

国投瑞银双债丰利两年定期开放债券型证券投资基金基金份额

上市交易公告书

一、重要声明与提示

国投瑞银双债丰利两年定期开放债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）基金份额上市交易公告书依据《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，本基金管理人的董事会及董事保证本上市交易公告书（以下简称“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，请投资人详细查阅2016年1月15日刊登于《证券时报》和国投瑞银基金管理有限公司网站（www.ubssdic.com）的本基金招募说明书。

二、基金概览

- 1、基金名称：国投瑞银双债丰利两年定期开放债券型证券投资基金
- 2、基金类型：债券型
- 3、基金运作方式：契约型、定期开放式
- 4、基金存续期限：不定期
- 5、国投瑞银双债丰利两年定期开放债券型证券投资基金基金份额的申购与赎回：本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。本基金场外申购和赎回场所为基金管理人的直销网点及基金场外代销机构的代销网点，场内申购和赎回场所为深圳证券交易所内具有相应业务资格的会员单位。
- 6、基金份额简称：国投瑞银双债丰利定开债券、国投瑞银双债丰利定开债A、国投瑞银双债丰利定开债C
- 7、本次上市交易的基金份额场内简称：丰利A类
- 8、基金份额交易代码：161230
- 9、基金份额总额：截止2016年2月18日，基金份额总额为803,780

, 019.03 份

10、本次上市交易份额：677,029.00 份

11、基金份额净值：截止 2016 年 2 月 18 日，基金份额净值为 1.001 元。

12、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所

13、上市交易日期：2016 年 2 月 25 日

14、基金管理人：国投瑞银基金管理有限公司

15、基金托管人：中国建设银行股份有限公司

16、基金份额注册登记机构：中国证券登记结算有限责任公司

三、基金的募集与上市交易

（一）上市前基金募集情况

1、本基金募集申请的注册机构和注册文号：2014 年 1 月 15 日中国证监会证监许可[2014]99 号

2、基金运作方式：契约型、定期开放式

3、基金合同期限：不定期

4、本基金发售日期：2016 年 1 月 18 日至 2016 年 1 月 28 日

5、份额发售方式：场外和场内两种方式公开发售。A 类基金份额通过场外和场内两种方式发售，并在交易所上市交易；C 类基金份额通过场外方式发售，不在交易所上市交易。

6、发售价格：基金份额初始面值为人民币 1.00 元，按面值发售

7、发售机构

（1）场外发售机构

1) 直销机构：国投瑞银基金管理有限公司直销中心（含直销柜台与网上交易）

2) 代销银行：上海浦东发展银行股份有限公司。

3) 其他发售机构：好买基金销售、数米基金销售、天天基金销售、浙江同花顺基金销售。

（2）场内发售机构：具有基金代销资格的深圳证券交易所会员单位。

8、验资机构名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

9、募集资金总额及入账情况

本次募集的净认购金额为 803,635,044.71 元人民币，认购款项在本基金验资确认日之前产生的银行利息共计 144,974.32 元人民币。本次募集所有资金已于 2016 年 2 月 2 日全额划入本基金托管专户。

本次募集有效认购户数为 1,535 户，按照每份基金份额面值 1.00 元人民币计算，本次募集资金及其产生的利息结转的基金份额共计 803,780,019.03 份，已全部

计入各基金份额持有人的基金账户。

10、基金备案情况

本基金已于 2016 年 2 月 2 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 2016 年 2 月 3 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：2016 年 2 月 3 日

12、基金合同生效日的基金份额总额：803,780,019.03 份

(二) 基金份额上市交易的主要内容

1、本基金基金份额上市交易的核准机构和核准文号：深圳证券交易所深证上

【2016】70 号

2、上市交易日期：2016 年 2 月 25 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：国投瑞银双债丰利定开债 A

5、场内简称：丰利 A 类

6、交易代码：161230

7、本次上市交易份额：677,029.00 份

8、未上市交易份额的流通规定：未上市交易的 A 类份额托管在场外，基金份额持有人将其跨系统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

(一) 基金份额持有情况

截至 2016 年 2 月 18 日，国投瑞银双债丰利定开债券的基金份额持有人总户数为 1,535 户，共持有基金份额 803,780,019.03 份，其中丰利 A 类场内基金份额持有人户数为 343 户，平均每户持有的场内基金份额为 1,973.85 份；丰利 A 类场外基金份额持有人户数为 883 户，平均每户持有的场外基金份额为 907,959.11 份；

