



招商信用添利债券型证券投资基金

上市交易公告书

基金管理人：招商基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

注册登记人：中国证券登记结算有限责任公司

上市地点：深圳证券交易所

上市时间：2010年7月30日

公告时间：2010年7月27日

目 录

一、重要声明与提示.....	2
二、基金概览.....	2
三、基金的募集与上市交易.....	3
四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人情况.....	5
五、基金主要当事人简介.....	6
六、基金合同摘要.....	12
七、基金财务状况（未经审计）.....	34
八、基金投资组合.....	35
九、重大事件揭示.....	37
十、基金管理人承诺.....	38
十一、基金托管人承诺.....	38
十二、基金上市推荐人意见.....	38
十三、备查文件目录.....	39



一、重要声明与提示

《招商信用添利债券型证券投资基金上市交易公告书》（以下简称“本公告书”）依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号<上市交易公告书的内容与格式>》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，招商信用添利债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）管理人的董事会及董事保证本公告书所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，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。

本基金托管人保证本公告书中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。

凡本公告书未涉及的有关内容，请投资者详细查阅刊登在2010年5月28日《中国证券报》和《证券时报》及招商基金管理有限公司网站（www.cmfchina.com）上公告的《招商信用添利债券型证券投资基金招募说明书》。

二、基金概览

- 1、基金名称：招商信用添利债券型证券投资基金
- 2、基金类型：债券型
- 3、基金简称：招商信用添利债券封闭
- 4、基金场内简称：招商信用
- 5、交易代码：161713
- 6、基金份额总额：2,116,636,763.44份（截至：2010年7月23日）
- 7、基金份额净值：1.018元（截至：2010年7月23日）
- 8、本次上市交易份额：1,649,213,376份（截至：2010年7月23日）
- 9、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所

- 10、上市交易日期：2010年7月30日
- 11、基金管理人：招商基金管理有限公司
- 12、基金托管人：中国农业银行股份有限公司
- 13、上市推荐人：无
- 14、本次上市交易的基金份额注册登记机构：中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司

三、基金的募集与上市交易

（一）本基金上市前基金募集情况

1、基金募集申请的核准机构和核准文号：中国证券监督管理委员会 2010年5月14日证监许可【2010】645号

2、基金运作方式：契约型。本基金在基金合同生效后进入第一个五年封闭期，封闭期结束前召开基金份额持有人大会，审议决定基金继续进入下一个五年封闭期或是转为上市开放式基金（LOF），本基金在深圳证券交易所上市交易。

3、基金存续期限：不定期

4、基金募集时间：自2010年6月1日至2010年6月21日

5、发售价格：1.00元人民币

6、发售方式：场内、场外发售

7、发售机构：

（1）场外发售机构

1) 直销机构：招商基金管理有限公司

2) 场外代销机构：中国农业银行、招商证券、申银万国证券、银河证券（排名不分先后）。

（2）场内发售机构

本基金通过深圳证券交易所上网定价发售，基金份额发售机构为具有基金代销资格的深圳证券交易所会员单位。包括：国信证券、招商证券、平安证券、长城证券、光大证券、方正证券、华泰证券、广发证券、广州证券、世纪证券、华西证券、国海证券、联讯证券、南京证券、华鑫证券、华林证券、厦门证券、民族证券、申银万国证券、中信万通证券、



海通证券、山西证券、民生证券、兴业证券、广发华福、长江证券、东莞证券、国联证券、国金证券、东北证券、恒泰证券、华安证券、东海证券、中信证券、东吴证券、中山证券、第一创业证券、大同证券、宏源证券、西藏证券、湘财证券、中金公司、华泰联合证券、东方证券、国泰君安证券、西南证券、银河证券、西部证券、渤海证券、上海证券、华龙证券、万联证券、齐鲁证券、国元证券、国都证券、中银证券、华宝证券、红塔证券、中信金通、日信证券、浙商证券、江南证券、财富证券、金元证券、国盛证券、中原证券、德邦证券、财通证券、新时代证券、远东证券、江海证券、中投证券、中信建投证券、安信证券、银泰证券、瑞银证券等（排名不分先后）。

8、验资机构名称：德勤华永会计师事务所

9、募集资金总额及入账情况：经德勤华永会计师事务所验资，此次募集的资金净额为人民币 2,116,202,568.81 元，折算成基金份额计 2,116,202,568.81 份；经基金注册登记人计算并确认的认购资金在募集期间的利息为人民币 434,194.63 元，折算成基金份额计 434,194.63 份。

上述资金除场内网上认购资金在 6 月 21 日至 6 月 24 日的利息外共 2,116,599,026.44 元人民币已于 2010 年 6 月 25 日划入本基金在基金托管人中国农业银行股份有限公司开立的招商信用添利债券型证券投资基金托管专户。场内网上认购资金 6 月 21 日至 6 月 24 日期间的利息将由中国证券登记结算有限公司深圳分公司（以下简称中登公司）于招商信用添利债券封闭募集期结束后第一个季度银行结息日后划付至基金托管人开立于中登公司的结算备付金账户，并由本基金的托管人中国农业银行股份有限公司于当日划入本基金托管专户。

10、本基金募集备案情况

本基金已于 6 月 25 日验资完毕，当日向中国证监会提交了验资报告，办理基金备案手续，并于 2010 年 6 月 25 日获书面确认，本基金《基金合同》自该日起正式生效。

