

# 华泰紫金丰益中短债债券型发起式证券投资基金招募说明书（更新）

基金管理人：华泰证券（上海）资产管理有限公司

基金托管人：江苏银行股份有限公司

二〇二六年八月

## 【重要提示】

1、本基金根据 2019 年 3 月 19 日中国证券监督管理委员会《关于准予华泰紫金丰益中短债债券型发起式证券投资基金注册的批复》（证监许可[2019]430 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。

3、本基金募集的目标客户为符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、合格境外投资者、发起资金提供方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。

4、投资有风险，投资人认购（或申购）基金时应认真阅读基金合同、本招募说明书等信息披露文件，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。投资人需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险。投资本基金可能遇到的风险包括：证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等因素导致的市场风险；基金管理人在基金运作过程中产生的管理风险；流动性风险；基金管理或运作因违反法律、法规的规定或基金合同的约定导致的合规性风险；本基金特有的风险；投资本基金的其他风险等等。此外，本基金以 1 元初始面值进行募集，在市场波动等因素的影响下，存在基金份额净值跌破 1 元初始面值的风险。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。

5、本基金可投资于资产支持证券，资产支持证券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。

6、本基金的业绩比较基准为中债总财富（1-3 年）指数收益率\*80%+一年期定期存款利率(税后)\*20%，但本基金的收益水平有可能不能达到或超过同期的目标收益率水平，投资人面临获得低于目标收益率甚至亏损的风险。

7、基金不同于银行储蓄与债券，基金投资人有可能获得较高的收益，也有可能损失本金。投资有风险，投资人在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的招募说明书及《基金合同》。

8、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并不构成新基金业绩表现的保证。

9、基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行负责。

10、本基金单一投资者持有基金份额数不得超过基金份额总数的 50%，但在本基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动超过前述 50%比例的除外。基金管理人使用固有资金、公司高级管理人员及基金经理等人员出资认购的基金份额超过基金总份额 50%的，不受前款规定的限制。

11、基金管理人根据投资者适当性管理办法，对投资者进行分类。投资者应当如实提供个人信息及证明材料，并对所提供的信息和证明材料的真实性、准确性、完整性负责。投资者应知晓并确认当个人信息发生重要变化、可能影响投资者分类和适当性匹配的，应及时主动进行更新。

12、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，具体详见基金合同和本招募说明书的有关章节。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，投资者不得办理侧袋账户份额的申购赎回等业务。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。

本招募说明书所载内容截止日为 2026 年 6 月 30 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2026 年 6 月 30 日（财务数据未经审计）。

## 目 录

|                               |     |
|-------------------------------|-----|
| 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.....               | 19  |
| 第五部分 相关服务机构.....              | 22  |
| 第六部分 基金的募集.....               | 24  |
| 第七部分 基金合同的生效.....             | 25  |
| 第八部分 基金份额的申购与赎回.....          | 26  |
| 第九部分 基金的投资.....               | 36  |
| 第十部分 基金的业绩.....               | 46  |
| 第十一部分 基金的财产.....              | 48  |
| 第十二部分 基金资产的估值.....            | 49  |
| 第十三部分 基金的收益分配.....            | 55  |
| 第十四部分 基金的费用与税收.....           | 57  |
| 第十五部分 基金的会计与审计.....           | 59  |
| 第十六部分 基金的信息披露.....            | 60  |
| 第十七部分 侧袋机制.....               | 66  |
| 第十八部分 风险揭示.....               | 70  |
| 第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算..... | 74  |
| 第二十部分 基金合同的内容摘要.....          | 76  |
| 第二十一部分 基金托管协议的内容摘要.....       | 91  |
| 第二十二部分 其他应披露事项.....           | 107 |
| 第二十三部分 对基金份额持有人的服务.....       | 109 |
| 第二十四部分 招募说明书的存放及查阅方式.....     | 110 |
| 第二十五部分 备查文件.....              | 111 |

## 第一部分 绪言

《华泰紫金丰益中短债债券型发起式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》”）、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》（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》”）以及《华泰紫金丰益中短债债券型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”或《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、误导性陈述或重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。

华泰紫金丰益中短债债券型发起式证券投资基金（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，并经中国证券监督管理委员会（以下简称“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、义务关系的法律文件。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。

## 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：

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：指华泰紫金丰益中短债债券型发起式证券投资基金。

2、基金管理人：指华泰证券（上海）资产管理有限公司。

3、基金托管人：指江苏银行股份有限公司。

4、基金合同：指《华泰紫金丰益中短债债券型发起式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《华泰紫金丰益中短债债券型发起式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、招募说明书或本招募说明书：指《华泰紫金丰益中短债债券型发起式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《华泰紫金丰益中短债债券型发起式证券投资基金基金份额发售公告》。

8、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。

9、《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。

10、《销售办法》：指中国证监会2020年8月28日颁布、同年10月1日实施的《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订。

11、《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。

12、《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。

13、《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。

14、中国证监会：指中国证券监督管理委员会。

15、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或国家金融监督管理总局。

16、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。

17、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。

18、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。

19、合格境外投资者：指符合《合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者境内证券期货投资管理办法》及相关法律法规规定使用来自境外的资金进行境内证券期货投资的境外机构投资者，包括合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者。

20、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。

21、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。

22、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。

23、销售机构：指华泰证券（上海）资产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。

24、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。

25、登记机构：指办理登记业务的机构。基金的登记机构为华泰证券（上海）资产管理有限公司或接受华泰证券（上海）资产管理有限公司委托代为办理登记业务的机构。

26、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。

27、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。

28、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。

29、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。

30、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。

31、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限。

32、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日。

33、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。

34、T+n日：指自T日起第n个工作日(不包含T日)。

35、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。

36、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。

37、《业务规则》：指华泰证券（上海）资产管理有限公司相关业务规则，是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金方面的业务规则，由基金管理人和投资人共同遵守。

38、认购：指在基金募集期内，投资人申请购买基金份额的行为。

39、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。

40、赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为。

41、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。

42、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。

43、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。

44、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%。

45、基金份额类别：指根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同将基金份额分为不同的类别，各基金份额类别代码不同，基金份额净值和基金份额累计净值或有不同。

46、A类基金份额：指投资人在认购/申购基金时收取认购/申购费，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费，并在赎回时根据持有期限收取



赎回费用的基金份额。

47、C类基金份额：指投资人在认购/申购基金时不收取认购/申购费，而是从本类别基金资产中计提销售服务费，并在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额。

48、元：指人民币元。

49、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。

50、基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券及票据价值、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和。

51、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值。

52、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。

53、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。

54、发起资金：指基金管理人股东、基金管理人、基金管理人高级管理人员或者基金经理等人员参与认购的资金。发起资金认购本基金的金额不低于 1000 万元，且发起资金认购的基金份额持有期限不低于三年。

55、发起资金提供方：指以发起资金认购本基金且承诺发起资金认购的基金份额持有期限不少于三年的基金管理人股东、基金管理人、基金管理人高级管理人员或者基金经理等人员。

56、规定媒介：指符合中国证监会规定条件的用以进行信息披露的全国性报刊及《信息披露办法》规定的互联网网站（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。

57、销售服务费：指从基金财产中计提的，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。

58、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。

59、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，确保投资人的合法权益不受损害并得到公平对待。

60、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一个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。

61、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。

62、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。

63、基金产品资料概要：指《华泰紫金丰益中短债债券型发起式证券投资基金基金产品资料概要》及其更新。

### 第三部分 基金管理人

名称：华泰证券（上海）资产管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区基隆路6号1222室

办公地址：上海市浦东新区东方路18号保利广场E座21楼

法定代表人：江晓阳

成立时间：2014年10月16日

注册资本：26亿元人民币

存续期间：持续经营

联系人：周维佳

联系电话：4008895597

华泰证券（上海）资产管理有限公司是经中国证监会证监许可〔2014〕679号文批准，由华泰证券股份有限公司设立的全资资产管理子公司；公司经中国证监会证监许可〔2016〕1682号文批准，获得公开募集证券投资基金管理业务资格。2014年10月成立时，注册资本3亿元人民币。2015年10月增加注册资本至10亿元人民币。2016年7月增加注册资本至26亿元人民币。

#### 二、主要成员情况

##### 1、基金管理人董事会成员

江晓阳先生，董事长，毕业于河海大学技术经济及管理专业，获硕士学历。曾任华泰证券资产管理总部高级经理、证券投资部投资策划员、金融创新部投资策划员、广州体育东路证券营业部副总经理、北京月坛南街证券营业部总经理、金融创新部总经理、证券投资部总经理。2024年1月加入华泰证券（上海）资产管理有限公司，现任华泰证券（上海）资产管理有限公司董事长。

朱前女士，董事，毕业于复旦大学经济学院世界经济专业，获硕士学位。曾在东方证券有限责任公司、富通基金管理公司、海富通基金管理有限公司任职，曾任中国国际金融有限公司资产管理部机构事业部负责人、执行总经理。2015年3月加入华泰证券（上海）资产管理有限公司，现任华泰证券（上海）资产管理有限公司总经理。

陈天翔先生，董事，毕业于武汉理工大学通信工程专业，获学士学位。曾任东方通信股份有限公司工程师、南京欣网视讯科技股份有限公司项目经理。2007年加入华泰证券，曾任网络金融部总经理，现任华泰证券股份有限公司执行委员会委员。

焦晓宁女士，董事，毕业于美国乔治华盛顿大学会计学专业，获硕士学位。曾任财政部会

计司调研员、证监会会计部副主任，2020年1月加入华泰证券，现任华泰证券股份有限公司执行委员会委员、首席财务官。

王玲女士，董事，毕业于东南大学计算机应用技术专业，获硕士学位。曾任南京电信管理信息中心技术工程师、南京欣网视讯经理、江苏天智互联科技有限公司职员，2007年加入华泰证券，现任华泰证券股份有限公司信息技术部联席负责人、用户增长与平台运营部总经理，兼任华泰创新投资有限公司董事、华泰联合证券有限责任公司董事。

王宇捷先生，董事，毕业于法兰克福财经管理大学国际商务专业及银行管理专业，获硕士学位。2013年加入华泰证券，曾任嘉兴纺工路证券营业部总经理、杭州解放东路证券营业部总经理、泰州分公司总经理，现任华泰证券执行委员会委员，兼任华泰证券北京分公司总经理。

罗新宇先生，男，本科学历，硕士学位，曾任湖南省邵东市委宣传部记者、中国青年报记者、新华社上海分社记者、上海联合产权交易所会员部总经理，后进入上海国盛集团历任集团董事会办公室副主任、战略委副主任、董事会战略与投资决策委员会副主任，现任上海国有资产运营研究院有限公司担任院长职务。2022年12月起兼任华泰证券（上海）资产管理有限公司独立董事。

