

**华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金  
更新的招募说明书  
2025年第2号  
(基金合同和托管协议变更)**

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

二〇二五年十二月

## 华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金招募说明书（更新）

### 重要提示

华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）由友邦华泰中短期债券投资基金转型而成。依据中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）2007年11月28日证监基金字[2007]323号文（《关于核准友邦华泰中短期债券投资基金基金份额持有人大会有关变更基金类别决议的批复》）核准的友邦华泰中短期债券投资基金基金份额持有人大会决议，友邦华泰中短期债券投资基金调整投资目标、范围和策略、修订基金合同，并更名为“友邦华泰金字塔稳本增利债券型证券投资基金”。自2007年12月3日起，由《友邦华泰中短期债券投资基金基金合同》修订而成的《友邦华泰金字塔稳本增利债券型证券投资基金基金合同》生效。

本基金名称自2010年4月30日起，由“友邦华泰金字塔稳本增利债券型证券投资基金”更名为“华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金”，基金简称为“华泰柏瑞稳本增利债券”，基金代码保持不变。本基金、基金管理人更名等的详细内容见我公司2010年4月30日刊登在中国证券报、上海证券报、证券时报的《友邦华泰基金管理有限公司关于股东更名、公司更名及旗下基金更名的公告》。

自2019年1月11日起至2019年2月11日本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，会议审议通过了《关于华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金调整管理费率和托管费率等有关事项的议案》，内容包括降低本基金的管理费率和托管费率。上述基金份额持有人大会决议事项自表决通过之日起生效。自2019年2月13日起，由原《基金合同》修订而成的《华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金基金合同》生效，原《基金合同》失效。

华泰柏瑞基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”或“管理人”或“本公司”）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核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

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，充分考虑自身的风险承受能力，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、由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险、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。

当本基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，基金管理人履行相应程序后，可以启用侧袋机制，具体详见本招募说明书“侧袋机制”章节。侧袋机制实施期间，基金管理人将对基金简称进行特殊标识，并不办理侧袋账户的申购赎回。请基金份额持有人仔细阅读相关内容并关注本基金启用侧袋机制时的特定风险。

本基金的投资范围包括存托凭证。存托凭证是新证券品种，本基金投资存托凭证在承担境内上市交易股票投资的共同风险外，还将承担与存托凭证、创新企业发行、境外发行人以及交易机制相关的特有风险。

投资有风险，投资人申购本基金时应认真阅读本基金的招募说明书、基金合同及基金产品资料概要。基金管理人建议投资人根据自身的风险收益偏好，选择适合自己的基金产品，并且中长期持有。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本次招募说明书更新主要涉及 C 类份额调低销售服务费率，并已对相应内容做出了更新，基金管理人相关信息截止日为 2025 年 12 月 18 日。除非另有说明，本更新招募说明书所载其余内容截止日为 2025 年 06 月 27 日，有关财务和业绩表现数据截止日为 2025 年 03 月 31 日，财务和业绩表现数据未经审计。

## 目录

一、绪言.....	5
二、释义.....	6
三、基金管理人.....	11
四、基金托管人.....	19
五、相关服务机构.....	25
六、基金的历史沿革.....	27
七、基金的存续.....	28
八、基金份额的申购与赎回.....	29
九、基金的非交易过户、转托管、冻结、质押及其他业务.....	39
十、基金的投资.....	40
十一、基金的业绩.....	50
十二、基金的财产.....	53
十三、基金财产的估值.....	54
十四、基金的收益与分配.....	59
十五、基金的费用与税收.....	61
十六、基金的会计与审计.....	65
十七、基金的信息披露.....	66
十八、侧袋机制.....	71
十九、基金的风险揭示.....	73
二十、终止与基金财产的清算.....	76
二十一、基金合同的内容摘要.....	78
二十二、基金托管协议的内容摘要.....	90
二十三、对基金份额持有人的服务.....	101
二十四、其他应披露事项.....	103
二十五、招募说明书存放及查阅方式.....	105
二十六、备查文件.....	106

## 一、绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《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管理信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）、《公开募集开放式证券投资基金管理规定》（以下简称《流动性风险规定》）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第5号<招募说明书的内容与格式>》等有关法律法规以及《华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金基金合同》（以下简称基金合同）编写。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。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，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，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。基金投资人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。

## 二、释义

本招募说明书中，除非文义另有所指，下列词语或简称代表如下含义：

基金或本基金：	指华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金；
基金合同或本基金合同：	指《华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金基金合同》及对本合同的任何有效修订和补充；
招募说明书：	指《华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金招募说明书》及其更新；
托管协议：	指《华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金托管协议》；
发售公告：	指《华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金发售公告》；
基金产品资料概要：	指《华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金基金产品资料概要》及其更新；
中国证监会：	指中国证券监督管理委员会；
中国银保监会：	指中国银行保险监督管理委员会；
《证券法》：	指《中华人民共和国证券法》；
《合同法》：	指《中华人民共和国合同法》；
《基金法》：	指《中华人民共和国证券投资基金法》；
《运作管理办法》：	指《证券投资基金运作管理办法》
《销售管理办法》：	指《证券投资基金销售管理办法》
《信息披露管理办法》：	指《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》
《流动性风险规定》：	指《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》
上交所《业务规则》：	指上海证券交易所 2005 年 7 月 14 日发布并施行的《上海证券交易所开放式基金认购、申购、赎回业务办理规则（试行）》
元：	指人民币元；
基金合同当事人：	指受本基金合同约束，根据本基金合同享受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；
基金管理人：	指华泰柏瑞基金管理有限公司；
基金托管人：	指招商银行股份有限公司；
A 类、B 类、C 类基金份额：	本基金将根据申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别，在投资者申购时分级收取前端申

购费用但免收销售服务费的称为 A 类，而不收取前端申购费用只从本类别基金资产中计提销售服务费的称为 B 类、

C 类。本基金 A 类、B 类、C 类基金份额分别设置代码。

由于基金费用的不同，本基金 A 类、B 类和 C 类基金份额将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。投资者申购本基金时，可自行选择申购的基金份额类别。

**注册登记业务：**指本基金登记、存管、清算和交收业务，具体内容包括投资人基金账户管理、基金份额注册登记、清算及基金交易确认、发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等；

**注册登记机构：**指办理本基金注册登记业务的机构。本基金 A 类基金份额的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司或接受基金管理人委托代为办理本基金注册登记业务的机构；本基金 B 类、C 类基金份额的注册登记机构为基金管理人或接受基金管理人委托代为办理本基金注册登记业务的机构；

**投资人：**指个人投资人、机构投资人、合格境外机构投资人和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者；

**个人投资人：**指依据中华人民共和国有关法律法规及其他有关规定可以投资于证券投资基金的自然人投资人；

**机构投资人：**指在中国境内合法注册登记或经有权政府部门批准设立和有效存续并依法可以投资证券投资基金的企业法人、事业法人、社会团体或其它组织；

**合格境外机构投资人：**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合法设立的证券投资基金的中国境外的机构投资人；

**基金份额持有人大会：**指按照本基金合同第八部分之规定召集、召开并由基金份额持有人进行表决的会议；

**基金募集期：**指基金合同和招募说明书中载明，并经中国证监会核准的基金份额募集期限，自基金份额发售之日起最长不超过三个月；

**基金合同生效日：**指基金募集期满，基金募集的基金份额总额超过核准的最低募集份额总额，并且基金份额持有人人数符合相关法律法规和基金合同规定的，基金管理人依据《基金法》向中

	国证监会办理备案手续后，中国证监会的书面确认之日；
存续期：	指本基金合同生效至终止之间的不定期期限；
工作日：	指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日；
认购：	指在基金募集期内，投资人按照本基金合同的规定申请购买本基金基金份额的行为；
申购：	指在本基金合同生效后的存续期间，投资人申请购买本基金基金份额的行为；
赎回：	指基金份额持有人按本基金合同规定的条件，向基金管理人要求其购回本基金基金份额的行为；
转换：	指基金份额持有人按基金管理人规定的条件，将其持有的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另一只基金的基金份额的行为；
转托管：	指基金份额持有人将其所持有的某一基金部分或全部份额从同一个基金账户下的一个交易账户指定到另一交易账户进行交易的行为；
投资指令：	指基金管理人在运用基金财产进行投资时，向基金托管人发出的资金划拨及实物券调拨等指令；
代销机构：	指接受基金管理人委托代为办理本基金认、申购、赎回和其他基金业务的机构，以及通过上海证券交易所开放式基金销售系统办理本基金销售业务的会员单位；
会员单位：	指具有开放式基金代销资格，经上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的、可通过上海证券交易所开放式基金销售系统办理开放式基金的认、申购、赎回和转托管等业务的上海证券交易所会员单位；
销售机构：	指基金管理人及本基金代销机构；
基金销售网点：	指基金管理人的直销中心及基金代销机构的代销网点；
场外或柜台：	指不通过上海证券交易所的开放式基金销售系统办理基金份额认、申购和赎回等业务的销售机构和场所；
场内或交易所：	指通过上海证券交易所的开放式基金销售系统办理基金份额认、申购和赎回等业务的销售机构和场所；
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；
基金账户：	指注册登记机构为基金投资人开立的记录其持有的由该注

	册登记机构办理注册登记的基金份额余额及其变动情况的账户；
交易账户：	指销售机构为投资者开立的记录投资者通过该销售机构办理基金认购、申购、赎回及转托管等业务的基金份额余额及其变动情况的账户；
开放日：	指为投资人办理基金申购、赎回等业务的工作日；
T 日：	指销售机构受理投资人申购、赎回或其他业务申请的日期；
基金销售服务费：	指从基金资产中计提的，用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务的费用；
基金收益：	指基金投资所得股票红利、债券利息、票据投资收益、买卖证券差价、银行存款利息以及其他合法收益和因运用基金财产带来的成本和费用的节约；
基金资产总值：	指基金购买的各类证券、银行存款本息、应收申购款以及其他资产等形式存在的基金财产的价值总和；
基金资产净值：	指基金资产总值减去基金负债后的价值；
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）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、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；
基金财产估值：	指计算评估基金财产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程；
法律法规：	指中华人民共和国现行有效的法律、行政法规、司法解释、地方法规、地方规章、部门规章及其他规范性文件以及对于该等法律法规的不时修改和补充；
侧袋机制：	指将基金投资组合中的特定资产从原有账户分离至专门账户进行处置清算，目的在于有效隔离并化解风险，确保投资者得到公平对待，属于流动性风险管理工具。侧袋机制实施期间，原有账户称为主袋账户，专门账户称为侧袋账户
特定资产：	包括：（一）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的资产；（二）按摊余成

本计量且计提资产减值准备仍导致资产价值存在重大不确定性的资产；（三）其他资产价值存在重大不确定性的资产

不可抗力：指任何无法预见、无法克服、无法避免的任何事件和因素，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律变化、突发停电或其他突发事件、证券交易场所非正常暂停或停止交易等。

### 三、基金管理人

#### (一) 基金管理人概况

名称：华泰柏瑞基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号楼 17 层

设立日期：2004 年 11 月 18 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监基金字[2004]178 号

法定代表人：贾波

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号楼  
17 层

电话：400-888-0001，021-38601777

联系人：汪莹白

注册资本：贰亿元人民币

经营范围：基金管理业务；发起设立基金；中国证监会批准的其他业务

组织形式：有限责任公司

存续期间：持续经营

股权结构：**PineBridge Investments LLC**49%、华泰证券股份有限公司 49%、苏州新  
区高新技术产业股份有限公司 2%

#### (二) 主要人员情况

##### 1、董事会成员

贾波先生：董事长，学士，曾任职于工商银行江苏省分行，2001 年 7 月至 2016 年 11  
月在华泰证券工作，历任经纪业务总部技术主办、零售客户服务总部地区经理、南宁双拥  
路营业部总经理、南京长江路营业部总经理、企划部副总经理(主持工作)、北京分公司总  
经理、融资融券部总经理等职务。2016 年 12 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，任公司董  
事长。

陆春光先生：董事，学士，2009 年 5 月加入华泰证券，曾任网络金融部互联网运营团  
队负责人、用户体验与设计团队负责人、副总经理，现任华泰证券上海分公司副总经理  
(主持工作)。

Kirk Chester SWEENEY 先生：董事，学士，1982 年 9 月加入 United States Trust Co  
of NY，1984 年至 1988 年任 Drexel Burnham Lambert 副总裁，1988 年至 1990 年任 Morgan  
Stanley (纽约)副总裁，1990 年至 1992 年任 Wardley-Thomson Securities (香港)董事，

1992 年至 2008 年任雷曼兄弟亚洲（香港）董事总经理兼香港地区负责人，2009 年至 2010 年任野村证券（香港）董事总经理，2010 年至 2013 年任巴克莱资本（香港）董事总经理，2013 年至 2019 年任 Millennium Capital Management（香港/新加坡）Pte Ltd 亚洲首席执行官，2019 年至 2020 年任泓策投资管理有限公司总裁，2020 年至 2021 年任 ExodusPoint Capital Management Hong Kong, Limited 亚洲区主管兼香港首席执行官，2021 年至今任柏瑞投资亚洲有限公司亚洲首席执行官。

杨智雅女士：董事，硕士，曾就职于升强工业股份有限公司、华之杰国际商业顾问有限公司、AIG 友邦证券投资顾问股份有限公司、AIG 友邦证券投资信托股份有限公司、AIG 友邦证券投资顾问股份有限公司、柏瑞证券投资顾问股份有限公司。

崔春女士：董事，清华大学五道口金融学院货币银行学硕士。曾任中国光大国际信托投资公司证券部经理；光大证券有限公司总裁办高级经理；中国建设银行总行计划财务部副处长、金融机构部副处长；嘉实基金管理有限公司固定收益部总监；中国国际金融股份有限公司资产管理部副总经理、执行总经理、董事总经理，兼任中金香港资产管理有限公司董事；华泰证券（上海）资产管理有限公司总经理、董事长。2025 年 10 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，现任公司总经理。

吴冠雄先生：独立董事，硕士，1999 年加入天元律师事务所，历任事务所专职律师、权益合伙人、管理合伙人、事务所执行主任和管理委员会成员。

田中荣治先生：独立董事，硕士，曾任职于野村证券株式会社、瑞穗证券亚洲有限公司、野村国际（香港）有限公司、野村资产管理香港有限公司。2022 年 9 月至今任中国国际金融日本株式会社代表取缔役社长。

孙茂竹先生：独立董事，硕士，1987 年 6 月至 2019 年 2 月任中国人民大学商学院教授、博士生导师。2019 年 2 月从中国人民大学退休。

尹雷先生：独立董事，硕士，曾任深圳证券交易所经理、麦顿投资副总裁、凯鹏华盈基金执行董事、阿里巴巴集团投资总监、阿里巴巴影业集团副总裁、海南阿里影业文化产业基金总裁，2019 年至今任厦门云尚汇影影视文化有限公司董事长。

## 2、监事会成员

刘晓冰先生：监事长。1993 年 12 月进入华泰证券股份有限公司，曾任无锡解放西路营业部总经理助理、副总经理、总经理，无锡永乐路营业部负责人，无锡城市中心营业部总经理，无锡分公司总经理等职务。现任华泰证券股份有限公司苏州分公司总经理。

卢龙威先生：监事，学士，曾任职于毕马威会计师事务所、安永会计师事务所、华为技术有限公司、荷兰银行（香港）、英美烟草（香港）有限公司、苏格兰皇家银行（香港），2014 年 10 月加入柏瑞投资亚洲有限公司，现任柏瑞投资亚洲有限公司全球税务主管兼亚太区财务总监。

刘声先生：监事，硕士。2011 年 7 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，现任风险管理

部副总监。

杨宇先生：监事，硕士。2016年7月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，现任人力资源部总监助理。

### 3、总经理及其他高级管理人员

崔春女士：总经理，清华大学五道口金融学院货币银行学硕士。曾任中国光大国际信托投资公司证券部经理；光大证券有限公司总裁办高级经理；中国建设银行总行计划财务部副处长、金融机构部副处长；嘉实基金管理有限公司固定收益部总监；中国国际金融股份有限公司资产管理部副总经理、执行总经理、董事总经理，兼任中金香港资产管理有限公司董事；华泰证券（上海）资产管理有限公司总经理、董事长。2025年10月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，现任公司总经理。

王溯舸先生：副总经理，硕士，1997-2000年任深圳特区证券公司总经理助理、副总经理，2001-2004年任华泰证券股份有限公司受托资产管理总部总经理。

房伟力先生：副总经理，硕士，1997-2001年任上海证券交易所登记结算公司交收系统开发经理，2001-2004年任华安基金管理有限公司基金登记及结算部门总监，2004-2008年5月任华泰柏瑞基金管理有限公司总经理助理。

刘万方先生：督察长，财政部财政科学研究所财政学博士。曾任中国普天信息产业集团公司项目投资经理，美国MBP咨询公司咨询顾问，中国证监会主任科员、副处长，上投摩根基金管理有限公司督察长，朱雀股权投资管理股份有限公司副总经理，朱雀基金管理有限公司总经理。2019年4月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，现任公司督察长。

满黎先生：副总经理，硕士。曾任华安基金管理有限公司北京分公司高级董事总经理，国联安基金管理有限公司副总经理，金鹰基金管理有限公司副总裁，万家基金管理有限公司副总经理。2021年9月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，现任副总经理。

童辉先生：首席信息官，硕士。1997-1998年任上海众恒信息产业有限公司程序员，1998-2004年任国泰基金管理有限公司信息技术部经理，2004年4月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，现任首席信息官兼信息技术部总监。

裴晓思先生：副总经理，复旦大学硕士。曾任泰和诚医疗集团行业研究员，中国出口信用保险公司投资经理，永诚财产保险有限公司投资经理，易方达基金管理有限公司非银客户部总经理助理（主持工作），2021年4月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，现任公司副总经理。

周俊梁先生：财务总监，硕士。曾任普华永道中天会计师事务所审计经理、渣打银行（中国）有限公司财务部高级经理、大华银行（中国）有限公司财务部第一副总裁，2015年10月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，现任公司财务总监。

柳军先生：副总经理，硕士，2000-2001年任上海汽车集团财务有限公司财务，2001-2004年任华安基金管理有限公司高级基金核算员，2004年7月加入华泰柏瑞基金管理有限

公司，历任基金事务部总监、指数投资部总监、总经理助理兼指数投资部总监，现任公司副总经理兼指数投资部总监。2009年6月起任上证红利交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2011年1月至2020年2月任华泰柏瑞上证中小盘ETF基金、华泰柏瑞上证中小盘ETF联接基金基金经理。2012年5月起任华泰柏瑞沪深300交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2015年2月起任指数投资部总监。2015年5月至2025年1月任华泰柏瑞中证500交易型开放式指数证券投资基金及华泰柏瑞中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2018年3月至2018年11月任华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018年3月至2018年10月任华泰柏瑞泰利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018年4月起任华泰柏瑞MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2018年10月起任华泰柏瑞MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2018年12月起任华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019年7月起任华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019年9月至2021年4月任华泰柏瑞中证科技100交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2020年2月至2021年4月任华泰柏瑞中证科技100交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2020年9月起任华泰柏瑞上证科创板50成份交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021年3月起任华泰柏瑞上证科创板50成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2021年5月起任华泰柏瑞南方东英恒生科技指数交易型开放式指数证券投资基金(QDII)的基金经理。2021年7月至2023年8月任华泰柏瑞中证沪港深创新药产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021年8月至2023年12月任华泰柏瑞中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021年12月起任华泰柏瑞中证500增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022年8月起任华泰柏瑞南方东英恒生科技指数交易型开放式指数证券投资基金联接基金(QDII)的基金经理。2022年11月起任华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023年3月起任华泰柏瑞纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金(QDII)的基金经理。2023年9月起任华泰柏瑞中证2000交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023年10月起任华泰柏瑞中证A股交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025年7月起任华泰柏瑞中证A股交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。