11、基金合同生效日：2010 年 6 月 25 日

12、基金合同生效日的基金份额总额：2,116,636,763.44 份

（二）本基金上市交易的主要内容

1、基金上市交易的核准机构和核准文号：深圳证券交易所深证上[2010]236 号

2、上市交易日期：2010 年 7 月 30 日

3、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所。投资者在深圳证券交易所各会员单位证



券营业部均可参与基金交易。

4、基金简称：招商信用添利债券封闭

基金场内简称：招商信用

5、交易代码：161713

6、本次上市交易份额：1,649,213,376 份

7、基金净值的披露：基金管理人每个估值日对基金资产估值。用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。本基金上市交易后，基金管理人于每个工作日交易结束后将经过基金托管人复核的基金份额净值传送给深交所，深交所于次日通过行情系统揭示。根据《基金法》，本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此基金管理人公布的基金净值负责。

8、未上市交易份额的流通规定：未上市交易的份额托管在场外，持有人将其转托管至深圳证券交易所场内后即可上市流通。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人情况

（一）场内基金份额持有人户数

截至 2010 年 7 月 23 日，本基金场内份额持有人户数为 1172 户，平均每户持有的场内基金份额为 1,407,178.65 份。

（二）场内基金份额持有人结构

截至 2010 年 7 月 23 日，场内机构投资者持有的本基金份额有 1,619,493,132 份，占本基金场内总份额的 98.20%；场内个人投资者持有的基金份额有 29,720,244 份，占本基金场内总份额的 1.80%。

（三）本基金场内份额前十名持有人情况（截至 2010 年 7 月 23 日）

序号	持有人名称（全称）	持有基金份额	占场内基金份额的比例(%)
1	中国人民人寿保险股份有限公司-分红-个险分红	200,030,999	12.13%
2	中国出口信用保险公司	190,026,200	11.52%



3	辽宁大辽河投资集团有限公司	145,030,450	8.79%
4	长江金色晚晴(集合型)企业年金计划-浦发银行	125,020,398	7.58%
5	中英人寿保险有限公司	100,022,999	6.06%
6	中国人民健康保险股份有限公司-万能保险产品	100,014,999	6.06%
7	招商证券股份有限公司	100,007,999	6.06%
8	长城人寿保险股份有限公司-万能-个险万能	50,008,500	3.03%
9	中国平安人寿保险股份有限公司-传统-普通保险产品	50,006,999	3.03%
10	方正证券-中信-方正金泉友1号集合资产管理计划	50,004,000	3.03%
合计		1,110,173,543	67.29%

注：由于四舍五入的原因，占场内总份额比例分项之和与合计可能有尾差。

五、基金主要当事人简介

(一) 基金管理人

1、公司概况

名称：招商基金管理有限公司

法定代表人：马蔚华

总经理：成保良

设立日期：2002年12月27日

注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦28楼

注册资本：人民币2.1亿元

办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦28楼

设立批准文号：中国证监会证监基金字[2002]100号

工商登记注册的法人营业执照文号：企合国字第000976

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。

存续期间：持续经营

电话：(0755) 83196412

传真：(0755) 83196405

联系人：陈宏威

2、股东及其出资比例

管理人股东名称	占注册资本比例
招商银行股份有限公司	33.4%
招商证券股份有限公司	33.3%
ING Asset Management B.V.	33.3%

3、内部组织结构及职能

公司具体经营管理由总经理负责，公司根据经营运作需要设置董事会办公室、股票投资部、固定收益投资部、交易部、研究部、专户资产投资部、渠道管理部、市场部、产品研发部、国际业务部、机构理财一部、机构理财二部、机构理财三部、信息技术部、基金核算部、基金事务部、法律合规部、风险管理部、总经理办公室、人力资源部、财务部等 21 个职能部门，并设有北京分公司、上海分公司和成都分公司 3 个分支机构。

