

# 博时季季乐三个月持有期债券型证 券投资基金 更新招募说明书

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

## 【重要提示】

1、本基金根据 2020 年 03 月 20 日中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于准予博时季季乐三个月持有期债券型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2020]478 号)进行募集。

2、基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册,但中国证监会对本基金募集的注册,并不表明其对本基金的投资价值和市场前景做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

3、投资有风险,投资者认购(或申购)基金份额时应认真阅读基金合同、本招募说明书、基金产品资料概要等信息披露文件,自主判断基金的投资价值,全面认识本基金产品的风险收益特征,应充分考虑投资者自身的风险承受能力,并对认购(或申购)基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则,在投资者作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化导致的投资风险,由投资者自行承担。

4、本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动,投资者在投资本基金前,应全面了解本基金的产品特性,理性判断市场,并承担基金投资中出现的各类风险,包括:因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险、本基金的特定风险等等。

5、本基金为债券型基金,预期收益和预期风险高于货币市场基金,但低于混合型基金、股票型基金,属于中低风险/收益的产品。

6、本基金的投资范围主要包括债券(国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资债券、公开发行的次级债、可分离交易可转债的纯债部分、政府机构支持债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、信用衍生品、国债期货等法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

本基金不投资于股票、权证等权益类资产,也不投资于可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分除外)、可交换债券。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。

7、本基金的一部分资产将可能投资于资产支持证券，资产支持证券（ABS）是一种债券性质的金融工具，是一种以资产信用为支持的证券，所面临的风险主要包括交易结构风险、各种原因导致的基础资产池现金流与对应证券现金流不匹配产生的信用风险、市场交易不活跃导致的流动性风险等。

8、为对冲信用风险，本基金可能投资于衍生品为对冲信用风险，本基金可能投资于衍生品为对冲信用风险，本基金可能投资于衍生品面临流动性风险、偿付以及价格波动。

9、本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的债券及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定），在正常市场环境下本基金的流动性风险适中。在特殊市场条件下，如证券市场的成交量发生急剧萎缩、基金发生巨额赎回以及其他未能预见的特殊情形下，可能导致基金资产变现困难或变现对证券资产价格造成较大冲击，发生基金份额净值波动幅度较大、无法进行正常赎回业务、基金不能实现既定的投资决策等风险。

10、基金的投资组合比例为：本基金对债券的投资比例不低于基金资产的80%；本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。若法律法规的相关规定发生变更或监管机构允许，本基金管理人在履行适当程序后，可对上述资产配置比例进行调整。

11、本基金发售面值为人民币1.00元。在市场波动因素影响下，本基金净值可能低于发售面值，本基金投资者有可能出现亏损。

12、基金的过往业绩并不预示其未来表现，基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。

13、基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本招募说明书（更新）所载内容截止日2021年4月29日，有关财务数据和净值表现截止日为2020年09月30日（财务数据未经审计）。

## 目录

|                               |     |
|-------------------------------|-----|
| 【重要提示】 .....                  | 2   |
| 第一部分绪言 .....                  | 5   |
| 第二部分释义 .....                  | 6   |
| 第三部分基金管理人 .....               | 11  |
| 第四部分基金托管人 .....               | 28  |
| 第五部分相关服务机构 .....              | 34  |
| 第六部分基金的募集与基金合同的生效 .....       | 49  |
| 第七部分基金份额的申购与赎回 .....          | 50  |
| 第八部分基金的投资 .....               | 61  |
| 第九部分基金的业绩 .....               | 70  |
| 第十部分基金的财产 .....               | 71  |
| 第十一部分基金资产的估值 .....            | 72  |
| 第十二部分基金的收益与分配 .....           | 77  |
| 第十三部分基金的费用与税收 .....           | 79  |
| 第十四部分基金的会计与审计 .....           | 82  |
| 第十五部分基金的信息披露 .....            | 83  |
| 第十六部分风险揭示 .....               | 90  |
| 第十七部分基金合同的变更、终止与基金财产的清算 ..... | 94  |
| 第十八部分基金合同的内容摘要 .....          | 96  |
| 第十九部分基金托管协议的内容摘要 .....        | 111 |
| 第二十部分对基金份额持有人的服务 .....        | 127 |
| 第二十一部分其他应披露的事项 .....          | 130 |
| 第二十二部分招募说明书存放及查阅方式 .....      | 132 |
| 第二十三部分备查文件 .....              | 133 |

## 第一部分 绪言

《博时季季乐三个月持有期债券型证券投资基金招募说明书》(以下简称“招募说明书”或“本招募说明书”)依照《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性风险管理规定》”)和其他有关法律法规以及《博时季季乐三个月持有期债券型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)编写。

本招募说明书阐述了博时季季乐三个月持有期债券型证券投资基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资人投资决策有关的必要事项,投资人在作出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。

博时季季乐三个月持有期债券型证券投资基金(以下简称“基金”或“本基金”)是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息,或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写,并经中国证监会注册。基金合同是约定基金合同当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资者自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

## 第二部分 释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

- 1、基金或本基金：指博时季季乐三个月持有期债券型证券投资基金
- 2、基金管理人：指博时基金管理有限公司
- 3、基金托管人：指中国民生银行股份有限公司
- 4、基金合同：指《博时季季乐三个月持有期债券型证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充
- 5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《博时季季乐三个月持有期债券型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
- 6、招募说明书或者本招募说明书：指《博时季季乐三个月持有期债券型证券投资基金招募说明书》及其更新
- 7、基金份额发售公告：指《博时季季乐三个月持有期债券型证券投资基金基金份额发售公告》
- 8、基金产品资料概要：指《博时季季乐三个月持有期债券型证券投资基金基金产品资料概要》及其更新
- 9、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等
- 10、《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，经 2012 年 12 月 28 日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自 2013 年 6 月 1 日起实施，并经 2015 年 4 月 24 日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修正的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 11、《销售办法》：指中国证监会 2013 年 3 月 15 日颁布、同年 6 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 12、《信息披露办法》：指中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 13、《运作办法》：指中国证监会 2014 年 7 月 7 日颁布、同年 8 月 8 日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

14、《流动性风险管理规定》：指中国证监会2017年8月31日颁布、同年10月1日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订

15、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

16、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行保险监督管理委员会

17、基金合同当事人：指受基金合同约束，根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人

18、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

19、机构投资者：指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织

20、合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》及相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者

21、人民币合格境外机构投资者：指按照《人民币合格境外机构投资者境内证券投资试点办法》及相关法律法规规定，运用来自境外的人民币资金进行境内证券投资的境外法人

22、投资人、投资者：指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称

23、基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人

24、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务

25、销售机构：指博时基金管理有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务协议，办理基金销售业务的机构

26、登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等

27、登记机构：指办理登记业务的机构。基金的登记机构为博时基金管理有限公司或接受博时基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构

28、基金账户：指登记机构为投资人开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户



- 29、基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构办理认购、申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户
- 30、基金合同生效日：指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期
- 31、基金合同终止日：指基金合同规定的基金合同终止事由出现后，基金财产清算完毕，清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期
- 32、基金募集期：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过3个月
- 33、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限
- 34、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所及相关期货交易所的正常交易日
- 35、T日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日
- 36、T+n日：指自T日起第n个工作日(不包含T日)
- 37、开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日
- 38、最短持有期：指本基金对每份基金份额设置三个月的最短持有期。在最短持有期到期日之前（不含当日），投资者不能提出赎回申请；最短持有期期满后（含最短持有期到期日当日）投资者可以申请赎回
- 39、最短持有期起始日：指自基金合同生效日（对认购份额而言）或每份基金份额申购申请的确认日（对申购份额而言）
- 40、最短持有期到期日：指最短持有期起始日起三个月后的对应日，如无对应日或该对应日为非工作日，则顺延至下一工作日。因不可抗力或基金合同约定的其他情形致使基金管理人无法在该基金份额的最短持有期到期日按时开放办理该基金份额的赎回业务的，该基金份额的最短持有期到期日顺延至不可抗力或基金合同约定的其他情形的影响因素消除之日起的下一个工作日
- 41、开放时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段
- 42、《业务规则》：指《博时基金管理有限公司开放式基金业务规则》，是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金登记方面的业务规则，由基金管理人和投资人共同遵守
- 43、认购：指在基金募集期内，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为



44、申购：指基金合同生效后，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

45、赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为

46、基金转换：指基金份额持有人按照基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金基金份额的行为

47、转托管：指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基金份额销售机构的操作

48、定期定额投资计划：指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期申购日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及受理基金申购申请的一种投资方式

49、巨额赎回：指本基金单个开放日，基金净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一开放日基金总份额的 10 %

50、元：指人民币元

51、基金收益：指基金投资所得债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约

52、基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收款项及其他资产的价值总和

53、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

54、基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

55、基金资产估值：指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程

56、基金份额分类：指本基金分设两类基金份额：A类基金份额和C类基金份额。两类基金份额分设不同的基金代码，分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数

57、A类基金份额：指在投资者认购、申购时收取认购、申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额类别

58、C类基金份额：指在投资者认购、申购时不收取认购、申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额类别

59、流动性受限资产：指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等

60、摆动定价机制：指当本基金遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待

61、指定媒介：指中国证监会指定的用以进行信息披露的全国性报刊及指定互联网网站（包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介

62、信用衍生品：指符合证券交易所或银行间市场相关业务规则，专门用于管理信用风险的信用衍生工具

63、信用保护买方：亦称信用保护购买方，指接受信用风险保护的一方

64、信用保护卖方：亦称信用保护提供方，指提供信用风险保护的一方

65、名义本金：亦称交易名义本金，是一笔信用衍生产品交易提供信用风险保护的金额，各项支付和结算以此金额为计算基准

66、不可抗力：指基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

## 第三部分 基金管理人

### 一、基金管理人概况

名称： 博时基金管理有限公司

住所： 深圳市福田区莲花街道福新社区益田路 5999 号基金大厦 21 层

办公地址： 广东省深圳市福田区益田路 5999 号基金大厦 21 层

法定代表人： 江向阳

成立时间： 1998 年 7 月 13 日

注册资本： 2.5 亿元人民币

存续期间： 持续经营

联系人： 韩强

联系电话： (0755) 8316 9999

博时基金管理有限公司（以下简称“公司”）经中国证监会证监基字[1998]26 号文批准设立。目前公司股东为招商证券股份有限公司，持有股份 49%；中国长城资产管理公司，持有股份 25%；天津港（集团）有限公司，持有股份 6%；上海汇华实业有限公司，持有股份 12%；上海盛业股权投资基金有限公司，持有股份 6%；广厦建设集团有限责任公司，持有股份 2%。注册资本为 2.5 亿元人民币。

公司设立了投资决策委员会。投资决策委员会负责指导基金资产的运作、确定基本的投资策略和投资组合的原则。

公司下设两大总部和三十四个直属部门，分别是：权益投资总部、固定收益总部以及宏观策略部、交易部、指数与量化投资部、多元资产管理部、年金投资部、绝对收益投资部、基础设施投资管理部、综合解决方案业务部、产品规划部、销售管理部、客户服务中心、市场部、养老金业务中心、战略客户部、机构-北京、机构-上海、机构-南方、券商业务部、零售-北京、零售-上海、零售-南方、零售-西部、零售-中部、央企业务部、互联网金融部、财富管理部、董事会办公室、办公室、人力资源部、财务部、信息技术部、基金运作部、风险管理部和监察法律部。

权益投资总部负责公司所管理资产的权益投资管理及相关工作。权益投资总部下设股票投资部（含各投资风格小组）、特定资产管理部、研究部。股票投资部负责进行股票选择和组合管理。特定资产管理部负责公司权益类特定资产专户和权益类社保投资组合的投资管理

及相关工作。研究部负责完成对宏观经济、投资策略、行业上市公司及市场的研究。固定收益总部负责公司所管理资产的固定收益投资管理及相关工作。固定收益总部下设现金管理组、公募基金组、专户组、指数与创新组、国际组和研究组，分别负责各类固定收益资产的研究和投资工作。

市场部负责市场竞争分析、市场政策的拟订；牵头组织落实公司总体市场战略，协同产品和投资体系以及机构业务团队的协同；拟订年度市场计划和费用预算，具体负责机构业务的绩效考核和费用管理；机构产品营销组织和销售支持；专户业务中台服务与运营支持等工作。战略客户部集中服务国有银行、政策性银行、大型头部保险公司、中央汇金公司等重要金融机构。机构-北京负责北方地区其他银行、保险和财务公司等机构业务。机构-上海和机构-南方分别主要负责华东地区、华南地区以及其他指定区域的机构客户销售与服务工作。养老金业务中心负责公司社保基金、企业年金、基本养老金及职业年金的客户拓展、销售与服务、养老金研究与政策咨询、养老金销售支持与中台运作协调、相关信息服务等工作。券商业务部负责券商渠道的开拓和销售服务、大宗交易业务、融券业务、做市商业业务、股指期货业务等工作。零售-北京、零售-上海、零售-南方、零售-西部、零售-中部负责公司全国范围内零售客户的渠道销售和服务。央企业务部负责招商局集团签约机构客户、重要中央企业及其财务公司等客户的拓展、合作业务落地与服务等工作。销售管理部负责总行渠道维护，零售产品营销组织、销售督导；营销策划及公募销售支持；营销培训管理；渠道代销支持与服务；零售体系的绩效考核与费用管理等工作。

宏观策略部负责为投委会审定资产配置计划提供宏观研究和策略研究支持。交易部负责执行基金经理的交易指令并进行交易分析和交易监督。指数与量化投资部负责公司各类指数与量化投资产品的研究和投资管理工作。多元资产管理部负责公司的基金中基金投资产品的研究和投资管理工作。年金投资部负责公司所管理企业年金等养老金资产的投资管理及相关工作。绝对收益投资部负责公司绝对收益产品的研究和投资管理工作。基础设施投资管理部负责公司所管理基础设施资产的投资管理、项目运营、内部控制、风险管理及相关工作。综合解决方案业务部负责通过 FOF/MOM 主动管理资产配置，为客户量身定制跨一二级市场解决方案，同时负责主动管理资产的投资管理、产品运营、内部控制、风险管理等工作。产品规划部负责新产品设计、新产品报批、主管部门沟通维护、产品维护以及年金方案设计、重要政府部门、监管部门以及交易所、外汇交易中心等证券市场重要主体的关系维护等工作。互联网金融部负责公司互联网金融战略规划的设计和实施，公司互联网金融的平台建设、业务

拓展和客户运营，推动公司相关业务在互联网平台的整合与创新。财富管理部负责高端客户的理财服务与销售。客户服务中心负责电话咨询与服务；网络咨询与服务；电话呼出业务；营销数据分析统计、直销柜台业务等工作。

董事会办公室专门负责股东会、董事会、监事会及董事会各专业委员会各项会务工作；股东关系管理与董、监事的联络、沟通及服务；基金行业政策、公司治理、战略发展研究、公司文化建设；与公司治理及发展战略等相关的重大信息披露管理；政府公共关系管理；党务工作；博时慈善基金会的管理及运营等。办公室负责公司的行政后勤支持、会议及文件管理、外事活动管理、档案管理及工会工作等。人力资源部负责公司的人员招聘、培训发展、薪酬福利、绩效评估、员工沟通、人力资源信息管理工作。财务部负责公司预算管理、财务核算、成本控制、财务分析等工作。信息技术部负责信息系统开发、网络运行及维护、IT系统安全及数据备份等工作。基金运作部负责基金会计和基金注册登记等业务。风险管理部负责建立和完善公司投资风险管理制度与流程，组织实施公司投资风险管理及绩效分析工作，确保公司各类投资风险得到良好监督与控制。监察法律部负责对公司投资决策、基金运作、内部管理、制度执行等方面进行监察，并向公司管理层和有关机构提供独立、客观、公正的意见和建议。

另设北京分公司和上海分公司，分别负责对驻京、沪人员日常行政管理和对赴京、沪、处理公务人员给予协助。此外，还设有全资子公司博时资本管理有限公司，以及境外子公司博时基金（国际）有限公司。

截止到 2020 年 12 月 31 日，公司总人数为 664 人，其中研究员和基金经理超过 90% 拥有硕士及以上学位。

公司已经建立健全投资管理制度、风险控制制度、内部监察制度、财务管理制度、人事管理制度、信息披露制度和员工行为准则等公司管理制度体系。

## 二、主要成员情况

### 1、基金管理人董事会成员

江向阳先生，博士。中共党员，南开大学国际金融博士，清华大学金融媒体 EMBA。1986-1990 年就读于北京师范大学信息与情报学系，获学士学位；1994-1997 年就读于中国政法大学研究生院，获法学硕士学位；2003-2006 年，就读于南开大学国际经济研究所，获国际金融博士学位。1997 年 8 月至 2014 年 12 月就职于中国证监会，历任办公厅、党办副主任兼新闻办（网信办）主任；中国证监会办公厅副巡视员；中国证监会深圳专员办

处长、副专员；中国证监会期货监管部副处长、处长。2015年1月至7月，任招商局金融集团副总经理、博时基金管理有限公司党委副书记。2015年7月至2020年10月任博时基金管理有限公司总经理。自2020年1月9日至2020年4月15日代为履行博时基金董事长职务。自2020年4月1日起任博时基金管理有限公司党委书记。自2020年4月15日起，任博时基金管理有限公司董事长。□

苏敏女士,分别于1990年7月及2002年12月获得上海财经大学金融专业学士学位和中国科学技术大学工商管理硕士学位。苏女士分别于1998年6月、1999年6月及2008年6月获中国注册会计师协会授予的注册会计师资格、中国资产评估协会授予的注册资产评估师资格及安徽省人力资源和社会保障厅授予的高级会计师职称。苏女士拥有管理金融类公司及上市公司的经验，其经验包括：自2015年9月及2015年12月起任招商局金融集团有限公司总经理及董事；自2016年6月起任招商证券股份有限公司（上海证券交易所上市公司，股票代码：600999；香港联交所上市公司，股票代码：6099）董事；自2014年9月起担任招商银行股份有限公司（上海证券交易所上市公司，股票代码：600036；香港联交所上市公司，股票代码：3968）董事。自2016年1月至2018年8月任招商局资本投资有限责任公司监事；自2015年11月至2018年8月任招商局创新投资管理有限公司董事；自2015年11月至2017年4月任深圳招商启航互联网投资管理有限公司董事长；自2013年5月至2015年8月任中远海运能源运输股份有限公司（上海证券交易所上市公司，股票代码：600026；香港联交所上市公司，股票代码：1138）董事；自2013年6月至2015年12月任中远海运发展股份有限公司（上海证券交易所上市公司，股票代码：601866；香港联交所上市公司，股票代码：2866）董事；自2009年12月至2011年5月担任徽商银行股份有限公司（香港联交所上市公司，股票代码：3698）董事；自2008年3月至2011年9月担任安徽省皖能股份有限公司（深圳证券交易所上市公司，股票代码：000543）董事。苏女士亦拥有会计等相关管理经验，其经验包括：自2011年3月至2015年8月担任中国海运（集团）总公司总会计师；自2007年5月至2011年4月担任安徽省能源集团有限公司总会计师，并于2010年11月至2011年4月担任该公司副总经理。



自 2018 年 9 月 3 日起，任博时基金管理有限公司董事。

高阳先生，中共党员，经济学硕士，CFA，总经理。1998 年 7 月至 2000 年 2 月在中国国际金融股份有限公司任销售交易部经理。2000 年 3 月至 2008 年 2 月在博时基金管理有限公司历任债券组合经理、固定收益部总经理、基金经理、股票投资部总经理。2008 年 8 月至 2021 年 1 月在鹏华基金管理有限公司工作，2008 年 12 月至 2021 年 1 月在在鹏华基金管理有限公司任副总经理。自 2021 年 2 月 5 日起，任博时基金管理有限公司总经理。自 2021 年 4 月 7 日起，任博时基金管理有限公司第八届董事会董事。

姚俊先生，博士。1993 年至 1997 年在华南理工大学学习，获双学士学位。1997 年至 2000 年在华南理工大学工商管理专业学习，获硕士学位。2002 年 9 月至 2005 年 7 月在华南理工大学管理专业学习，获得博士学位。2000 年 6 月至 2002 年 8 月任广东电信广州分公司业务部业务主管。2005 年 9 月至 2007 年 7 月，招商局集团博士后工作站任博士后研究员。2007 年 8 月至 2014 年 5 月，任招商证券研究发展中心分析师。2014 年 6 月至 2015 年 6 月任招商证券研究发展中心二部总经理助理。2015 年 6 月至 2016 年 7 月任招商证券研究发展中心二部副总经理（主持工作）。2016 年 7 月至 2020 年 3 月任招商证券研究发展中心二部总经理。2020 年 3 月至今任招商证券财富管理及机构业务总部财富管理部总经理。自 2020 年 12 月 8 日起，任博时基金管理有限公司董事。