王文慧女士：副总经理，经济学硕士。2005年2月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任第一营销中心总监、第二营销中心总监、机构理财部总监、机构业务一部总监、华中营销中心总监、券商业务部总监、总经理助理兼券商业务部总监，现任公司副总经理兼券商业务部总监。

#### 4、本基金基金经理

王烨斌先生，中国人民大学西方经济学硕士、法国图卢兹经济学院公共发展政策专业硕士。曾任中诚信国际信用评级有限责任公司分析师，2015年5月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，任固定收益部研究员。2021年2月起任华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金、华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金的基金经理。2021年12月至2023年11月任华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2022年1月起任华泰柏瑞锦瑞债券型证券投资基金的基金经理。2022年3月起任华泰柏瑞鸿益30天滚动持有短债债券型证券投资基金的基金经理。2022年4月至2024年12月任华泰柏瑞恒悦混合型证券投资基金的基金经理。2022年5月至2025年2月任华泰柏瑞鸿裕90天滚动持有短债债券型证券投资基金的基金经理。2022年6月起任华泰柏瑞恒泽混合型证券投资基金的基金经理。

#### 5、固定收益投资决策委员会成员

主席：固定收益部联席总监罗远航先生；

成员：固定收益部联席总监郑青女士；固定收益部副总监何子建先生；基金经理王烨斌先生；固定收益部副总监张璐女士；投资经理吴梦兮女士；投资经理王超凡女士。

列席人员：督察长或风险管理部总监可列席投资决策委员会会议。总经理可以提名其他人员列席投资决策委员会会议。

上述人员之间不存在近亲属关系。

### （三）基金管理人的职责

- 1、依法募集基金，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、转换和登记事宜；
- 2、办理基金备案手续；
- 3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；
- 4、按照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收益；
- 5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- 6、编制季度报告、中期报告和年度报告；
- 7、计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回价格；
- 8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；
- 9、召集基金份额持有人大会；
- 10、基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- 11、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者实施其他法律行为；
- 12、中国证监会规定的其他职责。

#### (四) 基金管理人的承诺

1、本基金管理人承诺严格遵守现行有效的相关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会有关规定的发生。

2、本基金管理人承诺严格遵守《中华人民共和国证券法》、《基金法》及有关法律法规，建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止下列行为发生：

- (1) 将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
- (2) 不公平地对待其管理的不同基金财产；
- (3) 利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人谋取利益；
- (4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- (5) 法律法规或中国证监会禁止的其他行为。

3、本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，不从事以下活动：

- (1) 越权或违规经营；
- (2) 违反基金合同或托管协议；
- (3) 故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法利益；
- (4) 在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；
- (5) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
- (6) 玩忽职守、滥用职权；
- (7) 违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，泄漏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；
- (8) 违反证券交易场所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；
- (9) 贬损同行，以抬高自己；
- (10) 以不正当手段谋求业务发展；
- (11) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；
- (12) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
- (13) 其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

#### 4、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及其代理人、受雇人或任何第三人谋取利益；
- (3) 不违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，

泄漏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；

（4）不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

## （五）基金管理人的内部控制制度

### 1、内部控制的原则

（1）健全性原则。内部控制必须覆盖公司各个部门和各级岗位，并渗透到各项业务过程，涵盖决策、执行、监督、反馈等各个经营环节；

（2）有效性原则。通过科学的内控手段和方法，建立合理的内控程序，维护内控制度的有效执行；

（3）独立性原则。公司在精简的基础上设立能够充分满足经营运作需要的机构、部门和岗位，各机构、部门和岗位职能上保持相对独立。内部控制的检查评价部门必须独立于内部控制的建立和执行部门；

（4）相互制约原则。公司内部部门和岗位的设置应权责分明、相互制衡，消除内部控制中的盲点；

（5）防火墙原则。公司基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离，基金投资研究、决策、执行、清算、评估等部门和岗位，应当在物理上和制度上适当隔离，以达到风险防范的目的；

（6）成本效益原则。公司运用科学化的经营管理方法降低运作成本，提高经济效益，以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

### 2、内部控制的主要内容

#### （1）控制环境

董事会下设风险管理与审计委员会，全面负责公司的风险管理、风险控制和财务监控，审查公司的内控制度，并对重大关联交易进行审计；董事会下设薪酬、考核与资格审查委员会，对董事、总经理、督察长、财务总监和其他高级管理人员的候选人进行资格审查以确保其具有中国证监会所要求的任职资格，制定董事、监事、总经理、督察长、财务总监、其他高级管理人员及基金经理的薪酬/报酬计划或方案。

公司管理层在总经理领导下，认真执行董事会确定的内部控制战略，为了有效贯彻公司董事会制定的经营方针及发展战略，设立了投资决策委员会和风险控制委员会，就基金投资和风险控制等发表专业意见及建议。

公司设立督察长，对董事会负责，主要负责对公司内部控制的合法合规性、有效性和合理性进行审查，发现重大风险事件时向公司董事长和中国证监会报告。

#### （2）风险评估

公司风险控制人员定期评估公司风险状况，范围包括所有能对经营目标产生负面影响的内部和外部因素，评估这些因素对公司总体经营目标产生影响的程度及可能性，并将评估报告报公司董事会及高层管理人员。

**(3) 控制活动**

控制活动包括自我控制、职责分离、监察稽核、实物控制、业绩评价、严格授权、资产分离、危机处理等政策、程序或措施。

自我控制以各岗位的目标责任制为基础，是内部控制的第一道防线。在公司内部建立科学、严格的岗位分离制度，在相关部门和相关岗位之间建立重要业务处理凭据传递和信息沟通制度，后续部门及岗位对前一部门及岗位负有监督责任，使相互监督制衡的机制成为内部控制的第二道防线。充分发挥督察长和法律监察部对各岗位、各部门、各机构、各项业务全面监察稽核作用，建立内部控制的第三道防线。

**(4) 信息与沟通**

公司建立了内部办公自动化信息系统与业务汇报体系，形成了自上而下的信息传播渠道和自下而上的信息呈报渠道。通过建立有效的信息交流渠道，保证了公司员工及各级管理人员可以充分了解与其职责相关的信息，并及时送达适当的人员进行处理。

**(5) 内部监控**

内部监控由公司风险管理与审计委员会、督察长、风险控制委员会和法律监察部等部门在各自的职权范围内开展。本公司设立了独立于各业务部门的法律监察部，其中监察稽核人员履行内部稽核职能，检查、评价公司内部控制制度合理性、完备性和有效性，监督公司内部控制制度的执行情况，揭示公司内部管理及基金运作中的风险，及时提出改进意见，促进公司内部管理制度有效地执行。

**3、基金管理人关于内部控制的声明**

- (1) 基金管理人确知建立、实施和维持内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任；
- (2) 本公司承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确；
- (3) 本公司承诺将根据市场环境的变化及公司的发展不断完善内部控制制度。

## 四、基金托管人

### (一) 基金托管人概况

#### 1、基本情况

名称：招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）

设立日期：1987年4月8日

注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

注册资本：252.20亿元

法定代表人：缪建民

行长：王良

资产托管业务批准文号：证监基金字[2002]83号

电话：4006195555

传真：0755-83195201

资产托管部信息披露负责人：张姗

#### 2、发展概况

招商银行成立于1987年4月8日，是我国第一家完全由企业法人持股的股份制商业银行，总行设在深圳。自成立以来，招商银行先后进行了三次增资扩股，并于2002年3月成功地发行了15亿A股，4月9日在上交所挂牌（股票代码：600036），是国内第一家采用国际会计标准上市的公司。2006年9月又成功发行了22亿H股，9月22日在香港联交所挂牌交易（股票代码：3968），10月5日行使H股超额配售，共发行了24.2亿H股。截至2025年3月31日，本集团总资产125,297.92亿元人民币，高级法下资本充足率19.06%，权重法下资本充足率15.62%。

2002年8月，招商银行成立基金托管部；2005年8月，经报中国证监会同意，更名为资产托管部，现下设基金券商团队、银保信托团队、养老金团队、业务管理团队、产品研发团队、风险管理团队、系统与数据团队、项目支持团队、运营管理团队、基金外包业务团队10个职能团队，现有员工261人。2002年11月，经中国人民银行和中国证监会批准获得证券投资基金管理业务资格，成为国内第一家获得该项业务资格上市银行；2003年4月，正式办理基金托管业务。招商银行作为托管业务资质最全的商业银行之一，拥有证券投资基金管理资格、基本养老保险基金托管机构资格、受托投资管理托管业务托管资格、保险资金托管业务资格、企业年金基金托管业务资格、合格境外机构投资者托管（QFII）资格、合格境内机构投资者托管（QDII）资格、私募基金业务外包服务资格、存托凭证试点存托业务等业务资格。

招商银行资产托管结合自身在托管行业深耕23年的专业能力和创新精神，推出“招商银行托管+”服务品牌，以“践行价值银行战略，致力于成为专业更精、科技更强、服务更佳的客户首选全球托管银行”品牌愿景为指引，以“值得信赖的专家、贴心服务的管家、让价值持续增加、客户的体验更佳”的“4+目标”，以创新的“服务产品化”为方法论，全方位助力资管机构实现可持续的高质量发展。招商银行资产托管围绕资管全场景，打造了“如风运营”“大观投研”“见微数据”三个服务子品牌，不断创新托管系统、服务和产品：在业内率先推出“网上托管银行系统”、托管业务综合系统和“6S”托管服务标准，首家发布私募基金绩效分析报告，开办国内首个托管银行网站，推出国内首个托管大数据平台，成功托管国内第一只券商集合资产管理计划、第一只FOF、第一只信托资金计

划、第一只股权私募基金、第一家实现货币市场基金赎回资金 T+1 到账、第一只境外银行 QDII 基金、第一只红利 ETF 基金、第一只“1+N”基金专户理财、第一家大小非解禁资产、第一单 TOT 保管，实现从单一托管服务商向全面投资者服务机构的转变，得到了同业认可。

招商银行资产托管业务持续稳健发展，社会影响力不断提升，近年来获得业内各类奖项荣誉。2016 年 5 月 “托管通”荣获《银行家》2016 中国金融创新 “十佳金融产品创新奖”； 6 月荣获《财资》“中国最佳托管银行奖”，成为国内唯一获得该奖项的托管银行； 7 月荣获中国资产管理 “金贝奖” “最佳资产托管银行”、《21 世纪经济报道》“2016 最佳资产托管银行”。2017 年 5 月荣获《亚洲银行家》“中国年度托管银行奖”； 6 月荣获《财资》“中国最佳托管银行奖”； “全功能网上托管银行 2.0” 荣获《银行家》2017 中国金融创新 “十佳金融产品创新奖”。2018 年 1 月荣获中央国债登记结算有限责任公司 “2017 年度优秀资产托管机构” 奖； 同月，托管大数据平台风险管理系统荣获 2016-2017 年度银监会系统 “金点子” 方案一等奖，以及中央金融团工委、全国金融青联第五届 “双提升” 金点子方案二等奖； 3 月荣获《中国基金报》“最佳基金托管银行” 奖； 5 月荣获国际财经权威媒体《亚洲银行家》“中国年度托管银行奖”； 12 月荣获 2018 东方财富风云榜 “2018 年度最佳托管银行”、“20 年最值得信赖托管银行” 奖。2019 年 3 月荣获《中国基金报》“2018 年度最佳基金托管银行” 奖； 6 月荣获《财资》“中国最佳托管机构” “中国最佳养老金托管机构” “中国最佳零售基金行政外包” 三项大奖； 12 月荣获 2019 东方财富风云榜 “2019 年度最佳托管银行” 奖。2020 年 1 月，荣获中央国债登记结算有限责任公司 “2019 年度优秀资产托管机构” 奖项； 6 月荣获《财资》“中国境内最佳托管机构” “最佳公募基金托管机构” “最佳公募基金行政外包机构” 三项大奖； 10 月荣获《中国基金报》第二届中国公募基金英华奖 “2019 年度最佳基金托管银行” 奖。2021 年 1 月，荣获中央国债登记结算有限责任公司 “2020 年度优秀资产托管机构” 奖项； 同月荣获 2020 东方财富风云榜 “2020 年度最受欢迎托管银行” 奖项； 2021 年 10 月，《证券时报》“2021 年度杰出资产托管银行天玑奖”； 2021 年 12 月，荣获《中国基金报》第三届中国公募基金英华奖 “2020 年度最佳基金托管银行”； 2022 年 1 月荣获中央国债登记结算有限责任公司 “2021 年度优秀资产托管机构、估值业务杰出机构” 奖项； 9 月荣获《财资》“中国最佳托管银行” “最佳公募基金托管银行” “最佳理财托管银行” 三项大奖； 12 月荣获《证券时报》“2022 年度杰出资产托管银行天玑奖”； 2023 年 1 月荣获中央国债登记结算有限责任公司 “2022 年度优秀资产托管机构”、银行间市场清算所股份有限公司 “2022 年度优秀托管机构”、全国银行间同业拆借中心 “2022 年度银行间本币市场托管业务市场创新奖” 三项大奖； 2023 年 4 月，荣获《中国基金报》第二届中国基金业创新英华奖 “托管创新奖”； 2023 年 9 月，荣获《中国基金报》中国基金业英华奖 “公募基金 25 年基金托管示范银行（全国性股份行）”； 2023 年 12 月，荣获《东方财富风云榜》“2023 年度托管银行风云奖”。2024 年 1 月，荣获中央国债登记结算有限责任公司 “2023 年度优秀资产托管机构”、“2023 年度估值业务杰出机构”、“2023 年度债市领军机构”、“2023 年度中债绿债指数优秀承销机构” 四项大奖； 2024 年 2 月，荣获泰康养老保险股份有限公司 “2023 年度最佳年金托管合作伙伴” 奖。2024 年 4 月，荣获中国基金报 “中国基金业英华奖-ETF20 周年特别评选 “优秀 ETF 托管人”” 奖。2024 年 6 月，荣获上海清算所 “2023 年度优秀托管机构” 奖。2024 年 8 月，在《21 世纪经济报道》主办的 2024 资产管理年会暨十七届 21 世纪【金贝】资产管理竞争力研究案例发布盛典上，“招商银行托管+” 荣获 “2024 卓越影响力品牌” 奖项； 2024 年 9 月，在 2024 财联社中国金融业 “拓扑

奖”评选中，荣获银行业务类奖项“2024 年资产托管银行‘拓扑奖’”；2024 年 12 月，荣获《中国证券报》“ETF 金牛生态圈卓越托管机构（银行）奖”；2024 年 12 月，荣获《2024 东方财富风云际会》“年度托管银行风云奖”。2025 年 1 月，荣获中央国债登记结算有限责任公司“2024 年度优秀资产托管机构”奖项、上海清算所“2024 年度优秀托管机构”奖项；2025 年 2 月，荣获全国银行间同业拆借中心“2024 年度市场创新业务机构”奖项；2025 年 3 月，荣获《中国基金报》2025 年指数生态圈英华典型案例“指数产品托管机构”奖项。

## （二）主要人员情况

缪建民先生，本行董事长、非执行董事，2020 年 9 月起担任本行董事、董事长。中央财经大学经济学博士，高级经济师。中国共产党第十九届、二十届中央委员会候补委员。招商局集团有限公司董事长。曾任中国人寿保险（集团）公司副董事长、总裁，中国人民保险集团股份有限公司副董事长、总裁、董事长，曾兼任中国人民财产保险股份有限公司董事长，中国人保资产管理有限公司董事长，中国人民健康保险股份有限公司董事长，中国人民保险（香港）有限公司董事长，人保资本投资管理有限公司董事长，中国人民养老保险有限责任公司董事长，中国人民人寿保险股份有限公司董事长。

王良先生，本行党委书记、执行董事、行长。中国人民大学经济学硕士，高级经济师。1995 年 6 月加入本行，历任本行北京分行行长助理、副行长、行长，2012 年 6 月起历任本行行长助理、副行长、常务副行长，2022 年 5 月起任本行党委书记，2022 年 6 月起任本行行长。兼任本行香港上市相关事宜之授权代表、招银国际金融控股有限公司董事长、招银国际金融有限公司董事长、招商永隆银行董事长、招联消费金融有限公司副董事长、招商局金融控股有限公司董事、中国银行业协会中间业务专业委员会第四届主任、中国金融会计学会第六届常务理事、广东省第十四届人大代表。

王颖女士，本行副行长，南京大学政治经济学专业硕士，经济师。王颖女士 1997 年 1 月加入本行，历任本行北京分行行长助理、副行长，天津分行行长，深圳分行行长，本行行长助理。2023 年 11 月起任本行副行长。

孙乐女士，本行资产托管部总经理，硕士研究生毕业，2001 年 8 月加入本行至今，历任本行合肥分行风险控制部副经理、经理、信贷管理部总经理助理、副总经理、总经理、公司银行部总经理、中小企业金融部总经理、投行与金融市场部总经理；无锡分行行长助理、副行长；南京分行副行长，具有 20 余年银行从业经验，在风险管理、信贷管理、公司金融、资产托管等领域有深入的研究和丰富的实务经验。

## （三）基金托管业务经营情况

截至 2025 年 3 月 31 日，招商银行股份有限公司累计托管 1598 只证券投资基金。

## （四）托管人的内部控制制度

### 1. 内部控制目标

招商银行确保托管业务严格遵守国家有关法律法规和行业监管制度，坚持守法经营、规范运作的经营理念；形成科学合理的决策机制、执行机制和监督机制，防范和化解经营风险，确保托管业务的稳健运行和托管资产的安全；建立有利于查错防弊、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；确保内控机制、体制的不断改进和各项业务制度、流程的不断完善。

### 2. 内部控制组织结构

招商银行资产托管业务建立三级内部控制及风险防范体系：

一级内部控制及风险防范是在招商银行总行风险管理层面对风险进行预防和控制；总行风险管理部、法律合规部、审计部独立对资产托管业务进行评估监督，并提出内控提升管理建议。

二级内部控制及风险防范是招商银行资产托管部设立风险合规管理相关团队，负责部门内部风险预防和控制，及时发现内部控制缺陷，提出整改方案，跟踪整改情况，并直接向部门总经理室报告。