各部门主要职能如下：

董事会办公室：负责公司董事会相关工作。

股票投资部：根据投资决策委员会制定的原则进行投资股票投资。

固定收益投资部：负责固定收益产品的投资、研究。

交易部：负责公司所有产品的交易管理工作。

研究部：负责宏观、策略、行业和公司研究。

专户资产投资部：负责社保基金、专户理财产品的投资、研究。

渠道管理部：负责基金销售、销售渠道管理等工作。

市场部：负责营销策划、客户服务、市场推广等工作。

产品研发部：负责产品研发、申报等工作。

国际业务部：负责海外基金产品的投资、研究。

机构理财一部、机构理财二部、机构理财三部：负责公募产品和专户产品的机构销售



业务。

信息技术部：负责公司电脑信息技术的开发、维护及基金后台运作支持工作。

基金核算部：负责公司基金的会计核算、估值。

基金事务部：负责公司基金的注册登记、资金清算。

法律合规部：处理日常法律事务、信息披露事务。

风险管理部：负责揭示、控制公司投资运作以及其他各项业务的风险，对公司管理和基金运作合法合规性进行全方位的监察稽核，督促公司内部管理制度的执行。

总经理办公室：负责文档、印鉴管理，公司品牌建设、市场调研以及其他行政工作。

人力资源部：负责公司人力资源管理工作。

财务部：负责公司财务管理、会计核算等相关工作。

北京分公司：负责所辖区域内销售渠道的开发、维护。

上海分公司：负责所辖区域内销售渠道的开发、维护。

成都分公司：负责所辖区域内销售渠道的开发、维护。

4、人员情况

截至 2010 年 6 月 30 日，公司共有员工 175 人，其中 93 人具有硕士学历，5 人具有博士学历。公司主要业务部门人员大部分具有基金从业资格。

5、信息披露负责人及咨询电话：

欧志明，（0755）83196401。

6、基金管理业务情况

本基金管理公司目前管理十五只基金，其中一只封闭式基金，为招商信用添利债券型证券投资基金；十四只开放式基金，包括：招商安泰系列开放式证券投资基金（含招商安泰股票基金、招商安泰平衡型基金、招商安泰债券基金）、招商现金增值开放式证券投资基金、招商先锋混合型证券投资基金、招商优质成长股票型证券投资基金（LOF）、招商安本增利债券型证券投资基金、招商核心价值混合型证券投资基金、招商大盘蓝筹股票型证券投资基金、招商安心收益债券型证券投资基金、招商行业领先股票型证券投资基金、招商中小盘精选股票型证券投资基金、招商全球资源股票型证券投资基金（QDII）、招商深证 100 指数型证券投资基金。

7、本基金基金经理简介

张国强，男，中国国籍，经济学硕士。曾任中信证券股份有限公司研究咨询部分析师、债券销售交易部经理、产品设计主管、总监，中信基金管理有限责任公司投资管理部总监、



基金经理。2009年加入招商基金管理有限公司，现任固定收益投资部总监及招商安本增利债券型证券投资基金的基金经理。张国强具有8年证券从业经历，拥有中国证券业执业证书。

（二）基金托管人

1、基金托管人概况

名称：中国农业银行股份有限公司（简称中国农业银行）

住所：北京市东城区建国门内大街69号

办公地址：北京市海淀区西三环北路100号金玉大厦

法定代表人：项俊波

成立日期：2009年1月15日

注册资本：2600亿元人民币

存续期间：持续经营

联系电话：010-68424199

联系人：李芳菲

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分，总行设在北京。经国务院批准，中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于2009年1月15日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡，成为国内网点最多、业务辐射范围最广，服务领域最广，服务对象最多，业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外，中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉，每年位居《财富》世界500强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行，中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念，坚持审慎稳健经营、可持续发展，立足县域和城市两大市场，实施差异化竞争策略，着力打造“伴你成长”服务品牌，依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品，致力为广大客户提供优质的金融服务，与广大客户共创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行，经验丰富，服务优质，业绩突出，2004年被英国《全球托管人》评为中国“最佳托管银行”。2007年中国农业银行通过了美国SAS70内部控制审计，并获得无保留意见的SAS70审计报告，表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农

业银行证券投资基金托管部于1998年5月经中国证监会和中国人民银行批准成立，2004年9月更名为托管业务部，内设养老金管理中心、技术保障处、营运中心、委托资产托管处、保险资产托管处、证券投资基金托管处、境外资产托管处、综合管理处、风险管理处，拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

2、基金托管部负责人情况

张健：1955年生，男，中国农业银行托管业务部总经理，经济学学士、高级经济师。曾任中国农业银行党委组织部副部长、人事部副总经理（主持工作），中国农业银行房地产信贷部总经理，中国农业银行河南分行党委书记、行长。28年金融从业经历。

3、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工130名，其中高级会计师、高级经济师、高级工程师、律师等专家10余名，服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强，高级管理层均有20年以上金融从业经验和高级技术职称，精通国内外证券市场的运作。

4、基金托管业务经营情况

截止2010年3月底，中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共75只，包括金元比联丰利债券型证券投资基金、富国天源平衡混合型证券投资基金、华夏平稳增长混合型证券投资基金、大成积极成长股票型证券投资基金、大成景阳领先股票型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金、长盛同德主题增长股票型证券投资基金、裕阳证券投资基金、汉盛证券投资基金、裕隆证券投资基金、景福证券投资基金、鸿阳证券投资基金、丰和价值证券投资基金、久嘉证券投资基金、长盛成长价值证券投资基金、宝盈鸿利收益证券投资基金、大成价值增长证券投资基金、大成债券投资基金、银河稳健证券投资基金、银河收益证券投资基金、长盛中信全债指数增强型债券投资基金、长信利息收益开放式证券投资基金、长盛动态精选证券投资基金、景顺长城内需增长开放式证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、长信银利精选开放式证券投资基金、富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金、鹏华货币市场证券投资基金、中海分红增利混合型证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、新华优选分红混合型证券投资基金、交银施罗德精选股票证券投资基金、泰达荷银货币市场基金、交银施罗德货币市场证券投资基金、景顺长城资源垄断股票型证券投资基金、大成沪深300指数证券投资基金、信诚四季红混合型证券投资基金、富国天时货币市场基金、富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金、益民货币市场基金、长城安心回报混合型证券投资基金、中邮核心优选股票型证券投资基金、景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金、交银施罗德成长股票型证券投