王颖千女士，女，本科学历，曾在中国工商银行北京分行历任项目信贷处科长，公司业务部高级客户经理、副总经理，在交通银行北京分行历任公司业务部副高级经理兼集团大客户部高级经理、行长助理、副行长、高级督察，并曾兼任交银金融租赁有限责任公司董事，后在万瑞联合国际融资租赁有限公司任监事，在仁瑞投资控股有限公司（现香港潮商集团有限公司）任执行董事，现任国华集团控股有限公司董事局主席、执行董事。2022年12月起兼任华泰证券（上海）资产管理有限公司独立董事。

张俊杰先生，男，博士研究生学历，曾在美国加州大学圣地亚哥分校全球政策与战略学院历任环境经济学助理教授、环境经济学副教授，2016年7月至今在美国杜克大学尼古拉斯环境学院任环境经济学教授，在昆山杜克大学任环境研究中心主任、环境政策硕士项目主任、可持续投资项目主任等职务。2022年12月起兼任华泰证券（上海）资产管理有限公司独立董事。

曾庆生先生，男，博士研究生学历，曾在上海交通大学安泰经济与管理学院历任讲师、副教授，2010年3月至今在上海财经大学会计学院任副教授，教授，现任上海财经大学会计学院副院长兼任高级会计审计学院副院长、讲席教授、博士生导师。同时，目前兼任全国审计专业教育联盟首届理事会副理事长、中国金融会计学会理事、上海市会计学会理事、海通恒信国际融资租赁股份有限公司独立董事、江苏恒瑞医药股份有限公司独立董事，2025年12月起兼任华泰证券（上海）资产管理有限公司独立董事。

贺香彬女士，女，职工董事，毕业于南京大学行政管理专业，硕士学位。2011年7月至2015年8月，曾在南京紫金投资集团有限责任公司任职。2015年9月进入华泰证券（上海）资产管理有限公司工作。现任华泰证券（上海）资产管理有限公司工会主席、战略发展部（资管）总经理。2025年12月起兼任华泰证券（上海）资产管理有限公司职工董事。

## 2、高级管理人员

朱前女士，总经理。（简历请参照上述董事会成员介绍）

刘博文先生，合规总监、督察长、首席风险官、董事会秘书，毕业于天津大学管理科学与工程专业，获硕士学位。曾任华泰证券股份有限公司资产管理总部产品团队负责人，2015年加入华泰证券（上海）资产管理有限公司，现任华泰证券（上海）资产管理有限公司合规总监、督察长、首席风险官、董事会秘书。

司晓彬先生，副总经理，毕业于北京大学教育经济与管理专业，获博士学位。曾在中国建银投资证券、中国中投证券、中国民族证券等机构任职。2016年2月进入华泰证券（上海）资产管理有限公司，现任华泰证券（上海）资产管理有限公司副总经理、不动产基金部总经理。

张艳女士，首席信息官，毕业于东南大学计算机系统结构专业，获硕士学位。曾任华泰证券股份有限公司信息技术部机构产品中心负责人。2022年加入华泰证券（上海）资产管理有限公司，现任华泰证券（上海）资产管理有限公司首席信息官。

## 3、基金经理

### （1）现任基金经理

陈利女士，具有基金从业资格，上海财经大学数量经济学硕士，曾任职于德邦证券、德邦基金从事固定收益相关工作。2017年1月加入华泰证券（上海）资产管理有限公司，现担任基金经理。

陈利女士管理基金情况：

| 基金名称                               | 任职日期       | 离任日期       |
|------------------------------------|------------|------------|
| 华泰紫金天天金交易型货币市场基金                   | 2018-05-22 | —          |
| 华泰紫金添鑫 30 天滚动持有中短债债券型发起式证券投资基金     | 2022-07-11 | —          |
| 华泰紫金中债-同业存单 AAA 指数 7 天持有期发起式证券投资基金 | 2024-07-31 | —          |
| 华泰紫金丰益中短债债券型发起式证券投资基金              | 2025-12-10 | —          |
| 华泰紫金零钱宝货币市场基金                      | 2019-07-02 | 2022-03-16 |
| 华泰紫金周周购 12 个月滚动持有债券型发起式证券投资基金      | 2020-08-05 | 2024-08-27 |
| 华泰紫金丰安 27 个月定期开放债券型发起式证券投资基金       | 2020-11-19 | 2024-09-27 |
| 华泰紫金周周购 6 个月滚动持有债券型发起式证券投资基金       | 2022-03-28 | 2024-09-27 |

### （2）历任基金经理

| 基金经理 | 任职日期       | 离任日期       |
|------|------------|------------|
| 肖芳芳  | 2023-08-31 | 2026-05-11 |
| 赵骥   | 2021-07-30 | 2025-04-02 |
| 杨义山  | 2019-11-06 | 2021-07-30 |
| 阮毅   | 2019-09-19 | 2021-07-29 |
| 陈晨   | 2019-09-06 | 2021-05-10 |

#### 4、公募基金投资决策委员会

主席：朱前（总经理）

成员：查晓磊（权益投资总监、权益公募投资部总经理）、赵骥（固定收益投资总监、固收公募投资部总经理）、郑武（研究中心总经理(权益)）、谢秋平（研究中心总经理(固收)）、王曦（多资产公募投资部总经理）、李国庆（交易部总经理）

5、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，向审计、法律等外部专业顾问提供的情况除外；

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不低于法律法规规定的最低期限；

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、内部控制制度概述**

为保障公司及其所开展的资产管理业务规范运作，有效防范、规避和化解各类风险，最大限度地保护利益相关者及公司的合法权益，本基金管理人建立了科学合理、控制严密、运行高效的内部控制制度。 内部控制制度是对公司章程规定的内控原则的细化和展开，是公司各项



基本管理制度的纲要和总揽，贯穿公司运营的所有环节，其内容包括公司内控目标、内控原则、控制环境、内控措施等。

## 2、内部控制目标

（1）确保公司经营运作严格遵守国家有关法律、法规和行业监管规则，自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念。

（2）防范和化解经营风险，提高经营管理效益，实现公司资产管理业务的持续、稳定、健康发展。

（3）建立行之有效的风险控制系统，保障公司资产及客户资产的安全完整，维护公司股东的合法权益，并最大限度地保护投资人的合法权益。

（4）确保公司业务记录、财务信息和其它信息真实、准确、完整、及时。

（5）保证公司内部规章制度的贯彻执行，提高公司经营效益。

## 3、内部控制原则

（1）健全性原则。内部控制机制应当做到事前、事中、事后控制相统一；覆盖公司各个部门和各级岗位，渗透到决策、执行、监督、反馈等各个环节。

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

（3）独立性原则。公司各部门和岗位职责应当保持相对独立，公司对受托资产、自有资产、其他资产的管理运作必须分离；公司设立合规稽核部和风险管理部，分别承担内部控制监督检查职能和对各部门、岗位进行流程监控、风险管理职能。

（4）相互制约原则。内部部门和岗位的设置必须权责分明、相互制衡；前台业务运作与后台管理支持适当分离。

（5）成本效益原则。公司内部控制与公司业务范围、经营规模、风险状况相适应，运用科学化的经营管理方法，以合理的成本实现内部控制目标。

## 4、控制环境

内部控制环境主要包括公司所有权结构、经营理念与风险意识、治理结构、组织架构与决策程序、内部控制体系、员工的诚信和道德价值观、人力资源政策等。

## 5、内控措施

公司建立科学严密的风险控制评估体系，通过定期与不定期风险评估，对公司内外部风险进行识别、评估和分析，发现风险来源和类型，针对不同的风险由相关部门提出相应的风险控制方案，及时防范和化解风险。控制活动主要包括：授权控制、内幕交易控制、关联交易控制

和法律风险控制等。 内部控制的主要内容包括：市场开发业务控制、投资管理业务控制、信息披露控制、信息技术系统控制、会计系统控制和人力资源控制等。

## 第四部分 基金托管人

### 一、基金托管人情况

#### （一）基本情况

名称：江苏银行股份有限公司（简称“江苏银行”）

住所：江苏省南京市中华路 26 号

办公地址：江苏省南京市中华路 26 号

法定代表人：袁军

成立时间：2007 年 1 月 22 日

组织形式：股份有限公司（上市）

注册资本：1835132.4463 万元整

存续期间：持续经营

基金托管业务批准文号：证监许可〔2014〕619 号

联系人：杨宁

电话：025-58587833

#### （二）主要人员情况

江苏银行托管业务条线现有员工近 100 名，来自于基金、券商、托管行等不同的行业，具有会计、金融、法律、IT 等不同的专业知识背景，团队成员具有较高的专业知识水平、良好的服务意识、科学严谨的态度；部门管理层有 20 年以上金融从业经验，精通国内外证券市场的运作。

#### （三）基金托管业务经营情况

2014 年，江苏银行先后获得基金托管业务资格及保险资金托管业务资格。江苏银行依靠严密科学的风险管理和内部控制体系以及先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务。目前江苏银行的托管业务产品线已涵盖公募基金、信托计划、基金专户、基金子公司专项资管计划、券商资管计划、产业基金、私募投资基金、QDII、QFII 专户资产等。江苏银行将在现有的基础上开拓创新继续完善各类托管产品线。江苏银行同时可以为各类客户提供现金管理、绩效评估、风险管理等个性化的托管增值服务。

### 二、基金托管人的内部控制制度

#### 1、内部风险控制目标

（1）确保有关法律法规在托管业务中得到全面严格的贯彻执行；

（2）确保我行有关托管的各项管理制度和业务操作规程在托管业务中得到全面严格的贯彻执行；

（3）确保资产安全，保证托管业务稳健运行。

2、内部风险控制组织结构 由江苏银行内审部和资产托管部内设的监察稽核人员构成。资产托管部内部设置专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，对业务的运行独立行使稽核监察职权。

### 3、内部风险控制原则

（1）全面性原则。“实行全员、全程风险控制方法”，内部控制必须渗透到托管业务的各个环节，覆盖所有的岗位，不能留有任何死角。

（2）预防性原则。必须树立“预防为主”的管理理念，以业务岗位为主体，从风险发生的源头加强内部控制，防患于未然，尽量避免业务操作中各种问题的产生。

（3）及时性原则。各团队要及时建立健全各项规章制度，采取有效措施加强内部控制。发现问题，要及时处理，堵塞漏洞。

（4）独立性原则。托管业务内部控制机构必须独立于托管业务执行机构，业务操作人员和检查人员必须分开，以保证内控机构的工作不受干扰。

## 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

### 1、监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。利用投资监督系统，严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督，并定期编写基金投资运作监督报告，报送中国证监会。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，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开支情况进行检查监督。

### 2、监督流程

（1）每工作日按时通过基金监督子系统，对各基金投资运作比例控制指标进行例行监控，发现投资比例超标等异常情况，向基金管理人发出书面通知，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，并及时报告中国证监会。