三级内部控制及风险防范是招商银行资产托管部在设置专业岗位时，遵循内控制衡原则，视业务的风险程度制定相应监督制衡机制。

### 3. 内部控制原则

(1) 全面性原则。内部控制覆盖各项业务过程和操作环节、覆盖所有团队和岗位，并由全部人员参与。

(2) 审慎性原则。托管组织体系的构成、内部管理制度的建立均以防范风险、审慎经营为出发点，体现“内控优先”的要求。

(3) 独立性原则。招商银行资产托管部各团队、各岗位职责保持相对独立，不同托管资产之间、托管资产和自有资产之间相互分离。内部控制的检查、评价部门独立于内部控制的建立和执行部门。

(4) 有效性原则。内部控制有效性包含内部控制设计的有效性、内部控制执行的有效性。内部控制设计的有效性是指内部控制的设计覆盖了所有应关注的重要风险，且设计的风险应对措施适当。内部控制执行的有效性是指内部控制能够按照设计要求严格执行。

(5) 适应性原则。内部控制适应招商银行托管业务风险管理的需要，并能够随着托管业务经营战略、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及时进行修订和完善。

(6) 防火墙原则。招商银行资产托管部办公场地与我行其他业务场地隔离，办公网和业务网物理分离，部门业务网和全行业务网防火墙策略分离，以达到风险防范的目的。

(7) 重要性原则。内部控制在实现全面控制的基础上，关注重要托管业务重要事项和

高风险环节。

(8) 制衡性原则。内部控制能够实现在托管组织体系、机构设置、权责分配及业务流程等方面相互制约、相互监督，同时兼顾运营效率。

#### 4. 内部控制措施

(1) 完善的制度建设。招商银行资产托管部从资产托管业务内控管理、产品受理、会计核算、资金清算、岗位管理、档案管理和信息管理等方面制定一系列规章制度，建立了三层制度体系，即：基本规定、业务管理办法和业务操作规程。制度结构层次清晰、管理要求明确，满足风险管理全覆盖的要求，保证资产托管业务科学化、制度化、规范化运作。

(2) 业务信息风险控制。招商银行资产托管部在数据传输和保存方面有严格的加密和备份措施，采用加密、直连方式传输数据，数据执行异地实时备份，所有的业务信息须经过严格的授权方能进行访问。

(3) 客户资料风险控制。招商银行资产托管部对业务办理过程中获取的客户资料严格保密，除法律法规和其他有关规定、监管机构及审计要求外，不向任何机构、部门或个人泄露。

(4) 信息技术系统风险控制。招商银行对信息技术系统机房、权限管理实行双人双岗双责，电脑机房 24 小时值班并设置门禁，所有电脑设置密码及相应权限。业务网和办公网、托管业务网与全行业务网双分离制度，与外部业务机构实行防火墙保护，对信息技术系统采取两地三中心的应急备份管理措施等，保证信息技术系统的安全。

(5) 人力资源控制。招商银行资产托管部通过建立良好的企业文化和员工培训、激励机制、加强人力资源管理及建立人才梯级队伍及人才储备机制，有效地进行人力资源管理。

### (五) 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《中华人民共和国证券投资基金法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关法律法规的规定及基金合同、托管协议的约定，对基金投资范围、投资比例、投资组合等情况的合法性、合规性进行监督和核查。

在为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，基金托管人对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与支付情况进行检查监督，对违反法律法规、基金合同的指令拒绝执行，并立即通知基金管理人。

基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定，及时以书面形式通知基金管理人进行整改，整改的时限应符合法律法规及基金合同允许的调整期限。基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式向基金托管人发出回函并改正。基金管理人对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。



## 五、相关服务机构

### (一) 基金份额发售机构

基金份额发售机构包括基金管理人的直销机构和代销机构的销售网点。

#### 1、直销机构

华泰柏瑞基金管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号楼  
17 层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号楼  
17 层

法定代表人：贾波

电话：（021）38784638

传真：（021）50103016

联系人：汪莹白

客服电话：400-888-0001，（021）38784638

公司网址：[www.huatai-pb.com](http://www.huatai-pb.com)

#### 2、代销机构

本基金代销机构信息详见基金管理人网站公示。

3、基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时在基金管理人网站公示。

### (二) 注册登记机构

#### 1、A类基金份额

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区金融大街 27 号投资广场 23 层

法定代表人：金颖

电话：（010）58598835

传真：（010）58598834

联系人：任瑞新

#### 2、B类、C类基金份额

名称：华泰柏瑞基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号楼 17 层

法定代表人：贾波

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号楼 17

层

电话：（021）38601777

传真：（021）38601799

联系人：赵景云

### （三）律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：韩炯

电话：（021）31358666

传真：（021）31358600

经办律师：秦悦民、王利民

### （四）审计基金财产的会计师事务所

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层

办公地址：北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层

执行事务合伙人：毛鞍宁

经办注册会计师：许培菁、张亚旎

联系人：许培菁

联系电话：010-58153000

传真：010-85188298

## 六、基金的历史沿革

华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金由友邦华泰中短期债券投资基金转型而成。

友邦华泰中短期债券投资基金经中国证监会 2006 年 3 月 8 日证监基金字[2006]37 号文批准，并自 2006 年 3 月 15 日起公开募集。截止到 2006 年 4 月 7 日，基金募集工作顺利结束，募集有效认购总户数为 25,981 户；募集的净认购金额为 5,652,942,702.72 元人民币，折合基金份额 5,652,942,702.72 份；认购款项在基金验资确认日之前产生的银行利息共计 1,358,932.48 元人民币，折合基金份额 1,358,932.48 份归基金份额持有人所有；合计折合基金份额 5,654,301,635.20 份。华泰柏瑞基金管理有限公司向中国证监会办理完毕基金备案手续，并于 2006 年 4 月 13 日获书面确认，友邦华泰中短期债券投资基金基金合同自该日起正式生效。

2007 年 10 月 12 日，友邦华泰中短期债券投资基金基金份额持有人大会以通讯方式召开，大会讨论通过了友邦华泰中短期债券投资基金调整投资目标、投资范围和投资策略以及修订基金合同等内容。依据中国证监会 2007 年 11 月 28 日证监基金字[2007]323 号文（《关于核准友邦华泰中短期债券投资基金基金份额持有人大会有关变更基金类别决议的批复》）核准，持有人大会决议生效。依据持有人大会决议，原《友邦华泰中短期债券投资基金基金合同》失效，《友邦华泰金字塔稳本增利债券型证券投资基金基金合同》生效，同时基金更名为“友邦华泰金字塔稳本增利债券型证券投资基金”。

经中国证监会批准，自 2010 年 4 月 30 日起，基金管理人中文名称由“友邦华泰基金管理有限公司”变更为“华泰柏瑞基金管理有限公司”。经基金托管人同意，并报请中国证监会批准，本基金名称自 2010 年 4 月 30 日起，由“友邦华泰金字塔稳本增利债券型证券投资基金”更名为“华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金”，基金简称为“华泰柏瑞稳本增利债券”，基金代码保持不变。本基金、基金管理人更名等的详细内容见我公司 2010 年 4 月 30 日刊登在中国证券报、上海证券报、证券时报的《友邦华泰基金管理有限公司关于股东更名、公司更名及旗下基金更名的公告》。

## 七、基金的存续

### (一) 基金合同的生效

自取得中国证监会对友邦华泰中短期债券投资基金持有人大会决议的书面核准文件之日起，《基金合同》生效。基金管理人在收到中国证监会核准文件后的 2 日内对《基金合同》生效事宜予以公告。

### (二) 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，基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元的，基金管理人应当及时报告中国证监会；连续 20 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会说明原因并报送解决方案。

法律法规另有规定时，从其规定。

## 八、基金份额的申购与赎回

### (一) 申购与赎回办理的场所

本基金的销售机构包括基金管理人及其委托的场内和场外代销机构。具体的销售网点将由基金管理人在招募说明书、基金份额发售公告或其他公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减代销机构，并在基金管理人网站公示。投资者可以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的申购与赎回。其中，本基金 A 类基金份额可通过基金管理人及其委托的场内和场外代销机构进行申购赎回，投资者通过场内（交易所）申购本基金获得的基金份额需遵守上海证券交易所相关业务规则；本基金 B 类、C 类基金份额可通过基金管理人及其委托的场外代销机构进行申购赎回。

### (二) 申购与赎回办理的时间

#### 1、开放日及开放时间

上海证券交易所和深圳证券交易所同时开放交易的工作日为本基金的开放日。具体业务办理时间以销售机构公布时间为准。

若出现新的证券交易市场、证券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时间进行相应的调整并公告。

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、赎回或转换申请的，其基金份额申购、赎回价格为下次办理基金份额申购、赎回时间所在开放日的价格。

#### 2、申购与赎回的开始时间

本基金的申购自基金合同生效日起不超过 3 个月的时间开始办理。

本基金的赎回自基金合同生效日起不超过 3 个月的时间开始办理。

在确定申购开始时间与赎回开始时间后，由基金管理人最迟于申购或赎回开始前 2 日在指定媒介公告。

### (三) 申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即任一类基金份额的申购与赎回价格以受理申请当日收市后计算的该类基金份额净值为基准进行计算；

2、基金采用金额申购和份额赎回的方式，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、基金份额持有人在赎回基金份额时，基金管理人按先进先出的原则，即对该基金份额持有人在该销售机构托管的基金份额进行赎回处理时，申购确认日期在先的基金份额先赎回，申购确认日期在后的基金份额后赎回，以确定所适用的赎回费率；

4、当日的申购与赎回申请可以在当日交易时间结束前撤销，在当日的交易时间结束后

不得撤销；

5、基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可更改上述原则，但最迟应在新的原则实施前 3 个工作日前在指定媒介上予以公告。

#### （四）申购与赎回的程序

##### 1、申购与赎回的申请方式

基金投资者须按销售机构规定的手续，在开放日的业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

投资者申购本基金，须按销售机构规定的方式备足申购资金并全额交付申购款项，否则其提交的申购申请无效，不予成交。

投资者提交赎回申请时，其在销售机构（网点）必须有足够的可用基金份额余额。否则其提交的赎回申请无效，不予成交。

##### 2、申购与赎回申请的确认

基金管理人应在法律法规规定的时限内对基金投资者申购、赎回申请的有效性进行确认。

##### 3、申购与赎回申请的款项支付

申购采用全额交款方式，若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功，申购款项将退回投资者账户。投资者赎回申请被确认后，基金管理人应通过注册登记机构按规定向投资者支付赎回款项，赎回款项在自受理基金投资者有效赎回申请之日起不超过 7 个工作日的时间内划往投资者银行账户。在发生巨额赎回时，赎回款项的支付办法按本基金合同和有关法律法规规定处理。

#### （五）申购与赎回的数额限制

1、基金管理人的网上交易系统每个账户首次申购的最低金额为 10 元人民币，单笔申购的最低金额为 10 元人民币；直销柜台每个账户首次申购的最低金额为 50,000 元人民币，已在直销柜台有认/申购本公司旗下基金记录的投资者不受首次申购最低金额的限制，单笔申购的最低金额为 10 元人民币；

2、基金份额持有人可将其全部或部分基金份额赎回，但某笔赎回导致单个基金账户的基金份额余额少于 1 份时，余额部分基金份额必须一同赎回；基金管理人的网上交易系统和直销柜台赎回申请的最低份额为 10 份，但基金份额持有人单个基金账户内的基金份额余额少于 10 份并申请全部赎回时，可不受前述最低 10 份的申请限制；赎回申请的具体处理结果以注册登记中心确认结果为准；

3、除上述情况及另有公告外，基金管理人规定每个基金账户单笔最低申购金额为人民币 1 元、单笔最低追加申购金额为人民币 1 元、单笔最低赎回份额为 1 份、单个基金账户

最低持有份额为 1 份，各销售机构可根据情况设定最低申购金额、最低赎回份额以及最低持有份额，但不得低于本基金管理人设定的最低限制，具体以销售机构公布的为准，投资者需遵循销售机构的相关规定；

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，具体规定请参见招募说明书或相关公告；

5、基金管理人可根据市场情况，合理调整对申购金额和赎回份额的数量限制，基金管理人进行前述调整必须提前 3 个工作日在指定媒介上刊登公告。

## （六）申购与赎回的数额和价格

### 1、申购份额、余额以及赎回金额的处理方式：

申购份额、余额的处理方式：场外申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除申购费用后，以申请当日该类基金份额净值为基准计算，计算结果四舍五入保留到小数点后 2 位，四舍五入的部分归基金所有；场内申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除申购费用后，以申请当日 A 类基金份额净值为基准计算，计算结果保留到整数位，非整数份额部分对应金额返还投资者。

赎回金额的处理方式：净赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以申请当日该类基金份额净值为基准计算，扣除赎回费用，计算结果四舍五入保留到小数点后 2 位，四舍五入的部分归基金所有。

### 2、申购费和赎回费

#### （1）申购费

本基金 A 类基金份额申购时对申购费用采取前端收费模式，本基金 B 类、C 类基金份额申购时免收申购费用。本基金 A 类基金份额的申购费用由基金投资者承担，不列入基金资产，主要用于本基金 A 类基金份额的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

本基金 A 类基金份额的申购费率结构如下：

申购金额（元）	申购费率
申购金额<50 万	0.80%
50 万≤申购金额<100 万	0.60%
100 万≤申购金额<200 万	0.40%
200 万≤申购金额<500 万	0.20%
申购金额≥500 万	1000 元/笔

在申购费按金额分档的情况下，如果投资人多次申购，申购费适用单笔申购金额所对应的费率。

## (2) 赎回费

投资者可将其持有的全部或部分基金份额（包括 A 类、B 类和 C 类基金份额）赎回。本基金份额（包括 A 类、B 类和 C 类基金份额）的赎回费用由基金赎回人承担，在投资者赎回本基金份额（包括 A 类、B 类和 C 类基金份额）时收取，其中持有期少于 7 日的赎回费用全额计入基金财产；除基金合同另有约定外，持有期不少于 7 日的赎回费用的 40% 归入基金财产，其余部分用于支付注册登记费和其他必要的相关手续费。

本基金 A 类、B 类和 C 类基金份额的赎回费率结构如下：

	持有期限	赎回费率(%)
华泰柏瑞稳本增利债券 A (519519)	7 天以下	1.50
	7 天（含）以上至 30 天	0.30
	30 天（含）以上	0.00
华泰柏瑞稳本增利债券 B (460003)	7 天以下	1.50
	7 天（含）以上至 30 天	0.30
	30 天（含）以上至 365 天	0.15
	365 天（含）以上	0.00
华泰柏瑞稳本增利债券 C (020502)	7 天以下	1.50
	7 天（含）以上	0.00

(3) 本基金 A 类基金份额的申购费率、A 类、B 类和 C 类基金份额的赎回费率和收费方式由基金管理人根据基金合同的规定确定并在更新的招募说明书中列示。基金管理人可以在法律法规和基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日 3 个工作日前在指定媒介上刊登公告。

(4) 基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对以特定交易方式（如网上交易、电话交易等）等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，经相关监管部门核准，基金管理人可以适当调低本基金 A 类基金份额的申购费率、A 类、B 类和 C 类基金份额的赎回费率。

## 3、申购份额的计算

### (1) A 类基金份额

申购本基金 A 类基金份额的申购费用采用前端收费模式（即申购基金时缴纳申购费），投资人的申购金额包括申购费用和净申购金额。申购份额的计算方式如下：

$$A \text{类基金份额净申购金额} = A \text{类基金份额申购金额} / (1 + A \text{类基金份额申购费率})$$

$$A \text{类基金份额申购费用} = A \text{类基金份额申购金额} - A \text{类基金份额净申购金额}$$

A类基金份额申购份额 = A类基金份额净申购金额/申购当日A类基金份额净值

例：某投资人投资5万元申购本基金A类基金份额，假设申购当日A类基金份额净值为1.0520元，则可得到的申购份额为：

$$\text{净申购金额} = 50000 / (1 + 0.8\%) = 49603.17 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 50000 - 49603.17 = 396.83 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 49603.17 / 1.0520 = 47151.30 \text{ 份}$$

即：投资人投资5万元申购本基金A类基金份额，其对应费率为0.80%，假设申购当日基金份额净值为1.0520元，则其可得到：47151.30份A类基金份额。

### (2) B类基金份额

本基金B类基金份额的申购费率为0，即免收申购费用。

B类基金份额净申购金额 = B类基金份额申购金额

B类基金份额申购费用 = 0

B类基金份额申购份额 = B类基金份额净申购金额/申购当日B类基金份额净值

例：某投资人投资5万元申购本基金B类基金份额，免申购费，假设申购当日B类基金份额净值为1.0520元，则可得到的申购份额为：

$$\text{净申购金额} = 50000 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 0$$

$$\text{申购份额} = 50000 / 1.0520 = 47528.52 \text{ 份}$$

即：投资人投资5万元申购本基金B类基金份额，假设申购当日B类基金份额净值为1.0520元，则其可得到：47528.52份B类基金份额。

### (3) C类基金份额

本基金C类基金份额的申购费率为0。

C类基金份额净申购金额 = C类基金份额申购金额

C类基金份额申购费用 = 0

C类基金份额申购份额 = C类基金份额净申购金额/申购当日C类基金份额净值

例：某投资人投资5万元申购本基金C类基金份额，免申购费，假设申购当日C类基金份额净值为1.0520元，则可得到的申购份额为：

$$\text{净申购金额} = 50000 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 0$$

$$\text{申购份额} = 50000 / 1.0520 = 47528.52 \text{ 份}$$

即：投资人投资5万元申购本基金C类基金份额，假设申购当日C类基金份额净值为1.0520元，则其可得到：47528.52份C类基金份额。

## 4、净赎回金额的计算

投资人在赎回本基金（A类、B类和C类基金份额）时缴纳赎回费，投资人的净赎回

金额为赎回金额扣减赎回费用。净赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以申请当日该类基金份额净值为基准计算，扣除赎回费用，计算结果四舍五入均保留到小数点后 2 位，四舍五入的部分归基金所有。其中，

$$\text{A类基金份额赎回金额} = \text{A类基金份额赎回份额} \times \text{赎回当日 A类基金份额净值}$$

$$\text{A类基金份额赎回费用} = \text{A类基金份额赎回金额} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{A类基金份额净赎回金额} = \text{A类基金份额赎回金额} - \text{A类基金份额赎回费用}$$

$$\text{B类基金份额赎回金额} = \text{B类基金份额赎回份额} \times \text{赎回当日 B类基金份额净值}$$

$$\text{B类基金份额赎回费用} = \text{B类基金份额赎回金额} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{B类基金份额净赎回金额} = \text{B类基金份额赎回金额} - \text{B类基金份额赎回费用}$$

$$\text{C类基金份额赎回金额} = \text{C类基金份额赎回份额} \times \text{赎回当日 C类基金份额净值}$$

$$\text{C类基金份额赎回费用} = \text{C类基金份额赎回金额} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{C类基金份额净赎回金额} = \text{C类基金份额赎回金额} - \text{C类基金份额赎回费用}$$