截至 2016 年 2 月 18 日，场内个人投资者持有的本次上市交易的基金份额为 677,029.00 份，占本次上市交易场内基金份额比例为 100.00%。

(二) 截至 2016 年 2 月 18 日，场内基金份额前十名持有人情况

■

五、基金主要当事人简介

(一) 基金管理人

1、基金管理人概况

名称：国投瑞银基金管理有限公司

注册地址：上海市虹口区东大名路 638 号 7 层

法定代表人：叶柏寿

总经理：王彬

成立时间：2002 年 6 月 13 日

注册资本：壹亿元人民币

设立批准文号：中国证监会证监基字 [2002] 25 号

工商登记注册的法人营业执照文号：440301501129644（市局）

经营范围：基金管理业务；设立与发起基金；特定客户资产管理；境外证券投资管理及经中国证券监督管理委员会批准的其他业务

存续期间：持续经营

2、股东及其出资比例



3、内部组织结构及职能

本基金管理人内部共设有研究部、基金投资部、专户投资部、交易部、运营部、信息技术部、机构服务部、产品及业务拓展部、市场服务部、国际业务部、监察稽核部、人力资源部、财务部、总经理办公室等职能部门，并在北京、深圳、广州设立有分公司，在香港设立有子公司，并设立了国投瑞银专项子公司。

研究部是公司的研究支持部门，为基金及其他产品投资提供决策依据；

基金投资部负责基金的投资管理；

专户投资部负责专户产品的投资管理；

交易部负责公司投资交易的具体执行；

运营部负责基金和其他产品的会计、清算及注册登记；

信息技术部负责为公司正常运转提供信息系统支持；

机构服务部负责直销和机构客户服务；

产品及业务拓展部负责产品设计和部分营销支持；

市场服务部负责营销决策、支持和客户服务；

国际业务部负责 QDII 基金产品等及国际业务；

监察稽核部负责公司法律、合规监察、风险控制、内部审计事务；

人力资源部负责人事劳资管理；

财务部负责公司财务管理；

总经理办公室协助总经理研究公司发展战略及公司文秘工作。

4、人员情况

截至 2015 年 12 月 31 日，公司共有员工 180 人，所有人员在最近三年内均没有受到所在单位或有关管理部门的处罚。

5、信息披露负责人及咨询电话：刘凯，（0755）83575990

6、基金管理业务情况

截至 2015 年 12 月 31 日，国投瑞银基金管理有限公司旗下共管理 53 只基金产品，管理的基金总资产 960 亿元。

7、本基金基金经理

刘莎莎女士，中国籍，香港科技大学经济学硕士。8 年证券从业经历，曾任中诚信证券评估公司分析师、阳光保险资产管理中心信用研究员、泰康资产管理有限公司信用研究员。2013 年 7 月加入国投瑞银基金管理有限公司固定收益部。

2014 年 9 月 2 日起任国投瑞银双债增利债券型证券投资基金基金经理，2014 年 10 月 17 日起兼任国投瑞银岁增利一年期定期开放债券型证券投资基金基金经理，2016 年 2 月 3 日起兼任国投瑞银双债丰利两年定期开放债券型证券投资基金基金经理。

（二）基金托管人

1、基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：王洪章

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

联系人：田青

联系电话：(010)6759 5096

中国建设银行成立于 1954 年 10 月，是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行，总部设在北京。中国建设银行于 2005 年 10 月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码 939)，于 2007 年 9 月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码 601939)。

2015 年 6 月末，本集团资产总额 182,192 亿元，较上年末增长 8.81%；客户贷款和垫款总额 101,571 亿元，增长 7.20%；客户存款总额 136,970 亿元，增长 6.19%。

净利润 1,322 亿元，同比增长 0.97%；营业收入 3,110 亿元，同比增长 8.34%，其中，利息净收入同比增长 6.31%，手续费及佣金净收入同比增长 5.76%。成本收入比 23.23%，同比下降 0.94 个百分点。资本充足率 14.70%，处于同业领先地位。

物理与电子渠道协同发展。总行成立了渠道与运营管理部，全面推进渠道整合；营业网点“三综合”建设取得新进展，综合性网点达到 1.44 万个，综合营销团队达到 19,934 个、综合柜员占比达到 84%，客户可在转型网点享受便捷舒适的“一站式”服务。加快打造电子银行的主渠道建设，有力支持物理渠道的综合化转型，电子银行和自助渠道账务性交易量占比达 94.32%，较上年末提高 6.29 个百分点；个人网上银行客户、企业网上银行客户、手机银行客户分别增长 8.19%、10.78%和 11.47%；善融商务推出精品移动平台，个人商城手机客户端“建行善融商城”正式上线。