资基金、长盛中证100指数证券投资基金、泰达荷银首选企业股票型证券投资基金、东吴价值成长双动力股票型证券投资基金、鹏华动力增长混合型证券投资基金、宝盈策略增长股票型证券投资基金、国泰金牛创新成长股票型证券投资基金、益民创新优势混合型证券投资基金、中邮核心成长股票型证券投资基金、华夏复兴股票型证券投资基金、富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金、长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金、富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金、申万巴黎竞争优势股票型证券投资基金、新华优选成长股票型证券投资基金、金元比联成长动力灵活配置混合型证券投资基金、天治稳健双盈债券型证券投资基金、中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金、交银施罗德先锋股票型证券投资基金、东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、银华内需精选股票型证券投资基金(LOF)、大成行业轮动股票型证券投资基金、交银施罗德上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金、上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金、富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金、南方中证500指数证券投资基金(LOF)、景顺长城能源基建股票型证券投资基金、中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信中小盘成长股票型证券投资基金。

(三) 基金验资机构

名称：德勤华永会计师事务所有限公司
注册地址：上海市延安东路 222 号 30 楼
法定代表人：卢伯卿
电话：(021) 61418888
传真：(021) 63350177
经办注册会计师：陶坚、汪芳
联系人：陶坚

(四) 上市推荐人

本基金无上市推荐人。



六、基金合同摘要

(一) 基金合同当事人的权利、义务

1、基金管理人的权利和义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的权利为：

(1) 自本基金合同生效之日起，依照有关法律法规和本基金合同的规定独立运用基金财产；

(2) 依照《基金合同》获得基金管理费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；

(3) 依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

(4) 在符合有关法律法规和本基金合同的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则，决定基金的除调高托管费和管理费之外的费率结构和收费方式；

(5) 根据本基金合同及有关规定监督基金托管人，对于基金托管人违反了本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金财产、其他基金当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会和银行业监督管理机构，并采取必要措施保护基金及相关基金当事人的利益；

(6) 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购、赎回和转换申请；

(7) 自行担任基金注册登记机构或选择、更换注册登记机构，并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查；

(8) 选择、更换代销机构，并依据销售代理协议和有关法律法规，对其行为进行必要的监督和检查；

(9) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

(10) 依法召集基金份额持有人大会；

(11) 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；

(12) 根据国家有关规定，在法律法规允许的前提下，以基金的名义依法为基金融资、融券；

(13) 法律法规规定的其他权利。

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的义务为：



- (1) 依法募集基金，办理或者委托经由证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和注册登记事宜；
- (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、勤勉尽责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财产分别管理，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) 计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；
- (9) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回、注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；
- (10) 按规定受理基金份额的申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
- (11) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- (12) 编制中期和年度基金报告；
- (13) 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；
- (14) 保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、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，不得向他人泄露；
- (15) 按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；
- (16) 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；
- (17) 保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- (18) 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- (19) 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；
- (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，应当承



承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(21) 基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

(22) 按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；

(23) 建立并保存基金份额持有人名册；

(24) 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；

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；

(26) 不从事任何有损基金及其他基金合同当事人利益的活动；

(27) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利，不谋求对上市公司的控股和直接管理；

(28) 法律法规、基金合同规定的以及中国证监会要求的其他义务。

2、基金托管人的权利和义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的权利为：

(1) 依照《基金合同》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收入；

(2) 监督基金管理人对本基金的投资运作；

(3) 自本基金合同生效之日起，依法保管基金财产；

(4) 在基金管理人更换时，提名新任基金管理人；

(5) 根据本基金合同及有关规定监督基金管理人，对于基金管理人违反本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金财产、其他基金合同当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关基金合同当事人的利益；

(6) 依法召集基金份额持有人大会；

(7) 按规定取得基金份额持有人名册；

(8) 法律法规规定的其他权利。

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的义务为：

(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，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；



对所托管的不同基金财产分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

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

(5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

(6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；

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

(8) 对基金财务会计报告、中期和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人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；

(9) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料不少于 15 年；

(10) 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；

(11) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

(12) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值和基金份额申购、赎回价格；

(13) 按照规定监督基金管理人的投资运作；

(14) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

(15) 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；

(16) 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；

(17) 因违反基金合同导致基金财产损失，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(18) 按规定监督基金管理人按照法律法规规定和基金合同履行其义务，基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿；

(19) 根据本基金合同和托管协议规定建立并保存基金份额持有人名册；

(20) 参加基金财产清算组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

(21) 面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告中国证监会和中国银监会，并通知基金管理人；

(22) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；

(23) 法律法规、基金合同规定的以及中国证监会要求的其他义务。



3、基金份额持有人的权利和义务

基金投资者自依招募说明书、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当事人，直至其不再持有本基金的基金份额，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的完全承认和接受。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。

每份基金份额具有同等的合法权益。

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关法律法规的规定，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；
- (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、基金份额代销机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；
- (9) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关法律法规的规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：

- (1) 遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；
- (2) 缴纳基金认购、申购款项及法律法规、基金合同和招募说明书规定的费用；
- (3) 在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；
- (4) 不从事任何有损基金及其他基金份额持有人合法权益的活动；
- (5) 执行生效的基金份额持有人大会决议；
- (6) 返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人、基金托管人及基金管理人的代理人处获得的不当得利；
- (7) 法律法规和基金合同规定的其他义务。



(二) 基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

1、基金份额持有人大会由基金份额持有人或基金份额持有人的合法授权代表共同组成。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