例：某投资人赎回本基金 1 万份 A 类基金份额，持有时间为 25 天，对应的赎回费率为 0.30%，假设赎回当日 A 类基金份额净值是 1.0520 元，则其可得到的赎回金额为：

$$\text{赎回金额} = 10000 \times 1.0520 = 10520 \text{ 元}$$

$$\text{赎回费用} = 10520 \times 0.30\% = 31.56 \text{ 元}$$

$$\text{赎回净额} = 10520 - 31.56 = 10488.44 \text{ 元}$$

即：投资人赎回本基金 1 万份 A 类基金份额，假设赎回当日 A 类基金份额净值是 1.0520 元，则其可得到的赎回金额为 10488.44 元。

例：某投资人赎回本基金 1 万份 B 类基金份额，持有时间为九个月，对应的赎回费率为 0.15%，假设赎回当日 B 类基金份额净值是 1.0520 元，则其可得到的赎回金额为：

$$\text{赎回金额} = 10000 \times 1.0520 = 10520 \text{ 元}$$

$$\text{赎回费用} = 10520 \times 0.15\% = 15.78 \text{ 元}$$

$$\text{赎回净额} = 10520 - 15.78 = 10504.22 \text{ 元}$$

即：投资人赎回本基金 1 万份 B 类基金份额，假设赎回当日 B 类基金份额净值是 1.0520 元，则其可得到的赎回金额为 10504.22 元。

例：某投资人赎回本基金 1 万份 C 类基金份额，持有时间为 7 天，对应的赎回费率为 0.00%，假设赎回当日 C 类基金份额净值是 1.0520 元，则其可得到的赎回金额为：

$$\text{赎回金额} = 10000 \times 1.0520 = 10520 \text{ 元}$$

赎回费用为零

$$\text{赎回净额} = 10520 \text{ 元}$$

即：投资人赎回本基金 1 万份 C 类基金份额，假设赎回当日 C 类基金份额净值是 1.0520 元，则其可得到的赎回金额为 10520 元。

## 5、基金份额净值计算

本基金 A 类、B 类和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值。

A 类基金份额净值 = A 类基金资产净值总额 / 发行在外的 A 类基金份额总数

B 类基金份额净值 = B 类基金资产净值总额 / 发行在外的 B 类基金份额总数

C 类基金份额净值 = C 类基金资产净值总额 / 发行在外的 C 类基金份额总数

T 日的各类基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。本基金各类基金份额净值的计算，单位为元，均保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入。由此产生的误差由基金财产承担。

### （七）申购与赎回的注册登记

1、投资者 T 日申购基金成功后，基金注册登记机构在 T+1 日为投资者增加权益并办理注册登记手续，投资者自 T+2 日起可以到原销售机构查询成交情况，并有权赎回该部分基金份额。

2、投资者 T 日赎回基金成功后，基金注册登记机构在 T+1 日为投资者扣除权益并办理相应的注册登记手续。

3、基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，并最迟于开始实施前 3 个工作日在在中国证监会指定媒介上予以公告。

### （八）巨额赎回的认定及处理方式

#### 1、巨额赎回的认定

单个开放日中，本基金的基金份额净赎回申请（赎回申请总份额扣除申购总份额后的余额）与净转出申请（转出申请总份额扣除转入申请总份额后的余额）之和超过上一日基金总份额的 10%，为巨额赎回。

#### 2、巨额赎回的处理方式

出现巨额赎回时，基金管理人可以根据本基金当时的资产组合状况决定接受全额赎回或部分延期赎回。

1) 接受全额赎回：当基金管理人认为有能力兑付投资者的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

2) 部分延期赎回：当基金管理人认为兑付投资者的赎回申请有困难，或认为兑付投资者的赎回申请进行的资产变现可能使基金资产净值发生较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一日基金总份额 10%的前提下，对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个基金份额持有人申请赎回份额占当日申请赎回总份额的比例，确定该单个基金份额持有人当日办理的赎回份额；当日未受理部分除投资者在提交赎回申请时选择将当日未获受理部分予以撤销者外，延迟至下一开放日办理，赎回价格为下一个开放日的价格。转入下一开放日的赎回申请不享有赎回优先权，以此类推，直到全部赎回为

止。

3) 若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额的 20%，基金管理人可以先行对该单个基金份额持有人超出 20%的赎回申请实施延期办理。而对该单个基金份额持有人 20%以内（含 20%）的赎回申请，基金管理人根据前述“1) 接受全额赎回”或“2) 部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。如下一开放日，该单一基金份额持有人剩余未赎回部分仍旧超出前述比例约定的，继续按前述规则处理，直至该单一基金份额持有人单个开放日内申请赎回的基金份额占上一开放日基金总份额的比例低于前述比例。

4) 当发生巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或招募说明书规定的其他方式，在 3 个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，并在 2 日内在指定媒介予以公告。

5) 暂停接受和延缓支付：本基金连续 2 个开放日以上发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但延缓期限不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒介公告。

### （九）拒绝或暂停申购、暂停赎回及延缓支付赎回款项的情形及处理

1、在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资者的申购申请：

- 1) 因不可抗力导致基金管理人无法受理投资者的申购申请；
- 2) 证券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；
- 3) 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值的情况；
- 4) 基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔或某几笔申购；
- 5) 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；
- 6) 当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上的，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；
- 7) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

基金管理人决定拒绝或暂停接受某些投资者的申购申请时，申购款项将退回投资者账户。除上述第 4)、5) 项外，基金管理人决定暂停接受申购申请时，应当依法公告。在暂停申购的情形消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理并予以公告。

2、在如下情况下，基金管理人可以暂停接受投资者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无法支付赎回款项；
- 2) 证券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；
- 3) 基金连续发生巨额赎回，根据本基金合同规定，可以暂停接受赎回申请的情况；
- 4) 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值的情况；

5) 当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上的，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；

6) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一的，基金管理人应当在当日向中国证监会备案，并及时公告。已接受的赎回申请，基金管理人应当足额支付；如暂时不能足额支付，应当按单个赎回申请人已被接受的赎回申请量占已接受的赎回申请总量的比例分配给赎回申请人，其余部分在后续开放日予以支付。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予以公告。

已经确认的赎回申请根据前述规定延期支付赎回款项时，延缓期限不得超过 20 个工作日，并在中国证监会指定媒介予以公告。

3、暂停基金的申购、赎回，基金管理人应按规定公告。

4、暂停期间结束，基金重新开放时，基金管理人应按规定公告。

1) 如果发生暂停的时间为一天，基金管理人将于重新开放日，在指定媒介，刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并公告最近一个开放日的各类基金份额净值。

2) 如果发生暂停的时间超过一天但少于两周，暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人将提前一个工作日，在指定媒介，刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近一个开放日的各类基金份额净值。

3) 如果发生暂停的时间超过两周，暂停期间，基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次；当连续暂停时间超过两个月时，可对重复刊登暂停公告的频率进行调整。暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前三个工作日，在指定媒介连续刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近一个开放日的各类基金份额净值。

## （十）基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及本基金合同的规定，在条件成熟的情况下提供本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换服务。基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及本基金合同的规定制定并公告。

## （十一）定期定额投资计划

本基金为基金投资者提供定期定额投资计划服务。通过定期定额投资计划，基金投资者可通过固定的渠道，采用定期定额的方式申购本基金基金份额。该定期申购计划不受最低申购份额限制，具体以基金管理人的公告为准。

#### (十二) 实施侧袋机制期间本基金的申购与赎回

本基金实施侧袋机制的，本基金的申购和赎回安排详见本招募说明书“侧袋机制”部分的规定或相关公告。

## 九、基金的非交易过户、转托管、冻结、质押及其他业务

(一) 基金注册登记机构只受理继承、捐赠、司法强制执行和经注册登记机构认可的其他情况下的非交易过户。其中：

“继承”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”仅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的情形；

“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、社会团体或其他组织。

办理非交易过户业务必须提供基金注册登记机构规定的相关资料。

(二) 符合条件的非交易过户申请自申请受理日起，二个月内办理；申请人按基金注册登记机构规定的标准缴纳过户费用。

(三) 基金份额持有人可以办理其基金份额在不同交易账户的转托管手续。投资者于 T 日转托管基金份额成功后，转托管份额于 T+1 日到达转入方网点，投资者可于 T+2 日起赎回该部分基金份额。

(四) 基金注册登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金账户或基金份额的冻结与解冻。基金账户或基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益一并冻结，该业务的具体办理方式以注册登记机构的相关规定为准。

(五) 如相关法律法规允许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。

## 十、基金的投资

### （一）投资目标

在控制本金下跌风险的前提下，充分利用资本市场各种资产定价不准确产生的投资机会，实现基金资产的持续稳定增值。

### （二）投资范围

本基金的投资范围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、股票、存托凭证、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。此外，如法律法规或中国证监会允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入本基金的投资范围。

本基金投资于固定收益类资产（包括国债、金融债、企业债、可转换债券、资产支持证券、央行票据、债券回购、同业存款等）的比例不低于基金资产的 80%，投资于风险类资产（固定收益类资产以外的其它资产，包括股票、存托凭证、权证等）的比例不超过基金资产的 20%。本基金可以参与一级市场新股申购，并持有因在一级市场申购所获得的股票以及因可转债转股所形成的股票，也可以直接投资于二级市场中的股票、权证等，还可以持有股票所派发的权证、可分离债券产生的权证。

本基金持有现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年以内的政府债券（含政策性金融债、央行票据）不低于基金资产净值的 5%，本基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%。

### （三）投资理念

不同的资产类别具有其特定的风险收益特征。通过深入分析特定时期不同资产类别风险收益的相对变化趋势和价值定位，并依此进行有效的资产配置，可以构造下跌风险可控，同时又具有良好收益的投资产品组合，以满足低风险偏好客户的投资需求。

### （四）投资策略

本基金总体投资策略包括以下三个方面：

1、本基金将以固定收益类资产投资为基础，以其投资收益为保障，参照固定比例组合保险机制（CPPI）对风险类资产上限进行动态调整，以有效保障投资组合本金的安全。风险类资产的投资比例上限将根据固定比例组合保险机制的原理来进行调整，但在限度范围内风险类资产的投资比例将由基金管理人根据不同类别风险资产的最大可能损失比例来具体确定。

2、固定收益类资产投资策略

(1) 在流动性许可情况下，本基金部分固定收益类资产将采取持有到期（与基金业绩基准期限相匹配）的策略，首先考虑该类资产的收益性，同时兼顾流动性。这部分投资可以保证债券组合收益的稳定性，尽可能地控制利率、收益率曲线和再投资等各种风险。

(2) 积极投资策略。这部分固定收益类资产综合考虑收益性、流动性，进行主动调整，积极投资。具体策略包括根据利率预测调整组合久期、选择低估值债券、把握市场上的无风险套利机会等，以争取获得适当的超额收益，提高组合整体收益率。

(3) 含权债券投资策略。这主要指可转债/可分离债和选择权债券。本基金为债券型基金，为保持债券基金的风险收益特征，基金管理人将以其纯债价值作为评价的主要标准，以期权调整后的收益率水平(OAS)为基础，来选择具体含权债券进行投资。

### 3、风险类资产投资策略

(1) 新股申购策略：从我国证券市场的发展来看，新股发行仍然会保持一定的数量与规模。由于一、二级市场价差的存在，参与新股申购能够取得较高的收益。本基金将在充分研究新发股票基本面的前提下，积极参与新股的申购。本基金对于通过参与新股认购所获得的股票，将根据其市场价格相对于其合理内在价值的高低，确定继续持有或者卖出。

(2) 二级市场股票投资策略：本基金股票投资将注重基本面研究，选择流动性好、估值水平较低、具有中长期投资价值的个股进行投资。同时分散个股，构建组合，以避免单一股票的特定风险。

(3) 权证投资策略：权证为本基金辅助性投资工具，其投资原则为有利于基金资产增值，有利于加强基金风险控制。本基金在权证投资中将对权证标的证券的基本面进行研究，同时综合考虑权证定价模型、市场供求关系、交易制度设计等多种因素对权证进行定价，主要运用的投资策略为：杠杆交易策略、对冲保底组合投资策略、保底套利组合投资策略、买入跨式投资策略、Delta 对冲策略等。

(4) 存托凭证投资策略：本基金将根据投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。

### (五) 投资决策依据

- 1、国家有关法律、法规、基金合同等的有关规定；
- 2、投资分析团队对于宏观经济走势、宏观经济政策取向、行业增长速度等经济数据的量化分析的报告和建议；
- 3、投资分析团队对于企业和债券基础分析的报告和建议；
- 4、投资风险管理对于投资组合风险评估的报告和建议。

### (六) 投资决策机制

- 1、投资决策委员会负责审定基金经理的整体投资策略和原则；审定基金经理季度投资

策略报告；决定基金禁止投资事项等。

2、基金经理：在投资决策委员会的授权范围内，根据基金的整体投资策略和原则进行投资运作，确定具体的投资品种、数量、策略，优化和调整投资组合，进行投资组合的日常分析和管理。

3、基金经理助理/研究员：通过内部调研和参考外部研究报告，编写有关公司分析、行业分析、宏观分析、市场分析的各类报告，提交基金经理，作为投资决策的依据。

### （七）投资程序

1、研究部、集中交易室通过自身研究及借助外部研究机构形成有关上市公司分析、行业分析、宏观分析、市场分析以及数据模拟的各类报告，为本基金的投资管理提供决策依据。

2、投资决策委员会依据上述报告对基金的投资方向、资产配置比例等提出指导性意见。

3、基金经理根据投资决策委员会的决议，参考上述报告，并结合自身对证券市场和上市公司的分析判断，形成基金投资计划。

4、集中交易室依据基金经理的指令，制定交易策略，统一执行证券投资组合计划，进行具体品种的交易。

5、法律监察部对投资组合计划的执行过程进行监控。

6、基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下有权根据环境变化和实际需要对上述投资程序做出调整。

### （八）业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：中债综合指数收益率 $\times$ 80%+一年期银行定期存款税后收益率 $\times$ 20%

其中，中债综合指数是一个全面反映整个债券市场的综合性权威债券指数。另外，如果当年一年期银行定期存款税后收益率有调整，则新的比较基准将从调整当日起开始生效。

如果有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，基金管理人有权对此基准进行调整。业绩比较基准的变更须经基金管理人和基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，基金管理人应在调整前3个工作日在指定媒介上公告，并在更新的招募说明书中列示。

本基金为债券型基金，追求低风险水平下的稳定收益，在考虑了本基金的投资范围、投资策略和不同资产的投资比例后，选定了上述业绩比较基准。

## (九) 风险收益特征

本基金属主动管理的债券型证券投资基金，为证券投资基金中的较低风险较低收益品种，其预期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。本基金力争通过主动投资追求适度风险水平下的较高收益。

## (十) 投资禁止行为与限制

### 1、禁止用本基金财产从事以下行为

- (1) 承销证券；
- (2) 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，但是国务院另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- (6) 买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内主承销的证券；
- (7) 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；
- (8) 依照法律法规有关规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

如相关法律法规对上述约定内容另有明确规定，使得此部分内容与相关法律法规不符或冲突的，基金管理人与基金托管人应当对此进行修改并遵照执行。

### 2、基金投资组合比例限制

- (1) 本基金持有一家上市公司的股票，其市值不得超过基金资产净值的 10%；
- (2) 本基金投资于同一公司发行的债券、短期融资券等的比例合计不得超过基金资产净值的 10%；
- (3) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 10%；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%；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%；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%；
- (4) 本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，其市值不得超过该证券的 10%；
- (5) 进入全国银行间同业市场的债券回购融入的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；
- (6) 存放在本基金托管银行以外的具有基金托管资格的同一商业银行的存款，不得超过基金资产净值的 10%，不得超过此银行净资产的 10%；

(7) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不得超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司当次发行股票的总量；

(8) 本基金运用基金财产进行权证投资时，在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 5%；本基金与由基金管理人管理的其他基金持有同一权证的总和，不得超过该权证的 10%；

(9) 本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；

(10) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合本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；

(11) 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；

(12) 本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行，与境内上市交易的股票合并计算；

(13) 本基金不得违反本《基金合同》关于投资范围、投资策略和投资比例的约定；

(14) 本基金的建仓期为六个月；

(15) 法律法规或中国证监会对上述比例限制另有规定的，从其规定。

法律法规或监管部门取消上述限制的，本基金不受上述限制。

## (十一) 投资组合比例调整

基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例不在限制之内，但基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，以达到标准，上述第(10)、(11)项除外。法律法规另有规定的从其规定。

## (十二) 基金管理人代表基金行使所投资证券产生权利的处理原则及方法

- 1、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理。
- 2、有利于基金资产的安全与增值。
- 3、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金投资者的利益。
- 4、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利，保护基金投资者的利益。
- 5、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。

### (十三) 侧袋机制的实施和投资运作安排

当基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，根据最大限度保护基金份额持有人利益的原则，基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制，无需召开基金份额持有人大会审议。

侧袋机制实施期间，本部分约定的投资组合比例、投资策略、组合限制、业绩比较基准、风险收益特征等约定仅适用于主袋账户。基金管理人原则上应当在侧袋机制启用后 20 个交易日内完成对主袋账户投资组合的调整，因资产流动性受限等中国证监会规定的情形除外。

侧袋账户的实施条件、实施程序、运作安排、投资安排、特定资产的处置变现和支付等对投资者权益有重大影响的事项详见本招募说明书“侧袋机制”部分的规定。

### (十四) 基金投资组合报告

投资组合报告截止日为 2025 年 03 月 31 日，本报告财务资料未经审计师审计。

#### 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	10,050,511.31	18.51
	其中：股票	10,050,511.31	18.51
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	42,176,294.09	77.69
	其中：债券	42,176,294.09	77.69
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	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	2,021,846.91	3.72
8	其他资产	42,192.34	0.08
9	合计	54,290,844.65	100.00

#### 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	3,007,143.00	5.79
C	制造业	6,188,368.31	11.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—

F	批发和零售业		
G	交通运输、仓储和邮政业		
H	住宿和餐饮业		
I	信息传输、软件和信息技术服务业	569,400.00	1.10
J	金融业	285,600.00	0.55
K	房地产业		
L	租赁和商务服务业		
M	科学研究和技术服务业		
N	水利、环境和公共设施管理业		
O	居民服务、修理和其他服务业		
P	教育		
Q	卫生和社会工作		
R	文化、体育和娱乐业		
S	综合		
	合计	10,050,511.31	19.35

## 2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 3、期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

### 3.1 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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000333	美的集团	10,000	785,000.00	1.51
2	600489	中金黄金	40,000	562,800.00	1.08
3	601899	紫金矿业	30,000	543,600.00	1.05
4	000858	五粮液	4,100	538,535.00	1.04
5	601857	中国石油	50,000	411,000.00	0.79
6	300124	汇川技术	6,000	409,020.00	0.79
7	000426	兴业银锡	30,000	405,000.00	0.78
8	603379	三美股份	10,000	404,000.00	0.78
9	601088	中国神华	10,000	383,500.00	0.74
10	600426	华鲁恒升	16,000	353,600.00	0.68

## 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	17,158,935.07	33.04
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	10,181,694.80	19.61
7	可转债（可交换债）	14,835,664.22	28.57