何翔先生，北京大学财务学专业学士。1995 年 7 月至 2000 年 2 月任中国农业银行广西分行国际业务部科员、副科长。2000 年 2 月至 2012 年 2 月任中国长城资产管理公司南宁办事处副科长、科长、副处长、高级经理。2012 年 2 月至 2014 年 12 月，任中国长城资产管理公司乌鲁木齐办事处总经理助理、副总经理；2014 年 12 月至 2018 年 2 月，任中国长城资产管理公司广西分公司副总经理。2018 年 2 月至 2019 年 8 月中国长城资产管理股份有限公司资金管理部副总经理。2019 年 8 月至今，任中国长城资产管理股份有限公司投资投行部（资产经营三部）副总经理。自 2020 年 12 月 8 日起，任博时基金管理有限公司董事。

李楚楚女士，香港注册会计师。2008 年以全额奖学金被香港中文大学录取，并获得工商管理学士学位。2012 年起加入毕马威香港办公室审计部门，为大型企业提供上市财务、审计、商业咨询及资本市场服务；2014 年起，调入毕马威香港办公室咨询部门，历任高级顾问和咨询经理，参与了众多并购、上市、尽职调查、公司治理、合规管理、风险管理等项



目，积累了丰富的行业知识及企业运营管理经验。2017年，加入上海信利股份投资基金管理有限公司并工作至今，历任投资经理、投资总监、董事等职，同时兼任上海汇华实业有限公司投资总监和上海盛业股权投资基金有限公司监事，负责股权投资项目管理。李女士在私募股权投资、投后管理等方面拥有丰富的经验，领导并管理了多个行业的投资，包括金融服务（保险、资产管理、金融科技等）、医疗保健、消费与零售、新能源与环境、科技与媒体通信等。自2020年12月8日起，任博时基金管理有限公司董事。

姜立军先生，1955年生，会计师，工商管理硕士（MBA）。1974年12月参加工作，历任中国远洋运输总公司财务处科员、中国-坦桑尼亚联合海运服务公司财务部经理、日本中铃海运服务公司财务部经理、中远（英国）公司财务部经理、香港益丰船务公司财务部经理、香港-佛罗伦租箱公司（香港上市公司）副总经理、中远太平洋有限公司（香港上市公司）副总经理、中远日本公司财务部长和营业副本部长、中远集装箱运输有限公司副总会计师等职。2002.8-2008.7，任中远航运股份有限公司（A股上市公司）首席执行官、董事。2008.8-2011.12，任中远投资（新加坡）有限公司（新加坡上市公司）总裁、董事会副主席、中远控股（新加坡）有限公司总裁；并任新加坡中资企业协会会长。2011.11-2015.12，任中国远洋控股股份有限公司执行（A+H上市公司）执行董事、总经理。2012.2-2015.12，兼任中国上市公司协会副监事长、天津上市公司协会副会长；2014.9-2015.12，兼任中国上市公司协会监事会专业委员会副主任委员。自2017年11月3日起，任博时基金管理有限公司独立董事。

赵如冰先生，1956年生，教授级高级工程师，国际金融专业经济学硕士研究生。赵如冰先生历任葛洲坝水力发电厂工程师、高级工程师、葛洲坝二江电厂电气分厂主任、书记；1989.09—1991.10任葛洲坝至上海正负50万伏超高压直流输电换流站书记兼站长，主持参加了我国第一条直流输电工程的安装调试和运行。1991.10—1995.12任厂办公室主任兼外事办公室主任。1995.12—1999.12，赵如冰先生任华能南方开发公司党组书记、总经理，兼任中国华能集团董事、深圳南山热电股份有限公司（上市公司代码0037）副董事长、长

城证券有限责任公司副董事长、深圳华能电讯有限公司董事长。2000.01-2004.07，华能南方公司被国家电力公司重组后，任华能房地产开发公司副总经理，长城证券有限责任公司副董事长。2004.07-2009.03，赵如冰先生任华能房地产开发公司党组书记、总经理。2009.12-2016.8，赵如冰先生任景顺长城基金管理公司董事长、景顺长城资产管理（深圳）公司董事长兼长城证券公司党委副书记。2016.8-2020.03，赵如冰先生任阳光资产管理股份有限公司副董事长；2016.8-至今，任西南证券、百隆东方独立董事，2020.03-至今深圳市深粮控股股份有限公司独立董事。自2017年11月3日起，任博时基金管理有限公司独立董事。

宋子洲先生，1960年生，中国保险资产管理业协会金融科技委员会主任委员。历任中国人寿保险公司稽核部制度处处长、资金运用部财会监督处处长、资金运用中心副总经理，中国人寿资产管理有限公司风险管理及合规部总监、首席风险官、副总裁。从事保险资金投资管理工作20余年，在保险资产管理公司的投资、运营、风险管理等方面积累了丰富的经验。自2020年12月8日起，任博时基金管理有限公司独立董事。

## 2、基金管理人监事会成员

何敏女士，1975年出生，中南财经大学会计学硕士。1999年7月至2006年4月任招商证券股份有限公司财务部会计核算岗，2006年4月至2009年4月任招商证券股份有限公司财务部总经理助理，2009年4月至2019年2月任招商证券股份有限公司财务部副总经理，2019年2月至今任招商证券股份有限公司财务部总经理。自2019年4月10日起，任博时基金管理有限公司监事会主席。

陈良生先生，中央党校经济学硕士。1980年至2000年就职于中国农业银行巢湖市支行及安徽省分行。2000年起就职于中国长城资产管理公司，历任合肥办事处综合管理部部长、福州办事处党委委员、总经理、福建省分公司党委书记、总经理。2017年4月至今任

中国长城资产管理股份有限公司机构协同部专职董监事。自 2017 年 6 月起，任博时基金管理有限公司监事。

赵兴利先生，硕士。1987 年至 1995 年就职于天津港务局计财处。1995 年至 2012 年 5 月先后任天津港贸易公司财务科科长、天津港（集团）公司委派货运公司会计主管、华夏人寿保险股份有限公司财务部总经理、天津港财务有限公司常务副总经理。2012 年 5 月至 2020 年 6 月就职于天津港（集团）有限公司金融事业部副部长，天津港（集团）有限公司计财部副部长。2020 年 6 月至今任天津港（集团）有限公司专职董监事。自 2013 年 3 月起，任博时基金管理有限公司监事。

严斌先生，硕士。1997 年 7 月起先后在华侨城集团公司、博时基金管理有限公司工作。现任博时基金管理有限公司财务部总经理。自 2015 年 5 月起，任博时基金管理有限公司监事。

黄健斌先生，工商管理硕士。1995 年起先后在广发证券有限公司、广发基金管理有限责任公司投资管理部、中银国际基金管理有限公司基金管理部工作。2005 年加入博时基金管理公司，历任固定收益部基金经理、博时平衡配置混合型基金经理、固定收益部副总经理、社保组合投资经理、固定收益部总经理、固定收益总部董事总经理、年金投资部总经理、公司总经理助理。现任公司首席资产配置官兼社保组合投资经理。自 2016 年 3 月 18 日起，担任博时基金管理有限公司监事。

车宏原先生，工学硕士。1985 年至 1989 年在四川大学计算机系学习，获得学士学位。1989 年至 1992 年在清华大学计算机系学习，获得硕士学位。1992 年至 1995 年深圳市天元金融电子有限公司任技术部负责人，1995 年至 2000 年在中国农业银行总行南方软件开发中心担任副总工程师，2001 年至 2003 年在太极华清信息系统有限公司担任副总经理，2003 年至 2014 年在景顺长城基金管理有限公司担任信息技术总监，2014 年至 2015 年任中财国信（深圳）有限公司总经理，2015 年至今担任博时基金管理有限公司信息技术部总经理。

### 3、高级管理人员

江向阳先生，简历同上。

高阳先生，简历同上。

王德英先生，硕士，副总经理。1995年起先后在北京清华计算机公司任开发部经理、清华紫光股份公司CAD与信息事业部任总工程师。2000年加入博时基金管理有限公司，历任行政管理部副经理，电脑部副经理、信息技术部总经理。现任公司副总经理、首席信息官，主管IT、指数与量化投资、养老金、基金零售等工作，兼任博时基金(国际)有限公司及博时资本管理有限公司董事。

邵凯先生，经济学硕士，副总经理。1997年至1999年在河北省经济开发投资公司从事投资管理的工作。2000年8月加入博时基金管理有限公司，历任债券组合经理助理、债券组合经理、社保债券基金基金经理、固定收益部副总经理兼社保债券基金基金经理、固定收益部总经理、固定收益投资总监、社保组合投资经理。现任公司副总经理兼首席固定收益投资官、兼任博时基金(国际)有限公司董事、博时资本管理有限公司董事。

徐卫先生，硕士，副总经理。1993年起先后在深圳市证券管理办公室、中国证监会、摩根士丹利华鑫基金工作。2015年6月加入博时基金管理有限公司，现任公司副总经理兼博时资本管理有限公司董事、博时基金(国际)有限公司董事会主席。

孙麒清女士，商法学硕士，督察长。曾供职于广东深港律师事务所。2002年加入博时基金管理有限公司，历任监察法律部法律顾问、监察法律部总经理。现任公司督察长，兼任博时基金(国际)有限公司董事、博时资本管理有限公司副董事长。

#### 4、本基金基金经理

李汉楠先生，硕士。2014年至2019年在长城基金工作。2019年加入博时基金管理有限公司。现任博时安瑞18个月定期开放债券型证券投资基金(2019年12月23日一至今)、博时荣升稳健添利18个月定期开放混合型证券投资基金(2020年4月29日一至今)、博时信用优选债券型证券投资基金(2020年5月22日一至今)、博时季季乐三个月持有期债券型证券投资基金(2020年5月27日一至今)、博时富灿纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金(2021年4月13日一至今)的基金经理。

倪玉娟女士，博士。2011年至2014年在海通证券任固定收益分析师。2014年加入博时基金管理有限公司。历任高级研究员、高级研究员兼基金经理助理、博时悦楚纯债债券型证券投资基金(2018年4月9日-2019年6月4日)、博时富丰纯债3个月定期开放债券型发起式证券投资基金(2019年6月26日-2021年2月25日)、博时稳欣39个月定期开放债券型

证券投资基金(2019年11月19日-2021年2月25日)的基金经理。现任博时富瑞纯债债券型证券投资基金(2018年4月9日一至今)、博时富业纯债3个月定期开放债券型发起式证券投资基金(2018年7月16日一至今)、博时现金宝货币市场基金(2019年2月25日一至今)、博时季季乐三个月持有期债券型证券投资基金(2020年5月27日一至今)、博时恒康一年持有期混合型证券投资基金(2020年12月30日一至今)的基金经理。

#### 5、投资决策委员会成员

委员：高阳、邵凯、黄健斌、张龙、魏凤春、过钧、曾鹏、黄瑞庆、金晟哲

高阳先生，简历同上。

邵凯先生，简历同上。

黄健斌先生，简历同上。

张龙先生，硕士。1996年起先后在长江证券、长盛基金、华夏基金、北京金百朋投资管理有限公司工作。2019年加入博时基金管理有限公司，历任股票投资部总经理、公司投资决策委员会专职委员，现任公司首席权益投资官。

魏凤春先生，博士。1993年起先后在山东经济学院、江南信托、清华大学、江南证券、中信建投证券工作。2011年加入博时基金管理有限公司。历任投资经理、博时抗通胀增强回报证券投资基金(2015年8月24日-2016年12月19日)、博时平衡配置混合型证券投资基金(2015年11月30日-2016年12月19日)的基金经理、多元资产管理部总经理、博时颐泽稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)(2019年3月20日-2020年9月3日)、博时颐泽平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)(2019年8月28日-2020年9月3日)的基金经理。现任首席宏观策略分析师兼宏观策略部总经理。

过钧先生，硕士。1995年起先后在上海工艺品进出口公司、德国德累斯顿银行上海分行、美国Lowe's食品有限公司、美国通用电气公司、华夏基金固定收益部工作。2005年加入博时基金管理有限公司。历任博时稳定价值债券投资基金(2005年8月24日-2010年8月4日)基金经理、固定收益部副总经理、博时转债增强债券型证券投资基金(2010年11月24日-2013年9月25日)、博时亚洲票息收益债券型证券投资基金(2013年2月1日-2014年4月2日)、博时裕祥分级债券型证券投资基金(2014年1月8日-2014年6月10日)、博时双债增强债券型证券投资基金(2013年9月13日-2015年7月16日)、博时新财富混合型证券投资基金(2015年6月24日-2016年7月4日)、博时新机遇混合型证券投资基金(2016年3月29日-2018年2月6日)、博时新策略灵活配置混合型证券投资基金(2016年8月1

日-2018年2月6日)、博时稳健回报债券型证券投资基金(LOF)(2014年6月10日-2018年4月23日)、博时双债增强债券型证券投资基金(2016年10月24日-2018年5月5日)、博时鑫润灵活配置混合型证券投资基金(2017年2月10日-2018年5月21日)、博时鑫和灵活配置混合型证券投资基金(2017年12月13日-2018年6月16日)、博时鑫惠灵活配置混合型证券投资基金(2017年1月10日-2018年7月30日)的基金经理、固定收益总部公募基金组负责人、博时新价值灵活配置混合型证券投资基金(2016年3月29日-2019年4月30日)、博时乐臻定期开放混合型证券投资基金(2016年9月29日-2019年10月14日)、博时转债增强债券型证券投资基金(2019年1月28日-2020年4月3日)、博时鑫源灵活配置混合型证券投资基金(2016年9月6日-2020年7月20日)、博时新起点灵活配置混合型证券投资基金(2016年10月17日-2020年7月20日)、博时鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金(2017年2月10日-2020年7月20日)、博时中债3-5年国开行债券指数证券投资基金(2019年7月19日-2020年10月26日)的基金经理。现任公司董事总经理兼固定收益总部指数与创新组负责人、博时信用债券投资基金(2009年6月10日一至今)、博时新收益灵活配置混合型证券投资基金(2016年2月29日一至今)、博时中债3-5年进出口行债券指数证券投资基金(2018年12月25日一至今)、博时双季鑫6个月持有期混合型证券投资基金(2021年1月20日一至今)的基金经理。

曾鹏先生, 硕士。2005年起先后在上投摩根基金、嘉实基金从事研究、投资工作。2012年加入博时基金管理有限公司。历任投资经理、博时灵活配置混合型证券投资基金(2015年2月9日-2016年4月25日)基金经理。现任公司董事总经理兼权益投资总部一体化投研总监、权益投资主题组负责人、博时新兴成长混合型证券投资基金(2013年1月18日一至今)、博时特许价值混合型证券投资基金(2018年6月21日一至今)、博时科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金(2019年6月27日一至今)、博时科技创新混合型证券投资基金(2020年4月15日一至今)、博时沪港深优质企业灵活配置混合型证券投资基金(2021年1月20日一至今)、博时新兴消费主题混合型证券投资基金(2021年1月20日一至今)、博时港股通领先趋势混合型证券投资基金(2021年2月9日一至今)的基金经理。

黄瑞庆先生, 博士。2002年起先后融通基金、长城基金、长盛基金、财通基金、合众资产管理股份有限公司从事研究、投资、管理等工作。2013年加入博时基金管理有限公司, 历任股票投资部ETF及量化组投资副总监、基金经理助理、股票投资部量化投资组投资副总监(主持工作)、股票投资部量化投资组投资总监、博时价值增长混合基金



(2015.2.9-2016.10.24)、博时价值增长贰号混合基金(2015.2.9-2016.10.24)、博时特许价值混合基金(2015.2.9-2018.6.21)的基金经理。现任指数与量化投资部总经理兼博时量化平衡混合基金(2017.5.4-至今)、博时量化多策略股票基金(2018.4.3-至今)、博时量化价值股票基金(2018.6.26-至今)的基金经理。

金晟哲先生, 硕士。2012年从北京大学硕士研究生毕业后加入博时基金管理有限公司。历任研究员、高级研究员、资深研究员、博时睿利定增灵活配置混合型证券投资基金(2017年2月28日-2017年12月1日)、博时睿益定增灵活配置混合型证券投资基金(2017年2月28日-2018年2月22日)、博时睿益事件驱动灵活配置混合型证券投资基金(LOF)(2018年2月23日-2018年8月13日)、博时睿丰灵活配置定期开放混合型证券投资基金(2017年3月22日-2018年12月8日)的基金经理、研究部副总经理。现任研究部副总经理(主持工作)兼博时鑫泽灵活配置混合型证券投资基金(2016年10月24日-至今)、博时价值增长证券投资基金(2017年11月13日-至今)、博时睿利事件驱动灵活配置混合型证券投资基金(LOF)(2017年12月4日-至今)、博时主题行业混合型证券投资基金(LOF)(2020年5月13日-至今)、博时荣泰灵活配置混合型证券投资基金(2020年8月26日-至今)的基金经理。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

### 三、基金管理人的职责

1、依法募集资金, 办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜;

2、办理基金备案手续;

3、自《基金合同》生效之日起, 以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产;

4、配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策, 以专业化的经营方式管理和运作基金财产;

5、建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度, 保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立, 对所管理的不同基金分别管理, 分别记账, 进行证券投资;

6、除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外, 不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益, 不得委托第三人运作基金财产;

7、依法接受基金托管人的监督;



8、采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回的价格；

9、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

10、编制季度报告、中期报告和年度报告；

11、严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

12、保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；

13、按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；

14、按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

15、依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

16、按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上；

17、确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件；

18、组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

19、面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

20、因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

21、监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

22、当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；

23、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；

24、基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后30日内退还基金认购人；

25、执行生效的基金份额持有人大会的决议；

26、建立并保存基金份额持有人名册；

27、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

#### **四、基金管理人的承诺**

1、基金管理人承诺不从事违反《中华人民共和国证券法》的行为，并承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反《中华人民共和国证券法》行为的发生；

2、基金管理人承诺不从事违反《基金法》的行为，并承诺建立健全内部风险控制制度，采取有效措施，防止下列行为的发生：

(1) 将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；

(2) 不公平地对待管理的不同基金财产；

(3) 利用基金财产或者职务之便为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；

(4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；

(5) 侵占、挪用基金财产；

(6) 泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

(7) 玩忽职守，不按照规定履行职责；

(8) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。

3、基金管理人承诺严格遵守基金合同，并承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反基金合同行为的发生；

4、基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责；

5、基金管理人承诺不从事其他法规规定禁止从事的行为。

#### **五、基金经理承诺**

1、依照有关法律法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；

2、不利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者牟取利益；

3、不泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

4、不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

## 六、基金管理人的内部控制制度

### 1、风险管理的原则

#### (1) 全面性原则

公司风险管理必须覆盖公司的所有部门和岗位，渗透各项业务过程和业务环节。

#### (2) 独立性原则

公司设立独立的监察部，监察部保持高度的独立性和权威性，负责对公司各部门风险控制工作进行稽核和检查。

#### (3) 相互制约原则

公司及各部门在内部组织结构的设计上要形成一种相互制约的机制，建立不同岗位之间的制衡体系。

#### (4) 定性和定量相结合原则

建立完备的风险管理指标体系，使风险管理更具客观性和操作性。

### 2、风险管理和内部风险控制体系结构

公司的风险管理体系结构是一个分工明确、相互牵制的组织结构，由最高管理层对风险管理负最终责任，各个业务部门负责本部门的风险评估和监控，监察部负责监察公司的风险管理措施的执行。具体而言，包括如下组成部分：

#### (1) 董事会

负责制定公司的风险管理政策，对风险管理负完全的和最终的责任。

#### (2) 风险管理委员会

作为董事会下的专业委员会之一，风险管理委员会负责批准公司风险管理系统文件，即负责确保每一个部门都有合适的系统来识别、评定和监控该部门的风险，负责批准每一个部门的风险级别。负责解决重大的突发的风险。

#### (3) 督察长

独立行使督察权利；直接对董事会负责；按季向风险管理委员会提交独立的风险管理报告和风险管理建议。

#### (4) 监察法律部

监察法律部负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察,并为每一个部门的风险管理系统的发展提供协助,使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标。

#### (5) 风险管理部

风险管理部负责建立和完善公司投资风险管理制度与流程,组织实施公司投资风险管理及绩效分析工作,确保公司各类投资风险得到良好监督与控制。

#### (6) 业务部门

风险管理是每一个业务部门最首要的责任。部门经理对本部门的风险负全部责任,负责履行公司的风险管理程序,负责本部门的风险管理系统的开发、执行和维护,用于识别、监控和降低风险。

### 3、风险管理和内部风险控制的措施

#### (1) 建立内控结构,完善内控制度

公司建立、健全了内控结构,高管人员关于内控有明确的分工,确保各项业务活动有恰当的组织授权,确保监察活动是独立的,并得到高管人员的支持,同时置备操作手册,并定期更新。

#### (2) 建立相互分离、相互制衡的内控机制

建立、健全了各项制度,做到基金经理分开,投资决策分开,基金交易集中,形成不同部门,不同岗位之间的制衡机制,从制度上减少和防范风险。

#### (3) 建立、健全岗位责任制

建立、健全了岗位责任制,使每个员工都明确自己的任务、职责,并及时将各自工作领域中的风险隐患上报,以防范和减少风险。

#### (4) 建立风险分类、识别、评估、报告、提示程序

建立了评估风险的委员会,使用适合的程序,确认和评估与公司运作有关的风险;公司建立了自下而上的风险报告程序,对风险隐患进行层层汇报,使各个层次的人员及时掌握风险状况,从而以最快速度作出决策。