（2）收到基金管理人的划款指令后，对涉及各基金的投资范围、投资对象及交易对手等内容进行合法合规性监督。

（3）根据基金投资运作监督情况，定期编写基金投资运作监督报告，对各基金投资运作的合法合规性、投资独立性和风格显著性等方面进行评价，报送中国证监会。

（4）通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求基金管理人进行解释或举证，并及时报告中国证监会。

## 第五部分 相关服务机构

### 一、基金份额发售机构

#### 1、直销机构

名称：华泰证券（上海）资产管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区基隆路6号1222室

办公地址：上海市浦东新区东方路18号21楼

法定代表人：江晓阳

电话：（025）83387046

传真：（025）83387074

联系人：孙晶晶

#### 2、非直销销售机构

本基金的非直销销售机构请详见基金管理人官网公示的销售机构信息表。

3、基金管理人可根据有关法律法规，变更、增减本基金的销售机构，并在基金管理人网站公示。

### 二、登记机构

名称：华泰证券（上海）资产管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区基隆路6号1222室

办公地址：上海市浦东新区东方路18号21楼

法定代表人：江晓阳

电话：4008895597

传真：（021）28972120

联系人：白海燕

### 三、出具法律意见书的律师事务所

名称：上海源泰律师事务所

住所：上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦14楼

办公地址：上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦14楼

负责人：廖海

电话：021-51150298

传真：021-51150398

联系人：刘佳

经办律师：刘佳、黄丽华

#### **四、审计基金财产的会计师事务所**

名称：德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：上海市黄浦区延安东路 222 号 30 楼

办公地址：上海市黄浦区延安东路 222 号 30 楼

执行事务合伙人：付建超

联系电话：021-61412068

传真电话：021-63350177

经办注册会计师：胡小骏、季潇然

联系人：胡小骏

## 第六部分 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 2019 年 3 月 19 日证监许可[2019]430 号注册募集。

募集期自 2019 年 9 月 2 日至 2019 年 9 月 3 日，共募集 933,043,725.24 份基金份额，利息结转的份额为 62,478.61，合计份额 932,981,246.63 份，募集户数为 8242 户。

本基金为契约型开放式基金，基金存续期限为不定期。



## 第七部分 基金合同的生效

### 一、基金合同的生效

本基金合同已于 2019 年 9 月 6 日正式生效。自基金合同生效日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

### 二、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

基金合同生效之日起三年后的对应日，若基金资产净值低于二亿元，基金合同自动终止，且不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定。

《基金合同》生效三年后持续存续的，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，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。

法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

## 第八部分 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。具体的销售网点由基金管理人在本招募说明书“第五部分 相关服务机构”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。

若基金管理人或其指定的销售机构开通电话、传真或网上等交易方式，投资人可以通过上述方式进行申购与赎回。

### 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》的有关规定在规定媒介上公告。

#### 2、申购、赎回开始日及业务办理时间

基金管理人自基金合同生效之日起不超过3个月开始办理申购，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。

基金管理人自基金合同生效之日起不超过3个月开始办理赎回，具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。

在确定申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告申购与赎回的开始时间。

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、赎回价格为下一开放日基金份额申购、赎回的价格。

### 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各类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；

6、当本基金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，摆动定价机制的相关原理与操作方法遵循相关法律法规及监管部门、自律组织的规定，具体请参见招募说明书或相关公告。

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》的有关规定在规定媒介上公告。

#### 四、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，投资人交付申购款项，申购成立；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；登记机构确认赎回时，赎回生效。

投资者赎回（T日）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。如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它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，则赎回款项的支付时间可相应顺延。在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。

##### 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，投资人可在T+2日后（包括该日）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，则申购款项退还给投资人。

销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表该申请一定生效，而仅代表销售机构已经接收到申购、赎回申请。申购与赎回的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资人应及时查询。因投资者怠于查询，致使其相关权益受损的，基金管理人、基金托管人、基

金销售机构不承担由此造成的损失或不利后果。

基金管理人可以在不违反法律法规的前提下，对上述业务办理时间进行调整，并提前公告。

## 五、申购与赎回的数额限制

1、投资者通过管理人网上交易系统每个基金账户首次申购的最低金额为人民币 1 元（含申购费），追加申购单笔最低金额 1 元；通过本基金管理人直销柜台申购，单个基金账户的首次最低申购金额为 1 万元（含申购费），追加申购单笔最低金额为 1000 元（含申购费）。

2、每个交易账户最低持有基金份额余额为 1.00 份。

3、本基金目前不对单个投资人累计持有份额设上限限制。

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。具体见基金管理人相关公告。

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前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告并报中国证监会备案。

## 六、申购和赎回的价格、费用及其用途

### 1、申购费

本基金 A 类基金份额在投资者申购时收取申购费，C 类基金份额在申购时不收取申购费。

本基金份额的申购费率如下表所示：

| 申购金额（M）            | A 类基金份额申购费率 | C 类基金份额申购费率 |
|--------------------|-------------|-------------|
| M < 100 万          | 0.3%        | 0           |
| 100 万 ≤ M < 1000 万 | 0.1%        | 0           |
| M ≥ 1000 万         | 每笔 1000 元   | 0           |

本基金申购费用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、赎回费

本基金份额的赎回费率如下表所示：

| 份额持有时间（N）      | A 类基金份额赎回费率 | C 类基金份额赎回费率 |
|----------------|-------------|-------------|
| N < 7 日        | 1.5%        | 1.5%        |
| 7 日 ≤ N < 30 日 | 0.1%        | 0.1%        |

|          |   |   |
|----------|---|---|
| N ≥ 30 日 | 0 | 0 |
|----------|---|---|

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，本基金的赎回费用在投资人赎回本基金份额时收取，对持有期少于 7 日的投资人收取的赎回费全额计入基金财产，对持有期不少于 7 日但少于 30 日的投资人收取的赎回费归入基金财产的比例为赎回费总额的 25%，其余用于市场推广、登记费和其他手续费。

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》的有关规定在规定媒介上公告。

## 七、申购份额与赎回金额的计算

### 1、本基金申购份额的计算方式

#### （1）A 类基金份额的申购

申购费用适用比例费率时：

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 / 申购当日 A 类基金份额净值

申购费用适用固定金额时：

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 / 申购当日基金份额净值

例：假定 T 日 A 类基金份额净值为 1.0150 元，某投资人投资 10 万元申购本基金 A 类基金份额，对应的本次申购费率为 0.3%，该投资人可得到的 A 类基金份额为：

净申购金额 =  $100,000 / (1 + 0.3\%) = 99,700.90$  元

申购费用 =  $100,000 - 99,700.90 = 299.10$  元

申购份额 =  $99,700.90 / 1.0150 = 98,227.49$  份

即：该投资人投资 10 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 1.0150 元，可得到 98,227.49 份 A 类基金份额。

#### （2）C 类基金份额的申购

申购份额 = 申购金额 / 申购当日 C 类基金份额净值

例：假设 T 日 C 类基金份额净值为 1.0150 元，某投资人投资 10 万元申购本基金 C 类基金份额，则可得到的申购份额为：

申购份额 =  $100,000 / 1.0150 = 98,522.17$  份

即：该投资人投资 10 万元申购本基金 C 类基金份额，假设申购当日本基金 C 类基金份额净值为 1.0150 元，则其可得到 98,522.17 份 C 类基金份额。

申购份额的计算结果按照四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

## 2、赎回金额的计算方式：

本基金的净赎回金额为赎回金额扣减赎回费用。采用“份额赎回”方式，赎回金额以 T 日的基金份额净值为基准进行计算，其中：

赎回金额 = 赎回份额 × T 日基金份额的基金份额净值

赎回费 = 赎回份额 × T 日基金份额的基金份额净值 × 赎回费率

净赎回金额 = 赎回金额 - 赎回费

赎回金额单位为人民币元，计算结果按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产享有或承担。

例：假设某基金份额持有人赎回基金份额 100,000 份，该笔份额持有期限大于等于 30 天，则对应的赎回费率为 0，假设赎回当日基金份额净值是 1.0800 元，则可得到的赎回金额为：

赎回金额 =  $100,000 \times 1.0800 = 108,000.00$  元

赎回费用 =  $100,000 \times 1.0800 \times 0 = 0$  元

净赎回金额 =  $108,000.00 - 0 = 108,000.00$  元

即：该基金份额持有人赎回本基金 10 万份基金份额，持有期限大于等于 30 天，假设赎回当日基金份额净值是 1.0800 元，则其可得到的赎回金额为 108,000.00 元。

例：假设某基金份额持有人赎回基金份额 100,000 份，该笔份额持有期限小于 7 日，则对应的赎回费率为 1.5%，假设赎回当日基金份额净值是 1.0800 元，则可得到的赎回金额为：

赎回金额 =  $100,000 \times 1.0800 = 108,000.00$  元

赎回费 =  $100,000 \times 1.0800 \times 1.5\% = 1,620.00$  元

净赎回金额 =  $108,000.00 - 1,620.00 = 106,380.00$  元

即：该基金份额持有人赎回本基金 10 万份基金份额，该笔份额持有期限小于 7 日，假设赎回当日基金份额净值是 1.0800 元，则其可得到的赎回金额为 106,380.00 元。

## 3、基金份额净值的计算

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 日基金份额净值在当天收市后计算，并根据基金合同的约定进行公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

4、基金管理人可以在不违反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，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销售费用。

5、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、投资者申购基金成功后，登记机构在 T+1 日为投资者登记权益并办理登记手续，投资者自 T+2 日（含该日）后有权赎回该部分基金份额。

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

4、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》的有关规定在规定媒介公告。

## 九、拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可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，基金管理人可暂停接受投资者的申购申请。
- 3、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。
- 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。
- 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技术故障等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。

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接受投资人申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在规定媒介上刊登暂停申购公告。发生上述第 8 项情形时，基金管理人可以采取比例确认等方式对该投资人的申购申请进行限制，基金管理人有权拒绝该等全部或者部分申购申请。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。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，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。

3、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。

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，基金管理人可暂停接受基金份额持有人的赎回申请。

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。

发生上述情形之一且基金管理人暂停赎回或延缓支付赎回款项时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，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，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。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的 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。

（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某一类别的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，基金管理人根据前段“（1）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。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，并应当在规定媒介上进行公告。

## 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、公告或通过销售机构告知等其他方式在 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 日内在规

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，基金管理人应在规定期限内在规定媒介上刊登暂停公告。

2、如发生暂停的时间为1日，基金管理人应于重新开放日，在规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个开放日的基金份额净值。

3、若暂停时间超过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规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

基金管理人可以根据相关法律法规以及基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换业务，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基金合同的规定制定并公告，并提前告知基金托管人与相关机构。

## 十四、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。

## 十五、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的标准收取转托管费。

## 十六、定期定额投资计划

基金管理人可以为投资人办理定期定额投资计划，具体规则由基金管理人另行规定。投资人在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额，每期扣款金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。