2、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：

(1) 终止基金合同；

(2) 转换基金运作方式；

(3) 变更基金类别；

(4) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略（法律法规和中国证监会另有规定的除外）；

(5) 变更基金份额持有人大会议事程序；

(6) 更换基金管理人、基金托管人；

(7) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准。但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；

(8) 本基金与其他基金的合并；

(9) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响，需召开基金份额持有人大会的变更基金合同等其他事项；

(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) 封闭期内基金扩募或者延长基金合同的封闭期限；

(13) 终止基金上市，但因本基金不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市的除外

(14) 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) 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) 调低基金管理费、基金托管费、其他应由基金或基金份额持有人承担的费用；

(2) 法律法规要求增加的基金费用的收取；

(3) 在法律法规和本基金合同规定的范围内调整基金的申购费率、调低赎回费率或变更



收费方式；

- (4) 因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；
- (5) 基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化；
- (6) 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；
- (7) 按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

3、召集人及召集方式

1) 除法律法规或本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。基金管理人未按规定召集或者不能召集时，由基金托管人召集。

2) 基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 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或在规定时间内未能作出书面答复，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。

3) 代表基金份额 10%以上（以上含本数，下同）的基金份额持有人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 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或在规定时间内未能作出书面答复，代表基金份额 10%以上的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 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。

4) 代表基金份额 10%以上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或在规定时间内未能作出书面答复的，代表基金份额 10%以上的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会，但应当至少提前 30 日向中国证监会备案。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。

- 5) 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。

4、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) 基金份额持有人大会的召集人(以下简称“召集人”)负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。召开基金份额持有人大会，召集人必须于会议召开日前 40 日在指定媒



体和基金管理人网站公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容：

- (1) 会议召开的时间、地点和出席方式；
- (2) 会议拟审议的主要事项；
- (3) 会议形式；
- (4) 议事程序；
- (5) 有权出席基金份额持有人大会的权益登记日；
- (6) 授权委托书的内容要求(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；
- (7) 表决方式；
- (8) 会务常设联系人姓名、电话；
- (9) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- (10) 召集人需要通知的其他事项。

2) 采用通讯方式开会并进行表决的情况下，由召集人决定通讯方式和表决方式，并在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、表达意见的寄交的截止时间和收取方式。

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

5、基金份额持有人出席会议的方式

1) 会议方式

(1) 基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会，会议的召开方式由会议召集人确定。

(2) 现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席，基金管理人或基金托管人拒不派代表出席的，不影响表决效力。

(3) 通讯方式开会指基金份额持有人将其对表决事项的表决意见以书面形式或会议通知等相关公告中指定的其他形式在表决截至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会议通知等相关公告中指定的其他形式进行表决。



2) 召开基金份额持有人大会的条件

(1) 现场开会方式

在同时符合以下条件时，现场会议方可举行：

a. 经核对、汇总，到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，全部有效凭证所对应的基金份额应占权益登记日基金总份额的 50%以上（含 50%，下同）；

b. 亲自出席会议者持有基金份额持有人凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及授权委托书等文件符合有关法律、法规和基金合同及会议通知的规定，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。

未能满足上述条件的情况下，则召集人可另行确定并公告重新开会的时间（至少应在 25 个工作日后）和地点，但确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不变。

(2) 通讯开会方式

在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

a. 召集人按本基金合同规定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告；

b. 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和统计基金份额持有人的表决意见，基金管理人或基金托管人经通知拒不参加收取和统计表决意见的，不影响表决效力；

c. 本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额应占权益登记日基金总份额的 50%以上（含 50%）；

d. 直接出具表决意见的基金份额持有人或受托代表他人出具表决意见的代表，同时提交的持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与登记注册机构记录相符，并且委托人出具的代理投票授权委托书符合法律法规、基金合同和会议通知的规定；

如果开会条件达不到上述的条件，则召集人可另行确定并公告重新表决的时间（至少应在 25 个工作日后），且确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不变。

6、议事内容与程序

1) 议事内容及提案权

(1) 议事内容为本基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容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。

(2) 基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日本基金总份额 10%以上的基



金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前就召开事由向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案；也可以在会议通知发出后向大会召集人提交临时提案，临时提案应当在大会召开日前 35 日提交召集人。召集人对于临时提案应当在大会召开日前 30 日公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少与临时提案公告日期有 30 日的间隔期。

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

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

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

(4) 单独或合并持有权益登记日基金总份额 10%以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案、基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于 6 个月。法律法规另有规定的除外。

(5) 基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后，如果需要对原有提案进行修改，应当最迟在基金份额持有人大会召开日前 30 日公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有 30 日的间隔期。

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规定程序宣布会议议事程序及注意事项，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，经合法执业的律师见证后形成大会决议。

大会由基金管理人授权代表主持。在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权代表主持；如果基金管理人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以所代表的基金份额 50%以上(含 50%)多数选举产生



一名代表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。

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)、身份证号码、住所地址、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名(或单位名称)等事项。

(2) 通讯方式开会

在通讯表决开会的方式下，首先由召集人按照前述约定公布提案，在所通知的表决截止日期第 2 日在公证机构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。