8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	42,176,294.09	81.22

## 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	019749	24国债15	150,000	15,129,226.03	29.13
2	10238046 5	23晋城国资 MTN001	50,000	5,108,126.03	9.84
3	10248013 1	24云能投 MTN002	50,000	5,073,568.77	9.77
4	019740	24国债09	20,000	2,029,709.04	3.91
5	123233	凯盛转债	15,000	1,732,497.53	3.34

## 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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 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

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

## 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

注：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

## 9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

## 9.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：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

## 10.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

## 10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

## 10.3 本期国债期货投资评价

注：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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的情形，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

**11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库**

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情形。

**11.3 其他资产构成**

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	35,074.60
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	7,117.74
6	其他应收款	—
7	其他	—
8	合计	42,192.34

**11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	123233	凯盛转债	1,732,497.53	3.34
2	110081	闻泰转债	1,117,420.55	2.15
3	123114	三角转债	708,596.79	1.36
4	118013	道通转债	695,676.03	1.34
5	127038	国微转债	602,609.32	1.16
6	128136	立讯转债	596,254.18	1.15
7	118025	奕瑞转债	590,243.97	1.14
8	118012	微芯转债	582,600.68	1.12
9	127071	天箭转债	571,498.15	1.10
10	110073	国投转债	563,526.03	1.09
11	113615	金诚转债	536,640.86	1.03
12	113621	彤程转债	520,625.75	1.00
13	127086	恒邦转债	488,159.51	0.94
14	128142	新乳转债	486,401.21	0.94
15	110062	烽火转债	486,104.11	0.94
16	113641	华友转债	485,833.42	0.94
17	123107	温氏转债	482,751.34	0.93
18	127090	兴瑞转债	469,908.22	0.90
19	113669	景23转债	463,220.14	0.89
20	127046	百润转债	444,443.94	0.86
21	118046	诺泰转债	439,331.42	0.85
22	123121	帝尔转债	368,999.26	0.71
23	113593	沪工转债	357,814.11	0.69
24	127064	杭氧转债	354,884.63	0.68
25	127027	能化转债	347,837.59	0.67
26	118024	冠宇转债	341,785.48	0.66

**11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 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。

## 十一、基金的业绩

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。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。

下述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。基金的业绩报告截止日为 2025 年 03 月 31 日。

### 1、基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较

华泰柏瑞稳本增利债券 A

阶段	份额净值增长 率①	份额净值增 长率标准差 ②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
2022.01.01-2022.12.31	3.93%	0.43%	0.71%	0.05%	3.22%	0.38%
2023.01.01-2023.12.31	2.03%	0.11%	1.96%	0.03%	0.07%	0.08%
2024.01.01-2024.12.31	2.97%	0.20%	4.28%	0.07%	-1.31%	0.13%
2025.01.01-2025.03.31	-0.85%	0.25%	-0.88%	0.09%	0.03%	0.16%
自基金合同生效起至今	94.75%	0.28%	54.39%	0.06%	40.36%	0.22%

华泰柏瑞稳本增利债券 B

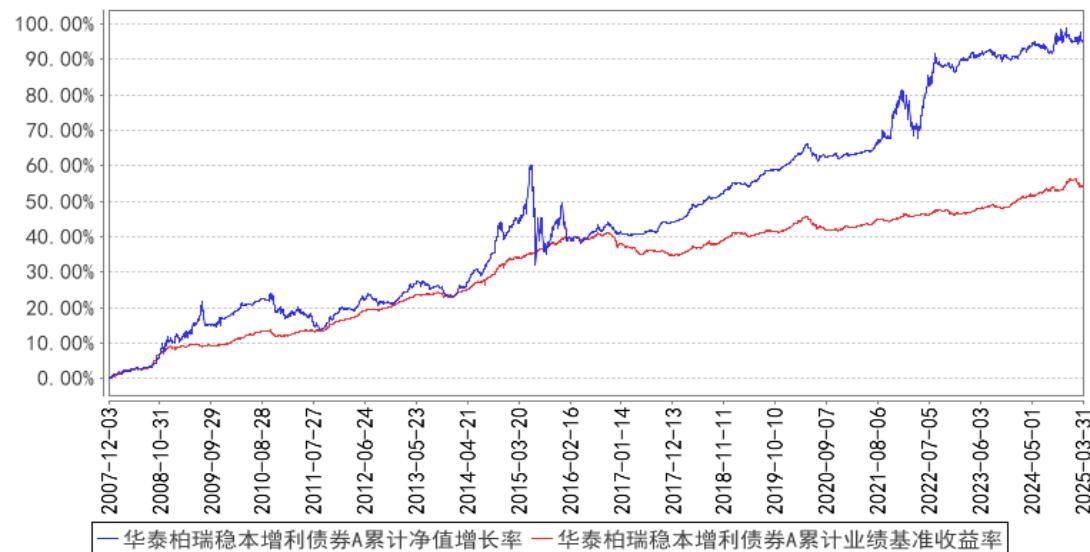
阶段	份额净值增长 率①	份额净值增 长率标准差 ②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
2022.01.01-2022.12.31	3.62%	0.43%	0.71%	0.05%	2.91%	0.38%
2023.01.01-2023.12.31	1.73%	0.11%	1.96%	0.03%	-0.23%	0.08%
2024.01.01-2024.12.31	2.65%	0.20%	4.28%	0.07%	-1.63%	0.13%
2025.01.01-2025.03.31	-0.91%	0.25%	-0.88%	0.09%	-0.03%	0.16%
自基金合同生效起至今	85.15%	0.28%	54.39%	0.06%	30.76%	0.22%

华泰柏瑞稳本增利债券 C

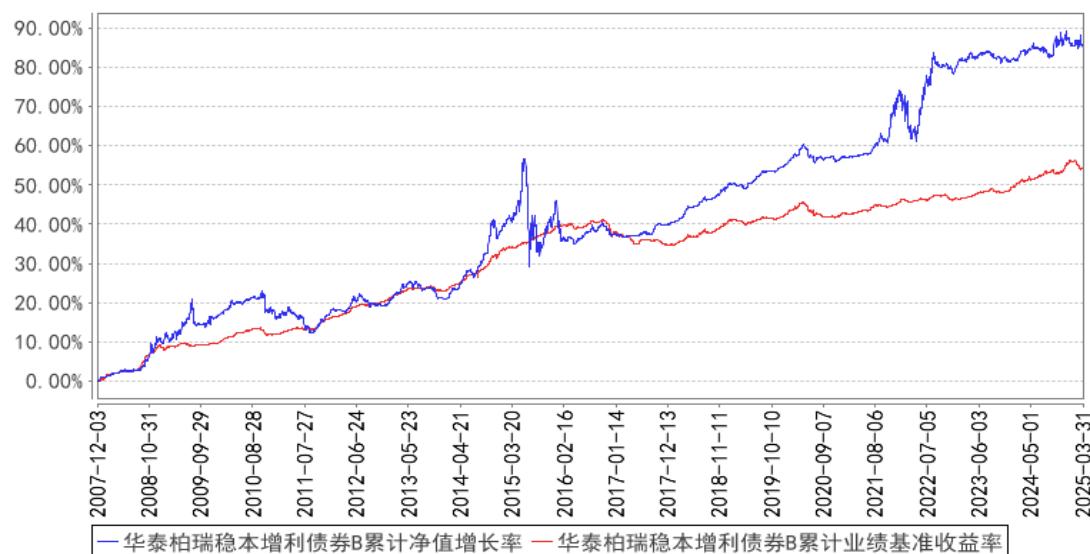
阶段	份额净值增长 率①	份额净值增 长率标准差 ②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
2024.01.04-2024.12.31	2.64%	0.20%	4.31%	0.07%	-1.67%	0.13%
2025.01.01-2025.03.31	-0.93%	0.25%	-0.88%	0.09%	-0.05%	0.16%
自基金合同生效起至今	1.69%	0.21%	3.39%	0.07%	-1.70%	0.14%

### 2、图示自基金转型以来基金份额净值的变动情况，并与同期业绩比较基准的变动的比较

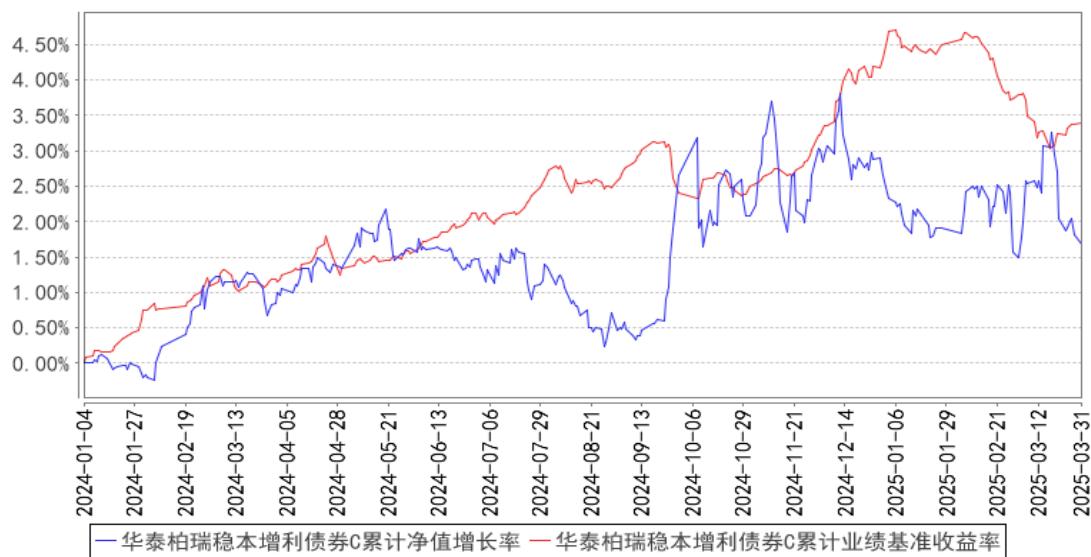
华泰柏瑞稳本增利债券A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



华泰柏瑞稳本增利债券B累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



华泰柏瑞稳本增利债券C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



- 注：1、A类，B类图示日期为2007年12月3日至2025年3月31日。  
2、C类图示日期为2024年1月4日至2025年3月31日。  
3、本基金于2007年12月3日由友邦华泰中短期债券投资基金转型为华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金。

## 十二、基金的财产

### (一) 基金资产总值

本基金基金资产总值包括基金所拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金的应收款项和其他投资所形成的价值总和。

### (二) 基金资产净值

本基金基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

### (三) 基金财产的账户

本基金根据相关法律法规、规范性文件开立基金资金账户以及证券账户，与基金管理人、基金托管人、基金代销机构和基金注册登记机构自有财产的账户以及其他基金财产账户独立。

### (四) 基金财产的保管及处分

- 1、基金财产由基金管理人和基金托管人严格按照法律、法规和基金合同的规定保管和处分。
- 2、本基金财产独立于基金管理人及基金托管人的固有财产，并由基金托管人保管。
- 3、基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益，归基金财产。
- 4、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范围。
- 5、非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

### 十三、基金财产的估值

#### (一) 估值目的

基金估值的目的是为了准确、真实地反映基金相关金融资产和金融负债的公允价值。开放式基金份额申购、赎回价格应按基金估值后确定的各类基金份额净值计算。

#### (二) 估值日

本基金合同生效后，每个交易日对基金财产进行估值。

#### (三) 估值对象

基金所持有的金融资产和金融负债。

#### (四) 估值方法

##### 1、股票估值方法

###### (1) 上市流通股票的估值

上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

###### (2) 未上市股票的估值

送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在交易所挂牌的同一股票的收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

首次发行未上市的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量的情况下，按成本估值。

###### (3) 有明确锁定期股票的估值

首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的收盘价估值；非公开发行且处于明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会的有关规定确定公允价值。

##### 2、固定收益证券的估值办法

(1) 证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘净价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最

近交易市价，确定公允价格。

(2) 证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息(自债券计息起始日或上一起息日至估值当日的利息)得到的净价进行估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按有交易的最近交易日所采用的净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

(3) 未上市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的情况下，按成本估值。

(4) 在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。

(5) 交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，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，按成本进行后续计量。

(6) 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。

### 3、权证估值：

(1) 配股权证的估值：

因持有股票而享有的配股权，类同权证处理方式的，采用估值技术进行估值。

(2) 认沽/认购权证的估值：

从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的认沽/认购权证按估值日的收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。未上市交易的认沽/认购权证采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量的情况下，按成本估值；因持有股票而享有的配股权，停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值。

### 4、本基金投资存托凭证的估值核算依照境内上市交易的股票执行。

### 5、其他资产的估值方法

其他资产按照国家有关规定或行业约定进行估值。

6、在任何情况下，基金管理人采用上述 1-5 项规定的方法对基金财产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人有充足的理由认为按上述方法对基金财产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素的基础上与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

### 7、国家有最新规定的，按其规定进行估值。

## （五）估值程序

基金日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行。各类基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以书面形式报给基金托管人，基金托管人按《基金合同》规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

## （六）暂停估值的情形

- 1、基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金财产价值时；
- 3、当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上的，经与基金托管人协商一致的，基金管理人应当暂停基金估值；
- 4、中国证监会认定的其他情形。

## （七）基金份额净值的确认

用于基金信息披露的基金净值信息由基金管理人负责计算，基金托管人进行复核。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信息予以公布。

各类基金份额净值的计算均精确到 0.0001 元，小数点后第五位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

## （八）估值错误的处理

- 1、当基金资产的估值导致任一类基金份额净值小数点后四位（含第四位）内发生差错时，视为该类基金份额净值估值错误。
- 2、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。当基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当计价错误达到或超过该类基金份额净值的 0.25%时，基金管理人应当报中国证监会备案；当计价错误达到或超过该类基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告，并同时报中国证监会备案。
- 3、前述内容如法律法规或监管机构另有规定的，按其规定处理。

关于差错处理，本合同的当事人按照以下约定处理：

### 1、差错类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人、基金托管人、注册登记机构、代理销售机构或投资者自身的过错造成差错，导致其它当事人遭受损失的，过错的相关责任人应当对

由于该差错遭受损失的当事人（“受损方”）按下述“差错处理原则”承担赔偿责任。

上述差错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；对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平无法预见、无法避免、无法抗拒，则属不可抗力，由于不可抗力原因造成投资者的交易资料灭失或被错误处理或造成其它差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其它当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

## 2、差错处理原则

1) 差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正而产生的差错，给当事人造成损失的由差错责任方承担；若差错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，则协助义务的当事人应当承担相应赔偿责任。

差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正。

2) 差错的责任方对可能导致有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对差错的有关直接当事人负责，不对任何第三方负责。

3) 因差错而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但差错责任方仍应对差错负责，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它当事人的利益损失（“受损方”），则差错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差错责任方。

4) 差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式。

5) 当基金管理人计算的各类基金份额净值与基金托管人的计算结果不一致时，相关各方应本着勤勉尽责的态度重新计算核对，如果最后仍无法达成一致，应以基金管理人的计算结果为准对外公布，基金管理人应在单方面对外公告基金资产净值计算结果时注明未经基金托管人复核。由此造成的损失以及因该交易日各类基金份额净值计算顺延而引起的损失由基金管理人承担赔偿责任，基金托管人不负赔偿责任。

6) 如果因基金管理人过错造成基金财产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人过错造成基金财产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。除基金管理人和基金托管人之外的第三方造成基金财产的损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错方追偿。

7) 如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿，并且依据法律、行政法规、本《基金合同》或其他规定，基金管理人或基金托管人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任，则基金管理人或基金托管人有权向出现过错的当事人进行追索，并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失；

8) 由于交易所及登记结算公司发送的数据错误，或由于其他不可抗力原因，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，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

针对净值差错处理，如果法律法规或证监会有新的规定，则按新的规定执行；如果行业有通行做法，在不违背法律法规且不损害投资者利益的前提下，相关各方当事人应本着平等互利的原则重新协商确定处理原则。

### 3、差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

- 1) 查明差错发生的原因，列明所有的当事人，并根据差错发生的原因确定差错的责任方；
- 2) 根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；
- 3) 根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失；
- 4) 根据差错处理的方法，需要修改基金注册登记机构的交易数据的，由基金注册登记机构进行更正，并就差错的更正向有关当事人进行确认；
- 5) 基金资产净值计算错误偏差达到基金资产净值 0.5%时，基金管理人应当按本基金合同的规定进行公告、通报基金托管人并报中国证监会备案。

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。

## （九）实施侧袋机制期间的基金资产估值

本基金实施侧袋机制的，应根据本部分的约定对主袋账户资产进行估值并披露主袋账户的基金份额净值，暂停披露侧袋账户的基金份额净值。

## （十）特殊情形的处理

1、基金管理人按本条第（四）款有关估值方法规定的第 6 项条款进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

2、由于不可抗力原因，或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，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可以免除赔偿责任。但基金管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

（十一）由于基金费用的不同，本基金 A 类、B 类和 C 类基金份额将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。

## 十四、基金的收益与分配

### (一) 基金收益的构成

基金收益包括：基金投资所得红利、股息、债券利息、票据投资收益、买卖证券差价、银行存款利息以及其他收入。因运用基金财产带来的成本或费用的节约计入收益。

### (二) 基金净收益

基金净收益为基金收益扣除按照国家有关规定和基金合同中的有关规定可以在基金收益中扣除的费用后的余额。

### (三) 收益分配原则

1、由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，B 类、C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同，本基金同一类别内的每一基金份额享有同等分配权；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按除息日的基金份额净值自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

基金份额持有人可对 A 类、B 类、C 类基金份额分别选择不同的分红方式。选择采取红利再投资形式的，同一类别基金份额的分红资金将按分红实施日该类别的基金份额净值转成相应的同一类别的基金份额，红利再投资的份额免收前端申购费。同一投资者持有的同一基金的同一费用类别只能选择一种分红方式，如投资者在不同销售机构选择的分红方式不同，则注册登记机构将以投资者最后一次选择的分红方式为准；

3、基金当期收益先弥补上期亏损后，方可进行当期收益分配；

4、如果基金当期出现亏损，则不进行收益分配；

5、基金收益分配后各类基金份额净值不低于面值；

6、在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益每年至少分配一次，基金收益分配每年至多 4 次；

7、全年基金收益分配比例不得低于年度基金可供分配收益的 60%；若基金合同生效不满 3 个月，收益可不分配；

8、法律、法规或监管机构另有规定的从其规定。

### (四) 收益分配方案

基金收益分配方案中应载明基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式、支付方式等内容。

### **(五) 收益分配方案的确定与公告**

本基金收益分配方案由基金管理人拟定、经基金托管人复核后，并依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

### **(六) 基金收益分配中发生的费用**

- 1、收益分配采用红利再投资方式免收再投资的费用。
- 2、收益分配时发生的银行转账等手续费用由基金份额持有人自行承担。

### **(七) 实施侧袋机制期间的收益分配**

本基金实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配，详见本招募说明书“侧袋机制”部分的规定。

## 十五、基金的费用与税收

### (一) 基金运作有关的费用

#### 1、基金运作费用的种类

- (1) 基金管理人的管理费；
- (2) 基金托管人的托管费；
- (3) 基金的销售服务费（B类、C类）；
- (4) 基金的证券交易费用；
- (5) 基金合同生效以后的信息披露费用；
- (6) 基金份额持有人大会费用；
- (7) 基金合同生效以后的会计师费和律师费；
- (8) 按照国家有关规定可以列入的其他费用。