## **十七、基金份额的冻结和解冻**

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。

基金份额的冻结手续、冻结方式按照登记机构的相关规定办理。基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益按照我国法律法规、监管规章及国家有权机关的要求以及登记机构业务规定来处理。

## **十八、基金份额转让及其他业务**

在相关法律法规允许的条件下且履行一定的程序后，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或基金份额持有人提交的基金份额质押申请，基金登记机构可依据其业务规则，办理基金份额转让、质押等业务，并收取一定的手续费用。基金管理人拟受理基金份额转让业务或基金份额质押业务的，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或基金份额质押业务。

## **十九、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”章节或届时发布的相关公告。

## 第九部分 基金的投资

### 一、投资目标

本基金在严格控制风险和保持良好流动性的前提下，重点投资中短期债券，力争实现超过业绩比较基准的投资回报。

### 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，包括债券（包括国债、央行票据、金融债券、公开发行的次级债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府机构债券、地方政府债券、可分离交易可转债中的纯债部分）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。

本基金不投资于股票、权证，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债中的纯债部分除外）、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。

本基金投资于债券资产比例不低于基金资产的 80%，其中投资于中短债的比例不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日，本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券合计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。

本基金所指的中短债是指剩余期限不超过三年的债券资产，主要包括国债、央行票据、金融债券、次级债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府机构债券、地方政府债券、可分离交易可转债中的纯债部分等金融工具。

如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

### 三、投资策略

#### 1、资产配置策略

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，进行前瞻性的决策。一方面，本基金将分析和预测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，本基金将对中短期债券市场收益率曲线和信用利差的变化进行深入细致分析，从而得出对市场走势和波动特征的判断。在此基础上，确定资产在不同行业、不同品种的债券之间的配置比例。

## 2、固定收益类品种投资策略

本基金灵活应用各种期限结构策略、买入持有策略、信用策略、互换策略、息差策略，在合理管理并控制信用风险的前提下选择有投资价值的个券，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。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别于收益率曲线，适用于收益率曲线水平移动。

（2）买入持有策略。本基金还可以采用买入信用债并持有到期的投资策略。在市场资金面紧张、收益率高企时买入债券并持有到期，或者是持有到回售期，获得本金和票息收入；同时也可以根据所持债券信用状况变化，进行必要的动态调整。

（3）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，我们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，最好综合各种因素，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，我们将采用变化后债券信用级别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（详见下表）。我们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。

表格：风险类型与信用参数

| 风险类型 | 信用参数 |
|------|------|
| 行业风险 | 进入壁垒 |
|      | 竞争程度 |
|      | 成长能力 |
|      | 技术进步 |
|      | 融资能力 |

|      |       |
|------|-------|
| 公司风险 | 竞争力   |
|      | 管理团队  |
|      | 财务稳健度 |
|      | 财务弹性  |
| 现金流  | 规模    |
|      | 稳定性   |
|      | 可视性   |
|      | 增长    |
| 资产负债 | 杠杆    |
|      | 流动性   |
|      | 覆盖率   |
| 其他   | 担保    |

（4）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。

（5）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。

（6）资产支持证券的投资策略。资产支持类证券的定价受市场利率、流动性、发行条款、标的资产的构成及质量、提前偿还率及其它附加条款等多种因素的影响。本基金将在利率基本面分析、市场流动性分析和信用评级支持的基础上，辅以与国债、企业债等债券品种的相对价值比较，审慎投资资产支持证券类资产。

#### 四、投资限制

##### （一）投资组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于中短债的比例不低于非现金基金资产的 80%；

（2）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、存出保证金和应收申购款等；

- （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%，完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金品种可以不受此条款规定的比例限制；
- （5）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%；
- （6）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%；
- （7）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%；
- （8）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%；
- （9）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；
- （10）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；
- （11）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、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合该比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；
- （12）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；
- （13）本基金资产总值不超过基金资产净值的 140%；
- （14）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。

除上述第（2）、（9）、（11）、（12）项外，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，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

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变更上述限制，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以变更后的规定为准。

## （二）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、行政法规和监管部门取消或调整上述禁止性规定的，在适用于本基金的情况下，则本基金投资不再受相关限制或以调整后的规定为准。

## 五、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%

中债总财富（1-3年）指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制的中债总财富细分指数之一。该指数同时覆盖了上海证券交易所、深圳证券交易所、银行间以及银行柜台债券市场上的待偿期限在1-3年(含1年)的国债、央行票据、政策性金融债，具有一定的代表性，适合作为本基金的债券投资业绩比较基准。

如果今后法律法规发生变化，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，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数，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停止发布时，本基金管理人在与基金托管人协商一致，可调整或变更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。

## 七、基金管理人代表基金行使股东或债权人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、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。

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招募说明书“侧袋机制”章节的规定。

## 九、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财务指标、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。

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。

本投资组合报告所载数据截至 2026 年 6 月 30 日（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. | 固定收益投资            | 1,125,207,854.66 | 99.53  |
|    | 其中：债券             | 1,125,207,854.66 | 99.53  |
|    | 资产支持证券            | —                | —      |
| 3. | 贵金属投资             | —                | —      |
| 4. | 金融衍生品投资           | —                | —      |
| 5. | 买入返售金融资产          | —                | —      |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | —                | —      |
| 6. | 银行存款和结算备付金合计      | 5,265,361.81     | 0.47   |
| 7. | 其他各项资产            | 32,200.45        | 0.00   |
| 8. | 合计                | 1,130,505,416.92 | 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

本基金本报告期末未持有境内股票。

### 2.2. 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

## 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      | 708,702,640.96 | 69.34        |
|    | 其中：政策性金融债 | 102,372,868.49 | 10.02        |
| 4. | 企业债券      | 91,041,020.27  | 8.91         |
| 5. | 企业短期融资券   | —              | —            |
| 6. | 中期票据      | 325,464,193.43 | 31.85        |
| 7. | 可转债（可交换债） | —              | —            |

|     |      |                  |        |
|-----|------|------------------|--------|
| 8.  | 同业存单 | -                | -      |
| 9.  | 其他   | -                | -      |
| 10. | 合计   | 1,125,207,854.66 | 110.10 |

## 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<br>净值比例<br>（%） |
|----|-----------|----------------------|--------------|----------------|----------------------|
| 1  | 102483612 | 24 邮政<br>MTN005      | 1,000,000.00 | 102,392,246.58 | 10.02                |
| 2  | 2420011   | 24 浙商银<br>行小微债<br>01 | 700,000.00   | 70,961,734.79  | 6.94                 |
| 3  | 220402    | 22 农发 02             | 600,000.00   | 61,122,526.03  | 5.98                 |
| 4  | 212480060 | 24 建行债<br>02BC       | 500,000.00   | 51,102,583.56  | 5.00                 |
| 5  | 102485100 | 24 汇金<br>MTN008      | 500,000.00   | 51,004,531.51  | 4.99                 |

## 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

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

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

## 9.1. 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

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

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

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

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

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. 声明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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，浙商银行在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行金华市分行的处罚，华夏银行在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚，邮储银行在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局的处罚，中国建设银行在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行和国家金融监督管理总局的处罚，中国农业银行在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚，北京银行在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行和国家金融监督管理总局北京监管局的处罚。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述主体外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期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。

### 11.2. 声明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

本基金本报告期末未持有股票。

### 11.3. 其他各项资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）     |
|----|---------|-----------|
| 1. | 存出保证金   | 32,200.45 |
| 2. | 应收证券清算款 | -         |
| 3. | 应收股利    | -         |
| 4. | 应收利息    | -         |
| 5. | 应收申购款   | -         |
| 6. | 其他应收款   | -         |
| 7. | 待摊费用    | -         |
| 8. | 其他      | -         |
| 9. | 合计      | 32,200.45 |

### 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

本基金本报告期末未持有股票。

#### 11.6. 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

## 第十部分 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。

本基金合同生效日为 2019 年 9 月 6 日，基金业绩数据截至 2026 年 6 月 30 日。

### 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

#### 华泰紫金丰益中短债发起 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    |
|-----------------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 2026.01.01-2026.06.30 | 0.96%    | 0.01%       | 1.03%      | 0.01%         | -0.07% | 0.00%  |
| 2025.01.01-2025.12.31 | 1.17%    | 0.02%       | 1.24%      | 0.02%         | -0.07% | 0.00%  |
| 2024.01.01-2024.12.31 | 2.52%    | 0.02%       | 3.42%      | 0.03%         | -0.90% | -0.01% |
| 2023.01.01-2023.12.31 | 2.20%    | 0.03%       | 2.60%      | 0.02%         | -0.40% | 0.01%  |
| 2022.01.01-2022.12.31 | 2.55%    | 0.06%       | 2.48%      | 0.04%         | 0.07%  | 0.02%  |
| 2021.01.01-2021.12.31 | 9.58%    | 0.15%       | 3.27%      | 0.02%         | 6.31%  | 0.13%  |
| 2020.01.01-2020.12.31 | -4.08%   | 0.60%       | 2.37%      | 0.06%         | -6.45% | 0.54%  |
| 2019.09.06-2019.12.31 | 2.06%    | 0.04%       | 1.16%      | 0.02%         | 0.90%  | 0.02%  |
| 2019.09.06-2026.06.30 | 17.74%   | 0.24%       | 18.96%     | 0.03%         | -1.22% | 0.21%  |