3) 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。

7、决议形成的条件、表决方式、程序

1) 基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

2) 基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

(1) 一般决议

一般决议须经出席会议的基金份额持有人及其代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）通过方为有效，除下列(2)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

特别决议须经出席会议的基金份额持有人及代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方为有效；更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式、提前终止基金合同必须以特别决议通过方为有效。

3) 基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会核准，或者备案，并予以公告。

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

5) 基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

6) 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。

8、计票



1) 现场开会

(1) 如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集, 则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推举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人; 如大会由基金份额持有人自行召集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和代理人中推举 3 名基金份额持有人担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的, 不影响计票的效力及表决结果。

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

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

2) 通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下, 计票方式为: 由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表(如果基金托管人为召集人, 则为基金管理人授权代表)的监督下进行计票, 并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人不派代表监督计票的, 不影响计票效力及表决结果。但基金管理人或基金托管人应当至少提前两个工作日通知召集人, 由召集人邀请无直接利害关系的第三方担任监督计票人员。

9、基金份额持有人大会决议报中国证监会核准或备案后的公告时间、方式

1) 基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议, 召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效, 并在生效后方可执行。

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

3) 基金份额持有人大会决议应自生效之日起 2 个工作日内在指定媒体和基金管理人网



站公告。

4) 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、公证机关、公证员姓名等一同公告。

(三) 基金的收益分配原则和执行方式

1、基金利润的构成

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

2、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资产负债表中基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

3、收益分配原则

本基金收益分配应遵循下列原则:

1) 封闭期间, 基金收益分配采用现金方式。开放期间, 基金收益分配方式分为现金分红与红利再投资, 投资人可选择获取现金红利或将现金红利按再投日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资, 若投资人不选择, 本基金默认的收益分配方式是现金红利; 登记在深圳证券账户的基金份额只能采取现金红利方式, 不能选择红利再投资;

2) 每一基金份额享有同等分配权;

3) 基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值, 基金收益分配基准日即基金可供分配利润计算截止日;

4) 在符合有关基金收益分配条件的前提下, 本基金收益分配每季度至少 1 次, 每年至多 12 次, 每次收益分配的比例不低于基金可供分配利润的 70%。并且, 封闭期间本基金每年度收益分配比例不得低于基金该年度已实现收益的 90%。基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配;

5) 基金红利发放日距离收益分配基准日的时间不超过 15 个工作日;

6) 投资者的现金红利和分红再投资形成的基金份额均保留到小数点后两位, 小数点两位以后四舍五入, 由此产生的收益和损失归基金资产;

7) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

4、收益分配方案

基金收益分配方案中应载明基金期末可供分配利润、基金收益分配对象、分配原则、



分配时间、分配数额及比例、分配方式、支付方式等内容。

5、收益分配的时间和程序

1) 本基金收益分配方案由基金管理人拟定、由基金托管人核实后确定，基金管理人按法律法规的规定在至少一家指定媒体公告并向中国证监会备案。

2) 在分配方案公布后(依据具体方案的规定)，基金管理人就支付的现金红利向基金托管人发送划款指令，基金托管人按照基金管理人的指令及时进行分红资金的划付。

6、收益分配中发生的费用

1) 收益分配采用红利再投资方式免收再投资的费用。

2) 收益分配时发生的银行转账等手续费用由基金份额持有人自行承担；如果基金份额持有人所获现金红利不足支付前述银行转账等手续费用，注册登记机构自动将该基金份额持有人的现金红利按除权日的基金份额净值转为基金份额。

7、收益分配方案的确定与公告

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核后确定，在 2 日内在至少一家指定媒体公告并报中国证监会备案。

(四) 与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例

1、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) 基金合同生效后的信息披露费用；
- 4) 基金上市费用；
- 5) 基金份额持有人大会费用；
- 6) 基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
- 7) 基金的证券交易费用；
- 8) 基金财产拨划支付的银行费用；
- 9) 按照国家有关规定可以在基金财产中列支的其他费用。

2、上述基金费用由基金管理人在法律法规规定的范围内按照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

3、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



在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}, \text{ 本基金年管理费率为 } 0.7\%$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

2) 基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}, \text{ 本基金年托管费率为 } 0.2\%$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

3) 上述(一)中 3 到 8 项费用由基金托管人根据其他有关法律法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

4、不列入基金费用的项目

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，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用；

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。

5) 基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。降低基金管理费率和基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率实施日前在指定媒体和基金管理人网站上刊登公告。

6、基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。



(五) 基金财产的投资范围和投资限制

1. 投资范围

本基金的投资范围限于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金重点投资于固定收益类证券，包括国债、央行票据、公司债、企业债、短期融资券、政府机构债、政策性金融机构金融债、商业银行金融债、资产支持证券、次级债、可转换债券及可分离转债、回购及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具。

本基金不从二级市场买入股票或权证，但可参与一级市场新股申购或增发新股，还可持有因可转债转股所形成的股票、因所持股票进行股票配售及派发所形成的股票、因投资可分离债券所形成的权证等资产。

如果法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入本基金的投资范围。

本基金对固定收益类证券的投资比例不低于基金资产的 80%，其中对投资级别以上的信用债券的投资比例不低于基金资产的 80%（信用债券包括公司债、企业债、短期融资券、商业银行金融债、资产支持证券、次级债、可转换债券、可分离转债，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他信用类金融工具），对股票等权益类证券的投资比例不超过基金资产的 20%。