#### (5) 建立有效的内部监控系统

建立了足够、有效的内部监控系统,如电脑预警系统、投资监控系统,对可能出现的各种风险进行全面和实时的监控。

#### (6) 使用数量化的风险管理手段

采取数量化、技术化的风险控制手段,建立数量化的风险管理模型,用以提示指数趋势、行业及个股的风险,以便公司及时采取有效的措施,对风险进行分散、控制和规避,尽可能地减少损失。

(7) 提供足够的培训

制定了完整的培训计划,为所有员工提供足够和适当的培训,使员工明确其职责所在,控制风险。

## 第四部分 基金托管人

### (一) 基金托管人概况

#### 1. 基本情况

名称：中国民生银行股份有限公司（以下简称“中国民生银行”）

住所：北京市西城区复兴门内大街2号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街2号

法定代表人：高迎欣

成立时间：1996年2月7日

基金托管业务批准文号：证监基金字[2004]101号

组织形式：其他股份有限公司（上市）

注册资本：28,365,585,227元人民币

存续期间：持续经营

电话：010-58560666

联系人：罗菲菲

中国民生银行是我国首家主要由非公有制企业入股的全国性股份制商业银行，同时又是严格按照《公司法》和《商业银行法》建立的规范的股份制金融企业。多种经济成份在中国金融业的涉足和实现规范的现代企业制度，使中国民生银行有别于国有银行和其他商业银行，而为国内外经济界、金融界所关注。中国民生银行成立二十年来，业务不断拓展，规模不断扩大，效益逐年递增，并保持了快速健康的发展势头。

2000年12月19日，中国民生银行A股股票（600016）在上海证券交易所挂牌上市。2003年3月18日，中国民生银行40亿可转换公司债券在上交所正式挂牌交易。2004年11月8日，中国民生银行通过银行间债券市场成功发行了58亿元人民币次级债券，成为中国第一家在全国银行间债券市场成功私募发行次级债券的商业银行。2005年10月26日，民生银行成功完成股权分置改革，成为国内首家完成股权分置改革的商业银行，为中国资本市场股权分置改革提供了成功范例。2009年11月26日，中国民生银行在香港交易所挂牌上市。

中国民生银行自上市以来，按照“团结奋进，开拓创新，培育人才；严格管理，规范行为，敬业守法；讲究质量，提高效益，健康发展”的经营发展方针，在改革发展与管理等方

面进行了有益探索，先后推出了“大集中”科技平台、“两率”考核机制、“三卡”工程、独立评审制度、八大基础管理系统、集中处理商业模式及事业部改革等制度创新，实现了低风险、快增长、高效益的战略目标，树立了充满生机与活力的崭新的商业银行形象。

民生银行荣获第十三届上市公司董事会“金圆桌”优秀董事会奖；

民生银行在华夏时报社主办的第十一届金蝉奖评选中荣获“2017年度小微金融服务银行”；

民生银行荣获《亚洲货币》杂志颁发的“2016中国地区最佳财富管理私人银行”奖项；

民生银行荣获新浪财经颁发的“年度最佳电子银行”及“年度直销银行十强”奖项；

民生银行荣获VISA颁发的“最佳产品设计创新奖”；

民生银行在经济观察报举办的“中国卓越金融奖”评选中荣获“年度卓越资产管理银行”；

民生银行荣获全国银行间同业拆借中心授予的“2016年度银行间本币市场优秀交易商”、“2016年度银行间本币市场优秀衍生品交易商”及“2016年度银行间本币市场优秀债券交易商”奖项；

民生银行荣获中国银行间交易协会授予的“2016年度优秀综合做市机构”和“2016年度优秀信用债做市商”奖项；

民生银行荣获英国WPP（全球最大的传媒集团之一）颁发的“2017年度最具价值中国品牌100强”；

民生银行在中国资产证券化论坛年会上被授予“2016年度特殊贡献奖”。

## 2、主要人员情况

张庆先生，中国民生银行资产托管部总经理，博士研究生，具有基金托管人高级管理人员任职资格，从事过金融租赁、证券投资、银行管理等工作，具有26年金融从业经历，不仅有丰富的一线实战经验，还有扎实的总部管理经历。历任中国民生银行西安分行副行长，中国民生银行沈阳分行筹备组组长、行长、党委书记。

## 3、基金托管业务经营情况

中国民生银行股份有限公司于2004年7月9日获得基金托管资格，成为《中华人民共和国证券投资基金法》颁布后首家获批从事基金托管业务的银行。为了更好地发挥后发优势，大力发展托管业务，中国民生银行股份有限公司资产托管部从成立伊始就本着充分保护基金持有人的利益、为客户提供高品质托管服务的原则，高起点地建立系统、完善制度、组织人



资产托管部目前共有员工 74 人，平均年龄 38 岁，100% 员工拥有大学本科以上学历，64% 以上员工具有硕士以上文凭。

中国民生银行坚持以客户需求为导向，秉承“诚信、严谨、高效、务实”的经营理念，依托丰富的资产托管经验、专业的托管业务服务和先进的托管业务平台，为境内外客户提供安全、准确、及时、高效的专业托管服务。截至 2020 年 9 月 30 日，中国民生银行已托管 257 只证券投资基金。中国民生银行资产托管部于 2018 年 2 月 6 日发布了“爱托管”品牌，近百余家资管机构及合作客户的代表受邀参加了启动仪式。资产托管部始终坚持以客户为中心，致力于为客户提供全面的综合金融服务。对内大力整合行内资源，对外广泛搭建客户服务平台，向各类托管客户提供专业化、增值化的托管综合金融服务，得到各界的充分认可，也在市场上树立了良好品牌形象，成为市场上一家有特色的托管银行。自 2010 年至今，中国民生银行荣获《金融理财》杂志颁发的“最具潜力托管银行”、“最佳创新托管银行”、“金牌创新力托管银行”奖和“年度金牌托管银行”奖，荣获《21 世纪经济报道》颁发的“最佳金融服务托管银行”奖，尤其 2019 年，获得由金融时报社和国家金融与发展实验室共同评出的“年度最佳托管银行”奖项。

## (二) 基金托管人的内部控制制度

### 1. 内部风险控制目标

(1) 建立完整、严密、高效的风险控制体系，形成科学的决策机制、执行机制和监督机制，防范和化解经营风险，保障资产托管业务的稳健运行和托管财产的安全完整。

(2) 大力培育合规文化，自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念，严格控制合规风险，保证资产托管业务符合国家有关法律法规和行业监管规则。

(3) 以相互制衡健全有效的风控组织结构为保障，以完善健全的制度为基础，以落实到位的过程控制为着眼点，以先进的信息技术手段为依托，建立全面、系统、动态、主动、有利于差错防弊、堵塞漏洞、消除隐患、保证业务稳健运行的风险控制制度，确保托管业务信息真实、准确、完整、及时。

### 2. 内部风险控制组织结构

总行高级管理层负责部署全行的风险管理工作。总行风险管理委员会是总行高级管理层下设的风险管理专业委员会，对高级管理层负责，支持高级管理层履行职责。资产托管业务风险控制工作在总行风险管理委员会的统一部署和指导下开展。

总行各部门紧密配合，共同把控资产托管业务运行中的风险，具体职责与分工如下：总行风险管理部作为总行风险管理委员会秘书机构，是全行风险管理的统筹部门，对资产托管部的风险控制工作进行指导；总行法律事务部负责资产托管业务项下的相关合同、协议等文本的审定；总行内控合规部负责该业务与管理的合规性审查、检查与督导整改；总行审计部对全行托管业务进行内部审计。包括定期内部审计、现场和非现场检查等；总行办公室与资产托管部共同制定声誉风险应对预案。按资产托管部需求对由托管业务引发的声誉风险事件进行定向舆情监测，对由托管业务引起的声誉风险进行应急处置，包括与全国性媒体进行沟通、避免负面报道、组织正面回应等。

### 3. 内部风险控制原则

(1) 合法合规原则。风险控制应符合和体现国家法律、法规、规章和各项政策。

(2) 全面性原则。风险控制覆盖托管部的各个业务中心、各个岗位和各级人员，并涵盖资产托管业务各环节。

(3) 有效性原则。资产托管业务从业人员应全力维护内部控制制度的有效执行，任何人都没有超越制度约束的权力。

(4) 预防性原则。必须树立“预防为主”的管理理念，控制资产托管业务中风险发生的源头，防患于未然，尽量避免业务操作中各种问题的产生。

(5) 及时性原则。资产托管业务风险控制制度的制定应当具有前瞻性，并且随着托管部经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律法规、政策制度等外部环境的改变进行及时的修改或完善。发现问题，要及时处理，堵塞漏洞。

(6) 独立性原则。各业务中心、各岗位职能上保持相对独立性。风险监督中心是资产托管部下设的执行机构，不受其他业务中心和个人干涉。业务操作人员和检查人员严格分开，以保证风险控制机构的工作不受干扰。

(7) 相互制约原则。各业务中心、各岗位权责明确，相互牵制，通过切实可行的相互制衡措施来消除风险控制的盲点。

(8) 防火墙原则。托管银行自身财务与托管资产财务严格分开；托管业务日常操作部门与行政、研发和营销等部门隔离。

### 4. 内部风险控制制度和措施

(1) 制度建设：建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度。

(2) 建立健全的组织管理结构：前后台分离，不同部门、岗位相互牵制。

(3) 风险识别与评估：风险监督中心指导业务中心进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施。

(4) 相对独立的业务操作空间：业务操作区相对独立，实施门禁管理和音像监控。

(5) 人员管理：进行定期的业务与职业道德培训，使员工树立风险防范与控制理念，并签订承诺书。

(6) 应急预案：制定完备的《应急预案》，并组织员工定期演练；建立异地灾备中心，保证业务不中断。

#### 5. 资产托管部内部风险控制

中国民生银行股份有限公司从控制环境、风险评估、控制活动、信息沟通、监控等五个方面构建了托管业务风险控制体系。

(1) 坚持风险管理与业务发展同等重要的理念。托管业务是商业银行新兴的中间业务，中国民生银行股份有限公司资产托管部从成立之日起就特别强调规范运作，一直将建立一个系统、高效的风险防范和控制体系作为工作重点。随着市场环境的变化和托管业务的快速发展，新问题新情况不断出现，中国民生银行股份有限公司资产托管部始终将风险管理放在与业务发展同等重要的位置，视风险防范和控制为托管业务生存和发展的生命线。

(2) 实施全员风险管理。完善的风险管理体系需要从上至下每个员工的共同参与，只有这样，风险控制制度和措施才会全面、有效。中国民生银行股份有限公司资产托管部实施全员风险管理，将风险控制责任落实到具体业务中心和业务岗位，每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责。

(3) 建立分工明确、相互牵制的风险控制组织结构。托管部通过建立纵向双人制，横向多中心制的内部组织结构，形成不同中心、不同岗位相互制衡的组织结构。

(4) 以制度建设作为风险管理的核心。中国民生银行股份有限公司资产托管部十分重视内部控制制度的建设，已经建立了一整套内部风险控制制度，包括业务管理办法、内部控制制度、员工行为规范、岗位职责及涵括所有后台运作环节的操作手册。以上制度随着外部环境和业务的发展还会不断增加和完善。

(5) 制度的执行和监督是风险控制的关键。制度执行比编写制度更重要，制度落实检查是风险控制管理的有力保证。中国民生银行股份有限公司资产托管部内部设置风险与合规管

理中心，依照有关法律规章，定期对业务的运行进行检查。总行审计部也不定期对资产托管部进行审计。

(6) 将先进的技术手段运用于风险控制中。在风险管理中，技术控制风险比制度控制风险更加可靠，可将人为不确定因素降至最低。托管业务系统需求不仅从业务方面而且从风险控制方面都要经过多方论证，托管业务技术系统具有较强的自动风险控制功能。

### (三) 基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法律法规的规定，对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金申购资金的到账和赎回资金的划付、基金收益分配等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

基金托管人发现基金管理人的违反《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法律法规规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

## 第五部分 相关服务机构

### 一、基金份额销售机构

#### 1、直销机构

名称：博时基金管理有限公司北京直销中心

住所：深圳市福田区莲花街道福新社区益田路 5999 号基金大厦 21 层

地址：北京市建国门内大街 18 号恒基中心 1 座 23 层

电话：010-65187055

传真：010-65187032、010-65187592

联系人：韩明亮

博时一线通：95105568（免长途话费）

#### 2、代销机构

##### (1) 交通银行股份有限公司

|         |   |
|---------|---|
| 注册地址：   | 上海市银城中路 188 号   |
| 办公地址：   | 上海市银城中路 188 号   |
| 法定代表人：  | 任德奇   |
| 联系人：    | 陈旭  |
| 电话：     | 021-58781234  |
| 传真：     | 021-58408483  |
| 客户服务电话： | 95559   |
| 网址：     | <a href="http://www.bankcomm.com/">http://www.bankcomm.com/</a> |

##### (2) 中信银行股份有限公司

|         |   |
|---------|---|
| 注册地址：   | 北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座                                      |
| 办公地址：   | 北京市东城区朝阳门北大街 9 号文化大厦  |
| 法定代表人：  | 李庆萍   |
| 联系人：    | 王晓琳   |
| 电话：     | 010-89937325  |
| 客户服务电话： | 95558   |
| 网址：     | <a href="http://bank.ecitic.com/">http://bank.ecitic.com/</a> |

##### (3) 上海浦东发展银行股份有限公司

|        |                        |
|--------|------------------------|
| 注册地址：  | 上海市中山东一路 12 号          |
| 办公地址：  | 上海市北京东路 689 号东银大厦 25 楼 |
| 法定代表人： | 高国富                    |
| 联系人：   | 吴斌                     |
| 电话：    | 021-61618888           |
| 传真：    | 021-63602431           |

|         |   |
|---------|---|
| 客户服务电话: | 95528   |
| 网址:     | <a href="http://www.spdb.com.cn">http://www.spdb.com.cn</a> |

**(4) 中国民生银行股份有限公司**

|         |   |
|---------|---|
| 注册地址:   | 北京市西城区复兴门内大街 2 号  |
| 办公地址:   | 北京市西城区复兴门内大街 2 号  |
| 法定代表人:  | 高迎欣   |
| 联系人:    | 王继伟   |
| 电话:     | 010-58560666  |
| 传真:     | 010-57092611  |
| 客户服务电话: | 95568   |
| 网址:     | <a href="http://www.cmbc.com.cn/">http://www.cmbc.com.cn/</a> |

**(5) 广发银行股份有限公司**

|         |   |
|---------|---|
| 注册地址:   | 广州市越秀区农林下路 83 号   |
| 办公地址:   | 广州市越秀区农林下路 83 号   |
| 法定代表人:  | 王滨  |
| 联系人:    | 陈泾渭/刘伟  |
| 电话:     | 020-38321497/020-38322566   |
| 传真:     | 020-38321676  |
| 客户服务电话: | 4008308003  |
| 网址:     | <a href="http://www.cgbchina.com.cn/">http://www.cgbchina.com.cn/</a> |

**(6) 平安银行股份有限公司**

|         |   |
|---------|---|
| 注册地址:   | 深圳市深南东路 5047 号  |
| 办公地址:   | 深圳市深南东路 5047 号  |
| 法定代表人:  | 谢永林   |
| 联系人:    | 施艺帆   |
| 电话:     | 021-50979384  |
| 传真:     | 021-50979507  |
| 客户服务电话: | 95511-3   |
| 网址:     | <a href="http://bank.pingan.com">http://bank.pingan.com</a> |

**(7) 东莞农村商业银行股份有限公司**

|         |   |
|---------|---|
| 注册地址:   | 广东省东莞市东城区鸿福东路 2 号   |
| 办公地址:   | 广东省东莞市东城区鸿福东路 2 号东莞农商银行大厦                                     |
| 法定代表人:  | 王耀球   |
| 联系人:    | 杨亢  |
| 电话:     | 0769-22866270   |
| 传真:     | 0769-22866282   |
| 客户服务电话: | 961122  |
| 网址:     | <a href="http://www.drcbank.com/">http://www.drcbank.com/</a> |

**(8) 晋商银行股份有限公司**

|       |                      |
|-------|----------------------|
| 注册地址: | 山西省太原市万柏林区长风西街一号丽华大厦 |
|-------|----------------------|



|         |                        |
|---------|------------------------|
| 办公地址:   | 山西省太原市万柏林区长风西街一号丽华大厦   |
| 法定代表人:  | 阎俊生                    |
| 联系人:    | 董嘉文                    |
| 电话:     | 0351-6819926           |
| 传真:     | 0351-6819926           |
| 客户服务电话: | 95105588               |
| 网址:     | http://www.jshbank.com |

**(9) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司**

|         |                                |
|---------|--------------------------------|
| 注册地址:   | 深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006# |
| 办公地址:   | 北京市西城区宣武门外大街 28 号富卓大厦 A 座 6 层  |
| 法定代表人:  | 马勇                             |
| 联系人:    | 张燕                             |
| 电话:     | 010-58325388                   |
| 传真:     | 010-58325300                   |
| 客户服务电话: | 400-166-1188                   |
| 网址:     | http://8.jrj.com.cn/           |

**(10) 厦门市鑫鼎盛控股有限公司**

|         |                               |
|---------|-------------------------------|
| 注册地址:   | 厦门市思明区鹭江道 2 号厦门第一广场 1501-1504 |
| 办公地址:   | 厦门市思明区鹭江道 2 号厦门第一广场 1501-1504 |
| 法定代表人:  | 陈洪生                           |
| 联系人:    | 徐明静                           |
| 电话:     | 0592-3122716                  |
| 传真:     | 0592-8060771                  |
| 客户服务电话: | 400-918-0808                  |
| 网址:     | www.xds.com.cn                |

**(11) 腾安基金销售(深圳)有限公司**

|         |   |
|---------|---|
| 注册地址:   | 深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司) |
| 办公地址:   | 深圳市南山区海天二路 33 号腾讯滨海大厦 15 层                    |
| 法定代表人:  | 刘明军   |
| 联系人:    | 谭广锋   |
| 传真:     | 0755-86013399                                 |
| 客户服务电话: | 95017(拨通后转 1 再转 8)                            |
| 网址:     | https://www.txfund.com/                       |

**(12) 诺亚正行基金销售有限公司**

|        |                                 |
|--------|---------------------------------|
| 注册地址:  | 上海市金山区廊下镇漕廊公路 7650 号 205 室      |
| 办公地址:  | 上海浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 8 楼 801 室 |
| 法定代表人: | 汪静波                             |
| 联系人:   | 方成                              |
| 电话:    | 021-38602377                    |

|         |   |
|---------|---|
| 传真:     | 021-38509777  |
| 客户服务电话: | 400-821-5399  |
| 网址:     | <a href="http://www.noah-fund.com">http://www.noah-fund.com</a> |

**(13) 上海天天基金销售有限公司**

|         |   |
|---------|---|
| 注册地址:   | 上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层  |
| 办公地址:   | 上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 9 楼  |
| 法定代表人:  | 其实  |
| 联系人:    | 潘世友   |
| 电话:     | 021-54509998  |
| 传真:     | 021-64385308  |
| 客户服务电话: | 400-181-8188  |
| 网址:     | <a href="http://www.1234567.com.cn">http://www.1234567.com.cn</a> |

**(14) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司**

|         |   |
|---------|---|
| 注册地址:   | 杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 栋 202 室                           |
| 办公地址:   | 浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼                             |
| 法定代表人:  | 陈柏青   |
| 联系人:    | 朱晓超   |
| 电话:     | 021-60897840  |
| 传真:     | 0571-26697013   |
| 客户服务电话: | 400-076-6123  |
| 网址:     | <a href="http://www.fund123.cn">http://www.fund123.cn</a> |

**(15) 浙江同花顺基金销售有限公司**

|         |  |
|---------|--|
| 注册地址:   | 杭州市西湖区文二西路 1 号元茂大厦 903 室                           |
| 办公地址:   | 浙江省杭州市余杭区五常街道同顺街 18 号同花顺大楼                         |
| 法定代表人:  | 凌顺平  |
| 联系人:    | 吴杰   |
| 电话:     | 0571-88911818                                      |
| 传真:     | 0571-86800423                                      |
| 客户服务电话: | 400-877-3772                                       |
| 网址:     | <a href="http://www.5ifund.com">www.5ifund.com</a> |

**(16) 嘉实财富管理有限公司**

|         |  |
|---------|--|
| 注册地址:   | 上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心办公楼二期 46 层 4609-10 单元 |
| 办公地址:   | 北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 11 层       |
| 法定代表人:  | 赵学军  |
| 联系人:    | 余永健  |
| 电话:     | 010-85097570                               |
| 传真:     | 010-65215433                               |
| 客户服务电话: | 400-021-8850                               |

|     |                  |
|-----|------------------|
| 网址: | www.harvestwm.cn |
|-----|------------------|

**(17) 北京恒天明泽基金销售有限公司**

|         |                            |
|---------|----------------------------|
| 注册地址:   | 北京市北京经济技术开发区宏达北路10号5层5122室 |
| 办公地址:   | 北京市朝阳区东三环中路20号乐成中心A座23层    |
| 法定代表人:  | 周斌                         |
| 联系人:    | 马鹏程                        |
| 电话:     | 010-57756074               |
| 传真:     | 010-56810782               |
| 客户服务电话: | 400-8980-618               |
| 网址:     | www.chtwm.com              |