#### 华泰紫金丰益中短债发起 C

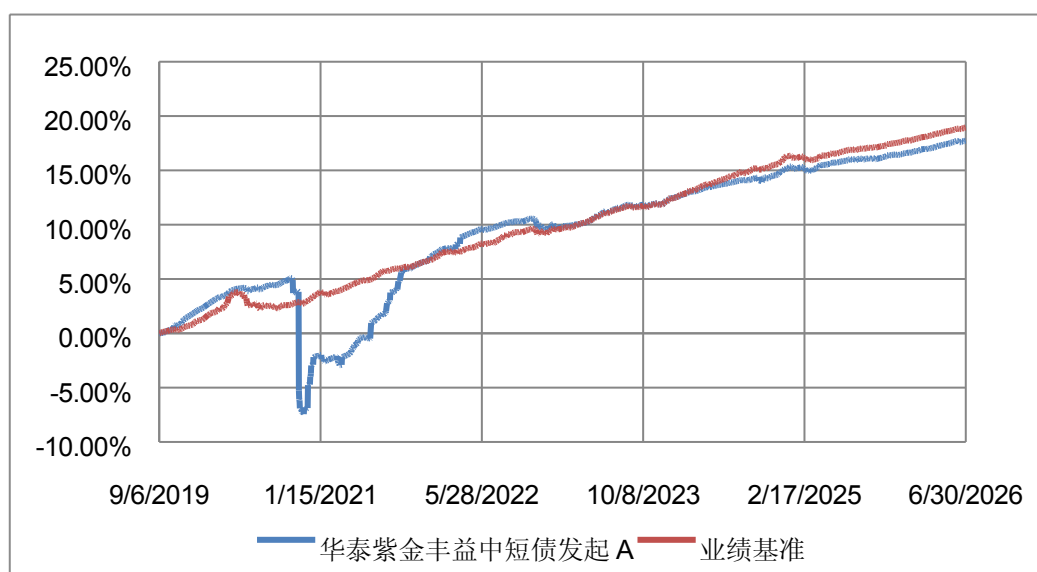
| 阶段                    | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④    |
|-----------------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 2026.01.01-2026.06.30 | 0.77%    | 0.01%       | 1.03%      | 0.01%         | -0.26% | 0.00%  |
| 2025.01.01-2025.12.31 | 0.76%    | 0.02%       | 1.24%      | 0.02%         | -0.48% | 0.00%  |
| 2024.01.01-2024.12.31 | 2.11%    | 0.02%       | 3.42%      | 0.03%         | -1.31% | -0.01% |
| 2023.01.01-2023.12.31 | 1.81%    | 0.03%       | 2.60%      | 0.02%         | -0.79% | 0.01%  |
| 2022.01.01-2022.12.31 | 2.14%    | 0.06%       | 2.48%      | 0.04%         | -0.34% | 0.02%  |
| 2021.01.01-2021.12.31 | 9.14%    | 0.15%       | 3.27%      | 0.02%         | 5.87%  | 0.13%  |
| 2020.01.01-2020.12.31 | -4.44%   | 0.60%       | 2.37%      | 0.06%         | -6.81% | 0.54%  |

|                           |        |       |        |       |        |       |
|---------------------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 2019.09.06-<br>2019.12.31 | 1.93%  | 0.04% | 1.16%  | 0.02% | 0.77%  | 0.02% |
| 2019.09.06-<br>2026.06.30 | 14.59% | 0.24% | 18.96% | 0.03% | -4.37% | 0.21% |

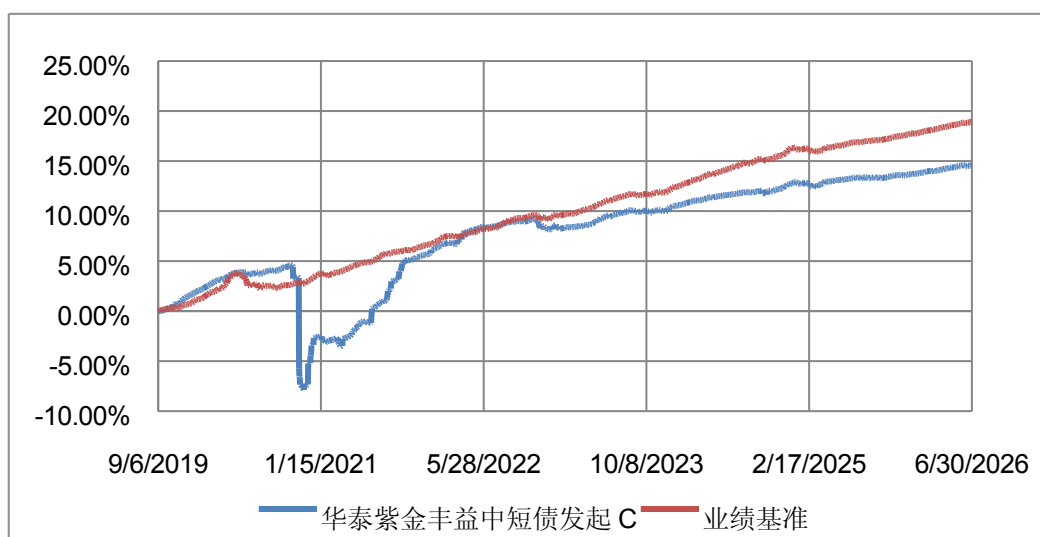
### 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华泰紫金丰益中短债债券型发起式证券投资基金  
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
(2019年9月6日至2026年6月30日)

#### 1. 华泰紫金丰益中短债发起 A



#### 2. 华泰紫金丰益中短债发起 C



注：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%。

## 第十一部分 基金的财产

### 一、基金资产总值

基金资产总值是指购买的各类证券及票据价值、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和。

### 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。



## 第十二部分 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。

与上述投资品种形同，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不含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；

（2）交易所上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供

的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价进行估值；

（3）交易所上市交易的可转换债券以每日收盘价作为估值全价；

（4）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。交易所市场挂牌转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值；

（5）对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为估值日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表估值日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认估值日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，应采用估值技术确定其公允价值。

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、银行间市场交易的固定收益品种的估值

对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种，回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异，未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。

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、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。

6、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、自律规则的规定。

7、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资产净值的计算结果对

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，各类基金份额的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。国家另有规定的，从其规定。

每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

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。对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平不能预见、不能避免、不能克服，则属不可抗力，按照下述规定执行；

由于不可抗力原因造成投资人的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他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、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；错误偏差达到基金份额净值的 0.5% 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，双方当事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估值；
- 4、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

用于基金信息披露的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开放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予以公布。

## 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净值信息，暂停披露侧袋账户份额净值。

## 十、特殊情况的处理

1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 5 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，或证券交易所、登记结算机构及存款银行等第三方机构发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等非基金管理人与基金托管人原因，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。

## 第十三部分 基金的收益分配

### 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损益后的余额。

### 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、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；

2、基金收益分配后每一类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位该类别基金份额收益分配金额后不能低于面值；

3、由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额收取销售服务费，两种基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同，本基金同一类别的每份基金份额享有同等分配权；

4、法律法规或监管机构另有规定的，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，无须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，依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

### 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。

#### **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”章节的规定。



## 第十四部分 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；
- 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、基金的证券交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、基金的开户费用、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0.40%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每月月末，按月支付，经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5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、公休假等，支付日期顺延。

#### 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0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

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，逐日累计至每月月末，按月支付，经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5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 3、C类份额的销售服务费

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年费率为 0.4%。本基金销售服务费主要用于本基金持续销售以及基金份额持有人服务等各项费用。

销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值的 0.4% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.4\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的 C 类基金份额销售服务费

E 为前一日的 C 类基金份额的基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人与基金托管人核对一致后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式在次月月初五个工作日内从基金财产中一次性支付至登记机构，由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、公休日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日。

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、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，有关费用可酌情收取或减免，但不得收取管理费，详见本招募说明书“侧袋机制”章节的规定或相关公告。

### 五、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，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。

## 第十五部分 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、期货相关从业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按照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

## 第十六部分 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。

### 二、信息披露义务人

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符合中国证监会规定条件的用以进行信息披露的全国性报刊（以下简称“规定报刊”）及《信息披露办法》规定的互联网网站（以下简称“规定网站”，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规定网站上；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，并登载在规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，基金管理人在基金份额发售的3日前，将基金招募说明书、《基金合同》摘要登载在规定媒介上；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规定媒介上。

## （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规定媒介上登载《基金合同》生效公告。《基金合同》生效公告中将说明基金募集情况及基金管理人股东、基金管理人、基金管理人高级管理人员或基金经理等人员持有的基金份额、承诺持有的期限等情况。

## （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规定网站披露一次各类基金份额净值和基金份额累计净值。

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，通过规定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日各类基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在规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

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，将年度报告登载在规定网站上，并将年度报告提示性公告登载在规定报刊上。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，将中期报告登载在规定网站上，并将中期报告提示性公告登载在规定报刊上。

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，将季度报告登载在规定网站上，并将季度报告提示性公告登载在规定报刊上。

《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。

基金管理人应在年度报告、中期报告、季度报告中分别披露基金管理人、基金管理人股东、基金管理人高级管理人员、基金经理等人员作为发起资金提供方持有本基金，中国证监会认定的份额、期限及期间的变动情况特殊情形除外。

#### （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在 2 日内编制临时报告书，并登载在规定报刊和规定网站上。

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，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；
- 11、涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁；
- 12、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；
- 13、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；
- 14、基金收益分配事项；
- 15、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；
- 16、任一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；
- 17、本基金开始办理申购、赎回；
- 18、本基金发生巨额赎回并延期办理；
- 19、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；
- 20、本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；
- 21、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时；
- 22、基金推出新业务或服务；
- 23、调整基金份额类别的设置；
- 24、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；

25、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。

#### （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）投资资产支持证券的信息披露内容

基金管理人应在基金年报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。

#### （十一）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”章节的规定。

#### （十二）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律法规规定。

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、基金托管人应当在规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规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规定媒介披露信息，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。

## 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、暂停或延迟披露基金相关信息的情形

当出现下述情况时，基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金相关信息：

- 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交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 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；
- 4、法律法规、基金合同或中国证监会规定的情况。

## 九、本基金信息披露事项以法律法规规定及本章节约定的内容为准。

## 第十七部分 侧袋机制

### 一、侧袋机制的实施条件和程序

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。

基金管理人应当在启用侧袋机制后及时发布临时公告，并在五个工作日内聘请侧袋机制启用日发表意见且符合《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，内容应包含侧袋账户的初始资产、份额、净资产等信息。

### 二、实施侧袋机制期间基金份额的申购、赎回与登记

1、启用侧袋机制当日，基金登记机构以基金份额持有人的原有账户各类别份额为基础，确认相应侧袋账户基金份额持有人名册和各类别份额；当日收到的申购申请，按照启用侧袋机制后的主袋账户份额办理；当日收到的赎回申请，仅办理主袋账户份额的赎回申请并支付赎回款项。

2、实施侧袋机制期间，基金管理人不得办理侧袋账户份额的申购、赎回和转换；同时，基金管理人按照基金合同和招募说明书约定的政策办理主袋账户份额的赎回，并根据主袋账户运作情况确定是否暂停申购。

3、除基金管理人应按照主袋账户的份额净值办理主袋账户份额的申购和赎回外，本招募说明书“基金份额的申购与赎回”部分的申购、赎回规定适用于主袋账户份额。巨额赎回按照单个开放日内主袋账户份额净赎回申请超过前一开放日主袋账户总份额的10%认定（如为启用侧袋机制当日，按照单个开放日内主袋账户份额净赎回申请超过前一开放日基金总份额的10%认定）。

4、侧袋机制实施期间，基金管理人应对侧袋账户份额实行独立管理，主袋账户沿用原基金代码，侧袋账户使用独立的基金代码。侧袋账户份额的名称应以“华泰紫金丰益中短债债券型发起式+侧袋标识S+侧袋账户建立日期”格式设定，同时主袋账户份额的名称增加大写字母M标识作为后缀。基金所有侧袋账户注销后，将取消主袋账户份额名称中的M标识。

侧袋账户资产完全清算后，基金管理人将注销侧袋账户。

### 三、实施侧袋机制期间的基金投资及业绩

侧袋机制实施期间，招募说明书“基金的投资”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。基金管理人计算各项投资运作指标和基金业绩指标时仅需考虑主袋账户资产。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。