若本基金转为上市开放式基金（LOF），则本基金将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。

2. 投资限制

1) 组合限制

本基金的投资组合将遵循以下限制：

(1) 本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%；

(2) 本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过该证券的 10%；

(3) 进入全国银行间同业市场的债券回购融入的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

(4) 本基金参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；



(5) 本基金不能在二级市场主动投资权证但可以通过一级市场申购可分离债等方式持有权证, 本基金在任何交易日买入权证的总金额, 不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%, 基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%, 本基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%, 法律法规或中国证监会另有规定的, 遵从其规定;

(6) 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%;

(7) 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, 不得超过该基金资产净值的 10%;

(8) 基金管理人管理的全部证券投资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) 本基金持有的全部资产支持证券, 其市值不得超过该基金资产净值的 20%;

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

(11) 本基金对固定收益类证券的投资比例不低于基金资产的 80%, 对投资级别以上的信用债券的投资比例不低于基金资产的 80%, 对股票等权益类证券的投资比例不超过基金资产的 20%;

若本基金转为上市开放式基金(LOF), 则本基金将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;

(12) 本基金只投资于投资级别以上的信用债券, 基金持有信用债券期间, 如果其信用等级下降至投资级别以下, 应在评级报告发布之日起 30 个交易日内予以全部卖出;

(13) 本基金不得违反基金合同中有关投资范围、投资策略、投资比例的规定;

(14) 法律法规或监管部门规定的其它限制。

基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。在符合相关法律法规规定的前提下, 因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等非本基金管理人的因素致使基金的投资组合不符合上述规定的投资比例的, 基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规或监管部门另有规定的, 从其规定。

若法律法规或监管部门取消上述限制, 履行适当程序后, 本基金投资可不受上述规定限制。



2) 禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

- 1、承销证券；
- 2、向他人贷款或者提供担保；
- 3、从事承担无限责任的投资；
- 4、买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
- 5、向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- 6、买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；
- 7、从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- 8、依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

若法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，履行适当程序后，本基金投资可不受上述规定限制。

(六) 基金资产净值的计算方法和公告方式

1、估值方法

本基金按以下方式进行估值：

1) 证券交易所上市的有价证券的估值

(1) 交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

(2) 交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

(3) 交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估



值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

(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。交易所上市的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

2) 处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

(1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价（收盘价）估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

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

(3) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的市价（收盘价）估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3) 因持有股票而享有的配股权，采用估值技术确定公允价值。

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

5) 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。

6) 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。

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。

根据《基金法》，基金管理人计算并公告基金资产净值，基金托管人复核、审查基金管理人计算的基金资产净值。因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。

2. 公告方式

本基金合同生效后，基金上市交易前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值。

基金上市交易后，基金管理人将在每个交易日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露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，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、申购赎回代理机构以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在上述市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定媒体和基金管理人网站上。

（七）基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

1、基金合同的变更

1)下列涉及到基金合同内容变更的事项应召开基金份额持有人大会并经基金份额持有人大会决议同意：

- (1)终止基金合同；
- (2)转换基金运作方式；
- (3)变更基金类别；
- (4)变更基金投资目标、投资范围或投资策略（法律法规和中国证监会另有规定的除外）；
- (5)变更基金份额持有人大会议事程序；
- (6)更换基金管理人、基金托管人；
- (7)提高基金管理人、基金托管人的报酬标准。但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；
- (8)本基金与其他基金的合并；
- (9)对基金合同当事人权利、义务产生重大影响，需召开基金份额持有人大会的变更基金合同等其他事项；
- (10) 终止基金上市，但因本基金不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市的除外；
- (11)法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

但出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会决议，由基金管理人和基金托管人同意变更后公布经修订的基金合同，并报中国证监会备案：

- (1)因相应的法律法规发生变动并属于基金合同必须遵照进行变更的情形；
- (2)基金合同的变更并不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化的；



(3)因为当事人名称、住所、法定代表人变更，当事人分立、合并等原因导致基金合同内容必须作出相应变动的；

(4)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的；

(5)除按照法律法规和基金合同规定不需要召开基金份额持有人大会的其他情形的。

2)关于变更基金合同的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准或备案，并经中国证监会核准或出具无异议意见之日起生效。基金管理人应在上述基金份额持有人大会决议生效后2日内在指定媒体和基金管理人网站公告。

2、本基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同将终止：

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

3、基金财产的清算

1) 基金财产清算小组

(1)基金合同终止后，成立基金清算小组，基金清算小组在中国证监会的监督下进行基金清算。

(2)基金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。基金清算小组可以聘用必要的工作人员。

(3)基金清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金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)基金合同终止时，由基金清算小组统一接管基金财产；
- (2)对基金财产进行清理和确认；
- (3)对基金财产进行估价和变现；
- (4)制作清算报告；
- (5)聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- (6)聘请会计师事务所对清算报告进行审计；
- (7)将基金清算结果报告中国证监会；



- (8) 公布基金清算报告；
- (9) 对基金剩余财产进行分配。

3) 清算费用

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

4) 基金财产按下列顺序清偿：

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

基金财产未按前款(1)－(3)项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

5) 基金财产清算的公告

基金财产清算报告于基金合同终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金清算小组公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算结果经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，由基金财产清算小组报中国证监会备案并公告。