**(18) 北京汇成基金销售有限公司**

|         |                                    |
|---------|------------------------------------|
| 注册地址:   | 北京市西城区西直门外大街1号院2号楼(西环广场T2)19层19C13 |
| 办公地址:   | 北京市西城区西直门外大街1号院2号楼(西环广场T2)19层19C13 |
| 法定代表人:  | 王伟刚                                |
| 联系人:    | 丁向坤                                |
| 电话:     | 010-56282140                       |
| 传真:     | 010-62680827                       |
| 客户服务电话: | 400-619-9059                       |
| 网址:     | www.hcjijin.com                    |

**(19) 北京植信基金销售有限公司**

|         |                           |
|---------|---------------------------|
| 注册地址:   | 北京市密云县兴盛南路8号院2号楼106-67    |
| 办公地址:   | 北京市朝阳区建华南路6号卓明大厦2层        |
| 法定代表人:  | 于龙                        |
| 联系人:    | 叶航                        |
| 电话:     | 010-65166112              |
| 传真:     | 010-65166001              |
| 客户服务电话: | 4006-802-123              |
| 网址:     | http://www.zhixin-inv.com |

**(20) 上海陆金所基金销售有限公司**

|         |                          |
|---------|--------------------------|
| 注册地址:   | 上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元 |
| 办公地址:   | 上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼     |
| 法定代表人:  | 郭坚                       |
| 联系人:    | 宁博宇                      |
| 电话:     | 021-20665952             |
| 传真:     | 021-22066653             |
| 客户服务电话: | 400-821-9031             |
| 网址:     | www.lufunds.com          |

**(21) 珠海盈米基金销售有限公司**

|         |  |
|---------|--|
| 注册地址:   | 珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491                  |
| 办公地址:   | 广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼<br>B1201-1203 |
| 法定代表人:  | 肖雯                                     |
| 联系人:    | 吴煜浩                                    |
| 电话:     | 020-89629099                           |
| 传真:     | 020-89629011                           |
| 客户服务电话: | 020-80629066                           |
| 网址:     | www.yingmi.cn                          |

**(22) 中证金牛(北京)投资咨询有限公司**

|         |                           |
|---------|---------------------------|
| 注册地址:   | 北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室       |
| 办公地址:   | 北京市西城区宣武门外大街甲1号环球财讯中心A座5层 |
| 法定代表人:  | 钱昊旻                       |
| 联系人:    | 孙雯                        |
| 电话:     | 010-59336519              |
| 传真:     | 010-59336500              |
| 客户服务电话: | 400-890-9998              |
| 网址:     | www.jnlc.com              |

**(23) 京东肯特瑞基金销售有限公司**

|         |                                |
|---------|--------------------------------|
| 注册地址:   | 北京市海淀区海淀东三街2号4层401-15          |
| 办公地址:   | 北京市经济开发区科创十一街18号院京东总部A座4层A428室 |
| 法定代表人:  | 江卉                             |
| 联系人:    | 徐伯宇                            |
| 电话:     | 400-098-8511                   |
| 传真:     | 010-89188000                   |
| 客户服务电话: | 400-088-8816                   |
| 网址:     | http://jr.jd.com/              |

**(24) 北京蛋卷基金销售有限公司**

|         |                               |
|---------|-------------------------------|
| 注册地址:   | 北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507 |
| 办公地址:   | 北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507 |
| 法定代表人:  | 钟斐斐                           |
| 联系人:    | 戚晓强                           |
| 电话:     | 15810005516                   |
| 传真:     | 010-85659484                  |
| 客户服务电话: | 400-061-8518                  |
| 网址:     | danjuanapp.com                |

**(25) 中信期货有限公司**

|       |   |
|-------|---|
| 注册地址: | 深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座13层1301-1305室、14层 |
|-------|---|

|         |   |
|---------|---|
| 办公地址:   | 深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座13层1301-1305室、14层 |
| 法定代表人:  | 张皓  |
| 联系人:    | 刘宏莹                                       |
| 电话:     | 010-60833754                              |
| 传真:     | 021-60819988                              |
| 客户服务电话: | 400-990-8826                              |
| 网址:     | www.citicsf.com                           |

**(26) 弘业期货股份有限公司**

|         |                 |
|---------|-----------------|
| 注册地址:   | 南京市中华路50号       |
| 办公地址:   | 南京市中华路50号       |
| 法定代表人:  | 周剑秋             |
| 联系人:    | 孙朝旺             |
| 电话:     | 025-52278870    |
| 传真:     | 025-52313068    |
| 客户服务电话: | 400-828-1288    |
| 网址:     | www.ftol.com.cn |

**(27) 国泰君安证券股份有限公司**

|         |                      |
|---------|----------------------|
| 注册地址:   | 中国(上海)自由贸易试验区商城路618号 |
| 办公地址:   | 上海市静安区新闻路669号博华广场21层 |
| 法定代表人:  | 贺青                   |
| 联系人:    | 钟伟镇                  |
| 电话:     | 021-38676666         |
| 传真:     | 021-38670666         |
| 客户服务电话: | 95521/4008888666     |
| 网址:     | https://www.gtja.com |

**(28) 中信建投证券股份有限公司**

|         |                        |
|---------|------------------------|
| 注册地址:   | 北京市朝阳区安立路66号4号楼        |
| 办公地址:   | 北京市朝阳区门内大街188号         |
| 法定代表人:  | 王常青                    |
| 联系人:    | 刘畅                     |
| 电话:     | 010-65608231           |
| 传真:     | 010-65182261           |
| 客户服务电话: | 4008888108/95587       |
| 网址:     | http://www.csc108.com/ |

**(29) 国信证券股份有限公司**

|        |                               |
|--------|-------------------------------|
| 注册地址:  | 深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层 |
| 办公地址:  | 深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层 |
| 法定代表人: | 何如                            |
| 联系人:   | 李颖                            |

|         |   |
|---------|---|
| 电话:     | 0755-82130833   |
| 传真:     | 0755-82133952   |
| 客户服务电话: | 95536   |
| 网址:     | <a href="http://www.guosen.com.cn/">http://www.guosen.com.cn/</a> |

**(30) 广发证券股份有限公司**

|         |   |
|---------|---|
| 注册地址:   | 广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街2号618室                                   |
| 办公地址:   | 广州市天河区马场路26号广发证券大厦  |
| 法定代表人:  | 孙树明   |
| 联系人:    | 黄岚  |
| 电话:     | 020-87555888  |
| 传真:     | 020-87555305  |
| 客户服务电话: | 95575、020-95575 或致电各地营业网点                                 |
| 网址:     | <a href="http://www.gf.com.cn/">http://www.gf.com.cn/</a> |

**(31) 中信证券股份有限公司**

|         |   |
|---------|---|
| 注册地址:   | 广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座                                       |
| 办公地址:   | 北京朝阳区新源南路6号京城大厦   |
| 法定代表人:  | 张佑君   |
| 联系人:    | 马静懿   |
| 电话:     | 010-60833889  |
| 传真:     | 010-84865560  |
| 客户服务电话: | 400-889-5548/95548  |
| 网址:     | <a href="http://www.cs.ecitic.com/">http://www.cs.ecitic.com/</a> |

**(32) 中国银河证券股份有限公司**

|         |   |
|---------|---|
| 注册地址:   | 北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座   |
| 办公地址:   | 北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座2-6层   |
| 法定代表人:  | 陈共炎   |
| 联系人:    | 辛国政   |
| 电话:     | 010-83574507  |
| 传真:     | 010-66568990  |
| 客户服务电话: | 95551/4008888888  |
| 网址:     | <a href="http://www.chinastock.com.cn/">http://www.chinastock.com.cn/</a> |

**(33) 海通证券股份有限公司**

|         |   |
|---------|---|
| 注册地址:   | 上海市淮海中路98号  |
| 办公地址:   | 上海市广东路689号海通证券大厦  |
| 法定代表人:  | 周杰  |
| 联系人:    | 李笑鸣   |
| 电话:     | 021-23219275  |
| 传真:     | 021-63602722  |
| 客户服务电话: | 95553   |
| 网址:     | <a href="http://www.htsec.com/">http://www.htsec.com/</a> |



**(34) 申万宏源证券有限公司**

|         |                      |
|---------|----------------------|
| 注册地址:   | 上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层 |
| 办公地址:   | 上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层 |
| 法定代表人:  | 杨玉成                  |
| 联系人:    | 陈宇                   |
| 电话:     | 021-33388252         |
| 传真:     | 021-33388224         |
| 客户服务电话: | 95523 或 4008895523   |
| 网址:     | www.swhysc.com       |

**(35) 长江证券股份有限公司**

|         |                       |
|---------|-----------------------|
| 注册地址:   | 武汉市新华路特 8 号长江证券大厦     |
| 办公地址:   | 武汉市新华路特 8 号长江证券大厦     |
| 法定代表人:  | 李新华                   |
| 联系人:    | 奚博宇                   |
| 电话:     | 027-65799999          |
| 传真:     | 027-85481900          |
| 客户服务电话: | 95579;4008-888-999    |
| 网址:     | http://www.95579.com/ |

**(36) 安信证券股份有限公司**

|         |                                       |
|---------|---------------------------------------|
| 注册地址:   | 深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元 |
| 办公地址:   | 深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元 |
| 法定代表人:  | 黄炎勋                                   |
| 联系人:    | 刘志斌                                   |
| 电话:     | 0755-82558323                         |
| 传真:     | 0755-82558355                         |
| 客户服务电话: | 95517, 4008001001                     |
| 网址:     | http://www.essence.com.cn             |

**(37) 湘财证券股份有限公司**

|         |                                     |
|---------|-------------------------------------|
| 注册地址:   | 湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼 |
| 办公地址:   | 湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼 |
| 法定代表人:  | 孙永祥                                 |
| 联系人:    | 江恩前                                 |
| 电话:     | 021-38784580-8920                   |
| 客户服务电话: | 95351                               |
| 网址:     | http://www.xcsc.com                 |

**(38) 中信证券（山东）有限责任公司**

|        |                                   |
|--------|-----------------------------------|
| 注册地址:  | 青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼 20 层 |
| 办公地址:  | 青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东 2、5 层        |
| 法定代表人: | 姜晓林                               |
| 联系人:   | 孙秋月                               |

|         |   |
|---------|---|
| 电话:     | 0532-85022026   |
| 传真:     | 0532-85022605   |
| 客户服务电话: | 95548   |
| 网址:     | <a href="http://www.cs.ecitic.com/newsite/">http://www.cs.ecitic.com/newsite/</a> |

**(39) 光大证券股份有限公司**

|         |   |
|---------|---|
| 注册地址:   | 上海市静安区新闻路 1508 号  |
| 办公地址:   | 上海市静安区新闻路 1508 号  |
| 法定代表人:  | 刘秋明   |
| 联系人:    | 李芳芳   |
| 电话:     | 021-22169089  |
| 传真:     | 021-22169134  |
| 客户服务电话: | 4008888788; 95525   |
| 网址:     | <a href="http://www.ebscn.com/">http://www.ebscn.com/</a> |

**(40) 中信证券华南股份有限公司**

|         |   |
|---------|---|
| 注册地址:   | 广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层                        |
| 办公地址:   | 广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层                        |
| 法定代表人:  | 胡伏云   |
| 联系人:    | 何雯  |
| 电话:     | 020-88836999  |
| 传真:     | 020-88836984  |
| 客户服务电话: | 95396   |
| 网址:     | <a href="http://www.gzs.com.cn">http://www.gzs.com.cn</a> |

**(41) 上海证券有限责任公司**

|         |   |
|---------|---|
| 注册地址:   | 上海市黄浦区四川中路 213 号 7 楼                                      |
| 办公地址:   | 上海市黄浦区四川中路 213 号久事商务大厦 7 楼                                |
| 法定代表人:  | 李俊杰   |
| 联系人:    | 魏熠琿   |
| 电话:     | 021-53686278  |
| 传真:     | 021-53686835  |
| 客户服务电话: | 4008918918  |
| 网址:     | <a href="https://www.shzq.com/">https://www.shzq.com/</a> |

**(42) 大同证券有限责任公司**

|         |   |
|---------|---|
| 注册地址:   | 大同市城区迎宾街 15 号桐城中央 21 层  |
| 办公地址:   | 太原市长治路 111 号山西世贸中心 A 座 F12、F13                                |
| 法定代表人:  | 董祥  |
| 联系人:    | 薛津  |
| 电话:     | 0351-4130322  |
| 传真:     | 0351-4192803  |
| 客户服务电话: | 4007121212  |
| 网址:     | <a href="http://www.dtsbc.com.cn">http://www.dtsbc.com.cn</a> |

**(43) 国联证券股份有限公司**

|         |   |
|---------|---|
| 注册地址:   | 无锡市县前东街 168 号   |
| 办公地址:   | 江苏省无锡市太湖新城金融一街 8 号国联金融大厦 702 室                              |
| 法定代表人:  | 姚志勇   |
| 联系人:    | 祁昊  |
| 电话:     | 0510-82831662   |
| 传真:     | 0510-82830162   |
| 客户服务电话: | 0510-82830162   |
| 网址:     | <a href="http://www.glsc.com.cn">http://www.glsc.com.cn</a> |

**(44) 平安证券股份有限公司**

|         |   |
|---------|---|
| 注册地址:   | 广东省深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层                                    |
| 办公地址:   | 广东省深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层                                    |
| 法定代表人:  | 何之江   |
| 联系人:    | 王阳  |
| 电话:     | 021-38632136  |
| 传真:     | 0755-82400862   |
| 客户服务电话: | 0755-22628888/95511-8   |
| 网址:     | <a href="http://www.stock.pingan.com">http://www.stock.pingan.com</a> |

**(45) 华安证券股份有限公司**

|         |   |
|---------|---|
| 注册地址:   | 安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号                                  |
| 办公地址:   | 安徽省合肥市南二环 959 号财智中心 B1 座                                |
| 法定代表人:  | 章宏韬   |
| 联系人:    | 范超  |
| 电话:     | 0551-65161821   |
| 传真:     | 0551-65161672   |
| 客户服务电话: | 95318   |
| 网址:     | <a href="http://www.hazq.com/">http://www.hazq.com/</a> |

**(46) 国都证券股份有限公司**

|         |   |
|---------|---|
| 注册地址:   | 北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层                         |
| 办公地址:   | 北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层                         |
| 法定代表人:  | 翁振杰   |
| 联系人:    | 黄静  |
| 电话:     | 010-84183333  |
| 传真:     | 010-84183311-3389                                       |
| 客户服务电话: | 400-818-8118  |
| 网址:     | <a href="http://www.guodu.com">http://www.guodu.com</a> |

**(47) 东海证券股份有限公司**

|        |                         |
|--------|-------------------------|
| 注册地址:  | 江苏省常州延陵西路 23 号投资广场 18 层 |
| 办公地址:  | 上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦 |
| 法定代表人: | 钱俊文                     |

|         |   |
|---------|---|
| 联系人:    | 王一彦   |
| 电话:     | 021-20333333  |
| 传真:     | 021-50498825  |
| 客户服务电话: | 95531; 4008888588   |
| 网址:     | <a href="http://www.longone.com.cn">http://www.longone.com.cn</a> |

**(48) 恒泰证券股份有限公司**

|         |   |
|---------|---|
| 注册地址:   | 内蒙古呼和浩特市赛罕区敕勒川大街东方君座D座光大银行办公楼14-18楼                           |
| 办公地址:   | 内蒙古呼和浩特市赛罕区敕勒川大街东方君座D座光大银行办公楼14-18楼                           |
| 法定代表人:  | 庞介民   |
| 联系人:    | 熊丽  |
| 电话:     | 0471-4972675  |
| 传真:     | 0471-4930707  |
| 客户服务电话: | 400-196-6188  |
| 网址:     | <a href="http://www.cnht.com.cn/">http://www.cnht.com.cn/</a> |

**(49) 国盛证券有限责任公司**

|         |   |
|---------|---|
| 注册地址:   | 江西省南昌市新建区子实路1589号   |
| 办公地址:   | 江西省南昌市红谷滩新区凤凰中大道1115号北京银行大厦                               |
| 法定代表人:  | 徐丽峰   |
| 联系人:    | 占文驰   |
| 电话:     | 0791-86283372   |
| 传真:     | 0791-6289395  |
| 客户服务电话: | 4008222111  |
| 网址:     | <a href="https://www.gszq.com/">https://www.gszq.com/</a> |

**(50) 华西证券股份有限公司**

|         |   |
|---------|---|
| 注册地址:   | 四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦                                       |
| 办公地址:   | 四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦                                       |
| 法定代表人:  | 杨炯洋   |
| 联系人:    | 张彬  |
| 电话:     | 010-58124967  |
| 传真:     | 028-86150040  |
| 客户服务电话: | 95584   |
| 网址:     | <a href="http://www.hx168.com.cn">http://www.hx168.com.cn</a> |

**(51) 申万宏源西部证券有限公司**

|        |                                       |
|--------|---------------------------------------|
| 注册地址:  | 新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005室 |
| 办公地址:  | 北京市西城区太平桥大街19号                        |
| 法定代表人: | 李琦                                    |
| 联系人:   | 陈宇                                    |

|         |   |
|---------|---|
| 电话:     | 021-3338825   |
| 传真:     | 021-33388224  |
| 客户服务电话: | 4008000562  |
| 网址:     | <a href="http://www.hysec.com">http://www.hysec.com</a> |

**(52) 中泰证券股份有限公司**

|         |  |
|---------|--|
| 注册地址:   | 山东省济南市经十路 20518 号                                  |
| 办公地址:   | 山东省济南市经七路 86 号 23 层                                |
| 法定代表人:  | 李玮   |
| 联系人:    | 朱琴   |
| 电话:     | 021-20315161                                       |
| 传真:     | 0531-68889357                                      |
| 客户服务电话: | 95538  |
| 网址:     | <a href="http://www.zts.com.cn">www.zts.com.cn</a> |

**(53) 第一创业证券股份有限公司**

|         |   |
|---------|---|
| 注册地址:   | 深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼   |
| 办公地址:   | 深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 18 楼   |
| 法定代表人:  | 刘学民   |
| 联系人:    | 吴军  |
| 电话:     | 0755-2383875  |
| 传真:     | 0755-25838701   |
| 客户服务电话: | 95358   |
| 网址:     | <a href="http://www.firstcapital.com.cn/">http://www.firstcapital.com.cn/</a> |

**(54) 财通证券股份有限公司**

|         |   |
|---------|---|
| 注册地址:   | 杭州市解放路 111 号  |
| 办公地址:   | 浙江省杭州市天目山路 198 号财通双冠大厦西楼 1201 室                         |
| 法定代表人:  | 陆建强   |
| 联系人:    | 陶志华   |
| 电话:     | 0571-87789160   |
| 传真:     | 0571-85071387   |
| 客户服务电话: | 95336 (上海地区 962336)                                     |
| 网址:     | <a href="http://www.ctsec.com">http://www.ctsec.com</a> |

**(55) 华鑫证券有限责任公司**

|         |   |
|---------|---|
| 注册地址:   | 深圳市福田区莲花街道福中社区深南大道 2008 号中国凤凰大厦 1 栋 20C-1 房 |
| 办公地址:   | 上海市徐汇区宛平南路 8 号                              |
| 法定代表人:  | 俞洋  |
| 联系人:    | 杨莉娟   |
| 电话:     | 021-54967552                                |
| 传真:     | 021-64333051                                |
| 客户服务电话: | 95323, 021-32109999, 029-68918888           |

|     |   |
|-----|---|
| 网址: | <a href="http://www.cfsc.com.cn">http://www.cfsc.com.cn</a> |
|-----|---|

**(56) 中国中金财富证券有限公司**

|         |  |
|---------|--|
| 注册地址:   | 深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层-21 层及第 04 层 01、02、03、05、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、23 单元 |
| 办公地址:   | 深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 04、18 层至 21 层  |
| 法定代表人:  | 高涛   |
| 联系人:    | 万玉琳  |
| 电话:     | 0755-82026907  |
| 传真:     | 0755-82026539  |
| 客户服务电话: | 4006008008/95532   |
| 网址:     | <a href="http://www.china-invs.cn/">http://www.china-invs.cn/</a>                            |

**(57) 国金证券股份有限公司**

|         |   |
|---------|---|
| 注册地址:   | 四川省成都市东城根上街 95 号  |
| 办公地址:   | 四川省成都市东城根上街 95 号  |
| 法定代表人:  | 冉云  |
| 联系人:    | 贾鹏  |
| 电话:     | 028-86690057、028-86690058                                   |
| 传真:     | 028-86690126  |
| 客户服务电话: | 4006-600109/95310   |
| 网址:     | <a href="http://www.gjqz.com.cn">http://www.gjqz.com.cn</a> |

**(58) 爱建证券有限责任公司**

|         |   |
|---------|---|
| 注册地址:   | 中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1600 号 1 幢 32 楼                     |
| 办公地址:   | 上海市浦东新区世纪大道 1600 号 32 楼                               |
| 法定代表人:  | 祝健  |
| 联系人:    | 姚盛盛   |
| 电话:     | 021-32229888  |
| 传真:     | 021- 68728703   |
| 客户服务电话: | 4001-962-502  |
| 网址:     | <a href="http://www.ajzq.com">http://www.ajzq.com</a> |