基金管理人、基金服务机构在展示基金业绩时，将就前述情况进行充分的解释说明，避免引起投资者误解。

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。

#### 四、实施侧袋机制期间的基金估值

本基金实施侧袋机制的，基金管理人和基金托管人应对主袋账户资产进行估值并披露主袋账户的基金净值信息，暂停披露侧袋账户份额净值。

侧袋机制启用当日，基金管理人以完成日终估值后的基金净资产为基数对主袋账户和侧袋账户的资产进行分割，与特定资产可明确对应的资产类科目余额、除应交税费外的负债类科目余额一并纳入侧袋账户。基金管理人应将特定资产作为一个整体，不能仅分割其公允价值无法确定的部分。

侧袋机制实施期间，基金管理人应对侧袋账户单独设置账套，实行独立核算。如果本基金同时存在多个侧袋账户，不同侧袋账户应分开进行核算。侧袋账户的会计核算应符合《企业会计准则》的相关要求。

#### 五、实施侧袋账户期间的基金费用

1、本基金实施侧袋机制的，管理费和托管费、销售服务费按主袋账户基金资产净值作为基数计提（如为启用侧袋机制当日，管理费和托管费、销售服务费按前一日总的基金资产净值作为基数计提）。

2、与侧袋账户有关的费用可从侧袋账户中列支，但应待侧袋账户资产变现后方可列支，有关费用可酌情收取或减免，但不得收取管理费。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。

#### 六、侧袋账户中特定资产的处置变现和支付

特定资产以可出售、可转让、恢复交易等方式恢复流动性后，基金管理人应当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变现款项。

侧袋机制实施期间，无论侧袋账户资产是否全部完成变现，基金管理人都应当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。

侧袋账户资产全部完成变现并终止侧袋机制后，基金管理人应及时聘请符合《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。

## 七、侧袋机制的信息披露

### 1、临时公告

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基金管理人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。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。

### 2、基金净值信息

基金管理人应按照招募说明书“基金的信息披露”部分规定的基金净值信息披露方式和频率披露主袋账户份额的基金份额净值和基金份额累计净值，实施侧袋机制期间本基金暂停披露侧袋账户份额净值和累计净值。

### 3、定期报告

侧袋机制实施期间，基金管理人应当在基金定期报告中披露报告期内侧袋账户及特定资产的相关信息，其中基金会计报表仅需针对主袋账户进行编制，会计师事务所对基金年度报告进行审计时，应对报告期内基金侧袋机制运行相关的会计核算和年度报告披露，执行适当程序并发表审计意见。侧袋账户相关信息在定期报告中单独进行披露，包括但不限于：

- （1）侧袋账户的基金代码、基金名称、侧袋账户成立日期等基本信息；
- （2）侧袋账户的初始资产、初始负债；
- （3）特定资产的名称、代码、发行人等基本信息；
- （4）报告期内的特定资产处置进展情况、与处置特定资产相关的费用情况及其他与特定资产状况相关的信息；
- （5）可根据特定资产处置进展情况披露特定资产的可变现净值或净值参考区间，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；
- （6）可能对投资者利益存在重大影响的其他情况及相关风险提示。

八、本部分关于侧袋机制的相关规定，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，基金管理人经与基金托管人协商一

致并履行适当程序后，在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，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。

## 第十八部分 风险揭示

### 一、投资于本基金的主要风险

#### （一）市场风险

证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响，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。基金投资于债券，收益水平也会随之变化，从而产生风险。

3、利率风险。利率直接影响着债券的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。基金投资于债券，其收益水平会受到利率变化的影响。在利率上升时，基金持有的债券价格下降，如基金组合久期较长，则将造成基金资产的损失。

4、购买力风险。基金的利润将主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀的影响而导致购买力下降，从而使基金的实际收益下降。

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。具体为当利率下降时，基金从投资的固定收益证券所得的利息收入进行再投资时，将获得比以前较少的收益率，这将对基金的净值增长率产生影响。

6、信用风险。基金所投资债券的发行人如出现违约、无法支付到期本息，或由于债券发行人信用等级降低导致债券价格下降，将造成基金资产损失。

7、债券回购风险。债券回购为提升整体基金组合收益提供了可能，但也存在一定的风险。债券回购的主要风险包括信用风险、投资风险及波动性加大的风险，其中，信用风险指回购交易中交易对手在回购到期时，不能偿还全部或部分证券或价款，造成基金净值损失的风险；投资风险是指在进行回购操作时，回购利率大于债券投资收益而导致的风险以及由于回购操作导致投资总量放大，致使整个组合风险放大的风险；而波动性加大的风险是指在进行回购操作时，在对基金组合收益进行放大的同时，也对基金组合的波动性（标准差）进行了放大，即基金组合的风险将会加大。回购比例越高，风险暴露程度也就越高，对基金净值造成损失的可能性也就越大。

#### （二）管理风险

基金运作过程中由于基金投资策略、人为因素、管理系统设置不当造成操作失误或基金管理人内部失控而可能产生的损失。管理风险包括：

- 1、决策风险：指基金投资的投资策略制定、投资决策执行和投资绩效监督检查过程中，由于决策失误而给基金资产造成的可能的损失；
- 2、操作风险：指基金投资决策执行中，由于投资指令不明晰、交易操作失误等人为因素而可能导致的损失；
- 3、技术风险：是指基金管理人管理信息系统设置不当等因素而可能造成的损失。

### （三）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、拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括债券（包括国债、央行票据、金融债券、公开发行的次级债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府机构债券、地方政府债券、可分离交易可转债中的纯债部分）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具，一般情况下具有较好的流动性。本基金严格控制投资于流动受限资产和不存在活跃市场需要采用估值技术确定公允价值的投资品种的比例。除此之外，本基金管理人将根据历史经验和现实条件，制定出现金持有量的上下限计划，在该限制范围内进行现金比例调控或现金与证券的转化。本基金管理人会进行标的的分散化投资并结合对各类标的资产的预期流动性合理进行资产配置，以防范流动性风险。

#### 2、巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

当基金出现巨额赎回情形时，基金管理人可以根据当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。从保护中小投资者的角度出发，针对单个基金份额持有人超过一定比例以上的赎回申请，管理人有权对超出该比例的赎回申请实施延期办理。

#### 3、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

当基金出现极端流动性风险或其他特定情况时，出于公平对待投资者的考虑，基金管理人经与基金托管人协商，依照法律法规及基金合同的约定，审慎选择备用的流动性风险管理工具，包括但不限于：延期办理赎回申请、暂停接受赎回申请、延缓支付赎回款项、收取短期赎回费、暂停基金估值、摆动定价、启用侧袋机制等。上述流动性风险管理工具的使用将严格按照基金

管理人内部制度完成决策和审批程序，并与基金托管人协商一致。实际运用时，将会影响投资者的赎回申请、赎回款项支付及申购申请，带来一定风险。

#### 4、启用侧袋机制的风险

侧袋机制是一种流动性风险管理工具，是将特定资产分离至专门的侧袋账户进行处置清算，并以处置变现后的款项向基金份额持有人进行支付，目的在于有效隔离并化解风险，但基金启用侧袋机制后，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，仅主袋账户份额正常开放赎回，因此启用侧袋机制时持有基金份额的持有人将在启用侧袋机制后同时持有主袋账户份额和侧袋账户份额，侧袋账户份额不能赎回，其对应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。

实施侧袋机制期间，因本基金不披露侧袋账户份额的净值，即便基金管理人在基金定期报告中披露报告期末特定资产可变现净值或净值区间的，也不作为特定资产最终变现价格的承诺，因此对于特定资产的公允价值和最终变现价格，基金管理人不承担任何保证和承诺的责任。

基金管理人将根据主袋账户运作情况合理确定申购政策，因此实施侧袋机制后主袋账户份额存在暂停申购的可能。

启用侧袋机制后，基金管理人计算各项投资运作指标和基金业绩指标时仅需考虑主袋账户资产，基金业绩指标应当以主袋账户资产为基准，因此本基金披露的业绩指标不能反映特定资产的真实价值及变化情况。

#### （四）合规性风险

指基金管理或运作过程中，违反国家法律、法规的规定，或者基金投资违反法规及基金合同有关规定的风险。

#### （五）本基金特有风险

1、根据本基金投资范围的规定，本基金主要投资于各类固定收益证券，无法完全规避发债主体特别是短期融资券、中期票据、公司债、企业债的发债主体的信用质量变化造成的信用风险；另外，如果持有的信用债出现信用违约风险，将给基金净值带来较大的负面影响和波动。

2、本基金可投资于资产支持证券。资产支持证券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。

3、本基金为发起式基金，本基金的基金合同生效之日起三年后的对应日，若基金资产净值低于 2 亿元，基金合同自动终止，且不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。本基金的基金合同生效后持续存续的，连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续六十个工作日出现前述情形的，管理人有权终止合同，无须召开基金份额持有人大会。基金合同生效后，连续二十个工作日出现基金资产净值低于 7000 万元情形的，管理人有权终止合同，无须召开基金份额持有人大会。因此，本基金存在基金合同终止等风险。

#### （六）其他风险

1、随着符合本基金投资理念的新投资工具的出现和发展，如果投资于这些工具，基金可能会面临一些特殊的风险；

2、因技术因素而产生的风险，如计算机系统不可靠产生的风险；

3、因基金业务快速发展而在制度建设、人员配备、内控制度建立等方面不完善而产生的风险；

4、因人为因素而产生的风险、如内幕交易、欺诈行为等产生的风险；

5、对主要业务人员如基金经理的依赖而可能产生的风险；

6、战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金资产的损失，影响基金收益水平，从而带来风险；

7、其他意外导致的风险。

## 二、声明

1、投资人投资于本基金，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，本基金还通过其他销售机构销售，基金管理人及其他机构都不能保证其收益或本金安全。

## 第十九部分 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，自决议生效后两个工作日内在规定媒介公告。

### 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、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。

3、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。

#### 4、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；
- （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。

5、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。

#### **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不低于法规要求的最低年限。

## 第二十部分 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) 发起资金提供方认购的基金份额持有期限不少于 3 年；
- (10) 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、赎回或转换申请；
- (12) 依照法律法规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) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；
- (14) 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；
- (15) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；
- (16) 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、转换和非交易过户等业务规则；

（17）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，向审计、法律等外部专业顾问提供的除外；

（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。

### （三）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和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）建立并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业监督管理机构，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。

## 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、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，法律法规或中国证监会另有规定或基金合同另有约定的除外：

- （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，但根据法律法规的要求调整该等报酬标准或服务费率的除外；
- （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）调低销售服务费；

（2）法律法规要求增加的基金费用的收取；

（3）在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率、变更收费方式或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变化；

（6）基金管理人、销售机构、登记机构调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则；

（7）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，在规定媒介公告。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、书面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书面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证明委派代表出席，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证明符合法律法规、《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基金合同约定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基金合同约定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）到指定地点对书面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书面表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取书面表决意见的，不影响表决效力；