#### 2、基金运作费用的计提方法、计提标准和支付方式

##### (1) 基金管理人的管理费

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的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为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起二个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

##### (2) 基金托管人的基金托管费

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的0.10%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起二个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

##### (3) 基金的销售服务费（B类、C类）

本基金A类基金份额不收取基金销售服务费，B类基金份额的基金销售服务费年费率为0.30%，C类基金份额的基金销售服务费年费率为0.01%。本基金B类、C类基金份额的基金销售服务费将专门用于本基金B类、C类基金份额的销售与B类、C类基金份额持有人服务，基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。

B类、C类基金份额的基金销售服务费按前一日B类、C类基金份额的基金资产净值的相应销售服务费年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{该类基金份额销售服务费率} \div \text{当年天数}$

$H$  为该类基金份额每日应计提的基金销售服务费

$E$  为该类基金份额前一日的基金资产净值

**B** 类、**C** 类基金份额的基金销售服务费由基金管理人每日计算，每日计提，按月支付。由基金管理人于次月首日起二个工作日内向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，基金托管人复核后于当日从基金财产中一次性支付给基金销售机构。

(4) 本条第(一)款第4至第8项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入基金费用。

(5) 基金管理人和基金托管人可根据基金规模等因素协商酌情调低基金管理费率、托管费率和**B**类、**C**类基金份额的销售服务费率，无须召开基金份额持有人大会。如降低基金管理费率、托管费率和**B**类、**C**类基金份额的销售服务费率，基金管理人最迟须于新的费率开始实施3个工作日前在指定媒介公告。

## (二) 与基金销售有关的费用

### 1、A类、B类和C类基金份额申购费

本基金**A**类基金份额的申购费用由投资人承担，不列入**A**类基金份额基金资产，用于**A**类基金份额基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。本基金**A**类基金份额采用前端收费的形式收取申购费用，申购费率按申购金额的大小分为不同档次，最高不超过0.8%，具体如下表所示：

申购金额(元)	申购费率
申购金额<50万	0.8%
50万≤申购金额<100万	0.6%
100万≤申购金额<200万	0.4%
200万≤申购金额<500万	0.2%
申购金额≥500万	1000元/笔

基金管理人可在法律法规允许的情况下，根据市场情况制定促销计划，在**A**类基金份额基金促销活动期间，基金管理人与基金托管人协商一致后，基金管理人可以对促销活动范围内的投资人调低**A**类基金份额基金申购费率。

本基金**B**类、**C**类基金份额申购时免收申购费用。

### 2、A类、B类和C类基金份额的赎回费

本基金**A**类、**B**类和**C**类基金份额的赎回费用由基金份额持有人承担，其中持有期少于7日的赎回费用全额计入基金财产；除基金合同另有约定外，持有期不少于7日的赎回

费用的 40%归入基金财产，其余部分用于支付注册登记费和其他必要的相关手续费。赎回费率随投资人持有本基金的时间的增加而递减，投资人持有本基金一定时间以上的赎回费为零。具体如下表所示：

	持有限期	赎回费率(%)
华泰柏瑞稳本增利债券 A (519519)	7 天以下	1.50
	7 天(含)以上至 30 天	0.30
	30 天(含)以上	0.00
华泰柏瑞稳本增利债券 B (460003)	7 天以下	1.50
	7 天(含)以上至 30 天	0.30
	30 天(含)以上至 365 天	0.15
	365 天(含)以上	0.00
华泰柏瑞稳本增利债券 C (020502)	7 天以下	1.50
	7 天(含)以上	0.00

### 3、转换费率

基金转换费由基金份额持有人承担，基金转换费率由基金管理人另行公告。

4、投资人通过网上交易方式办理基金申购或转换，适用网上交易费率，详见基金管理人网站的具体规定。

5、基金管理人与基金托管人协商一致后，可以在基金合同规定的范围内调整上述费率。上述费率如发生变更，基金管理人应最迟于新的费率实施前 3 个工作日在指定媒介公告。调整后的上述费率还将在最新的更新的招募说明书中列示。

6、基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对特定地域范围、特定行业、特定职业的投资人以及以特定交易方式(如网上交易、电话交易等)等定期或不定期地开展基金促销活动。

### (三) 不列入基金费用的项目

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资产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效之前的律师费、会计师费和信息披露费用等不得从基金资产中列支。

### (四) 实施侧袋机制期间的基金费用

本基金实施侧袋机制的，与侧袋账户有关的费用可以从侧袋账户中列支，但应待侧袋账户资产变现后方可列支。侧袋账户资产不收取管理费，其他费用详见本招募说明书“侧袋机制”部分的规定。

## (五) 税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，依照国家法律、法规的规定履行纳税义务。

## 十六、基金的会计与审计

### (一) 基金会计政策

- 1、基金的会计年度为公历每年 1 月 1 日至 12 月 31 日。
- 2、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位。
- 3、会计制度按国家有关的会计制度执行。
- 4、本基金独立建账、独立核算。
- 5、本基金会计责任人为基金管理人。
- 6、基金管理人应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，基金托管人定期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方式确认。

### (二) 基金年度审计

- 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相独立的、具有从事证券、期货相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师等机构对基金年度财务报表及其他规定事项进行审计；
- 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（或基金托管人）认为有充足理由更换会计师事务所，须经基金托管人（或基金管理人）同意。基金管理人应在更换会计师事务所后按照《信息披露办法》的有关规定公告。

## 十七、基金的信息披露

### (一) 披露原则

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”）及指定互联网站（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。

### (二) 基金募集信息披露

1、基金募集申请经中国证监会核准后，基金管理人应当在基金份额发售的三日前，将招募说明书、基金合同摘要登载在指定报刊和网站上；基金管理人、基金托管人应当将基金合同、基金托管协议登载在各自公司网站上。

2、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报刊和网站上。

3、基金管理人应当在基金合同生效的次日在指定报刊和网站上登载基金合同生效公告。

4、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。

5、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。

### (三) 定期报告

基金定期报告由基金管理人按照法律法规和中国证监会颁布的有关证券投资基金信息披露内容与格式的相关文件的规定单独编制，由基金托管人复核。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。

本基金在开始办理申购或者赎回后，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、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。

1、基金年度报告：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，将年度报告登载在指定网站上，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。

2、基金中期报告：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。

3、基金季度报告：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。

4、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。

5、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。

6、本基金持续运作过程中，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。

#### （四）临时报告

基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在两日内编制临时报告书，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；
- 9、基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十，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；
- 10、涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁；
- 11、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；
- 12、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，但中国证监会另有规定的除外；
- 13、基金收益分配事项；
- 14、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；
- 15、某类基金份额净值计价错误达该类基金份额净值百分之零点五；
- 16、基金开始办理申购、赎回；
- 17、基金发生巨额赎回并延期办理；
- 18、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；
- 19、基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；
- 20、变更基金份额类别的设置；
- 21、基金份额上市交易；
- 22、发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项；
- 23、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他事项。

#### （五）实施侧袋机制期间的信息披露

本基金实施侧袋机制的，相关信息披露义务人应当根据法律法规、基金合同和招募说明书的规定进行信息披露，详见本招募说明书“侧袋机制”部分的规定。

#### （六）清算报告

基金合同终止的，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。

### **(七) 公开澄清**

在基金合同期限内,任何公共媒体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。

### **(八) 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。

### **(九) 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、各类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。

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。

### **(十) 信息披露文件的存放与查阅**

1、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,供社会公众免费查阅。投资者在支付工本费后,可在合理时间内取得上述文件复印件。

2、基金管理人和基金托管人保证上述备查文件及复印件与公告的相应文件文本内容完全一致。

(十一) 本基金信息披露事项以法律法规规定及基金合同约定的内容为准。

## 十八、侧袋机制

### (一) 侧袋机制的实施条件和实施程序

当本基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，根据最大限度保护基金份额持有人利益的原则，基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制，无需召开基金份额持有人大会审议。

基金管理人应当在启用侧袋机制当日报中国证监会及基金管理人所在地中国证监会派出机构备案。

启用侧袋机制当日，基金管理人和基金服务机构应以基金份额持有人的原有账户份额为基础，确认相应侧袋账户基金份额持有人名册和份额。

### (二) 侧袋机制实施期间的基金运作安排

#### 1、基金份额的申购与赎回

##### (1) 侧袋账户

侧袋机制实施期间，基金管理人不办理侧袋账户的申购、赎回。基金份额持有人申请申购、赎回侧袋账户基金份额的，该申购、赎回申请将被拒绝。

##### (2) 主袋账户

基金管理人将依法保障主袋账户份额持有人享有基金合同约定的赎回权利，并根据主袋账户运作情况合理确定申购安排，具体事项届时将由基金管理人在相关公告中规定。

(3) 当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上的，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停基金估值，并暂停接受基金申购赎回申请或延缓支付赎回款项。

(4) 对于启用侧袋机制当日收到的赎回申请，基金管理人仅办理主袋账户的赎回申请并支付赎回款项。在启用侧袋机制当日收到的申购申请，视为投资者对侧袋机制启用后的主袋账户提交的申购申请。

#### 2、基金的投资

侧袋机制实施期间，本基金的各项投资运作指标和基金业绩指标应当以主袋账户资产为基准。

基金管理人原则上应当在侧袋机制启用后 20 个交易日内完成对主袋账户投资组合的调整，但因资产流动性受限等中国证监会规定的情形除外。

基金管理人不得在侧袋账户中进行除特定资产处置变现以外的其他投资操作。

侧袋机制实施期间，基金管理人、基金服务机构在计算基金业绩相关指标时仅考虑主袋账户资产，分割侧袋账户资产导致的基金净资产减少在计算基金业绩相关指标时按投资损失处理。

#### 3、基金的费用

侧袋机制实施期间，侧袋账户资产不收取管理费。基金管理人可以将与侧袋账户有关的费用从侧袋账户资产中列支，但应待特定资产变现后方可列支。因启用侧袋机制产生的咨询、审计费用等由基金管理人承担。

#### 4、基金的收益分配

侧袋机制实施期间，在主袋账户份额满足基金合同收益分配条件的情形下，基金管理人可对主袋账户份额进行收益分配。侧袋账户份额不再适用基金合同的收益与分配条款。

#### 5、基金的信息披露

##### (1) 基金净值信息

侧袋机制实施期间，基金管理人应当暂停披露侧袋账户的基金份额净值和基金份额累计净值。

##### (2) 定期报告

基金管理人应当按照规定在基金定期报告中披露报告期内侧袋账户相关信息。披露报告期末特定资产可变现净值或净值区间的，该净值或净值区间并不代表特定资产最终的变现价格，不作为基金管理人对特定资产最终变现价格的承诺。侧袋机制实施期间，基金定期报告中的基金会计报表仅需针对主袋账户进行编制。

##### (3) 临时报告

基金管理人在启用侧袋机制、处置特定资产、终止侧袋机制以及发生其他可能对投资者利益产生重大影响的事项后应及时发布临时公告。

启用侧袋机制的临时公告内容应当包括启用原因及程序、特定资产流动性和估值情况、对投资者申购赎回的影响、风险提示等重要信息。

处置特定资产的临时公告内容应当包括特定资产处置价格和时间、向侧袋账户份额持有人支付的款项、相关费用发生情况等重要信息。

侧袋机制实施期间，若侧袋账户资产无法一次性完成处置变现，基金管理人在每次处置变现后均应按照相关法律、法规要求及时发布临时公告。

#### 6、特定资产的处置清算

基金管理人将按照基金份额持有人利益最大化原则，采取将特定资产予以处置变现等方式，及时向侧袋账户份额持有人支付对应款项。无论侧袋账户资产是否全部完成变现，基金管理人都应及时向侧袋账户全部份额持有人支付已变现部分对应的款项。

#### 7、侧袋的审计

基金管理人应当在启用侧袋机制和终止侧袋机制后，及时聘请符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所进行审计并披露专项审计意见。

## 十九、基金的风险揭示

本基金的投资风险包括投资组合风险、管理风险、投资合规性风险和其它风险。

### (一) 投资组合风险

投资组合风险主要包括系统性风险、非系统性风险以及流动性风险。

#### 1、系统性风险

证券市场价格因受各种影响市场整体的因素如经济因素、政治因素、投资心理和交易监管制度等的影响而引起波动，从而导致基金收益水平变化，使本基金资产面临的风险。主要包括：

1) 政策风险：货币政策、财政政策、产业政策等国家宏观经济政策的变化导致证券市场价格波动，影响基金收益而产生风险；

2) 经济周期风险：经济运行具有周期性的特点，证券市场的收益水平受到宏观经济运行状况的影响，也呈现周期性变化，基金投资于债券与上市公司的股票，收益水平也会随之发生变化，从而产生风险；

3) 利率风险：金融市场利率的波动会导致股票市场及债券市场的价格和收益率的变动，同时直接影响企业的融资成本和利润水平。基金投资于股票和债券，收益水平会受到利率变化的影响，从而产生风险；

4) 购买力风险：基金持有人的收益将主要通过现金形式来分配，如果发生通货膨胀，现金的购买力会下降，从而影响基金的实际收益。

#### 2、非系统性风险

非系统性风险是指基金持有的单个证券的特有风险，包括企业的信用风险、经营风险、财务风险等。上市公司的经营状况受到多种因素影响，如管理能力、财务状况、市场前景、行业竞争能力、技术更新、研究开发、人员素质等，都会导致公司盈利发生变化。如果基金所投资股票和债券的发行人经营不善，导致其股票价格下跌、股息、红利减少，或者存在所投资的企业债券发行人无法按时偿付本息，从而使基金投资收益下降。

#### 3、流动性风险

流动性风险是指因市场交易量不足，导致基金不能以适当价格及时进行证券交易的风险，或基金无法应付赎回支付的要求所引起的违约风险。本基金是契约型开放式基金，基金规模将随着基金投资人对基金份额的申购和赎回而不断变化。基金投资人的连续大量赎回可能使基金资产难以按照预先期望的价格变现，而导致基金的投资组合流动性不足；或者投资组合持有的证券由于外部环境影响或基本面发生重大变化而导致流动性降低，造成基金资产变现的损失，从而产生流动性风险。

#### 4、实施侧袋机制的风险

当本基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，基金管理人经与基金托管人协

商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制。侧袋机制实施期间，侧袋账户份额将停止披露基金份额净值，并不得办理申购、赎回和转换，基金份额持有人可能面临无法及时获得侧袋账户对应部分的资金的流动性风险。基金管理人将按照持有人利益最大化原则，采取将特定资产予以处置变现等方式，及时向侧袋账户份额持有人支付对应款项，但因特定资产的变现时间具有不确定性，最终变现价格也具有不确定性并且有可能大幅低于启用侧袋机制时的特定资产的估值，基金份额持有人可能因此面临损失。

## （二）管理风险

基金的管理风险主要包括两个方面：一是在基金管理运作过程中，基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的占有以及对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平。另一方面，基金管理人和基金托管人的管理手段和管理技术等因素的变化也会影响基金收益水平。

基金的管理风险包括以下几种具体风险：

### （1）交易风险

由于交易权限或业务流程设置不当导致交易执行流程不畅通，交易指令的执行产生偏差或错误；或者由于故意或重大过失未能及时准确执行交易指令，事后也未能及时通知相关人员或部门；或者银行间债券市场交易对手未能履约导致基金利益的直接损失。

### （2）系统故障风险

当计算机系统、通信网络等技术保障系统出现异常情况，可能导致基金日常的申购赎回无法按正常时限完成、注册登记系统瘫痪、核算系统无法按正常时限产生净值、基金的投资交易指令无法及时传输等风险。

### （3）交易结算风险

在基金的投资交易中，因交易的对手方无法履行对一位或多位的交易对手的支付义务而使得基金在投资交易中蒙受损失的可能性。

### （4）会计核算风险

会计核算风险主要是指由于会计核算及会计管理上违规操作形成的风险或错误，通常是指基金管理人在计算、整理、制证、填单、登账、编表、保管及其相关业务处理中，由于客观原因与非主观故意所造成的行为过失，从而对基金收益造成影响的风险。

## （三）投资合规性风险

投资合规性风险是指因公司及员工违反法律法规、行业准则、职业操守和职业道德而可能引起法律制裁、重大财务损失或者声誉损失的风险，主要合规性风险包括如下具体风险：

#### （1）法律风险

法律风险是指基金管理人违反法律法规、基金合同从而给基金份额持有人利益带来损失的风险。

#### （2）道德风险

道德风险是指员工违背职业道德、法规和公司制度，通过内幕信息、利用工作程序中的漏洞或其他不法手段谋取不正当利益所带来的风险。

### （四）投资于存托凭证的风险

本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与存托凭证发行机制相关的风险，包括存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险；存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险；存托协议自动约束存托凭证持有人的风险；因多地上市造成存托凭证价格差异以及波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；存托凭证退市的风险；已在境外上市的基础证券发行人，在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险；境内外法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险。

### （五）其它风险

基金面临的其它风险包括因战争、自然灾害等不可抗力导致基金管理人、基金代销机构等无法正常工作，从而影响基金的申购、赎回按正常时限完成的风险。

## 二十、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本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。
- 2、变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案，并自中国证监会核准或出具无异议意见之日起生效。
- 3、但如因相应的法律法规发生变动并属于本基金合同必须遵照进行修改的情形，或者基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化或对基金份额持有人利益无实质性不利影响的，可不经基金份额持有人大会决议，而经基金管理人和基金托管人同意修改后公布，并报中国证监会备案。

### (二) 基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金管理人、基金托管人承接的；
- 3、法律法规和基金合同规定的其他情形。

基金合同终止后，基金管理人和基金托管人有权依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关法律法规的规定，行使请求给付报酬、从基金资产中获得补偿的权利。

### (三) 基金财产的清算

- 1、基金合同终止，应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。
- 2、基金财产清算组
  - (1) 自基金合同终止事由之日起 30 个工作日内由基金管理人组织成立基金财产清算组，在基金财产清算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。
  - (2) 基金财产清算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。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。
  - (3) 基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算组可以依法进行必要的民事活动。
- 3、清算程序

- (1) 基金合同终止情形发生后，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- (2) 基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；
- (3) 基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；
- (4) 对基金财产进行评估和变现；
- (5) 制作清算报告；
- (6) 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；
- (7) 将清算报告报中国证监会备案并公告；
- (8) 对基金财产进行分配。

#### 4、清算费用

清算费用是指基金财产清算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组优先从基金财产中支付。

#### 5、基金剩余财产的分配

基金财产按下列顺序清偿：

- (1) 支付清算费用；
- (2) 交纳所欠税款；
- (3) 清偿基金债务；
- (4) 按基金份额持有人持有的各类基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款(1)、(2)、(3)项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

#### 6、基金财产清算的公告

基金财产清算组做出的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，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。

#### 7、基金财产清算账册及文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 二十一、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

基金投资者购买本基金基金份额的行为即视为对基金合同的承认和接受，基金投资者自取得依据基金合同发行的基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同当事人。基金份额持有人作为当事人并不以在基金合同上书面签章为必要条件。除法律法规另有规定或基金合同另有约定外，同一类别每份基金份额具有同等的合法权益。