**(59) 开源证券股份有限公司**

|         |   |
|---------|---|
| 注册地址:   | 陕西省西安市高新区锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层                            |
| 办公地址:   | 陕西省西安市高新区锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层                            |
| 法定代表人:  | 李刚  |
| 联系人:    | 张蕊  |
| 电话:     | 029-88365809  |
| 传真:     | 86-29-88365835  |
| 客户服务电话: | 95325 /400-860-8866                                     |
| 网址:     | <a href="http://www.kysec.cn/">http://www.kysec.cn/</a> |



## 二、登记机构

名称：博时基金管理有限公司

住所：深圳市福田区莲花街道福新社区益田路 5999 号基金大厦 21 层

办公地址：北京市建国门内大街 18 号恒基中心 1 座 23 层

法定代表人：江向阳

电话：（010）65171166

传真：（010）65187068

联系人：许鹏

## 三、出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

注册地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

电话：021- 31358666

传真：021- 31358600

负责人：俞卫锋

联系人：安冬

经办律师：安冬、陆奇

## 四、审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 507 单元 01 室

办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

执行事务合伙人：李丹

联系电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

联系人：沈兆杰

经办注册会计师：张振波、沈兆杰

## 第六部分 基金的募集与基金合同的生效

### 一、基金的募集

基金管理人按照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定募集本基金，并经中国证监会 2020 年 03 月 20 日证监许可[2020]478 号文准予募集注册。

本基金募集期自 2020 年 05 月 18 日至 2020 年 05 月 22 日期间，基金份额共募集 691,563,064.85 份（含利息结转的份额），募集有效认购总户数为 6,793 户。

本基金的运作方式为契约型开放式，存续期间为不定期。

### 二、基金合同的生效

本基金的基金合同已于 2020 年 05 月 27 日正式生效。

### 三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

基金合同生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当在十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并在六个月内召开基金份额持有人大会进行表决。

法律法规或监管机构另有规定时，从其规定。

## 第七部分 基金份额的申购与赎回

### 一、申购与赎回的场所

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。具体的销售网点将由基金管理人在招募说明书或其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并在基金管理人网站公示。基金投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。

### 二、申购与赎回办理的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所及相关期货交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

基金合同生效后，若出现新的证券/期货交易市场，证券/期货交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

#### 2、申购、赎回开始日及业务办理时间

本基金已于 2020 年 6 月 22 日开通日常申购业务，于 2020 年 8 月 27 日开通日常赎回业务。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的，其基金份额申购、赎回或转换价格为下一开放日该类别基金份额申购、赎回或转换的价格。

### 三、申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的该类别基金份额净值为基准进行计算；

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；

4、赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人认购、申购的先后次序进行顺序赎回；

5、办理申购、赎回业务时，应当遵循基金份额持有人利益优先原则，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待。

基金管理人可在法律法规允许的情况下，对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

#### **四、申购与赎回的数额限制**

1、首次购买基金份额的最低金额为 1.00 元（含申购费），追加购买单笔最低金额为 1.00 元（含申购费）；详情请见当地销售机构公告；

2、每个基金交易账户最低持有基金份额余额为 1.00 份，若某笔赎回导致单个基金交易账户的基金份额余额少于 1.00 份时，余额部分基金份额必须一同赎回；

3、本基金目前对单个投资人累计持有份额不设上限限制，但法律法规、监管机构另有规定或基金合同另有约定的除外。基金管理人可以规定单个投资者累计持有的基金份额数量限制，具体规定见更新的招募说明书或相关公告；

4、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。具体请参见更新的招募说明书或相关公告。

5、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

#### **五、申购与赎回的程序**

##### **1、申购和赎回的申请方式**

投资人必须根据销售机构规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

##### **2、申购和赎回的款项支付**

投资人申购基金份额时，必须全额交付申购款项，投资人全额交付申购款项，申购成立；基金份额登记机构确认基金份额时，申购生效。

基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；基金份额登记机构确认赎回时，赎回生效。投资者赎回申请生效后，基金管理人将在 T+7 日（包括该日）内支付赎回款项。在发生巨额

赎回或基金合同约定的延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。

遇交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其他非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程，则赎回款项划付时间相应顺延至该因素消除的最近一个工作日。

### 3、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T日)，在正常情况下，本基金登记机构在T+1日内对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请，投资人应在T+2日后(包括该日)及时到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功或无效，则申购款项本金退还给投资人。

基金销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购、赎回申请的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资者应及时查询。

基金管理人可以在法律法规和基金合同允许的范围内，对上述业务办理时间进行调整，并在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

## 六、申购费率、赎回费率

1、投资者可以多次申购本基金，申购费率按每笔申购申请单独计算。

本基金基金份额采用前端收费模式收取基金申购费用。本基金A类基金份额在申购时收取基金申购费用；C类基金份额不收取申购费用。投资者的申购费用如下：

表 2：本基金份额的申购费率

| 金额(M)          | A类基金份额申购费率 | C类基金份额申购费率 |
|----------------|------------|------------|
| M<100万元        | 0.30%      | 0.00%      |
| 100万元≤M<500万元  | 0.15%      |            |
| 500万元≤M<1000万元 | 0.10%      |            |
| M≥1000万元       | 1000元/笔    |            |

本基金的申购费用由投资人承担，主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用，不列入基金财产。

2、本基金不收取赎回费，但每笔基金份额持有期满后3个月后，基金份额持有人方可就基金份额提出赎回申请。

3、基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

## 七、申购份额与赎回金额的计算方式

### 1、申购份额的计算方式：

(1) 申购费用适用比例费率的情形下：

净申购金额=申购金额/ (1+申购费率)

申购费用=申购金额-净申购金额

申购份额=净申购金额/T 日该类别基金份额净值

(2) 申购费用适用固定金额的情形下：

申购费用=固定金额

净申购金额=申购金额-申购费用

申购份额=净申购金额/T 日该类别基金份额净值

上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

例 3：假定 T 日 A 类基金份额净值为 1.0560 元，某投资人本次申购本基金 A 类基金份额 40 万元，对应的本次 A 类基金份额的申购费率为 0.30%，该投资人可得到的基金份额为：

净申购金额=400,000/ (1+0.30%) =398,803.59 元

申购费用=400,000-398,803.59=1196.41 元

申购份额=398,803.59/1.0560=377,654.915 份

即：投资人投资 40 万元申购本基金 A 类基金份额，假定申购当日 A 类基金份额的基金份额净值为 1.0560 元，可得到 377,654.915 份 A 类基金份额。

例 4：假定 T 日 A 类基金份额净值为 1.0560 元，某投资人投资 600 万元申购本基金 A 类基金份额，其对应的申购费用为 1,000 元，则其可得到的申购份额为：

申购费用=1,000.00 元

净申购金额=6,000,000-1,000.00=5,999,000.00 元

申购份额=5,999,000/1.0560=5,680,871.21 份

即：投资人投资 600 万元申购本基金 A 类基金份额，假定申购当日 A 类基金份额净值为 1.0560 元，可得到 5,680,871.21 份 A 类基金份额。

### 2、赎回金额的计算方式：

赎回总金额=赎回份额×T 日该类别基金份额净值

赎回费用=赎回总金额×赎回费率



净赎回金额=赎回总金额-赎回费用

上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

例 5：某投资者赎回本基金 1 万份 A 类基金份额，持有时间为三年，对应的赎回费率为 0%，假设赎回当日 A 类基金份额净值是 1.2500 元，则其可得到的赎回金额为：

赎回总金额=10,000×1.2500=12,500.00 元

赎回费用=12,500×0%=0.00 元

净赎回金额=12,500-0=12,500.00 元

即：投资者赎回本基金 1 万份 A 类基金份额，持有时间为三年，假设赎回当日 A 类基金份额净值是 1.2500 元，则其可得到的赎回金额为 12,500.00 元。

3、本基金份额净值的计算，保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T 日的各类基金份额净值在当天收市后计算，并按照基金合同的约定公告。遇特殊情况，经履行适当程序，可以适当延迟计算或公告。

4、基金管理人可以在违反法律法规规定及《基金合同》约定的情形下，且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，根据市场情况制定基金促销计划，定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率、基金赎回费率和销售服务费率，并进行公告。

5、当本基金份额发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。

## 八、申购与赎回的登记

1、经基金销售机构同意，基金投资者提出的申购和赎回申请，在基金管理人规定的时间之前可以撤销。

2、投资人赎回基金成功后，登记机构在 T+1 日为投资者办理扣除权益的登记手续。

3、基金管理人可以在法律法规允许的范围内，对上述登记办理时间进行调整，但不得实质影响投资者的合法权益，并最迟于开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定进行公告。

## 九、拒绝或暂停申购的情形及处理

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

- 1、因不可抗力导致基金无法正常运作。
- 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时。
- 3、证券、期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
- 4、接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益或对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时。
- 5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或发生其他损害现有基金份额持有人利益的情形。
- 6、基金管理人、基金托管人、基金销售机构或登记机构的异常情况导致基金销售系统、基金登记系统或基金会计系统无法正常运行。
- 7、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金申购申请。
- 8、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过 50%，或者变相规避 50%集中度的情形时。
- 9、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第 1、2、3、5、6、7、9 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购申请时，基金管理人应当根据有关规定进行公告。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的，被拒绝的申购款项本金将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

#### 十、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

- 1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。
- 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时。
- 3、证券、期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
- 4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。
- 5、发生继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时。

6、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请。

7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形（第 4 项除外）之一且基金管理人决定暂停接受基金份额持有人的赎回申请或延缓支付赎回款项时，基金管理人应按规定报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，未支付部分可延期支付，并以申请当日收市后计算的基金份额净值为依据计算赎回金额。若出现上述第 4 项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

### 十一、巨额赎回的情形及处理方式

#### 1、巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过前一开放日的基金总份额的 10%，即认为是发生了巨额赎回。

#### 2、巨额赎回的处理方式

当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。

（1）全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

（2）部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额 10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的该类基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎

回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。部分延期赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

(3) 本基金发生巨额赎回时，对于单个基金份额持有人当日赎回申请超过上一开放日基金总份额 10% 以上的部分，基金管理人有权对其进行延期办理（被延期赎回的赎回申请，将自动转入下一个开放日继续赎回，延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的该类基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止）；对于该基金份额持有人申请赎回的份额中未超过上一开放日基金总份额 10% 的部分，当基金管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行并与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理，当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，可在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额 10% 的前提下，对其余赎回申请延期办理。但是，如该持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。

(4) 暂停赎回：连续 2 个开放日以上(含本数)发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当依据相关规定进行公告。

### 3、巨额赎回的公告

当发生上述巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个工作日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，并在 2 日内在指定媒介上刊登公告。

## 十二、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

1、发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人应依据相关规定进行公告。

2、如发生暂停的时间为 1 日，基金管理人应于重新开放日，在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近 1 个开放日的各类基金份额净值。

3、如发生暂停的时间超过 1 日，基金管理人可以根据暂停申购或赎回的时间，依照《信息披露办法》的有关规定，最迟于重新开放日在指定媒介上刊登重新开放申购或赎回的公告，也可以根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间，届时不再另行发布重新开放的公告。

## 十三、基金转换

### 1、业务开放时间

本基金已于 2020 年 6 月 22 日开放日常转换转入业务,于 2020 年 8 月 27 日开放日常转换转出业务。

## 2、日常转换业务的办理时间

本基金日常业务的具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间,但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停有关业务时除外。

## 3. 日常转换业务

### 1) 转换费用

基金转换费用由转出基金赎回费和申购费补差两部分构成,其中:申购费补差具体收取情况,视每次转换时的两只基金的申购费率的差异情况而定。基金转换费用由基金持有人承担。

### 2) 其他与转换相关的事项

#### 1) 业务规则

①基金转换只能在同一销售机构进行。转换的两只基金必须都是该销售机构代理的同一基金管理人管理的、在同一注册登记机构处注册登记的基金。

②前端收费模式的开放式基金只能转换到前端收费模式的其它基金(申购费为零的基金视同为前端收费模式),后端收费模式的基金可以转换到前端或后端收费模式的其它基金,非 QDII 基金不能与 QDII 基金进行互转。

③基金转换的目标基金份额按新交易计算持有时间。基金转出视为赎回,转入视为申购。基金转换后可赎回的时间为 T+2 日。

④基金分红时再投资的份额可在权益登记日的 T+2 日提交基金转换申请。

⑤基金转换以申请当日基金份额净值为基础计算。投资者采用“份额转换”的原则提交申请。转出基金份额必须是可用份额,并遵循“先进先出”的原则。

#### 2) 暂停基金转换的情形及处理

基金转换视同为转出基金的赎回和转入基金的申购,因此有关转出基金和转入基金暂停或拒绝申购、暂停赎回的有关规定适用于基金转换。

出现法律、法规、规章规定的其它情形或其它在《基金合同》、《招募说明书》已载明并获中国证监会批准的特殊情形时,基金管理人可以暂停基金转换业务。

#### 3) 重要提示

①本基金转换业务适用于可以销售包括本基金在内的两只以上（含两只），且基金注册登记机构为同一机构的博时旗下基金的销售机构。

②转换业务的收费计算公式及举例参见 2010 年 3 月 16 日刊登于本公司网站的《博时基金管理有限公司关于旗下开放式基金转换业务的公告》。

③本公司管理基金的转换业务的解释权归本公司。

#### **十四、基金份额的转让**

对基金份额持有人无实质不利影响，在法律法规允许且条件具备的情况下，履行相关程序后，基金管理人可受理基金份额持有人通过中国证监会认可的交易场所或者交易方式进行份额转让的申请并由登记机构办理基金份额的过户登记。基金管理人拟受理基金份额转让业务的，将提前公告，基金份额持有人应根据基金管理人公告的业务规则办理基金份额转让业务。

#### **十五、基金的非交易过户**

基金的非交易过户是指基金登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资人。

继承是指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；捐赠指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体；司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供基金登记机构要求提供的相关资料，对于符合条件的非交易过户申请按基金登记机构的规定办理，并按基金登记机构规定的标准收费。

#### **十六、基金的转托管**

基金份额持有人可办理已持有基金份额在不同销售机构之间的转托管，基金销售机构可以按照规定标准收取转托管费。

#### **十七、定期定额投资计划**

本基金已于 2020 年 6 月 22 日开放定期定额投资业务。

##### **1 适用投资者范围**

个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会规定允许购买证券投资基金的其他投资者。

##### **2 申购费率**



本基金定期定额投资的申购费率与普通申购业务的费率相同，见上文。

### 3 扣款日期和扣款金额

投资者须遵循各销售机构有关扣款日期的规定，定投金额每次不少于人民币 10.00 元。

### 4 重要提示

1) 凡申请办理本基金“定期定额投资计划”的投资者须首先开立本公司开放式基金基金账户。

2) 本基金定期定额投资计划的每月实际扣款日即为基金申购申请日，并以该日(T日)的基金份额净值为基准计算申购份额。投资者可以从 T+2 日起通过本定期定额投资计划办理网点、致电本公司客服电话或登录本公司网站查询其每次申购申请的确认情况。申购份额将在确认成功后直接计入投资者的基金账户。

## 十八、基金份额的冻结、解冻和质押

基金登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻，以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益一并冻结，被冻结部分份额仍然参与收益分配与支付。法律法规或基金合同另有规定的除外。

对基金份额持有人无实质不利影响，如相关法律法规允许，履行相关程序后，基金管理人办理基金份额的质押业务或其他基金业务，基金管理人将制定和实施相应的业务规则。

## 第八部分 基金的投资

### 一、投资目标

在谨慎投资的前提下，本基金力争获取高于业绩比较基准的投资收益。

### 二、投资范围

基金的投资范围主要包括债券（国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资债券、公开发行的次级债、可分离交易可转债的纯债部分、政府机构支持债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、信用衍生品、国债期货等法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金不投资于股票、权证等权益类资产，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。

基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产比例不低于基金资产的 80%；本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。

### 三、投资策略

本基金通过自上而下和自下而上相结合、定性分析和定量分析相补充的方法，确定资产在固定收益类证券之间的配置比例。充分发挥基金管理人长期积累的信用研究成果，利用自主开发的信用分析系统，深入挖掘价值被低估的标的券种，以获取最大化的信用溢价。本基金采用的投资策略包括：期限结构策略、信用策略、互换策略、息差策略等。在谨慎投资的前提下，力争获取高于业绩比较基准的投资收益。

在以上战略性资产配置的基础上，本基金通过自上而下和自下而上相结合、定性分析和定量分析相补充的方法，进行前瞻性的决策。一方面，本基金将分析众多的宏观经济变量（包括 GDP 增长率、CPI 走势、M2 的绝对水平和增长率、利率水平与走势等），并关注国家财政、税收、货币、汇率政策和其它证券市场政策等。另一方面，本基金将对债券市场整体收益率

曲线变化进行深入细致分析，从而对市场走势和波动特征进行判断。在此基础上，确定资产在固定收益类证券之间的配置比例。

本基金灵活应用各种期限结构策略、信用策略、互换策略、息差策略等。本基金将投资组合的平均剩余期限控制在 2 年以内，在控制利率风险、在合理管理并控制组合风险的前提下，最大化组合收益。

1、期限结构策略。通过预测收益率曲线的形状和变化趋势，对各类型债券进行久期配置；当收益率曲线走势难以判断时，参考基准指数的样本券久期构建组合久期，确保组合收益超过基准收益。具体来看，又分为跟踪收益率曲线的骑乘策略和基于收益率曲线变化的子弹策略、杠铃策略及梯式策略。

1) 骑乘策略是当收益率曲线比较陡峭时，也即相邻期限利差较大时，买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券，通过债券的收益率的下滑，进而获得资本利得收益。

2) 子弹策略是使投资组合中债券久期集中于收益率曲线的一点，适用于收益率曲线较陡时；杠铃策略是使投资组合中债券的久期集中在收益率曲线的两端，适用于收益率曲线两头下降较中间下降更多的蝶式变动；梯式策略是使投资组合中的债券久期均匀分布于收益率曲线，适用于收益率曲线水平移动。

2、信用策略。信用债收益率等于基准收益率加信用利差，信用利差收益主要受两个方面的影响，一是该信用债对应信用水平的市场平均信用利差曲线走势；二是该信用债本身的信用变化。基于这两方面的因素，本基金分别采用以下的分析策略：

1) 基于信用利差曲线变化策略：一是分析经济周期和相关市场变化对信用利差曲线的影响，二是分析信用债市场容量、结构、流动性等变化趋势对信用利差曲线的影响，最后综合各种因素，分析信用利差曲线整体及分行业走势，确定信用债券总的及分行业投资比例。

2) 基于信用债信用变化策略：发行人信用发生变化后，本基金将采用变化后债券信用评级所对应的信用利差曲线对公司债、企业债定价。影响信用债信用风险的因素分为行业风险、公司风险、现金流风险、资产负债风险和其他风险等五个方面。本基金主要依靠内部评级系统分析信用债的相对信用水平、违约风险及理论信用利差。

3、互换策略。不同券种在利息、违约风险、久期、流动性、税收和衍生条款等方面存在差别，投资管理人可以同时买入和卖出具有相近特性的两个或两个以上券种，赚取收益级差。互换策略分为两种：

1) 替代互换。判断未来利差曲线走势，比较期限相近的债券的利差水平，选择利差较高的品种，进行价值置换。由于利差水平受流动性和信用水平的影响，因此该策略也可扩展到新老券置换、流动性和信用的置换，即在相同收益率下买入近期发行的债券，或是流动性更好的债券，或在相同外部信用级别和收益率下，买入内部信用评级更高的债券。

2) 市场间利差互换。一般在公司信用债和国家信用债之间进行。如果预期信用利差扩大，则用国家信用债替换公司信用债；如果预期信用利差缩小，则用公司信用债替换国家信用债。

4、息差策略。通过正回购，融资买入收益率高于回购成本的债券，从而获得杠杆放大收益。

5、个券挖掘策略。本部分策略强调公司价值挖掘的重要性，在行业周期特征、公司基本面风险特征基础上制定绝对收益率目标策略，甄别具有估值优势、基本面改善的公司，采取高度分散策略，重点布局优势债券，争取提高组合超额收益空间。

#### 6、资产支持证券投资策略

本基金将通过对资产支持证券基础资产及结构设计的研究，结合多种定价模型，根据基金资产组合情况适度进行资产支持证券的投资。本基金将在国内资产证券化具体政策框架下，通过宏观经济、提前偿还率、资产池结构及所在行业景气变化等因素的研究，对个券进行风险分析和价值评估后选择风险调整收益高的品种进行投资。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散，以降低流动性风险。