（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）；若本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面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书面意见或授权他人代表出具书面意见；

（4）上述第（3）项中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代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面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构允许的情况下，本基金的基金份额持有人亦可采用其他非书面方式进行表决或授权其代理人出席基金份额持有人大会并表决；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。

#### （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书面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，但应当计入出具书面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。

在上述规则的前提下，具体规则以召集人发布的基金份额持有人大会通知为准。

## （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书面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 2 个工作日内在规定媒介上公告。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）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，同一主侧袋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本部分的相关规定。

（十）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的部分，如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人与基金托管人协商一致并提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整。

（十一）法律法规或监管部门对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

### 三、基金合同解除和终止的事由、程序

#### （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，自决议生效后两个工作日内在规定媒介公告。

#### （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、基金财产清算小组成员：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。

3、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。

#### 4、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；

（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。

5、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。

（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、争议解决方式**

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，如经友好协商未能解决的，应提交上海国际经济贸易仲裁委员会，根据该会届时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为上海市，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，仲裁费由败诉方承担。

争议处理期间，基金合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

《基金合同》受中国法律（为本基金合同之目的，在此不包括香港、澳门特别行政区和台湾地区的有关规定）管辖。

#### **五、基金合同存放地和投资者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。

## 第二十一部分 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：华泰证券（上海）资产管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区东方路 18 号 21 层

法定代表人：江晓阳

设立日期：2014 年 10 月 16 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监许可（2014）679 号

组织形式：一人有限责任公司（法人独资）

注册资本：26 亿元人民币

存续期限：持续经营

联系电话：4008895597

#### （二）基金托管人

名称：江苏银行股份有限公司（简称：江苏银行）

住所：中国江苏省南京市中华路 26 号（邮编 210005）

办公地址：中国江苏省南京市中华路 26 号（邮编 210005）

法定代表人：夏平

成立时间：2007 年 1 月 22 日

基金托管业务批准文号：证监许可【2014】619 号

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、承销短期融资券；买卖政府债券、金融债券、企业债券；从事同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；代客理财、代理销售基金、代理销售贵金属、代理收付和保管集合资金信托计划；提供保险箱业务；办理委托存贷款业务；从事银行卡业务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外币兑换；结售汇、代理远期结售汇；国际结算；自营及代客外汇买卖；同业外汇拆借；买卖或代理买卖股票以外的外币有价证券；资信调查、咨询、见证业务；网上银行；经银行业监督管理机构和有关部门批准的其他业务。

注册资本：115.44 亿元人民币

组织形式：股份有限公司

存续期间：持续经营

## 二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

### （一）基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权

1、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》和本协议的约定，对基金的投资范围、投资对象进行监督。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括债券（包括国债、央行票据、金融债券、次级债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府机构债券、地方政府债券、可分离交易可转债中的纯债部分）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。

本基金不投资于股票、权证，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债中的纯债部分除外）、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。

本基金投资于债券资产比例不低于基金资产的 80%，其中投资于中短债的比例不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日，本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券合计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。

本基金所指的中短债是指剩余期限不超过三年的债券资产，主要包括国债、央行票据、金融债券、公开发行的次级债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府机构债券、地方政府债券、可分离交易可转债中的纯债部分等金融工具。

如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

2、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》和本协议的约定，对基金投资比例进行监督。

根据《基金合同》的约定，本基金投资组合比例应符合以下规定：

（1）本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于中短债的比例不低于非现金基金资产的 80%；

（2）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、存出保证金和应收申购款等；

（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%，完

全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金品种可以不受此条款规定的比例限制；

（5）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%；

（6）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%；

（7）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%；

（8）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%；

（9）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；

（10）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；

（11）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、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合该比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

（12）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；

（13）本基金资产总值不超过基金资产净值的 140%；

（14）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。

除上述第（2）、（9）、（11）、（12）项外，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，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

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变更上述限制，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以变更后的规定为准。

3、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同和本协议的约定，对基金投资禁止行为进行监督。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）向基金管理人、基金托管人出资。

对于基金管理人开展基金投资禁止行为，基金托管人对此无法提前知晓或阻止的，基金托管人不承担任何责任并有权向中国证监会报告。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，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。基金合同生效后2个工作日内，基金管理人和基金托管人应相互提供与本机构有控股关系的股东或者与本机构有其他重大利害关系的公司名单，以上名单发生变化的，应及时予以更新并通知对方。

若基金托管人发现基金管理人与关联交易名单中列示的关联方进行关联交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人采取必要措施，履行信息披露义务。对于基金管理人已成交的关联交易，基金托管人事前无法阻止该关联交易发生的，只能进行事后结算，基金托管人不承担由此造成的损失，并有权向中国证监会报告。

法律、行政法规和监管部门取消或调整上述禁止性规定的，在适用于本基金的情况下，则本基金投资不再受相关限制或以调整后的规定为准。

4、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同和本协议的约定，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。

（1）基金管理人向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的银行间债券市场交易对手的名单。基金托管人在收到名单后2个工作日内电话或回函确认收到该名单。基金管理人应定期和不定期对银行间债券市场现券及回购交易对手的名单进行更新。基金托管人在收到名单后2个工作日内电话或书面回函确认，新名单自基金托管人确认当日生效。新名单生效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。

基金托管人依据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定对于基金管理人参与银行间债券市场交易的交易是否符合交易对手库进行事后监督。

（2）基金管理人参与银行间债券市场交易时，有责任控制交易对手的资信风险，由于交易对手资信风险引起的损失，基金管理人应当负责向相关责任人追偿，基金托管人不承担责任。

5、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同和本协议的约定，对基金管理人选择存款银行进行监督。

基金投资银行定期存款的，基金管理人应根据法律法规的规定及基金合同的约定，确定符合条件的所有存款银行的名单，并及时提供给基金托管人，基金托管人应据以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。

本基金投资银行存款应符合如下规定：

（1）基金管理人、基金托管人应当与存款银行建立定期对账机制，确保基金银行存款业务账目及核算的真实、准确。

（2）基金管理人与基金托管人应根据相关规定，就本基金银行存款业务另行签订书面协议，明确双方在相关协议签署、账户开设与管理、投资指令传达与执行、资金划拨、账目核对、到期兑付、文件保管以及存款证实书的开立、传递、保管等流程中的权利、义务和职责，保护基金份额持有人的合法权益。

（3）基金托管人应加强对基金银行存款业务的监督与核查，严格审查、复核相关协议、账户资料、投资指令、存款证实书等有关文件，切实履行托管职责。

（4）基金管理人与基金托管人在开展基金存款业务时，应严格遵守《基金法》、《运作办法》等有关法律法规，以及国家有关账户管理、利率管理、支付结算等的各项规定。

（二）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认、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。如果基金管理人未经基金托管人的审核擅自将不实的业绩表现数据印制在宣传推介材料上，则基金托管人对此不承担任何责任，并有权在发现后报告中国证监会。

（三）基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查，在规定时间内答复并改正，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等。

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》及其他有关法规、《基金合同》和本协议规定的行为，应及时以书面或双方约定的其他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，并以电话或书面形式向基金托管人反馈，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，基金托管人有权报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人有关重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人在限期内纠正。

基金托管人发现基金管理人的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反《基金合同》约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。

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，并及时向中国证监会报告。

（四）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。

基金托管人依照相关法律法规的规定和基金合同的约定，对侧袋机制启用、特定资产处置和信息披露等方面进行复核和监督。侧袋机制实施期间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。

### 三、基金管理人对基金托管人的业务核查

根据《基金法》及其他有关法规、《基金合同》和本协议规定，基金管理人对基金托管人履行托管职责的情况进行核查，核查事项包括但不限于基金托管人是否安全保管基金财产、开立基金财产的资金账户、证券账户及债券托管账户等投资所需账户，是否及时、准确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，是否根据基金管理人指令办理清算交收，是否按照法规规定和《基金合同》规定进行相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

基金管理人定期和不定期地对基金托管人保管的基金资产进行核查。基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：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，在规定时间内答复并改正。

基金管理人发现基金托管人未对基金资产实行分账管理、擅自挪用基金资产、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》、本协议及其他有关规定的，应及时以书面形式通知基金托管人在限期内纠正，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。对基金管理人按照法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的，基金托管人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

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在限期内纠正。

#### 四、基金财产的保管

##### （一）基金财产保管的原则

1、基金托管人应安全保管基金财产，未经基金管理人的指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何资产。

2、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。

3、基金托管人按照规定开立基金财产的资金账户、证券账户和债券托管账户等投资所需账户。

4、基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整和独立。

5、对于因为基金投资产生的应收资产和基金申购过程中产生的应收资产，如基金托管人无法从公开信息或基金管理人提供的书面资料中获取到账日期信息的，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基金银行存款账户的，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。

##### （二）基金合同生效时募集资产的验证

基金募集期满或基金管理人宣布停止募集时，募集份额总额、发起资金的认购金额、发起资金提供方及其承诺的持有期限符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，由基金管理人在法定期限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。验资报告需对发起资金提供方及其持有的基金份额进行专门说明。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为基金开立的基金银行存款账户中，基金托管人在收到资金当日出具相关证明文件。

##### （三）基金的银行存款账户的开立和管理

1、基金托管人应负责本基金银行存款账户的开立和管理。

2、基金托管人以本基金的名义在其营业机构开立基金的银行存款账户，并根据中国人民银行规定计息。本基金的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益，均需通过本基金的银行存款账户进行。

3、本基金银行存款账户的开立和使用，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其他任何银行存款账户；亦不得使用基金的任何银行存款账户进行本基金业务以外的活动。

4、基金银行存款账户的管理应符合《中华人民共和国票据法》、《人民币银行账户结算管理办法》、《现金管理暂行条例实施细则》、《人民币利率管理规定》、《支付结算办法》以及银行业监督管理机构的其他规定。

#### （四）基金证券交收账户、资金交收账户的开立和管理

基金托管人以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司开立证券账户。

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。

基金托管人通过中国证券登记结算有限责任公司进行证券交易资金的结算。基金托管人以本基金的名义在托管人处开立基金的证券交易资金结算的二级结算备付金账户。

#### （五）债券托管账户的开立和管理

1、基金合同生效后，基金托管人负责在中央国债登记结算有限责任公司和银行间市场清算所股份有限公司以本基金的名义开立债券托管账户，基金管理人给与必要的配合，由基金托管人负责基金的债券及资金的清算。在上述手续办理完毕后，由基金托管人向人民银行进行报备。基金管理人负责申请基金进入全国银行间同业拆借市场进行交易，由基金管理人在中国外汇交易中心开设同业拆借市场交易账户。

2、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，协议正本由基金托管人保管，协议副本由基金管理人保存。

#### （六）其他账户的开立和管理

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，由基金管理人协助基金托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定，开立有关账户。该账户按有关规则使用并管理。