#### 1、基金份额持有人的权利

- 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；
- 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) 监督基金管理人投资运作；
- 8) 对基金管理人、基金托管人、基金份额发售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；
- 9) 法律法规、基金合同规定的其它权利。

10) 同类基金份额的每份基金份额具有同等的合法权益，A类、B类和C类基金份额由于基金费用不同所导致的基金份额净值的不同，基金收益分配的金额以及参与清算后的剩余基金财产分配的数量将可能有所不同。

#### 2、基金份额持有人的义务

- 1) 遵守基金合同；
- 2) 缴纳基金认购、申购款项及基金合同规定的费用；
- 3) 在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；
- 4) 不从事任何有损基金及其他基金份额持有人合法利益的活动；
- 5) 执行生效的基金份额持有人大会决定；
- 6) 法律法规及基金合同规定的其他义务。

#### 3、基金管理人的权利

- 1) 依法募集基金，办理基金备案手续；
- 2) 自基金合同生效之日起，基金管理人依照法律法规和基金合同独立管理基金财产；
- 3) 根据法律法规和基金合同的规定，制订、修改并公布有关基金募集、认购、申购、赎回、转托管、基金转换、非交易过户、冻结、收益分配等方面的业务规则；

- 4) 根据法律法规和基金合同的规定决定本基金的相关费率结构和收费方式，获得基金管理费，收取认购费、申购费、基金赎回手续费及其它事先批准或公告的合理费用以及法律法规规定的其它费用；
  - 5) 根据法律法规和基金合同之规定销售基金份额；
  - 6) 依据法律法规和基金合同的规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了法律法规或基金合同规定对基金财产、其它基金合同当事人的利益造成重大损失的，应及时呈报中国证监会和中国银保监会，以及采取其它必要措施以保护本基金及相关基金合同当事人的利益；
  - 7) 根据基金合同的规定选择适当的基金代销机构并有权依照代销协议对基金代销机构行为进行必要的监督和检查；
  - 8) 自行担任基金注册登记机构或选择、更换基金注册登记代理机构，办理基金注册登记业务，并按照基金合同规定对基金注册登记代理机构进行必要的监督和检查；
  - 9) 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回的申请；
  - 10) 在法律法规允许的前提下，为基金份额持有人的利益依法为基金进行融资；
  - 11) 依据法律法规和基金合同的规定，制订基金收益的分配方案；
  - 12) 按照法律法规，代表基金行使因投资于其它证券所产生的权利；
  - 13) 在基金托管人职责终止时，提名新的基金托管人；
  - 14) 依据法律法规和基金合同的规定，召集基金份额持有人大会；
  - 15) 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者实施其他法律行为；
  - 16) 选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构并确定有关费率；
  - 17) 法律法规、基金合同以及依据基金合同制订的其它法律文件所规定的其它权利。
- #### 4、基金管理人的义务
- 1) 依法募集基金，办理基金备案手续；
  - 2) 自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；
  - 3) 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运作基金财产；
  - 4) 配备足够的专业人员办理基金份额的认购、申购和赎回业务或委托其他机构代理该项业务；
  - 5) 配备足够的专业人员和相应的技术设施进行基金的注册登记或委托其他机构代理该项业务；
  - 6) 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资产相互独立，对所管理的不同基金分别管理、分别记账，进行证券投资；

- 7) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得以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；
- 8) 接受基金托管人依法进行的监督；
- 9) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回的方法符合基金合同等法律文件的规定，按照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；
- 10) 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；
- 11) 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，应予以保密，不得向他人泄露；
- 12) 按基金合同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；
- 13) 按照法律法规和本基金合同的规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回和分红款项；
- 14) 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；
- 15) 按规定保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- 16) 进行基金会计核算并编制基金的财务会计报告；
- 17) 确保需要向基金份额持有人提供的各项文件或资料，在规定时间内发出；保证投资人能够按照基金合同约定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并得到有关资料的复印件；
- 18) 组织并参加基金财产清算组，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、破产或者由接管人接管其资产时，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的合法权益，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- 21) 基金托管人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托管人追偿；
- 22) 不从事任何有损基金财产及本基金其他当事人利益的活动；
- 23) 公平对待所管理的不同基金，防止在不同基金间进行有损本基金份额持有人的利益及资源分配；
- 24) 以基金管理人的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；
- 25) 执行生效的基金份额持有人大会决定；
- 26) 法律法规及基金合同规定的其他义务。

## 5、基金托管人的权利

- 1) 依据法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产；
- 2) 依照基金合同的约定获得基金托管费；

- 3) 监督本基金的投资运作，如托管人发现基金管理人的投资指令违反基金合同或有关法律法规的规定的，不予执行并向中国证监会报告；
- 4) 在基金管理人职责终止时，提名新的基金管理人；
- 5) 依据法律法规和基金合同的规定召集基金份额持有人大会；
- 6) 依据法律法规和基金合同的规定监督基金管理人，如认为基金管理人违反了法律法规或基金合同规定对基金财产、其它基金合同当事人的利益造成重大损失的，应及时呈报中国证监会和中国银保监会，以及采取其它必要措施以保护本基金及相关基金合同当事人的利益；
- 7) 法律法规、基金合同规定的其它权利。

## 6、基金托管人的义务

- 1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则安全保管基金财产；
- 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资产以及不同的基金财产相互独立；对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名册登记、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》、本基金合同及其他有关规定外，不以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和证券账户；
- 7) 按照基金合同的约定，执行基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
- 8) 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应予以保密，不得向他人泄露；
- 9) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、各类基金份额净值及基金份额申购、赎回价格；
- 10) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
- 11) 对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度基金报告出具意见，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；如果基金管理人有未执行基金合同规定的行为，还应说明基金托管人是否采取了适当的措施；
- 12) 按规定保存有关基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料，保存基金的会计账册、报表和记录等 15 年以上；
- 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) 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会;
- 16) 按照规定监督基金管理人的投资运作;
- 17) 参加基金财产清算组，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、破产或者由接管人接管其资产时，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) 基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，基金托管人应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿;
- 20) 因违反基金合同导致基金财产的损失，应承担赔偿责任，其责任不因其退任而免除;
- 21) 不从事任何有损基金及基金其他当事人利益的活动;
- 22) 执行生效的基金份额持有人大会决定;
- 23) 法律、法规、本基金合同和依据本基金合同制定的其他法律文件所规定的其他义务。

## (二) 基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

- 1、本基金的基金份额持有人大会，由本基金的基金份额持有人（含基金份额持有人的合法授权人）组成。
- 2、有以下事由情形之一时，应召开基金份额持有人大会：
  - (1) 修改或终止基金合同，但基金合同另有约定的除外；
  - (2) 转换基金运作方式，但基金合同另有约定的除外；
  - (3) 更换基金托管人；
  - (4) 更换基金管理人；
  - (5) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准或提高销售服务费率，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；
  - (6) 本基金与其它基金的合并；
  - (7) 变更基金类别；
  - (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) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其它应当召开基金份额持有人大会的事项。
- 3、以下情况不需召开基金份额持有人大会：
  - (1) 调低基金管理费、基金托管费；

- (2) 在法律法规和基金合同规定的范围内变更本基金的申购费率、赎回费率或收费方式、调低销售服务费率、调整基金份额类别；
- (3) 因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改；
- (4) 对基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化；
- (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；
- (6) 除法律法规或基金合同规定应当召开基金份额持有人大会以外的其它情形。

#### 4、召集方式：

(1) 除法律法规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十日内决定是否召集，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六十日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当自行召集。

(3) 代表基金份额百分之十以上的基金份额持有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十日内决定是否召集，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六十日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额百分之十以上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十日内决定是否召集，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六十日内召开。

(4) 代表基金份额百分之十以上（含百分之十）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，而基金管理人、基金托管人都不召集的，代表基金份额百分之十以上（含百分之十）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前三十日报国务院证券监督管理机构备案。

(5) 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) 基金份额持有人大会的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

#### 5、通知

召开基金份额持有人大会，召集人应当于会议召开前 30 天，在中国证监会指定媒介公告通知。基金份额持有人大会不得就未经公告的事项进行表决。基金份额持有人大会通知将至少载明以下内容：

(1) 会议召开的时间、地点、方式；

- (2) 会议拟审议的主要事项;
- (3) 投票委托书的内容要求、送达时间和地点;
- (4) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续;
- (5) 会务常设联系人姓名、电话;
- (6) 权益登记日;
- (7) 如采用通讯表决方式，则载明具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表达意见的寄交和收取方式、投票表决的截止日以及表决票的送达地址等内容。

## 6、开会方式

(1) 基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会。现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席；通讯方式开会指按照基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。会议的召开方式由召集人确定，但决定基金管理人更换或基金托管人的更换、转换基金运作方式和终止基金合同意宜必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

(2) 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会议程：

- 1) 亲自出席会议者持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、本基金合同和会议通知的规定；
- 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，全部有效的基金份额不少于权益登记日基金总份额的 50%（含 50%）。

(3) 在符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

- 1) 召集人按基金合同规定公布会议通知后，在两个工作日内连续公布相关提示性公告；
- 2) 召集人按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见；
- 3) 本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额不少于权益登记日基金总份额的 50%（含 50%）；
- 4) 直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的其它代表，同时提交的持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定；
- 5) 会议通知公布前已报中国证监会备案。

(4) 采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则表明符合法律法规、基金合同和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决；表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

## 7、议事内容与程序

(1) 议事内容及提案权

- 1) 议事内容限为本条前述第 2 款规定的基金持有人大会召开事由范围内的事项。

2) 基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日本基金总份额 10%或以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案。

3) 对于基金份额持有人提交的提案，大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

a) 关联性。大会召集人对于基金份额持有人提案涉及事项与基金有直接关系，并且不超出法律法规和基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的，应提交大会审议；对于不符合上述要求的，不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会上进行解释和说明。

b) 程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题作出决定。如将其提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会作出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

4) 单独或合并持有权益登记日基金总份额 10%或以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，或基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获得基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于六个月。法律法规另有规定的除外。

5) 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

在现场开会的方式下，首先由召集人宣读提案，经讨论后进行表决，并经律师见证或公证员公证后形成大会决议，报经中国证监会核准或备案后生效；在通讯表决开会的方式下，首先由召集人提前 10 天公布提案，在所通知的表决截止日期第二个工作日在公证机构监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议，报经中国证监会核准或备案后生效。

## 8、表决

(1) 基金份额持有人所持每份基金份额享有平等的表决权。

(2) 基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

### 1) 特别决议

对于特别决议应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过。更换基金管理人或者基金托管人、转换基金运作方式或终止基金合同应当以特别决议通过方为有效。

### 2) 一般决议

对于一般决议应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的百分之五十以上（含百分之五十）通过。

(3) 基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

(4) 采取通讯方式进行表决时，符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决。

(5) 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。

#### 9、计票

##### (1) 现场开会

1) 基金份额持有人大会的主持人为召集人授权出席大会的代表，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中推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，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推举三名基金份额持有人担任监票人。

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) 如果会议主持人对于提交的表决结果有怀疑，可以对所投票数进行重新清点；如果会议主持人未进行重新清点，而出席会议的基金份额持有人或者基金份额持有人代理人对会议主持人宣布的表决结果有异议，其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点，会议主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

##### (2) 通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，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（如果基金托管人为召集人，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。

#### 10、实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定

若本基金实施侧袋机制，则相关基金份额或表决权的比例指主袋份额持有人和侧袋份额持有人分别持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例，但若相关基金份额持有人大会召集和审议事项不涉及侧袋账户的，则仅指主袋份额持有人持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例：

(1) 基金份额持有人行使提议权、召集权、提名权所需单独或合计代表相关基金份额 10% 以上（含 10%）；

(2) 现场开会的到会者在权益登记日代表的基金份额不少于本基金在权益登记日相关基金份额的二分之一（含二分之一）；

(3) 通讯开会的直接出具书面意见或授权他人代表出具书面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相关基金份额的二分之一（含二分之一）；

(4) 当参与基金份额持有人大会投票的基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日相关基金份额的二分之一，召集人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）相关基金份额的持有人参与或授权他人参与基金份额持有人大会投票；

(5) 现场开会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；

(6) 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；

(7) 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。

侧袋机制实施期间，基金份额持有人大会审议事项涉及主袋账户和侧袋账户的，应分别由主袋账户、侧袋账户的基金份额持有人进行表决，同一类别账户内的每份基金份额具有平等的表决权。表决事项未涉及侧袋账户的，侧袋账户份额无表决权。

侧袋机制实施期间，关于基金份额持有人大会的相关规定以本节特殊约定内容为准，本节没有规定的适用上文相关规定。

## 11、生效与公告

(1) 基金份额持有人大会按照投资基金法有关规定表决通过的事项，召集人应当自通过之日起五日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

(2) 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、基金托管人均有法律约束力。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定。

(3) 基金份额持有人大会决议应当自中国证监会核准或备案后 2 日内，由基金份额持有人大会召集人在中国证监会指定媒介公告。通讯方式表决的，应当将公证机关的名称、公证员的姓名和公证书全文一同公告。

## （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

### 1、基金合同的变更

(1) 涉及本基金合同第八条第（二）款第 2 项规定的事项，须变更基金合同的，应经基金份额持有人大会决议通过。

(2) 变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案，基金合同的变更自中国证监会核准或出具无异议意见之日起生效。

(3) 但如因基金合同第八条第（三）款规定的情形导致基金合同变更，可不经基金份额持有人大会决议，而经基金管理人和基金托管人同意修改后公布，并报中国证监会备案，基金合同的变更自公布之日起生效。

### 2、基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同终止：

- (1) 基金份额持有人大会决定终止;
- (2) 基金管理人、基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金管理人、基金托管人承接的;
- (3) 法律法规和基金合同规定的其他情形。

### 3、基金财产的清算

- (1) 基金合同终止，应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。
- (2) 基金财产清算组  
1) 自基金合同终止事由之日起三十个工作日内由基金管理人组织成立基金财产清算组，在基金财产清算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。  
2) 基金财产清算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。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。  
3) 基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算组可以依法进行必要的民事活动。

#### (3) 清算程序

- 1) 基金合同终止后，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- 2) 基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；
- 3) 基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；
- 4) 对基金财产进行评估和变现；
- 5) 基金财产清算组作出清算报告；
- 6) 会计师事务所对清算报告进行审计；
- 7) 律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- 8) 将基金清算结果报告中国证监会；
- 9) 公布基金清算公告；
- 10) 对基金财产进行分配。

#### (4) 清算费用

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

#### (5) 基金剩余财产的分配

基金财产清算后的全部剩余财产扣除基金财产清算费用后如有余额，按基金份额持有人持有的各类基金份额比例进行分配。

#### (6) 基金财产清算的公告

清算组成立后 2 日内应就清算组的成立进行公告；清算过程中的有关重大事项须及时

公告；基金财产清算组作出的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，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。

(7) 基金财产清算账册及文件由基金托管人保存十五年以上。

#### **(四) 争议解决方式**

- 1、本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。
- 2、本基金合同的当事人之间因本基金合同产生的或与本基金合同有关的争议可首先通过友好协商或调解解决。自一方书面要求协商解决争议之日起六十日内如果争议未能以协商或调解方式解决，则任何一方有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会上海分会，根据提交仲裁时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。
- 3、除争议所涉内容之外，本基金合同的其他部分应当由本基金合同当事人继续履行。

#### **(五) 基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式**

本基金合同正本一式六份，除上报有关监管机构一式二份外，基金管理人、基金托管人各持有二份，每份具有同等的法律效力。

基金合同可印制成册，存放在基金管理人和基金托管人住所，供投资人查阅，基金合同条款及内容应以基金合同正本为准。基金管理人和基金托管人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

## 二十二、基金托管协议的内容摘要

### (一) 托管协议当事人

#### 1、基金管理人（或简称“管理人”）

名称：华泰柏瑞基金管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号楼

17 层

法定代表人：贾波

成立时间：2004 年 11 月 18 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监基金字[2004]178 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：贰亿元人民币

存续期间：持续经营

经营范围：基金管理业务；发起设立基金；及中国证监会批准的其他业务

#### 2、基金托管人（或简称“托管人”）

名称：招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：李建红

成立时间：1987 年 4 月 8 日

批准设立机关：中国人民银行

批准设立文号：银复[1986]175 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币 252.20 亿元

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；办理结算；办理票据贴现；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；同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务。外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外币兑换；国际结算；结汇、

售汇；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营和代客外汇买卖；资信调查、咨询、见证业务；离岸金融业务。经中国人民银行批准的其他业务。

## （二）基金托管人与基金管理人之间的业务监督、核查

### 1、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

根据《基金法》及其他有关法规、《基金合同》和本协议，基金托管人对基金管理人的投资行为、净值计算、收益分配和业绩统计等行为的合法性、合规性进行业务监督和核查。

#### （1）基金托管人应对基金管理人的投资行为进行监督和核查

1) 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、投资对象进行监督的内容、标准和程序。

基金托管人应建立相关技术系统，对基金的投资范围和投资对象是否符合基金合同的规定进行监督。对基金管理人发送的不符合基金合同规定的投资行为，基金托管人可以拒绝执行，并书面通知基金管理人；对于已经执行的投资，基金托管人发现该投资行为不符合基金合同的规定的，基金托管人应书面通知基金管理人进行整改，并将该情况报告中国证监会。

2) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投融资比例进行监督的内容、标准和程序。

基金托管人应对基金的投资和融资比例是否符合基金合同的规定进行监督。基金托管人应自基金合同生效起，监督基金合同约定的基金投资资产配置比例、单一投资类别比例限制、融资限制、股票申购限制、基金投资比例是否符合法规规定，不符合规定的，基金托管人应书面通知基金管理人进行整改，整改的时限应符合法规允许的投资比例调整期限。对于因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等原因导致基金的投资不符合基金合同的约定的，基金托管人应书面通知基金管理人在 10 个工作日内进行调整以符合基金合同的约定，基金合同另有约定的除外。基金管理人在规定的调整时限内未完成整改的，基金托管人应书面报告中国证监会。

3) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资禁止行为进行监督的内容、标准和程序。

基金托管人应对基金的投资禁止行为进行监督。对基金管理人发送的属于投资禁止的投资行为，基金托管人可以拒绝执行，并书面通知基金管理人；对于已经执行的投资，基金托管人发现该投资行为属于投资禁止行为的，基金托管人应书面通知基金管理人进行整改，并将该情况报告中国证监会。

为配合对关联投资限制实施监督所采取的措施。基金管理人和基金托管人应在基金合同生效前以及关联方发生变化时，相互提供与本机构有控股关系的股东或与本机构有其他重大利害关系的公司名单。

4) 为控制基金参与银行间债券市场的信用风险，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的内容、标准和程序。

基金管理人应在基金合同生效前书面通知基金托管人与基金可进行交易的交易对手名单。在基金存续期间基金管理人可以调整交易对手名单，但应将调整结果至少提前一个工作日书面通知基金托管人。基金管理人应严格按照交易对手名单的范围在银行间交易市场选择交易对手。基金托管人按照交易对手名单监督基金在银行间的交易行为。基金管理人发送的银行间交易指令的交易对手不符合规定的，基金托管人可以拒绝执行，并书面通知基金管理人。

5) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人选择存款银行进行监督的内容、标准和程序。

为保证基金资产的安全性和流动性，基金活期存款存放在基金托管人处。

基金管理人应按年向基金托管人提供存款银行列表，基金托管人按照基金管理人提供的存款银行的列表办理定期存款、通知存款和协议存款等存款投资业务。基金管理人需与存款银行签定合作协议，约定各项权利和义务，并将基金存款存放在存款银行指定的分支机构。

基金托管人根据存款银行列表对基金投资银行存款的交易对手是否符合有关规定进行监督。对于不符合规定的银行存款，基金托管人可以拒绝执行，并书面通知基金管理人。

(2) 基金托管人应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。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、基金宣传推介材料中登载的基金业绩表现数据、基金定期报告和定期更新的招募说明书等公开披露的相关基金信息,应向基金管理人出具书面文件或者盖章确认。

(3) 基金托管人发现基金管理人的投资指令或实际投资运作违反《基金法》、基金合同、基金托管协议及其他有关规定时的处理方式和程序。

基金托管人发现基金管理人的投资指令或实际投资运作违反《基金法》、基金合同、基金托管协议及其他有关规定的，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，并以书面形式对基金托管人发出回函确认。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。基金托管人有义务要求基金管理人赔偿因其过失致使投资者遭受的损失。

基金托管人发现基金管理人有重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时以书面形式通知基金管理人限期纠正。

基金管理人有义务配合和协助基金托管人依照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规要求需向中国证监会报送基金监督报告的，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度。

(4) 当基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，根据最大限度保护基金份额持有人利益的原则，基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制，无需召开基金份额持有人大会审议。

侧袋机制的具体规则依照相关法律法规的规定和基金合同的约定执行。

## 2、基金管理人对基金托管人的业务核查

(1) 基金管理人对基金托管人的托管职责情况进行监督

根据《基金法》及其他有关法规、《基金合同》和本协议规定，基金管理人就基金托管人是否安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和各类基金份额净值、根据管理人指令办

理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

**(2) 基金管理人对基金托管人违反《基金法》、基金合同、基金托管协议及其他有关规定的处理方式和程序**

基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、基金合同、基金托管协议及其他有关规定的，基金管理人应立即以书面的方式要求基金托管人予以纠正并采取必要的补救措施。基金管理人有义务要求基金托管人赔偿基金因此所遭受的损失。

基金管理人发现基金托管人的行为违反《基金法》及其他有关法规、基金合同和本协议的规定，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正，基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金管理人发出回函。在限期内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正，基金托管人应提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复基金管理人并改正。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应报告中国证监会。

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

基金托管人有义务配合和协助基金管理人依照托管协议对基金业务执行核查。对基金管理人发出的书面提示，基金托管人提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，并在规定时间内答复基金管理人并改正。

### **(三) 基金财产的保管**

#### **1、基金资产保管的原则**

基金托管人依法持有基金资产，应安全保管所收到的基金的全部资产。基金资产应独立于基金管理人、基金托管人的自有资产。

基金托管人必须为基金设立独立的账户，与基金托管人的其他业务和其他基金的托管业务实行严格的分账管理。

基金托管人应安全、完整地保管基金资产；未经基金管理人的正当指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何资产。属于基金托管人实际有效控制下的实物证券在基金托管人保管期间的损坏、灭失，由此产生的责任应由基金托管人承担。

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托管人，到账日基金资产没有到达托管人处的，托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失。

对于基金申购、赎回过程中产生的应收资产，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，到账日基金资产没有到达托管人处的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失。

## 2、基金募集期满时募集资产的验证

基金募集期内的资金应存入基金管理人在银行开设的专用账户，任何人不得动用。基金募集期满十日内，由基金管理人聘请具有从事证券业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的 2 名以上（含 2 名）中国注册会计师签字有效。验资完成，基金管理人应将募集到的全部资金存入基金托管人以基金名义开立的银行账户中。基金托管人在收到资金当日出具基金资产接收报告。

若基金募集期限届满，未能达到基金合同生效的条件，由基金管理人按基金合同规定办理退款事宜。

## 3、基金的银行账户的开设和管理

基金托管人以基金的名义在其营业机构开设基金银行账户，保管基金的银行存款。该账户的开设和管理由基金托管人承担。本基金的一切货币收支活动，均需通过基金托管人的本基金银行账户进行。

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。

基金银行账户的管理应符合《银行账户管理办法》、《现金管理条例》、《中国人民银行利率管理的有关规定》、《关于大额现金支付管理的通知》、《支付结算办法》以及中国人民银行和中国证券监督管理机构的其他规定。

## 4、基金证券账户、资金交收账户的开设和管理

基金托管人以基金托管人和本基金联名的方式为本基金在中国证券登记结算有限公司开设证券账户。

基金证券账户的开立和使用，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出借和未经对方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。

基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司开立基金证券交易结算备付金账户，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，基金管理人应予积极协助。

## 5、债券托管账户的开设和管理

基金合同生效后，由基金管理人负责代基金向中国证监会、中国人民银行提出申请进入全国银行间同业拆借市场进行交易。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开立债券托管与结算账户，并代表基金进行银行间市场债券的结算，基金管理人予以配合并提供相关资料。

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回购主协议，基金托管人保管协议正本，基金管理人保存协议副本。

## 6、基金财产投资的有关实物证券、银行定期存款存单等有价凭证的保管

实物证券、银行定期存款存单等有价凭证由基金托管人存放于托管银行的保管库；也可存入登记结算机构的代保管库。保管凭证由基金托管人持有。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。托管人对由托管人以外机构实际有效控制的证券不承担责任。

## 7、与基金资产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同的原件分别由基金托管人、基金管理人保管，相关业务程序另有限制除外。对应由基金托管人保管的合同，基金管理人应在合同签署后及时以加密方式将合同传真给基金托管人，并在十个工作日内将正本送达基金托管人处。除本协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时应保证持有二份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。保管期限按照国家有关规定执行。

因基金托管人将自己保管的本基金重大合同在未经基金管理人同意的情况下，用于抵押、质押、担保或债权转让或作其他权利处分而造成基金资产损失，由基金托管人负责。

## （四）基金资产净值计算与复核

### 1、基金资产净值的计算和复核

（1）基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。各类基金份额净值是指计算日该类基金资产净值除以计算日该类基金份额总份额后的价值。

（2）基金管理人应每工作日对基金资产估值。用于基金信息披露的基金净值信息由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金净值信息加盖业务公章以书面形式发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核后，将复核结果加盖业务公章返回基金管理人，由基金管理人对基金净值信息予以公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

（3）如有确凿证据证明相关法规或基金合同规定的估值方法不能客观反映基金财产公允价值时，基金管理人可与基金托管人协商一致后，采用更为合理的估值方法，并在二个

工作日内公告确凿证据的证明、采用的估值方法和对持有人利益的影响。基金管理人和基金托管人无法达成一致，基金管理人单方面采用与相关法规或基金合同规定不符的估值方法，基金托管人免除因采用上述估值方法可能对基金或持有人产生的直接或间接损失的责任。基金管理人单方面采用与相关法规或基金合同规定不符的估值方法，应在二个工作日内公告确凿证据的证明、采用的估值方法、对持有人利益的影响和基金托管人的保留意见。

(4) 基金管理人和基金托管人应采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性和及时性。基金管理人和基金托管人发现基金估值原则、程序违反相关法律法规规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，并因上述基金估值影响达到该类基金份额净值0.25%时，基金管理人应当报中国证监会备案；当上述基金估值影响达到该类基金份额净值0.5%时，基金管理人应当公告，并同时报中国证监会备案，并与基金托管人一起采取合理的措施防止损失进一步扩大。

(5) 由于不可抗力导致的基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序以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，基金管理人和基金托管人应协商一致积极予以处理，并在定期报告中报告上述基金估值的变更原因和对持有人的影响。

## 2、基金会计核算

### (1) 基金账册的建立

基金管理人和基金托管人在基金合同生效后，应按照双方约定的同一记账方法和会计处理原则，分别独立地设置、登录和保管本基金的全套账册，对相关各方各自的账册定期进行核对，互相监督，以保证基金资产的安全。若双方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。

### (2) 会计数据和财务指标的核对

双方应每日核对账目，如发现双方的账目存在不符的，基金管理人和基金托管人必须及时查明原因并纠正，保证相关各方平行登录的账册记录完全相符。若当日核对不符，暂时无法查找到错账的原因而影响到基金净值信息的计算和公告的，以基金管理人的账册为准。

### (3) 基金财务报表和定期报告的编制和复核

基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。定期报告文件应按中国证监会公布的《公开募集证券投资基金管理信息披露管理办法》要求公告。季度报表的编制，应于季度结束之日起15个工作日内完成；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。中期报告在上半年结束之日起的两个月内公告；年度报告在每年结束之日起三个月内公告。

基金管理人应在季度结束之日起10个工作日内完成在季度报表编制，对报表加盖公章

后，以加密传真方式将有关报表提供基金托管人复核，基金托管人应在 5 个工作日内完成复核，并将复核结果及时书面通知基金管理人。基金管理人应上半年结束之日起 30 日内完成中期报告的编制，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到后 10 日内进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在每年结束之日起 50 日内完成年度报告的编制，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到后 15 日内复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人应在招募说明书的信息发生重大变更的三个工作日内，及时完成招募说明书（更新）的编制，并由基金托管人复核，基金托管人在收到后当日内进行复核，并将复核结果及时以书面或电子方式通知基金管理人，协助基金管理人在上述监管部门规定的时间内完成公告。

基金托管人在复核过程中，发现相关各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，调整以相关各方认可的账务处理方式为准。核对无误后，基金托管人在基金管理人提供的报告上加盖公章，相关各方各自留存一份。若双方无法达成一致，以基金管理人的帐务处理为准，并承担由此而产生的责任。如果基金管理人与基金托管人不能于应当发布公告之日之前就相关报表、文件达成一致，基金管理人有权按照其编制的报表对外发布公告，并由基金管理人承担相关责任，基金托管人有权就相关情况报中国证监会备案。

基金托管人在对中期报告或年报复核完毕后，需出具相应的复核确认书，以备有权机构对相关文件审核时提示。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。

## （五）基金份额持有人名册的登记与保管

基金管理人负责基金份额持有人名册的保管。

基金管理人应在十个工作日内采用电子数据表格的方式向基金托管人提供基金合同生效日、持有人大会登记日和基金清算登记日的持有人名册，持有人名册的内容包括但不限于持有人的名称和持有的基金份额。

基金托管人应妥善保管基金持有人名册，保管期限自取得持有人名册之日起 15 年。因基金托管人保管不善给基金份额持有人造成损失的，基金托管人应承担相应的责任。

## （六）适用法律和争议解决方式

相关各方当事人同意，因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议，应通过友好协商解决。经友好协商未能解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会上海分会，根据提交仲裁时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁裁决是终局性的并对相关各方均有约束力，仲裁

费用由败诉方承担。

争议处理期间，相关各方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责，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。

本协议受中国法律管辖。

## **(七) 托管协议的变更、终止与基金财产的清算**

### **1、基金托管协议的变更和终止**

(1) 本协议相关各方当事人经协商一致，可以对协议进行修改。修改后的新协议，其内容不得与基金合同的规定有任何冲突。修改后的新协议，报中国证监会核准后生效。

### **(2) 基金托管协议的终止情形**

- 1) 基金合同终止；
- 2) 因基金托管人解散、依法被撤销、破产或其他事由造成本基金更换基金托管人；
- 3) 因基金管理人解散、依法被撤销、破产或其他事由造成本基金更换基金管理人；
- 4) 发生《基金法》、《销售办法》、《运作办法》或其他法律法规规定的终止事项。

### **2、基金财产的清算**

(1) 基金合同终止，应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。

#### **(2) 基金财产清算组**

1) 自基金合同终止之日起 30 个工作日内基金管理人组织成立基金财产清算组，在基金财产清算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；

2) 基金财产清算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。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员；

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

#### **(3) 清算程序**

- 1) 基金合同终止后，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- 2) 基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；
- 3) 基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；
- 4) 对基金财产进行评估和变现；
- 5) 基金财产清算组作出清算报告；
- 6) 会计师事务所对清算报告进行审计；
- 7) 律师事务所对清算报告出具法律意见书；

- 8) 将基金财产清算结果报告中国证监会;
- 9) 公布基金财产清算公告;
- 10) 对基金财产进行分配。

(4) 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，清算费用由基金清算小组优先从基金财产中支付。

(5) 基金剩余财产的分配

基金财产清算后的全部剩余财产扣除基金财产清算费用后如有余额，按基金份额持有人持有的各类基金份额比例进行分配。

(6) 基金财产清算的公告

清算组做出的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，律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并在备案后的 5 个工作日内公告。

(7) 基金财产清算账册及文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 二十三、对基金份额持有人的服务

对基金份额持有人的服务主要由基金管理人、发售机构及销售机构提供，以下是基金管理人提供的主要服务内容。基金管理人根据基金份额持有人的需要和市场的变化，有权在符合法律法规的前提下，增加和修改相关服务项目。如因系统、第三方或不可抗力等原因，导致下述服务无法提供，基金管理人不承担任何责任。

### （一）网上开户及交易服务

机构投资者可通过基金管理人直销柜台，个人投资者可通过基金管理人网站或 APP 客户端办理开户、认购/申购、赎回及信息查询等业务。有关基金管理人电子直销具体规则请参见基金管理人网站相关公告和业务规则。

### （二）账户及信息查询服务

机构投资者通过基金管理人网站，个人投资者通过基金管理人网站、微信公众号或 APP 客户端，可享有基金交易查询、账户查询和基金管理人依法披露的各类基金信息等服务，包括基金产品基本信息（包括基金名称、管理人名称、基金代码、风险等级、持有份额、单位净值等）、基金的法律文件、基金公告、定期报告和基金管理人最新动态等各类资料。

### （三）账单及资讯服务

#### 1、对账单服务

基金管理人通过电子邮件形式向投资者定期发送交易电子邮件对账单（包括基金名称、基金代码、持有份额等基金保有情况信息），电子邮件地址不详及退订的除外。

#### 2、资讯服务

投资者知悉并同意基金管理人不定期通过电话、短信、邮件、微信等方式提供与投资者相关的账户服务通知、交易确认通知、重要公告通知、活动消息、营销信息等资讯服务。如需取消相应资讯服务，可按照相关指引退订，或通过基金管理人客户服务中心热线 400-888-0001、在线客服等人工服务方式退订。

### （四）客户服务中心电话及在线服务

#### 1、电话服务

投资人拨打基金管理人客户服务中心热线 400-888-0001 可享有如下服务：

- (1) 自助语音服务（7×24 小时）：提供基金净值信息、账户信息等自助查询服务。
- (2) 人工服务：提供交易日上午 9: 00-11: 30 下午 13: 00-17: 30 的人工服务。投资人可以通过该热线获得业务咨询、信息查询、服务投诉及建议、信息定制等专项服务。

## 2、在线服务

投资人通过基金管理人网站、微信公众号或 APP 客户端提供交易日上午 9: 00-11: 30  
下午 13: 00-17: 30 的在线服务人工服务。投资人可通过该方式获得业务咨询、信息查  
询、服务投诉及建议、信息定制等专项服务。

## （五）投诉及建议受理服务

投资人可以通过基金管理人客户服务中心人工热线、在线客服、书信、电子邮件、短  
信及各销售机构网点柜台等不同的渠道对基金管理人和销售网点所提供的服务进行投诉或  
提出建议。

## （六）联系基金管理人

- 1、网址: [www.huatai-pb.com](http://www.huatai-pb.com)
- 2、客服邮箱: cs4008880001@huatai-pb.com
- 3、客服热线: 400-888-0001 (免长途话费), 或 021-38784638
- 4、传真: 021-50103016
- 5、联系地址: 中国 (上海) 自由贸易试验区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号  
17 层

（七）如本招募说明书存在任何您/贵机构无法理解的内容, 请及时通过上述方式联系  
基金管理人。请确保投资前, 您/贵机构已经全面理解本招募说明书, 并同意全部内容。

## 二十四、其他应披露事项

本基金及基金管理人的有关公告（自 2024 年 06 月 28 日至 2025 年 06 月 27 日），下列公告在指定媒介披露：

公告名称	披露日期
华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金持有停牌证券估值调整的提示性公告	2025-06-04
华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止民商基金销售(上海)有限公司办理旗下基金相关业务公告	2025-05-24
华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金参加中国邮政储蓄银行股份有限公司费率优惠活动的公告	2025-05-14
华泰柏瑞基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	2025-05-10
华泰柏瑞基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	2025-05-01
华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	2025-04-22
华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金 2024 年年度报告	2025-03-31
华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金分红公告	2025-03-21
华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金暂停申购(含转换转入、定期定额投资)业务的公告	2025-03-20
华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金 2024 年第 4 季度报告	2025-01-22
华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金的销售机构由北京中植基金销售有限公司变更为华源证券股份有限公司的公告	2024-12-19
华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止乾道基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	2024-11-18
华泰柏瑞基金管理有限公司旗下部分基金改聘会计师事务所公告	2024-11-02
华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金 2024 年第 3 季度报告	2024-10-25
华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金持有停牌证券估值调整的提示性公告	2024-09-27
华泰柏瑞基金管理有限公司关于暂停海银基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	2024-09-19
华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止深圳前海财厚基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	2024-09-04
华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金 2024 年中期报告	2024-08-31
华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止中民财富基金销售（上海）有限公司办理旗下基金相关业务公告	2024-08-16
华泰柏瑞基金管理有限公司关于停牌股票估值调整情况的公告	2024-07-24
华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金参加招商证券股份有限公司费率优惠活动的公告	2024-07-19
华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金 2024 年第 2 季度报告	2024-07-19
华泰柏瑞基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	2024-07-13
华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型基金更新的招募说明书 2024 年第 2 号	2024-07-13

华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止喜鹊财富基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	2024-07-06
华泰柏瑞基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	2024-07-03
华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金（A类份额）基金产品资料概要更新	2024-06-28
华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金（B类份额）基金产品资料概要更新	2024-06-28
华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金（C类份额）基金产品资料概要更新	2024-06-28

## 二十五、招募说明书存放及查阅方式

本招募说明书存放在基金管理人、基金托管人及基金代销机构住所，投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。基金管理人和基金托管人保证其所提供的文本的内容与所公告的内容完全一致。

## 二十六、备查文件

- (一) 中国证监会核准本基金合同生效的文件;
- (二) 《华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金基金合同》;
- (三) 《华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金托管协议》;
- (四) 法律意见书;
- (五) 基金管理人业务资格批件、营业执照;
- (六) 基金托管人业务资格批件、营业执照;
- (七) 中国证监会要求的其他文件。

备查文件存放地点为基金管理人、基金托管人的住所；投资者如需了解详细的信息，可在营业时间前往相应场所免费查阅，也可按工本费购买复印件。

华泰柏瑞基金管理有限公司

二〇二五年十二月二十日