#### 7、购买信用衍生品规避个券信用风险策略

依托于公司整体的信用研究团队，当预期某只债券有较高的违约风险时，可以购买对应债券的信用衍生品来控制标的债券的信用风险冲击。

本基金按风险管理的原则，以风险对冲为目的参与信用衍生品交易，同时会根据实际情况尽量保持信用衍生品的名义本金与对应标的债券的面值相一致。

#### 8、国债期货投资策略

国债期货投资策略。本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性

及风险性特征，运用国债期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

#### 四、投资限制

##### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

- (1) 本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%；
- (2) 本基金每个交易日日终扣除国债期货需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；
- (3) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；
- (4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；
- (5) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；
- (6) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；
- (7) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；
- (8) 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；
- (9) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；
- (10) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；
- (11) 本基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；
- (12) 本基金参与国债期货交易，需遵守下列投资比例限制：
  - 1) 本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的 15%；

2) 本基金在任何交易日日终,持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%;

3) 本基金在任何交易日内交易(不包括平仓)的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 30%;

4) 本基金所持有的债券(不含到期日在一年以内的政府债券)市值和买入、卖出国债期货合约价值,合计(轧差计算)应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定;

(13) 本基金不持有具有信用保护卖方属性的信用衍生品,不持有合约类信用衍生品,本基金持有的信用衍生品名义本金不得超过本基金中所对应受保护债券面值的 100%;

(14) 本基金投资于同一信用保护卖方各类信用衍生品名义本金合计不得超过基金资产净值的 10%;

(15) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的 15%;  
因证券市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;

(16) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的,可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致;

(17) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述(2)、(10)、(15)、(16)项外,因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的,基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整,但法律法规或中国证监会规定的特殊情形除外。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内,本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或调整上述限制,如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制或按调整后的规定执行,但须提前公告。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或者活动:

- (1) 承销证券;
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保;
- (3) 从事承担无限责任的投资;



- (4) 买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- (6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

法律、行政法规或监管部门取消或变更上述禁止性规定，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按变更后的规定执行。

## 五、业绩比较基准

本基金业绩比较基准：中债总财富（1-3 年）指数收益率×80%+一年期定期存款利率（税后）×20%

本基金为债券型证券投资基金，组合久期不超过 2 年，所以本基金选取中债总财富（1-3 年）指数收益率作为业绩比较基准。中债总财富（1-3 年）指数是综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场中短期债券指数，对中短期债券价格变动趋势有很强的代表性，能较好的反映本基金的投资策略，较为科学、合理的评价本基金的业绩表现。若未来法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者市场发生变化导致本业绩比较基准不再适用或本业绩比较基准采用的指数停止发布，本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，在与基金托管人协商一致并报中国证监会备案后，适当调整业绩比较基准并及时公告，而无需召开基金份额持有人大会。

## 六、风险收益特征

本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金，属于中低风险/收益的产品。

## 七、基金管理人代表基金行使相关权利的处理原则及方法



1、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使相关权利，保护基金份额持有人的利益；

2、有利于基金财产的安全与增值；

3、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

## 八、基金投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人根据本基金合同规定，复核了本报告中的净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至 2020 年 09 月 30 日，本报告中所列财务数据未经审计。

### 1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额(元)            | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|------------------|---------------|
| 1  | 权益投资              | -                | -             |
|    | 其中：股票             | -                | -             |
| 2  | 基金投资              | -                | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 1,009,545,600.00 | 95.18         |
|    | 其中：债券             | 980,579,800.00   | 92.45         |
|    | 资产支持证券            | 28,965,800.00    | 2.73          |
| 4  | 贵金属投资             | -                | -             |
| 5  | 金融衍生品投资           | -                | -             |
| 6  | 买入返售金融资产          | 30,030,165.05    | 2.83          |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -                | -             |
| 7  | 银行存款和结算备付金合计      | 9,182,033.19     | 0.87          |
| 8  | 其他各项资产            | 11,890,444.40    | 1.12          |
| 9  | 合计                | 1,060,648,242.64 | 100.00        |

### 2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

### 3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

### 4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------|---------|---------------|
| 1  | 国家债券 | -       | -             |

|    |           |                |       |
|----|-----------|----------------|-------|
| 2  | 央行票据      | -              | -     |
| 3  | 金融债券      | 49,743,000.00  | 4.71  |
|    | 其中：政策性金融债 | 49,743,000.00  | 4.71  |
| 4  | 企业债券      | 216,438,300.00 | 20.49 |
| 5  | 企业短期融资券   | 242,247,500.00 | 22.93 |
| 6  | 中期票据      | 304,652,000.00 | 28.83 |
| 7  | 可转债（可交换债） | -              | -     |
| 8  | 同业存单      | 167,499,000.00 | 15.85 |
| 9  | 其他        | -              | -     |
| 10 | 合计        | 980,579,800.00 | 92.81 |

## 5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码      | 债券名称            | 数量（张）   | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|-----------------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 112009384 | 20 浦发银行 CD384   | 500,000 | 49,275,000.00 | 4.66         |
| 2  | 112009375 | 20 浦发银行 CD375   | 400,000 | 39,424,000.00 | 3.73         |
| 3  | 112087455 | 20 徽商银行 CD079   | 400,000 | 39,408,000.00 | 3.73         |
| 4  | 112087789 | 20 华融湘江银行 CD096 | 400,000 | 39,392,000.00 | 3.73         |
| 5  | 200211    | 20 国开 11        | 300,000 | 29,721,000.00 | 2.81         |

## 6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

| 序号 | 证券代码   | 证券名称    | 数量（张）      | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|---------|------------|---------------|--------------|
| 1  | 137156 | 时领 01 优 | 100,000.00 | 10,000,000.00 | 0.95         |
| 2  | 137168 | 20 阳城优  | 100,000.00 | 10,000,000.00 | 0.95         |
| 3  | 138686 | 合景 6A1  | 90,000.00  | 8,965,800.00  | 0.85         |

## 7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

## 10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 11 投资组合报告附注

11.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券中除 20 浦发银行 CD384(112009384)、20 浦发银行 CD375(112009375)、20 徽商银行 CD079(112087455)的发行主体外，没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

主要违规事实：2020 年 8 月 11 日，因该行在 2013 年至 2018 年，存在 1. 未按专营部门制规定开展同业业务；2. 同业投资资金违规投向“四证”不全的房地产项目；3. 延迟支付同业投资资金吸收存款等违规行为，中国保险监督管理委员会上海保监局对上海浦东发展银行股份有限公司处以罚款的行政处罚。

主要违规事实：2020 年 8 月 7 日，因存在 1. 备案类账户开立未及时备案，2. 个人银行账户开立未备案，3. 经收预算收入未在规定账户核算等违规行为。中国人民银行合肥市中心支行对徽商银行股份有限公司处以罚款的行政处罚。

对该证券投资决策程序的说明：根据我司的基金投资管理相关制度，以相应的研究报告为基础，结合其未来增长前景，由基金经理决定具体投资行为。

11.2 基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额(元)         |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | 4,363.88      |
| 2  | 应收证券清算款 | -             |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 11,824,874.12 |
| 5  | 应收申购款   | 61,206.40     |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 11,890,444.40 |

### 11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

### 11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## 第九部分 基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

自基金合同生效开始，基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

博时季季乐持有期债券 A

| 期间                    | ①净值增长率 | ②净值增长率标准差 | ③业绩比较基准收益率 | ④业绩比较基准收益率标准差 | ①-③   | ②-④    |
|-----------------------|--------|-----------|------------|---------------|-------|--------|
| 2020.05.27-2020.09.30 | 0.96%  | 0.02%     | -0.75%     | 0.05%         | 1.71% | -0.03% |

博时季季乐持有期债券 C

| 期间                    | ①净值增长率 | ②净值增长率标准差 | ③业绩比较基准收益率 | ④业绩比较基准收益率标准差 | ①-③   | ②-④    |
|-----------------------|--------|-----------|------------|---------------|-------|--------|
| 2020.05.27-2020.09.30 | 0.91%  | 0.02%     | -0.75%     | 0.06%         | 1.66% | -0.04% |

## 第十部分 基金的财产

### 一、基金资产总值

基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息和基金应收款项以及其他资产的价值总和。

### 二、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### 三、基金财产的账户

基金托管人根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立资金账户、证券账户以及投资所需的其他专用账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

### 四、基金财产的保管和处分

本基金财产独立于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的财产，并由基金托管人对基金托管账户中的资金进行保管。基金管理人、基金托管人、基金登记机构和基金销售机构以其自有的财产承担其自身的法律责任，其债权人不得对本基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。除依法律法规和《基金合同》的规定处分外，基金财产不得被处分。

基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。基金管理人管理运作基金财产所产生的债权，不得与其固有资产产生的债务相互抵销；基金管理人管理运作不同基金的基金财产所产生的债权债务不得相互抵销。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

## 第十一部分 基金资产的估值

### 一、估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券交易场所的交易日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非交易日。

### 二、估值对象

基金所拥有的债券、国债期货合约、信用衍生品和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

### 三、估值原则

基金管理人在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，应符合《企业会计准则》、监管部门有关规定。

(一)对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会计准则规定的例外情况外，应将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(二)对不存在活跃市场的投资品种，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(三)如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25%以上的，应对估值进行调整并确定公允价值。

### 四、估值方法

#### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

(1) 交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（基金合同另有规定的除外），选取估值日第三方估值机构提供的相应品种对应的估值净价估值，具体估值机构由基金管理人与基金托管人另行协商约定；

(2) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

2、首次公开发行未上市的债券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

3、同业存单、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

4、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

5、信用衍生品按第三方估值机构提供的当日估值价格进行估值，但管理人依法应当承担的估值责任不因委托而免除，选定的第三方估值机构未提供估值价格的，依照有关法律法规及企业会计准则要求采用合理估值技术，确定公允价值。

6、基金投资的国债期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

7、当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律组织的规定。

8、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

9、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对基金净值的计算结果对外予以公布。



## 五、估值程序

1、基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日该类基金份额的余额数量计算，精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入。基金管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。特殊情况下，基金管理人可提高基金份额净值计算的精度（即提高净值计算结果小数点后保留的位数），以维护基金投资人利益。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人应每个工作日计算基金资产净值及各类基金份额净值，并按规定进行公告。

2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将各类基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人按约定对外公布。

## 六、估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当任一类基金份额净值小数点后 4 位以内(含第 4 位)发生估值错误时，视为该类基金份额净值错误。

基金合同的当事人应按照以下约定处理：

### 1、估值错误类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或登记机构、或销售机构、或投资人自身的过错造成估值错误，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该估值错误遭受损失当事人（“受损方”）的直接损失按下述“估值错误处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

上述估值错误的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等。

### 2、估值错误处理原则

（1）估值错误已发生，但尚未给当事人造成损失时，估值错误责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正估值错误发生的费用由估值错误责任方承担；由于估值错误责任方未及时更正已产生的估值错误，给当事人造成损失的，由估值错误责任方对直接损失承担赔偿责任；若估值错误责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责任。估值错误责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保估值错误已得到更正。

(2) 估值错误的责任方对有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对估值错误的有关直接当事人负责，不对第三方负责。

(3) 因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但估值错误责任方仍应对估值错误负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失(“受损方”)，则估值错误责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给估值错误责任方。

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

### 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

(1) 查明估值错误发生的原因，列明所有的当事人，并根据估值错误发生的原因确定估值错误的责任方；

(2) 根据估值错误处理原则或当事人协商的方法对因估值错误造成的损失进行评估；

(3) 根据估值错误处理原则或当事人协商的方法由估值错误的责任方进行更正和赔偿损失；

(4) 根据估值错误处理的方法，需要修改基金登记机构交易数据的，由基金登记机构进行更正，并就估值错误的更正向有关当事人进行确认。

### 4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

(1) 基金份额净值计算出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；

(2) 错误偏差达到该类基金份额净值的 0.25%时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到该类基金份额净值的 0.50%时，基金管理人应当公告，并报中国证监会备案；

(3) 当基金份额净值计算差错给基金和基金份额持有人造成损失需要进行赔偿时，基金管理人和基金托管人应根据实际情况界定双方承担的责任，经确认后按以下条款进行赔偿：

①本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，与本基金有关的会计问题，如经双方在平等基础上充分讨论后，尚不能达成一致时，按基金管理人的建议执行，由此给基金份额持有人和基金财产造成的损失，由基金管理人负责赔付。

②若基金管理人计算的基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告，由此给基金份额持有人造成损失的，应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金，就实际向投资者或基金支付的赔偿金额，基金管理人与基金托管人按照过错程度各自承担相应的责任。

③如基金管理人和基金托管人对基金份额净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对，尚不能达成一致时，为避免不能按时公布基金份额净值的情形，以基金管理人的计算结果对外公布，由此给基金份额持有人和基金造成的损失，由基金管理人负责赔付。

④由于基金管理人提供的信息错误（包括但不限于基金申购或赎回金额等），进而导致基金份额净值计算错误而引起的基金份额持有人和基金财产的损失，由基金管理人负责赔付。

（4）前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。如果行业另有通行做法，基金管理人和基金托管人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商。

### 七、暂停估值的情形

- 1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；
- 3、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停估值；
- 4、法律法规规定、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

### 八、基金净值的确认

基金资产净值和各类基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金资产净值和各类基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金净值按约定予以公布。

### 九、特殊情况的处理方法

1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 8 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

2、由于不可抗力原因，或由于证券、期货交易所及登记结算公司等第三方机构发送的数据错误等原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任，但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

## 第十二部分 基金的收益与分配

### 一、基金利润的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额，基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

### 二、基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

### 三、基金收益分配原则

1、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资，且基金份额持有人可对 A 类、C 类基金份额分别选择不同的分红方式；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；通过红利再投资所得基金份额的最短持有期起始日与该认/申购份额最短持有期起始日相同。

2、基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

3、本基金同一类别的每份基金份额享有同等分配权；

4、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在符合法律法规及基金合同约定并对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人经与基金托管人协商一致后可对基金收益分配原则和支付方式进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

### 四、收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

### 五、收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，依据相关规定进行公告。

### 六、基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持

有人的现金红利自动转为相应类别的基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。

## 第十三部分 基金的费用与税收

### 一、基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、C类基金份额的销售服务费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用，法律法规、中国证监会另有规定的除外；

5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费；

6、基金份额持有人大会费用；

7、基金的证券、期货交易费用；

8、基金的银行汇划费用；

9、基金的账户开户费用、账户维护费用；

10、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

### 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.30%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力等致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

#### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.05%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日或不可抗力等致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

### 3、C 类基金份额的销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.30% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性划出，由登记机构代收，登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构等。若遇法定节假日、休息日或不可抗力等，支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类”中第 4—10 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

### 三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

### 四、基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。基金财产投资的相关税收，由基金份额持有人承担，基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

### 五、基金管理费、基金托管费的调整



在遵守相关的法律法规并履行了必要的程序的前提下，基金管理人和基金托管人协商一致后可酌情调整基金管理费、基金托管费。基金管理人必须于新的费率实施日前按照《信息披露办法》的规定在指定媒介上刊登公告。

## 第十四部分 基金的会计与审计

### 一、基金会计政策

- 1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；
- 2、基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日；基金首次募集的会计年度按如下原则：如果《基金合同》生效少于2个月，可以并入下一个会计年度披露；
- 3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
- 4、会计制度执行国家有关会计制度；
- 5、本基金独立建账、独立核算；
- 6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；
- 7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面约定的方式确认。

### 二、基金的年度审计

- 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意。
- 3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所需依照《信息披露办法》的相关规定在指定媒介公告。

## 第十五部分 基金的信息披露

一、本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《流动性风险管理规定》、《基金合同》及其他有关规定。相关法律法规关于信息披露的规定发生变化时，本基金从其最新规定。

### 二、信息披露义务人

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律、行政法规和中国证监会规定的自然人、法人和非法人组织。

本基金信息披露义务人以保护基金份额持有人利益为根本出发点，按照法律法规和中国证监会的规定披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性、完整性、及时性、简明性和易得性。

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的全国性报刊（以下简称“指定报刊”）和指定互联网网站（以下简称“指定网站”）等媒介披露，并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

### 三、本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

- 1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；
- 2、对证券投资业绩进行预测；
- 3、违规承诺收益或者承担损失；
- 4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构；
- 5、登载任何自然人、法人和非法人组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；
- 6、中国证监会禁止的其他行为。

四、本基金公开披露的信息应采用中文文本。如同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证不同文本的内容一致。不同文本之间发生歧义的，以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

### 五、公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

- （一）基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议、基金产品资料概要

1、《基金合同》是界定《基金合同》当事人的各项权利、义务关系，明确基金份额持有人大会召开的规则及具体程序，说明基金产品的特性等涉及基金投资者重大利益的事项的法律文件。

2、基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。《基金合同》生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在指定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。

3、基金托管协议是界定基金托管人和基金管理人在基金财产保管及基金运作监督等活动中的权利、义务关系的法律文件。

4、基金产品资料概要是基金招募说明书的摘要文件，用于向投资者提供简明的基金概要信息。《基金合同》生效后，基金产品资料概要的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金产品资料概要，并登载在指定网站及基金销售机构网站或营业网点；基金产品资料概要其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金产品资料概要。

基金募集申请经中国证监会注册后，基金管理人应当在基金份额发售的三日前，将基金份额发售公告、基金招募说明书提示性公告和基金合同提示性公告登载在指定报刊上，将基金份额发售公告、基金招募说明书、基金产品资料概要、《基金合同》和基金托管协议登载在指定网站上，并将基金产品资料概要登载在基金销售机构网站或营业网点；基金托管人应当同时将基金合同、基金托管协议登载在指定网站上。

## （二）基金份额发售公告

基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于指定媒介上。

## （三）《基金合同》生效公告

基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日在指定媒介上登载《基金合同》生效公告。

## （四）基金净值信息

《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周在指定网站披露一次各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过指定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日的各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。

基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在指定网站披露半年度和年度最后一日的各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。

#### （五）基金份额申购、赎回价格

基金管理人应当在《基金合同》、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资者能够在基金销售机构网站或营业网点查阅或者复制前述信息资料。

（六）基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告（含资产组合季度报告）

基金管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载于指定网站上，并将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计。

基金管理人应当在上半年结束之日起两个月内，编制完成基金中期报告，将中期报告登载在指定网站上，并将中期报告提示性公告登载在指定报刊上。

基金管理人应当在季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，将季度报告登载在指定网站上，并将季度报告提示性公告登载在指定报刊上。

《基金合同》生效不足 2 个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。

如报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额 20% 的情形，为保障其他投资者的权益，基金管理人至少应当在基金定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本基金的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

基金管理人应当在基金年度报告和中期报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。

#### （七）临时报告

本基金发生重大事件,有关信息披露义务人应当依照《信息披露办法》编制临时报告书,并登载在指定报刊和指定网站上。

前款所称重大事件,是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件:

- 1、基金份额持有人大会的召开及决定的事项;
- 2、基金合同终止、基金清算;
- 3、转换基金运作方式、基金合并;
- 4、更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构,基金改聘会计师事务所;
- 5、基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项,基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项;
- 6、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更;
- 7、基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人的实际控制人变更;
- 8、基金募集期延长或提前结束募集;
- 9、基金管理人的高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动;
- 10、基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十;
- 11、基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十;
- 12、涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁;
- 13、基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚,基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚;
- 14、基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券,或者从事其他重大关联交易事项,中国证监会另有规定的除外;
- 15、基金收益分配事项;
- 16、管理费、托管费、销售服务费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更;
- 17、基金份额净值估值错误达基金份额净值百分之零点五;

- 18、本基金开始办理申购、赎回；
- 19、本基金发生巨额赎回并延期办理；
- 20、本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；
- 21、本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；
- 22、调整基金份额类别的设置；
- 23、基金推出新业务或服务；
- 24、发生涉及本基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；
- 25、基金管理人采用摆动定价机制进行估值时；
- 26、基金信息披露义务人认为可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的其他事项或中国证监会规定的其它事项。

#### （八）澄清公告

在《基金合同》存续期限内，任何公共媒介中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动，以及可能损害基金份额持有人权益的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会。

#### （九）基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

#### （十）清算报告

基金终止运作的，基金管理人应当依法组织基金财产清算小组对基金财产进行清算并作出清算报告。基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

#### （十一）资产支持证券的投资情况

本基金投资资产支持证券，基金管理人应在基金年度报告及中期报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细。基金管理人应在基金季度报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期末按市值占基金净资产比例大小排序的前 10 名资产支持证券明细。

#### （十二）国债期货的投资情况



基金管理人应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露国债期货交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示国债期货交易对本基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标。

#### （十三）信用衍生品的投资情况

基金管理人应当在定期报告及招募说明书（更新）等文件中详细披露信用衍生品的投资情况，包括投资策略、持仓情况等，并充分揭示投资信用衍生品对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资目标及策略。

#### （十四）中国证监会规定的其他信息

### 六、信息披露事务管理

基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度，指定专门部门及高级管理人员负责管理信息披露事务。

基金信息披露义务人公开披露基金信息，应当符合中国证监会相关基金信息披露内容与格式准则等法规的规定。

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、各类基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告、更新的招募说明书、基金产品资料概要、基金清算报告等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人进行书面或电子确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定报刊中选择一家报刊披露本基金信息。基金管理人、基金托管人应当向中国证监会基金电子披露网站报送拟披露的基金信息，并保证相关报送信息的真实、准确、完整、及时。

基金管理人、基金托管人除按法律法规要求披露信息外，也可着眼于为投资者决策提供有用信息的角度，在保证公平对待投资者、不误导投资者、不影响基金正常投资操作的前提下，自主提升信息披露服务的质量。具体要求应当符合中国证监会及自律规则的相关规定。前述自主披露如产生信息披露费用，该费用不得从基金财产中列支。