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。

(八) 争议解决方式

对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。

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。

本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

(九) 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、代销机构的办公场所和营业场所查阅；投资者也可按工本费购买基金合同复制件或复印件，但内容应以本基金合



同正本为准。

七、基金财务状况（未经审计）

（一）本基金募集期间相关费用明细

深圳证券交易所在招商信用添利债券型证券投资基金认购期间未收取任何费用。其他各基金销售机构根据本基金《招募说明书》设定的认购费率或佣金比率收取认购费。

本基金募集期间的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用，不从基金财产中列支。

（二）本基金发售后至本公告书公告前的重要财务事项

本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

（三）招商信用添利债券型证券投资基金截至 2010 年 7 月 23 日资产负债表如下：

资产负债表

会计主体：招商信用添利债券型证券投资基金

报告截止日：2010 年 7 月 23 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2010 年 7 月 23 日
资 产：	
银行存款	45,368,944.11
结算备付金	9,556,180.30
存出保证金	250,000.00
交易性金融资产	2,755,211,019.88
其中：股票投资	-
基金投资	
债券投资	2,755,211,019.88
资产支持证券投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	-
应收利息	55,557,069.70
应收股利	-

应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产合计:	2,865,943,213.99
负债和所有者权益	本期末 2010年7月23日
负债:	
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	709,398,335.90
应付证券清算款	52,553.60
应付赎回款	-
应付管理人报酬	938,714.72
应付托管费	268,204.18
应付销售服务费	-
应付交易费用	15,647.10
应付税费	-
应付利息	130,198.46
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	274,421.19
负债合计	711,078,075.15
所有者权益:	
实收基金	2,116,636,763.44
未分配利润	38,228,375.40
所有者权益合计	2,154,865,138.84
负债与持有人权益总计:	2,865,943,213.99

注:报告截止日2010年7月23日,基金份额净值1.018元,基金份额总额2,116,636,763.44份。

八、基金投资组合

截至公告前两个工作日即2010年7月23日,招商信用添利债券型证券投资基金的投资组合如下:

(一) 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	2,755,211,019.88	96.14
	其中：债券	2,755,211,019.88	96.14
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	54,925,124.41	1.92
6	其他资产	55,807,069.70	1.95
7	合计	2,865,943,213.99	100.00

(二) 报告期末按行业分类的股票投资组合

截至公告前两个工作日即 2010 年 7 月 23 日，本基金未持有股票。

(三) 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

截至公告前两个工作日即 2010 年 7 月 23 日，本基金未持有股票。

(四) 报告期末按券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	99,970,000.00	4.64
3	金融债券	171,281,000.00	7.95
	其中：政策性金融债	171,281,000.00	7.95
4	企业债券	2,482,638,675.88	115.21
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	1,321,344.00	0.06
7	其他	-	-
8	合计	2,755,211,019.88	127.86

(五) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	1080003	10 乌城投债	2,000,000	211,740,000.00	9.83
2	1080058	10 鄂国资债	1,800,000	188,910,000.00	8.77
3	0980181	09 淮城资债	1,500,000	161,130,000.00	7.48
4	1080056	10 抚顺城投债	1,500,000	154,380,000.00	7.16
5	122973	09 昆创控	1,400,000	137,130,000.00	6.36

(六) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资



明细

截至公告前两个工作日即 2010 年 7 月 23 日，本基金未持有资产支持证券。

（七）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

截至公告前两个工作日即 2010 年 7 月 23 日，本基金未持有权证。

（八）投资组合报告附注

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。

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

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。

截至公告前两个工作日即 2010 年 7 月 23 日，本基金未持有股票。

3) 本基金 2010 年 7 月 23 日，其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	250,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	55,557,069.70
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	55,807,069.70

4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

截至公告前两个工作日即 2010 年 7 月 23 日，本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

截至公告前两个工作日即 2010 年 7 月 23 日，本基金未持有股票。

九、重大事件揭示

本基金自合同生效至上市交易期间未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。



十、基金管理人承诺

本基金管理人就本基金上市交易之后履行管理人职责做出如下承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规、基金合同的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

（二）真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件，披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息，并接受中国证监会、证券交易所的监督管理。

（三）在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后，将及时予以公开澄清。

十一、基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，设立专门的基金托管部，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。

（二）根据《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付等行为进行监督和核查。

（三）基金托管人发现基金管理人的行为违反《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，督促基金管理人改正。

（四）基金托管人发现基金管理人具有重大违规行为，将立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

十二、基金上市推荐人意见

本基金无上市推荐人。

十三、备查文件目录

投资者如果需了解更详细的信息，可向基金管理人、基金托管人或销售代理人申请查阅以下文件：

- 1、中国证监会批准招商信用债投资基金募集的文件
- 2、《招商信用添利债券型证券投资基金基金合同》
- 3、《招商信用添利债券型证券投资基金托管协议》
- 4、《招商信用添利债券型证券投资基金代销协议》
- 5、《招商信用添利债券型证券投资基金注册登记协议》
- 6、《律师事务所法律意见书》
- 7、招商基金管理有限公司业务资格批件、营业执照和公司章程
- 8、中国农业银行股份有限公司业务资格批件和营业执照
- 9、中国证监会要求的其他文件