#### （七）基金财产投资的有关实物证券、银行存款定期存单等有价凭证的保管

实物证券由基金托管人存放于托管银行的保管库。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。基金托管人对由基金托管人以外机构实际有效控制的本基金资产不承担保管责任。

银行存款证实书等有价值凭证由基金托管人负责保管。具体保管事项由双方另行签署《托管资产投资银行存款业务管理事项协议》进行约定。

#### （八）与基金财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。除本协议另有规定外，基金管理人在代基金签署与基金有关的重大合同时，应尽可能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，基金管理人应及时将正本送达基金托管人处。合同的保管期限按照国家有关规定执行。

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）基金资产净值及基金份额净值的计算与复核

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基金资产净值除以计算日该类基金总份额后的价值，各类基金份额净值的计算精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人每个工作日计算基金资产净值、各类基金份额净值，经基金托管人复核，按规定公告。

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。估值原则应符合《基金合同》、《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及其他法律、法规的规定。用于基金信息披露的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，以约定方式发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核后，将复核结果反馈给基金管理人，由基金管理人按规定对外公布。

本基金按以下方法估值：

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不含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；

（2）交易所上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价进行估值；

（3）交易所上市交易的可转换债券以每日收盘价作为估值全价；

（4）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。交易所市场

挂牌转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值；

（5）对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为估值日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表估值日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认估值日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，应采用估值技术确定其公允价值。

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、银行间市场交易的固定收益品种的估值

对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种，回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异，未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。

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、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。

6、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、自律规则的规定。

7、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资产净值的计算结果对外予以公布。

## （二）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。

本托管协议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。对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平不能预见、不能避免、不能克服，则属不可抗力，按照下述规定执行：

由于不可抗力原因造成投资人的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他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、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；错误偏差达到基金份额净值的 0.5% 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构另有规定的，从其规定处理。

### （三）暂停估值的情形

- 1、基金投资所涉及的证券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估值；
- 4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

#### （四）基金会计制度

按国家有关部门制定的会计制度执行。

#### （五）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，对双方各自的账册定期进行核对，互相监督，以保证基金财产的安全。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。

#### （六）会计数据和财务指标的核对

双方应每个交易日核对账目，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，确保核对一致。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）基金定期报告的编制和复核

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，将年度报告登载在规定网站上，并将年度报告提示性公告登载在规定报刊上。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，将中期报告登载在规定网站上，并将中期报告提示性公告登载在规定报刊上。

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，将季度报告登载在规定网站上，并将季度报告提示性公告登载在规定报刊上。

《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。

基金管理人应在年度报告、中期报告、季度报告中分别披露基金管理人、基金管理人高级管理人员、基金经理等人员以及基金管理人股东持有基金的份额、期限及期间的变动情况。

本基金持续运作过程中，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。

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。

基金托管人在对季度报告、中期报告或年度报告复核完毕后，可以出具复核确认书（盖章）或以其他双方约定的方式确认，以备有权机构对相关文件审核检查。

## 六、基金份额持有人名册的登记与保管

基金管理人可委托基金登记机构登记和保管基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容包括但不限于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，包括基金募集期结束并确认认购申请后的基金份额持有人名册、基金份额持有人大会权益登记日的基金份额持有人名册、每年最后一个交易日的基金份额持有人名册，由基金登记机构负责编制和保管，并对基金份额持有人名册的真实性、完整性和准确性负责。

基金管理人应根据基金托管人的要求定期和不定期向基金托管人提供基金份额持有人名册。

（一）基金管理人于《基金合同》生效日及《基金合同》终止日后 10 个工作日内向基金托管人提供由登记机构编制的基金份额持有人名册；

（二）基金管理人于基金份额持有人大会权益登记日后 5 个工作日内向基金托管人提供由登记机构编制的基金份额持有人名册；

（三）基金管理人于每年最后一个交易日后 10 个工作日内向基金托管人提供由登记机构编制的基金份额持有人名册；

（四）除上述约定时间外，如果确因业务需要，基金托管人与基金管理人商议一致后，由基金管理人向基金托管人提供由登记机构编制的基金份额持有人名册。

基金托管人以电子版形式妥善保管基金份额持有人名册，保存期限为 15 年，法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。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。若基金管理人或基金托管人由于自身原因无法妥善保管基金份额持有人名册，应按有关法规规定各自承担相应的责任。

## 七、争议解决方式

双方当事人同意，因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议，应经友好协商解决。如经友好协商未能解决的，则任何一方有权将争议提交上海国际经济贸易仲裁委员会进行仲裁，



仲裁地点为上海市，按照届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，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，双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》和本协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本协议受中华人民共和国（为本协议之目的，不包括香港、澳门特别行政区和台湾地区）法律管辖。

## 八、托管协议的变更、终止与基金财产的清算

### （一）基金托管协议的变更

本协议双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，应报中国证监会备案。

### （二）基金托管协议的终止

#### 1、《基金合同》终止；

2、基金托管人解散、依法被撤销、破产，被依法取消基金托管资格或因其他事由造成其他基金托管人接管基金财产；

3、基金管理人解散、依法被撤销、破产，被依法取消基金管理资格或因其他事由造成其他基金管理人接管基金管理权。

#### 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。

### （三）基金财产的清算

#### 1、基金财产清算小组

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》和本协议的规定继续履行保护基金资产安全的职责。

（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）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。

（3）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。

#### 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；

- （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，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，清算期限相应顺延。

基金财产清算的期限为 6 个月。

### 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依次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。

### 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。

## 第二十二部分 其他应披露事项

2025年7月1日至2026年6月30日发布的公告：

|    |                                                     |            |
|----|-----------------------------------------------------|------------|
| 1  | 华泰紫金丰益中短债债券型发起式证券投资基金 2025 年第 2 季度报告                | 2025-07-21 |
| 2  | 华泰证券（上海）资产管理有限公司旗下全部基金 2025 年 2 季度报告的提示性公告          | 2025-07-21 |
| 3  | 华泰紫金丰益中短债债券型发起式证券投资基金招募说明书更新 202508                 | 2025-08-09 |
| 4  | 华泰紫金丰益中短债债券型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新(202508)             | 2025-08-09 |
| 5  | 华泰证券（上海）资产管理有限公司关于运用自有资金投资旗下权益类公募基金的公告              | 2025-08-25 |
| 6  | 华泰证券（上海）资产管理有限公司旗下全部基金 2025 年中期报告的提示性公告             | 2025-08-29 |
| 7  | 华泰紫金丰益中短债债券型发起式证券投资基金 2025 年中期报告                    | 2025-08-29 |
| 8  | 华泰证券（上海）资产管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票估值调整的公告              | 2025-09-05 |
| 9  | 华泰证券（上海）资产管理有限公司关于高级管理人员变更的公告                       | 2025-10-24 |
| 10 | 华泰证券（上海）资产管理有限公司旗下全部基金 2025 年第 3 季度报告的提示性公告         | 2025-10-28 |
| 11 | 华泰紫金丰益中短债债券型发起式证券投资基金 2025 年第 3 季度报告                | 2025-10-28 |
| 12 | 华泰紫金丰益中短债债券型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新（202512）             | 2025-12-12 |
| 13 | 华泰紫金丰益中短债债券型发起式证券投资基金招募说明书更新 202512                 | 2025-12-12 |
| 14 | 华泰紫金丰益中短债债券型发起式证券投资基金基金经理变更公告                       | 2025-12-12 |
| 15 | 华泰证券（上海）资产管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票估值调整的公告              | 2025-12-23 |
| 16 | 华泰证券（上海）资产管理有限公司关于旗下部分基金 2026 年非港股通交易日暂停申购、赎回等业务的公告 | 2025-12-31 |
| 17 | 华泰证券（上海）资产管理有限公司旗下全部基金 2025 年第 4 季度                 | 2026-01-22 |

|    |                                                    |            |
|----|----------------------------------------------------|------------|
|    | 报告的提示性公告                                           |            |
| 18 | 华泰紫金丰益中短债债券型发起式证券投资基金 2025 年第 4 季度报告               | 2026-01-22 |
| 19 | 华泰证券（上海）资产管理有限公司高级管理人员变更公告                         | 2026-01-24 |
| 20 | 华泰证券（上海）资产管理有限公司高级管理人员变更公告                         | 2026-03-21 |
| 21 | 华泰证券（上海）资产管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）   | 2026-03-23 |
| 22 | 华泰证券（上海）资产管理有限公司旗下全部基金 2025 年度报告的提示性公告             | 2026-03-31 |
| 23 | 华泰紫金丰益中短债债券型发起式证券投资基金 2025 年年度报告                   | 2026-03-31 |
| 24 | 华泰紫金丰益中短债债券型发起式证券投资基金 2026 年第 1 季度报告               | 2026-04-22 |
| 25 | 华泰证券（上海）资产管理有限公司旗下全部基金 2026 年第 1 季度报告的提示性公告        | 2026-04-22 |
| 26 | 2025 年度华泰证券（上海）资产管理有限公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露 | 2026-04-29 |
| 27 | 华泰紫金丰益中短债债券型发起式证券投资基金基金经理变更公告-202605               | 2026-05-13 |
| 28 | 华泰紫金丰益中短债债券型发起式证券投资基金招募说明书更新 202605                | 2026-05-13 |
| 29 | 华泰紫金丰益中短债债券型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新（202605）            | 2026-05-13 |
| 30 | 华泰紫金丰益中短债债券型发起式证券投资基金分红公告                          | 2026-06-18 |

## 第二十三部分 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。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，有权增加和修改相关服务项目。

### （一）客户服务中心电话服务

投资人拨打基金管理人客服热线 4008895597（国内免长途话费）可享有如下服务：

1、自助语音服务：提供 7×24 小时基金净值信息、基金产品、最新公告信息等自助查询服务。

2、人工座席服务：提供每周五天，每个交易日不少于 8 小时的人工座席服务（法定节假日除外）。

### （二）客户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、传真等渠道对基金管理人和销售渠道提供的服务进行投诉或提出建议。

### （三）网站资讯服务

基金管理人网站（<https://www.htscamc.com>）为投资人提供理财刊物查阅、热点问答、市场波动点评、研究资讯等信息服务。同时，网站还设有在线客服、客服电子邮箱等，投资人可在线提问或留言。

（四）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。

## 第二十四部分 招募说明书的存放及查阅方式

本招募说明书存放在本基金管理人、基金托管人、基金销售机构的办公场所，投资人可在办公时间免费查阅；也可按工本费购买本招募说明书复制件或复印件，但应以招募说明书正本为准。

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。

## 第二十五部分 备查文件

以下备查文件存放在本基金管理人、基金托管人的办公场所。投资人可在办公时间免费查阅，也可按工本费购买复印件：

- 1、中国证监会准予本基金募集注册的文件；
- 2、《华泰紫金丰益中短债债券型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《华泰紫金丰益中短债债券型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、中国证监会规定的其他备查文件。