基金管理人、基金托管人除依法在指定媒介上披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒介披露信息，但是其他公共媒介不得早于指定媒介披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

为基金信息披露义务人公开披露的基金信息出具审计报告、法律意见书的专业机构，应当制作工作底稿，并将相关档案至少保存到《基金合同》终止后 10 年。

### 七、信息披露文件的存放与查阅

依法必须披露的信息发布后，基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于各自住所，供社会公众查阅、复制。

### 八、暂停或延迟信息披露的情形

- 1、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；
- 2、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 3、法律法规规定、中国证监会或基金合同认定的其他情形。

## 第十六部分 风险揭示

### 一、投资于本基金的主要风险

投资于本基金的主要风险有：

#### 1、市场风险

证券市场价格受到各种因素的影响，导致基金收益水平变化而产生风险，主要包括：

（1）政策风险。因国家宏观政策（如货币政策、财政政策、行业政策、地区发展政策等）发生变化，导致市场价格波动而产生风险。

（2）经济周期风险。随着经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化。本基金主要投资于债券，收益水平也会随之变化，从而产生风险。

（3）利率风险。金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。

（4）通货膨胀风险。如果发生通货膨胀，基金投资于证券所获得的收益可能会被通货膨胀抵消，从而影响基金资产的保值增值。

（5）再投资风险。再投资风险反映了利率下降对固定收益证券利息收入再投资收益的影响，这与利率上升所带来的价格风险（即利率风险）互为消长。

（6）杠杆风险。本基金可以通过债券回购放大杠杆，进行杠杆操作将会放大组合收益波动，对组合业绩稳定性有较大影响，同时杠杆成本波动也会影响组合收益率水平，在市场下行或杠杆成本异常上升时，有可能导致基金财产收益的超预期下降风险。

#### 2、信用风险

信用风险是指发行人是否能够实现发行时的承诺，按时足额还本付息的风险，或者交易对手未能按时履约的风险。包括：

（1）债务人违约风险：本基金投资于债券市场，如遇证券发行主体信用状况恶化，信用评级下降，会导致债券价格下降进而影响基金财产收益水平。严重的，甚至出现到期不能履行合约进行兑付，将给本基金带来损失。

（2）交易对手方违约风险：当固定收益证券交易对手违约时，将直接导致基金财产的损失，或导致本基金不能及时抓住市场机会，对投资收益产生影响

#### 3、流动性风险

流动性风险是指因证券市场交易量不足，导致证券不能迅速、低成本地变现的风险。流动性风险还包括基金出现巨额赎回，致使没有足够的现金应付赎回支付所引致的风险。

#### （1）基金申购、赎回安排

本基金在客户集中度控制、巨额赎回监测及应对在投资者申购赎回方面均明确了管理机制，在接受申购申请对存量客户利益构成潜在重大不利影响，以及市场大幅波动、流动性枯竭等极端情况下发生无法应对投资者巨额赎回的情形时，基金管理人在保障投资者合法权益的前提下可按照法律法规及基金合同的规定，审慎确认申购赎回申请并综合运用各类流动性风险管理工具作为辅助措施，全面应对流动性风险。

#### （2）拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

本基金的投资市场主要为证券交易所、全国银行间债券市场等流动性较好的规范型交易场所，主要投资对象为具有良好流动性的金融工具（包括国内依法发行上市的债券等），同时本基金基于分散投资的原则在行业 and 个券方面未有高集中度的特征，综合评估在正常市场环境下本基金的流动性风险适中。

#### （3）巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

基金出现巨额赎回情形下，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况或巨额赎回份额占比情况决定全额赎回或部分延期赎回。同时，如本基金单个基金份额持有人在单个开放日申请赎回基金份额超过基金总份额一定比例以上的，基金管理人有权对其采取延期办理赎回申请的措施。

#### （4）实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响

在市场大幅波动、流动性枯竭等极端情况下发生无法应对投资者巨额赎回的情形时，基金管理人将以保障投资者合法权益为前提，严格按照法律法规及基金合同的规定，谨慎选取延期办理巨额赎回申请、暂停接受赎回申请、延缓支付赎回款项、收取短期赎回费、暂停估值、摆动定价等流动性风险管理工具作为辅助措施。

##### 1) 延期办理巨额赎回申请

投资人具体请参见基金合同“第六部分、基金份额的申购与赎回”中的“九、巨额赎回的情形及处理方式”，详细了解本基金延期办理巨额赎回申请的情形及程序。在此情形下，

当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额 10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于单个基金份额持有人当日赎回申请超过上一开放日基金总份额 10%以上的部分，基金管理人有权对其进行延期办理。因此，当发生巨额赎回情形时，投资者的赎回申请存在延期办理风险。

#### 2) 暂停接受赎回申请

投资人具体请参见基金合同“第六部分、基金份额的申购与赎回”中的“、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形”，详细了解本基金暂停接受赎回申请的情形及程序。在此情形下，投资人的赎回申请可能会被拒绝。

#### 3) 延缓支付赎回款项

投资人具体请参见基金合同“第六部分、基金份额的申购与赎回”中的“、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形”，详细了解本基金延缓支付赎回款项的情形及程序。在此情形下，已确认的赎回申请，如暂时不能足额支付，未支付部分可延期支付，并以申请当日收市后计算的基金份额净值为依据计算赎回金额。

#### 4) 收取短期赎回费

本基金对持续持有期少于7日的投资者收取1.50%的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产。

#### 5) 暂停基金估值

投资人具体请参见基金合同“第十四部分、基金资产估值”中的“七、暂停估值的情形”，详细了解本基金暂停估值的情形及程序。在此情形下，投资人没有可供参考的基金份额净值，基金管理人可暂停接收投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。

#### 6) 摆动定价

当本基金发生大申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。当基金采用摆动定价时，投资者申购或赎回基金份额时的基金份额净值，将会根据投资组合的市场冲击成本而进行调整，使得市场的冲击成本能够分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待

对于各类流动性风险管理工具的使用，基金管理人将依照严格审批、审慎决策的原则，及时有效地对风险进行监测和评估，使用前经过内部审批程序并与基金托管人协商一致。在实际运用各类流动性风险管理工具时，投资者的赎回申请、赎回款项支付等可能受到相应影响，基金管理人将严格依照法律法规及基金合同的约定进行操作，全面保障投资者的合法权益。

#### 4、操作风险

操作风险是指基金运作过程中，因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险，例如，越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误、IT 系统故障等风险。

#### 5、管理风险

在基金管理运作过程中，基金管理人的研究水平、投资管理水平直接影响基金收益水平，如果基金管理人经济形势和证券市场判断不准确、获取的信息不充分、投资操作出现失误等，都会影响基金的收益水平。

#### 6、合规风险

合规风险指基金管理或运作过程中，违反国家法律、法规的规定，或者违反《基金合同》有关规定的风险。

#### 7、本基金的特有风险

本基金为纯债债券型基金，债券的投资比例不低于基金资产的 80%，该类债券的特定风险即成为本基金及投资者主要面对的特定投资风险。债券的投资收益会受到宏观经济、政府产业政策、货币政策、市场需求变化、行业波动等因素的影响，可能存在所选投资标的的成长性与市场一致预期不符而造成个券价格表现低于预期的风险。

本基金投资资产支持证券，资产支持证券（ABS）是一种债券性质的金融工具，其向投资者支付的本息来自于基础资产池产生的现金流或剩余权益。与股票和一般债券不同，资产支持证券不是对某一经营实体的利益要求权，而是对基础资产池所产生的现金流和剩余权益的要求权，是一种以资产信用为支持的证券，所面临的风险主要包括交易结构风险、各种原因导致的基础资产池现金流与对应证券现金流不匹配产生的信用风险、市场交易不活跃导致的流动性风险等。

## 二、声明

1、投资者投资于本基金，须自行承担投资风险；

2、除基金管理人直接办理本基金的销售外，本基金还通过基金销售机构代理销售，基金管理人与基金销售机构都不能保证其收益或本金安全。

## 第十七部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### 一、《基金合同》的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于法律法规规定和基金合同约定可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，自决议生效后按规定在指定媒介公告。

### 二、《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在6个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- 3、《基金合同》约定的其他情形；
- 4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### 三、基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现基金合同终止事由之日起30个工作日内成立基金财产清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

2、在基金财产清算小组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照《基金合同》和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

3、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券、期货相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

4、基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

#### 5、基金财产清算程序：

- (1) 《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金财产；
- (2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；



- (3) 对基金财产进行估值和变现；
- (4) 制作清算报告；
- (5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- (6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；
- (7) 对基金剩余财产进行分配。

6、基金财产清算的期限为 6 个月，但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的，清算期限可相应顺延。

#### **四、清算费用**

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金剩余财产中支付。

#### **五、基金财产清算剩余资产的分配**

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

#### **六、基金财产清算的公告**

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告，基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

#### **七、基金财产清算账册及文件的保存**

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 第十八部分 基金合同的内容摘要

### 一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

#### (一) 基金管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

- (1) 依法募集资金；
- (2) 自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
- (3) 依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- (4) 销售基金份额；
- (5) 按照规定召集基金份额持有人大会；
- (6) 依据《基金合同》及有关法律、法规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律、法规规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- (7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- (8) 选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；
- (9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；
- (10) 依据《基金合同》及有关法律、法规规定决定基金收益的分配方案；
- (11) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购、赎回与转换申请；
- (12) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使相关权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- (13) 以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- (14) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券、期货经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；
- (15) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、定期定额投资和非交易过户等业务规则；

- (16) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。
- 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：
- (1) 依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
- (2) 办理基金备案手续；
- (3) 自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；
- (4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；
- (5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；
- (6) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；
- (7) 依法接受基金托管人的监督；
- (8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回的价格；
- (9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- (10) 编制季度报告、中期报告和年度报告；
- (11) 严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
- (12) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；
- (13) 按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；
- (14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
- (15) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
- (16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上；

(17) 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间内发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件；

(18) 组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

(19) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

(20) 因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(21) 监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

(22) 当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；

(23) 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；

(24) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后30日内退还基金认购人；

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(26) 建立并保存基金份额持有人名册；

(27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## (二) 基金托管人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：

(1) 自《基金合同》生效之日起，依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产；

(2) 依《基金合同》约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用；

(3) 监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人违反《基金合同》及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

(4) 根据相关市场规则，为基金开设资金账户、证券账户等投资所需账户，为基金办理证券、期货交易资金清算；

(5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

(6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

(2) 设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；

(3) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

(4) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；

(5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

(6) 按规定开设基金财产的资金账户、证券账户等投资所需账户，按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

(7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；

(8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购、赎回价格；

(9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

(10) 对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行；如果基金管理人未执行《基金合同》规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

- (11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；
- (12) 保存基金份额持有人名册；
- (13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
- (14) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；
- (15) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
- (16) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；
- (17) 参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- (18) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人；
- (19) 因违反《基金合同》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- (20) 按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿；
- (21) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- (22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

### (三) 基金份额持有人的权利、义务

基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受，基金投资者自依据《基金合同》取得基金份额，即成为本基金份额持有人和《基金合同》的当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为《基金合同》当事人并不以在《基金合同》上书面签章或签字为必要条件。

同一类别每份基金份额具有同等的合法权益。

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：

- (1) 分享基金财产收益；
- (2) 参与分配清算后的剩余基金财产；
- (3) 依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；
- (4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会；

(5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；

(6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；

(7) 监督基金管理人的投资运作；

(8) 对基金管理人、基金托管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；

(9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：

(1) 认真阅读并遵守《基金合同》、招募说明书等信息披露文件；

(2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；

(3) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；

(4) 交纳基金认购、申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；

(5) 在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；

(6) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；

(7) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；

(9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## 二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的同一类别每一基金份额拥有平等的投票权。

本基金份额持有人大会不设日常机构。

### (一)、召开事由

1、除法律法规和中国证监会另有规定外，当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

(1) 终止《基金合同》；

(2) 更换基金管理人；



- (3) 更换基金托管人；
  - (4) 转换基金运作方式；
  - (5) 调整基金管理人、基金托管人的报酬标准或提高销售服务费率；
  - (6) 变更基金类别；
  - (7) 本基金与其他基金的合并；
  - (8) 变更基金投资目标、范围或策略；
  - (9) 变更基金份额持有人大会程序；
  - (10) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
  - (11) 单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；
  - (12) 对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；
  - (13) 法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。
- 2、在法律法规规定和《基金合同》约定的范围内且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：
- (1) 法律法规要求增加的基金费用的收取；
  - (2) 调低销售服务费；
  - (3) 调整本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式，调整基金份额类别设置、对基金份额分类办法及规则进行调整；
  - (4) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；
  - (5) 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生重大变化；
  - (6) 基金管理人、登记机构、基金销售机构调整有关认购、申购、赎回、转换、基金交易、非交易过户、转托管等业务规则；
  - (7) 履行相关程序后，基金推出新业务或服务；
  - (8) 按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。
- (二)、会议召集人及召集方式

1、除法律法规规定或《基金合同》另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。

3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集，并自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

4、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

5、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

6、基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

（三）、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 30 日，在指定媒介公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

- （1）会议召开的时间、地点和会议形式；
- （2）会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；
- （3）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；

(4) 授权委托书证明的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；

(5) 会务常设联系人姓名及联系电话；

(6) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；

(7) 召集人需要通知的其他事项。

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、表决意见寄交的截止时间和收取方式。

3、如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。

#### (四)、基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式或法律法规、监管机构允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托书委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或基金托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

(1) 亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托书符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；

(2) 经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）。若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效的基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之一（含三分之一）。

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式或大会公告载明的其他方式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式或大会公告载明的其他方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

(1) 会议召集人按《基金合同》约定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告；

(2) 召集人按基金合同约定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取表决意见的，不影响表决效力；

(3) 本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）；若本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）基金份额的持有人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见；

(4) 上述第（3）项中直接出具表决意见的基金份额持有人或受托代表他人出具表决意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具表决意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并与基金登记机构记录相符。

3、在法律法规和监管机关允许的情况下，本基金的基金份额持有人亦可采用其他非书面方式授权其代理人出席基金份额持有人大会，授权方式可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明；在会议召开方式上，本基金亦可采用其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开基金份额持有人大会，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。基金份额持有人可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式进行表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

(五)、议事内容与程序

1、议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如《基金合同》的重大修改、决定终止《基金合同》、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及《基金合同》规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开前及时公告。

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

## 2、议事程序

### (1) 现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名（或单位名称）、身份证明文件号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）和联系方式等事项。

### (2) 通讯开会

在通讯开会的情况下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后 2 个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

## (六)、表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1、一般决议，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过方为有效；除下列第 2 项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》、本基金与其他基金合并以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时监督员及公证机关均认为有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

#### （七）、计票

##### 1、现场开会

（1）如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

（2）监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。

（3）如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有怀疑，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

（4）计票过程应由公证机关予以公证，基金管理人或基金托管人拒不出席大会的，不影响计票的效力。

##### 2、通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关



对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

#### （八）、生效与公告

基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起按规定在指定媒介上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决议。生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。

（九）、本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

### 三、基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

#### （一）、《基金合同》的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于法律法规规定和基金合同约定可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，自决议生效后按规定在指定媒介公告。

#### （二）、《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- 3、《基金合同》约定的其他情形；



4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### （三）、基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现基金合同终止事由之日起 30 个工作日内成立基金财产清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

2、在基金财产清算小组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照《基金合同》和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

3、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券、期货相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

4、基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

### 5、基金财产清算程序：

- （1）《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金财产；
- （2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- （3）对基金财产进行估值和变现；
- （4）制作清算报告；
- （5）聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- （6）将清算报告报中国证监会备案并公告；
- （7）对基金剩余财产进行分配。

6、基金财产清算的期限为 6 个月，但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的，清算期限可相应顺延。

### （四）、清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金剩余财产中支付。

### （五）、基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

### （六）、基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告，基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

#### （七）、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

#### 四、争议的处理和适用的法律

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均有权将争议提交深圳国际仲裁院（深圳仲裁委员会），按照深圳国际仲裁院（深圳仲裁委员会）届时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点在深圳市，仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力。除非仲裁裁决另有规定，仲裁费用、律师费用由败诉方承担。

争议处理期间，基金管理人、基金托管人应恪守基金管理人和基金托管人职责，各自继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

《基金合同》受中国法律（为基金合同之目的，在此不包括香港、澳门特别行政区和台湾地区法律）管辖，并按其解释。

#### 五、基金合同存放地和投资人取得基金合同的方式

《基金合同》可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅。

## 第十九部分 基金托管协议的内容摘要

### 一、托管协议当事人

#### （一）基金管理人

名称：博时基金管理有限公司

注册地址：深圳市福田区莲花街道福新社区益田路 5999 号基金大厦 21 层

办公地址：深圳市福田区莲花街道福新社区益田路 5999 号基金大厦 21 层

邮政编码：518040

法定代表人：江向阳

成立日期：1998 年 7 月 13 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字【1998】26 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：2.5 亿元人民币

存续期间：持续经营

经营范围：基金募集；基金销售；资产管理以及中国证监会许可的其它业务。

#### （二）基金托管人

名称：中国民生银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

邮政编码：100031

法定代表人：洪崎

成立日期：1996 年 2 月 7 日

基金托管业务批准文号：证监基金字[2004]101 号

组织形式：其他股份有限公司（上市）

注册资本：28,365,585,227 元人民币

存续期间：持续经营

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现、发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事结汇、售汇业务；从事银行卡业务；提供信用证

服务及担保；代收付款项；保险兼业代理业务（有效期至 2020 年 02 月 18 日）；提供保管箱服务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。

## 二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

（一）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种池，以便基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。

本基金的投资范围主要包括债券（国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资债券、公开发行的次级债、可分离交易可转债的纯债部分、政府机构支持债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、信用衍生品、国债期货等法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金不投资于股票、权证等权益类资产，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。

基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产比例不低于基金资产的 80%；本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。

（二）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资、融券比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督：

基金的投资组合应遵循以下限制：

- （1）本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%；
- （2）本基金每个交易日日终扣除国债期货需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；
- （3）本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；

(4) 本基金管理人管理且于托管人托管的全部基金持有一家发行的证券，不超过该证券的 10%；

(5) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

(6) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；

(7) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

(8) 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；

(9) 本基金管理人管理且于托管人托管的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

(10) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

(11) 本基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

(12) 本基金参与国债期货交易，需遵守下列投资比例限制：

1) 本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的 15%；

2) 本基金在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%；

3) 本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 30%；

4) 本基金所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定；

(13) 本基金不持有具有信用保护卖方属性的信用衍生品，不持有合约类信用衍生品，本基金持有的信用衍生品名义本金不得超过本基金中所对应受保护债券面值的 100%；

(14) 本基金投资于同一信用保护卖方各类信用衍生品名义本金合计不得超过基金资产净值的 10%；

(15) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的 15%；因证券市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(16) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

(17) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述(2)、(10)、(15)、(16)项外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但法律法规或中国证监会规定的特殊情形除外。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或调整上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按调整后的规定执行，但须提前公告。

(三) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对本托管协议第十五条第九款基金投资禁止行为进行监督。基金托管人通过事后监督方式对基金管理人基金投资禁止行为进行监督。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

法律、行政法规或监管部门取消或变更上述禁止性规定，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按变更后的规定执行。

(四) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供符合法律法规及



行业标准的、经慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手名单，并约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金管理人应严格按照交易对手名单的范围在银行间债券市场选择交易对手。基金托管人监督基金管理人是否按事前提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易。基金管理人可以每半年对银行间债券市场交易对手名单及结算方式进行更新，新名单确定前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。如基金管理人根据市场情况需要临时调整银行间债券市场交易对手名单及结算方式的，应及时向基金托管人说明理由，协商解决。

基金管理人负责对交易对手的资信控制，按银行间债券市场的交易规则进行交易，并负责解决因交易对手不履行合同而造成的纠纷及损失，基金托管人不承担由此造成的任何法律责任及损失。若未履约的交易对手在基金托管人与基金管理人确定的时间前仍未承担违约责任及其他相关法律责任的，基金管理人可以对相应损失先行予以承担，然后再向相关交易对手追偿。基金托管人则根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督。如基金托管人事后发现基金管理人没有按照事先约定的交易对手或交易方式进行交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人，基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任。

(五) 基金管理人应当对投资中期票据业务进行研究，认真评估中期票据投资业务的风险，本着审慎、勤勉尽责的原则进行中期票据的投资业务。基金管理人根据法律、法规、监管部门的规定，制定了经公司董事会批准的基金投资中期票据相关制度(以下简称“《制度》”)，以规范对中期票据的投资决策流程、风险控制。基金管理人《制度》的内容与本协议不一致的，以本协议的约定为准

1. 基金投资中期票据应遵循以下投资限制：

(1) 中期票据属于固定收益类证券，基金投资中期票据应符合法律、法规及《基金合同》中关于该基金投资固定收益类证券的相关比例及期限限制；

(2) 基金管理人管理的全部公募基金投资于一家企业发行的单期中期票据合计不超过该期证券的 10%。

2. 基金托管人对基金管理人流动性风险处置的监督职责限于：

基金托管人对基金投资中期票据是否符合比例限制进行事后监督，如发现异常情况，应及时以书面形式通知基金管理人。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人接到通知后应及时核对并向基金托管人说明原因和解决措施。基金托管人有权随



时对所通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

3. 如因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素，基金管理人投资的中期票据超过投资比例的，基金托管人有权要求基金管理人在 10 个工作日内将中期票据调整至规定的比例要求，但法律法规或中国证监会规定的特殊情形除外。

(六) 基金如投资银行存款，基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资银行存款的交易对手范围是否符合有关规定进行监督；基金管理人在签署银行存款协议前，应将草拟的银行存款协议送基金托管人审核。

(七) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金资产净值计算、各类基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查。

(八) 基金托管人发现基金管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作违反法律法规、基金合同和本托管协议的规定，应及时以电话提醒或书面提示等方式通知基金管理人限期纠正，并及时向中国证监会报告。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到书面通知后应在下一工作日及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函，就基金托管人的疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

(九) 基金管理人应积极配合和协助基金托管人依照法律法规、基金合同和本托管协议对基金业务执行核查。对基金托管人发出的书面提示，基金管理人应在规定时间内答复并改正，或就基金托管人的疑义进行解释或举证；对基金托管人按照法律法规、基金合同和本托管协议的要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

(十) 若基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当立即通知基金管理人，由此造成的损失由基金管理人承担，并及时向中国证监会报告。

(十一) 基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。基金管理人无正当理由，拒绝、阻

绕对方根据本托管协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的，基金托管人应报告中国证监会。

### 三、基金管理人

（一）基金管理人

（二）基金管理人

（三）基金管理人

### 四、基金财产的保管

#### （一）基金财产保管的原则

1. 基金财产

2. 基金管理人、基金托管人

3. 基金托管人应安全保管基金财产。未经基金管理人依据合法程序作出的合法合规指令，基金托管人不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

4. 基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户等投资所需账户。

5. 基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，独立核算，分账管理，确保基金财产的完整与独立。

6. 基金托管人根据基金管理人的指令，按照基金合同和本协议的约定保管基金财产，如有特殊情况双方可另行协商解决。

7. 对于因为基金投资产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金账户的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金财产造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金财产的损失，基金托管人对此不承担任何责任。

8. 除依据法律法规和基金合同的规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

#### （二）基金募集期间及募集资金的验资

1. 基金募集期间应开立“基金募集专户”，用于存放募集的资金。该账户由基金管理人开立。

2. 基金募集期满或基金停止募集时，基金募集金额、基金认购人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，基金管理人应将属于基金财产的全部资金划入基金托管人为本基金开立的基金银行账户，同时在规定时间内，聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的 2 名或 2 名以上中国注册会计师签字并加盖会计师事务所公章方为有效。

3. 若基金募集期限届满或基金停止募集时，未能达到基金合同生效的条件，由基金管理人按规定办理退款等事宜，基金托管人应提供充分协助。

#### （三）基金银行账户的开立和管理

1. 基金托管人应负责本基金的银行账户的开设和管理。

2. 基金托管人应以本基金名义在其营业机构开立基金的银行账户，并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。

3. 基金银行账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立任何其他银行账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

4. 基金银行账户的开立和管理应符合银行业监督管理机构的有关规定。

5. 在符合法律法规规定的条件下，基金托管人可以通过基金托管人专用账户办理基金资产的支付。

#### （四）基金证券账户和结算备付金账户的开立和管理

1. 基金托管人在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司为本基金开立基金托管人与本基金联名的证券账户。

2. 基金证券账户的开立和使用，仅限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借或未经对方书面同意擅自转让基金的任何证券账户，亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

3. 基金证券账户的开立由基金托管人负责，账户资产的管理和运用由基金管理人负责。

4. 基金托管人以自身法人名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户，并代表所托管的基金完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级法人清算工作，基金管理人应予以积极协助。结算备付金、证券结算保证金等的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

5. 若中国证监会或其他监管机构在本托管协议订立日之后允许基金从事其他投资品种的投资业务，涉及相关账户的开立、使用的，若无相关规定，则基金托管人比照上述关于账户开立、使用的规定执行。

#### （五）债券托管账户的开设和管理

基金合同生效后，基金托管人根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司的有关规定，在中央国债登记结算有限责任公司、银行间市场清算所股份有限公司开立债券托管账户，并代表基金进行银行间市场债券的结算。基金管理人和基金托管人共同代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议。

#### （六）其他账户的开立和管理

1. 因业务发展需要而开立的其他账户，可以根据法律法规和基金合同的规定开立，在基金管理人和基金托管人商议后由基金托管人负责开立。新账户按有关规定使用并管理。

2. 法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

### （七）基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的有关实物证券、银行存款开户证实书等有价凭证由基金托管人存放于基金托管人的保管库，也可存入中央国债登记结算有限责任公司、中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司、银行间市场清算所股份有限公司或票据营业中心的代保管库，保管凭证由基金托管人持有。实物证券、银行存款开户证实书等有价凭证的购买和转让，由基金管理人和基金托管人共同办理。基金托管人对由基金托管人及基金托管人委托保管的机构以外机构实际有效控制的证券不承担保管责任，但基金托管人应妥善保管保管凭证。

### （八）与基金财产有关的重大合同的保管

与基金财产有关的重大合同的签署，由基金管理人负责。由基金管理人代表基金签署的、与基金财产有关的重大合同的原件分别由基金管理人、基金托管人保管。除本协议另有规定外，基金管理人代表基金签署的与基金财产有关的重大合同包括但不限于基金年度审计合同、基金信息披露协议及基金投资业务中产生的重大合同，基金管理人应保证基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。重大合同的保管期限为基金合同终止后 15 年。

对于无法取得二份以上的正本的，基金管理人应向基金托管人提供加盖授权业务章的合同传真件，未经双方协商或未在合同约定范围内，合同原件不得转移。

## 五、基金资产净值计算和会计核算

### （一）基金资产净值的计算、复核与完成的时间及程序

#### 1. 基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日该类基金份额的余额数量计算，精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入。基金管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。特殊情况下，基金管理人可提高基金份额净值计算的精度（即提高净值计算结果小数点后保留的位数），以维护基金投资人利益。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人应每个工作日计算基金资产净值及各类基金份额净值，并按规定进行公告。

#### 2. 复核程序

基金管理人每个工作日对基金资产进行估值后，将各类基金份额净值结果以双方约定的方式提交给基金托管人，经基金托管人复核无误后，以约定的方式将复核结果提交给基金管

理人，由基金管理人依据基金合同和有关法律法规对外公布。（二）基金资产估值方法和特殊情形的处理

#### 1. 估值对象

基金所拥有的债券、国债期货合约、信用衍生品和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

#### 2. 估值方法

##### （1）、证券交易所上市的有价证券的估值

1) 交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（基金合同另有规定的除外），选取估值日第三方估值机构提供的相应品种对应的估值净价估值，具体估值机构由基金管理人与基金托管人另行协商约定；

2) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

（2）、首次公开发行未上市的债券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

（3）、同业存单、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

（4）、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

（5）、信用衍生品按第三方估值机构提供的当日估值价格进行估值，但管理人依法应当承担的估值责任不因委托而免除，选定的第三方估值机构未提供估值价格的，依照有关法律法规及企业会计准则要求采用合理估值技术，确定公允价值。

（6）、基金投资的国债期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

（7）、当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律组织的规定。

（8）、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。



(9)、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对于基金净值的计算结果对外予以公布。

### 3. 特殊情形的处理

基金管理人或基金托管人按估值方法的第(8)项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

由于不可抗力原因，或由于证券、期货交易所及登记结算公司等第三方机构发送的数据错误等原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任，但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

#### (三) 基金份额净值错误的处理方式

1. 当任一类基金份额净值小数点后4位以内(含第4位)发生估值错误时，视为该类基金份额净值错误；基金份额净值计算出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；错误偏差达到该类基金份额净值的0.25%时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到该类基金份额净值的0.50%时，基金管理人应当公告，并报中国证监会备案。

当基金份额净值计算差错给基金和基金份额持有人造成损失需要进行赔偿时，基金管理人和基金托管人应根据实际情况界定双方承担的责任，经确认后按以下条款进行赔偿：

①本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，与本基金有关的会计问题，如经双方在平等基础上充分讨论后，尚不能达成一致时，按基金管理人的建议执行，由此给基金份额持有人和基金财产造成的损失，由基金管理人负责赔付。



②若基金管理人计算的基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告，由此给基金份额持有人造成损失的，应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金，就实际向投资者或基金支付的赔偿金额，基金管理人与基金托管人按照过错程度各自承担相应的责任。

③如基金管理人和基金托管人对基金份额净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对，尚不能达成一致时，为避免不能按时公布基金份额净值的情形，以基金管理人的计算结果对外公布，由此给基金份额持有人和基金造成的损失，由基金管理人负责赔付。

④由于基金管理人提供的信息错误（包括但不限于基金申购或赎回金额等），进而导致基金份额净值计算错误而引起的基金份额持有人和基金财产的损失，由基金管理人负责赔付。

（4）前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。如果行业另有通行做法，基金管理人和基金托管人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商。

2. 基金管理人和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差，以基金管理人计算结果为准。

3. 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。如果行业另有通行做法，基金管理人和基金托管人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商。

#### （四）暂停估值的情形

- 1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；
- 3、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停估值；
- 4、法律法规规定、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

#### （五）基金会计制度

按国家有关部门规定的会计制度执行。

#### （六）基金账册的建立

基金管理人进行基金会计核算并编制基金财务会计报告。基金管理人、基金托管人分别独立地设置、记录和保管本基金的全套账册。基金托管人按规定制作相关账册并与基金管理人核对。若基金管理人和基金托管人对会计处理方法存在分歧，应以基金管理人的处理方法为准。若当日核对不符，暂时无法查找到错账的原因而影响基金资产净值的计算和公告的，以基金管理人的账册为准。

### （七）基金财务报表与报告的编制和复核

#### 1. 财务报表的编制

基金财务报表由基金管理人编制，基金托管人复核。

#### 2. 报表复核

基金托管人在收到基金管理人编制的基金财务报表后，进行独立的复核。核对不符时，应及时通知基金管理人共同查出原因，进行调整，直至双方数据完全一致。

#### 3. 财务报表的编制与复核时间安排

##### 1) 报表的编制

基金管理人应当在每月结束后 5 个工作日内完成月度报表的编制；在季度结束之日起 15 个工作日内完成基金季度报告的编制；在上半年结束之日起两个月内完成基金中期报告的编制；在每年结束之日起三个月内完成基金年度报告的编制。基金年度报告中的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计。基金合同生效不足两个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。

##### 2) 报表的复核

基金管理人应及时完成报表编制，将有关报表提供基金托管人复核；基金托管人在复核过程中，发现双方的报表存在不符时，基金管理人和基金托管人应共同查明原因，进行调整，调整以国家有关规定为准。

基金管理人应留足充分的时间，便于基金托管人复核相关报表及报告。

（八）基金管理人应在编制季度报告、中期报告或者年度报告之前及时向基金托管人提供基金业绩比较基准的基础数据和编制结果。

### 六、基金份额持有人名册的保管

基金份额持有人名册至少应包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。基金份额持有人名册由基金登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，保存期自基金账户销户之日起不少于 20 年，基金管理人和基金托管人应分别保管基金份额持有人名册，保存期不少于 15 年，法律法规另有规定或有权机关另有要求的除外。如不能妥善保管，则按相关法规承担责任。

在基金托管人要求或编制中期报告和年度报告前，基金管理人应将有关资料送交基金托管人，不得无故拒绝或延误提供，并保证其的真实性、准确性和完整性。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。

## 七、基金托管协议的变更、终止与基金财产的清算

### （一）本托管协议的变更程序

本托管协议双方当事人经协商一致，可以对本托管协议进行修改。修改后的新托管协议，其内容不得与基金合同的规定有任何冲突。基金托管协议的变更报中国证监会备案。

### （二）基金托管协议终止出现的情形

1. 基金合同终止；
2. 基金托管人解散、依法被撤销、破产或由其他基金托管人接管基金资产；
3. 基金管理人解散、依法被撤销、破产或由其他基金管理人接管基金管理权；
4. 发生法律法规、中国证监会或基金合同规定的终止事项。

### （三）基金财产的清算

#### 1. 基金财产清算小组

1) 自出现基金合同终止事由之日起 30 个工作日内成立基金财产清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

2) 在基金财产清算小组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照《基金合同》和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

3) 基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券、期货相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

4) 基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

#### 2. 基金财产清算程序

- 1) 《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金财产；
- 2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- 3) 对基金财产进行估值和变现；
- 4) 制作清算报告；
- 5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- 6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；
- 7) 对基金剩余财产进行分配。

基金财产清算的期限为 6 个月，但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的，清算期限可相应顺延。

### 3. 清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金剩余财产中支付。

### 4. 基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

### 5. 基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告，基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

### 6. 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 八、争议解决方式

因本托管协议产生或与之相关的争议，双方当事人应通过协商、调解解决，如不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均有权将争议提交深圳国际仲裁院(深圳仲裁委员会)，按照深圳国际仲裁院(深圳仲裁委员会)届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为深圳市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力。除非仲裁裁决另有规定，仲裁费用、律师费用由败诉方承担。

争议处理期间，本托管协议双方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责，各自继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和本托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本协议受中国法律（为本协议之目的，在此不包括香港、澳门特别行政区和台湾地区法律）管辖，并按其解释。

## 第二十章 对基金份额持有人的服务

对本基金份额持有人的服务主要由基金管理人、基金销售机构提供。基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务，根据基金份额持有人的需要和市场的变化，有权增加或变更服务项目，主要服务内容如下：

### 一、基金份额持有人交易资料的寄送服务

#### 1、交易确认单

基金合同生效后正常开放期，每次交易结束后，投资者可在 T+2 个工作日后通过销售机构的网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询和打印交易确认单，或在 T+1 个工作日后通过博时一线通电话、博时网站查询交易确认情况。基金管理人向投资者寄电子对账单

每月结束后，基金管理人向所有订阅电子邮件对账单的投资者发送电子邮件对账单。

投资者可以登录基金管理人网站（<http://www.bosera.com>）自助订阅；或发送“订阅电子对账单”邮件到客服邮箱 [service@bosera.com](mailto:service@bosera.com)；也可直接拨打博时一线通 95105568（免长途话费）订阅。

2、由于投资者提供的电子邮箱不详、错误、未及时变更或通讯故障、延误等原因有可能造成对账单无法按时或准确送达。因上述原因无法正常收取对账单的投资者，敬请及时通过本基金管理人网站，或拨打博时一线通客服电话查询、核对、变更您的预留联系方式。

### 二、网上理财服务

通过基金管理人网站，投资者可获得如下服务：

#### 1、自助开户交易

投资者可登录基金管理人网站网上交易系统，与基金管理人达成电子交易的相关协议，接受基金管理人有关服务条款并办理相关手续后，即可自助开户并进行网上交易，如基金认/申购、定投、转换、赎回、赎回转申购及分红方式变更等。具体业务办理情况及业务规则请登录基金管理人网站查询。

#### 2、查询服务

投资者可以通过基金管理人网站查询所持有基金的基金份额、交易记录等信息，同时可以修改基金账户信息等基本资料。

#### 3、信息资讯服务

投资者可以利用基金管理人网站获取基金和基金管理人各类信息，包括基金法律文件、基金管理人最新动态、热点问题等。

#### 4、在线客服

投资者可以通过基金管理人网站首页“在线客服”功能进行在线咨询。也可以在“您问我答”栏目中，直接提出有关本基金的问题和建议。

### 三、短信服务

基金管理人向订制短信服务的基金份额持有人提供相应短信服务。

### 四、电子邮件服务

基金管理人为投资者提供电子邮件方式的业务咨询、投诉受理、基金份额净值等服务。

### 五、手机理财服务

投资者通过手机博时移动版直销网上交易系统（<http://m.bosera.com>）和博时 App 版直销网上交易系统，可以使用基金理财所需的基金交易、理财查询、账户管理、信息资讯等功能和服务。

### 六、信息订阅服务

投资者可以通过基金管理人网站、客服中心提交信息订制的申请，基金管理人将以电子邮件、手机短信的形式定期为投资者发送所订制的信息。

### 七、电话理财服务

投资者拨打博时一线通：95105568（免长途话费）可享有投资理财交易的一站式综合服务：

1、自助语音服务：基金管理人自助语音系统提供 7×24 小时的全天候服务，投资者可以自助查询账户余额、交易情况、基金净值等信息，也可以进行直销交易、密码修改、传真索取等操作。

2、电话交易服务：基金管理人直销投资者可通过博时一线通电话交易平台在线办理基金的赎回、变更分红方式、撤单等直销交易业务。

3、人工电话服务：投资者可以获得业务咨询、信息查询、资料修改、投诉受理、信息订制、账户诊断等服务。

4、电话留言服务：非人工服务时间或线路繁忙时，投资者可进行电话留言。

### 八、基金管理人联系方式

网址：[www.bosera.com](http://www.bosera.com)

电子信箱: [service@bosera.com](mailto:service@bosera.com)

博时一线通客服电话: 95105568 (免长途话费)

九、如本招募说明书存在任何您/贵机构无法理解的内容, 请通过上述方式联系基金管理人。请确保投资前, 您/贵机构已经全面理解了本招募说明书。



## 第二十一部分 其他应披露的事项

（一）、 2020年11月03日，我公司公告了《博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的债券调整估值的公告 20201103》；

（二）、 2020年10月28日，我公司公告了《博时季季乐三个月持有期债券型证券投资基金 2020年第3季度报告》；

（三）、 2020年10月16日，我公司公告了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》；

（四）、 2020年10月12日，我公司公告了《博时基金管理有限公司关于直销网上交易开通中信银行快捷开户和支付服务及费率优惠的公告》；

（五）、 2020年09月25日，我公司公告了《博时基金管理有限公司关于对投资者在直销网上交易申购、认购及定投基金实施费率优惠的公告》；

（六）、 2020年09月01日，我公司公告了《博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的债券调整估值的公告 20200901》；

（七）、 2020年08月27日，我公司公告了《博时季季乐三个月持有期债券型证券投资基金（博时季季乐持有期债券 A）基金产品资料概要更新》、《博时季季乐三个月持有期债券型证券投资基金（博时季季乐持有期债券 C）基金产品资料概要更新》；

（八）、 2020年08月05日，我公司公告了《博时基金管理有限公司关于暂停使用通联支付提供的中信银行、中国银行快捷支付通道办理直销网上交易部分业务的公告》；

（九）、 2020年07月23日，我公司公告了《博时基金管理有限公司关于暂停使用中国农业银行非快捷支付服务办理直销网上交易部分业务的公告》；

（十）、 2020年07月09日，我公司公告了《博时基金管理有限公司关于暂停使用上海银联提供的光大银行通道办理直销网上交易部分业务的公告》；

（十一）、 2020年06月29日，我公司公告了《博时基金管理有限公司关于暂停使用中国银行理财直付服务办理直销网上交易部分业务的公告》、《博时基金管理有限公司关于对投资者在直销网上交易申购、认购及定投基金实施费率优惠的公告》；

（十二）、 2020年06月18日，我公司公告了《博时季季乐三个月持有期债券型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告》；

(十三)、 2020年06月01日，我公司公告了《关于博时旗下部分基金参加招商银行申购及定投业务费率优惠活动的公告》；

(十四)、 2020年05月28日，我公司公告了《博时基金管理有限公司关于博时季季乐三个月持有期债券型证券投资基金C类基金份额销售费率优惠的公告》、《博时季季乐三个月持有期债券型证券投资基金基金合同生效公告》；

(十五)、 2020年04月28日，我公司公告了《关于博时季季乐三个月持有期债券型证券投资基金首次募集规模上限的公告》；

(十六)、 2020年04月18日，我公司公告了《博时季季乐三个月持有期债券型证券投资基金招募说明书》、《博时季季乐三个月持有期债券型证券投资基金托管协议》、《博时季季乐三个月持有期债券型证券投资基金基金合同》、《博时季季乐三个月持有期债券型证券投资基金基金份额发售公告》；

(十七)、 2020年04月17日，我公司公告了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。

## 第二十二部分 招募说明书存放及查阅方式

招募说明书公布后，应当分别置备于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的住所，投资人可在办公时间查阅；投资人在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。对投资人按此种方式所获得的文件及其复印件，基金管理人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

投资人还可以直接登录基金管理人的网站（[www.bosera.com](http://www.bosera.com)）查阅和下载招募说明书。

## 第二十三部分 备查文件

以下备查文件存放在基金管理人的办公场所，在办公时间可供免费查阅。

- (一) 中国证监会准予博时季季乐三个月持有期债券型证券投资基金募集的文件
- (二) 《博时季季乐三个月持有期债券型证券投资基金基金合同》
- (三) 《博时季季乐三个月持有期债券型证券投资基金托管协议》
- (四) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (五) 基金托管人业务资格批件、营业执照
- (六) 关于申请募集博时季季乐三个月持有期债券型证券投资基金的法律意见
- (七) 中国证监会要求的其他文件

查阅方式：投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

博时基金管理有限公司

2021年4月30日