转型重点业务快速发展。2015 年 6 月末，累计承销非金融企业债务融资工具 2,374.76 亿元，承销金额继续保持同业第一；证券投资基金托管只数和新发基金托管只数均列市场第一，成为首批香港基金内地销售代理人中唯一一家银行代理人；多模式现金池、票据池、银联单位结算卡等战略性产品市场份额不断扩大，现金管理品牌“禹道”的市场影响力持续提升；代理中央财政授权支付业务、代理中央非税收入收缴业务客户数保持同业第一，在同业中首家按照财政部要求实现中央非税收入收缴电子化上线试点。“鑫存管”证券客户保证金第三方存管客户数 3,076 万户，管理资金总额 7,417.41 亿元，均为行业第一。

2015 年上半年，本集团各方面良好表现，得到市场与业界广泛认可，先后荣获国内外知名机构授予的 40 多项重要奖项。在英国《银行家》杂志 2015 年“世界银行 1000 强排名”中，以一级资本总额继续位列全球第 2；在美国《福布斯》杂志 2015 年全球上市公司 2000 强排名中继续位列第 2；在美国《财富》杂志 2015 年世界 500 强排名第 29 位，较上年上升 9 位；荣获美国《环球金融》杂志颁发的“2015 年中国最佳银行”奖项；荣获中国银行业协会授予的“年度最具社会责任金融机构奖”和“年度社会责任最佳民生金融奖”两个综合大奖。

中国建设银行总行设投资托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII 托管处、养老金托管处、清算处、核算处、监督稽核处等 9 个职能处室，在上海设有投资托管服务上海备份中心，共有员工 210 余人。自 2007 年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

2、主要人员情况

赵观甫，投资托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行郑州市分行、总行信贷部、总行信贷二部、行长办公室工作，并在中国建设银行河北省分行营业部、总行个人银行业务部、总行审计部担任领导职务，长期从事信贷业务、个人银行业务和内部审计等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行总行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室，长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张力铮，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行建筑经济部、信贷二部、信贷部、信贷管理部、信贷经营部、公司业务部，并在总行集团客户部和中国建设银行北京市分行担任领导职务，长期从事信贷业务和集团客户业务等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

3、基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至 2015 年末，中国建设银行已托管 556 只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行自 2009 年至今连续五年被国际权威杂志《全球托管人》评为“中国最佳托管银行”。

（三）基金验资机构

名称：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

注册地址：中国上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：中国上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼

执行事务合伙人：李丹

联系电话：(021) 23238888

传真：(021) 23238800

联系人：曹阳

经办注册会计师：陈玲、曹阳

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件：基金合同摘要。

七、基金财务状况

深圳证券交易所在本基金募集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》设定的认购费用收取认购费。

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。

国投瑞银双债丰利两年定期开放债券型证券投资基金截止 2016 年 2 月 18 日资产负债表如下：



八、基金投资组合

截止到 2016 年 2 月 18 日，国投瑞银双债丰利两年定期开放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

金额单位：人民币元



（二）报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票资产。

（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
本基金本报告期末未持有股票资产。

（四）报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元



（五）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
金额单位：人民币元



（六）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。

（七）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投资。

（八）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投资。

(九) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
根据本基金合同规定, 本基金不参与股指期货交易。

(十) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

1、本期国债期货投资政策

为更好地实现投资目标, 本基金在注重风险管理的前提下, 以套期保值为目的, 适度运用国债期货。本基金利用国债期货流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点, 提高投资组合的运作效率。

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投资国债期货。

(十一) 投资组合报告附注

1、本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查的, 在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

2、基金投资的前十名股票均属于基金合同规定备选股票库之内的股票。

3、期末其他各项资产构成

金额单位: 人民币元

■

(十二) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位: 人民币元

■

(十三) 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资产。

(十四) 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因, 分项之和与合计项之间可能存在尾差。

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

基金托管人就本基金上市交易后履行托管人职责做出如下承诺:

(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, 并在限期内, 随时对书面通知事项进行复查, 督促基金管理人改正。

(四) 基金托管人发现基金管理人有关重大违规行为, 将立即报告中国证监会, 同时书面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、备查文件目录

本基金备查文件包括下列文件:

- (一) 中国证监会核准基金募集的文件;
- (二) 国投瑞银双债丰利两年定期开放债券型证券投资基金基金合同;
- (三) 国投瑞银双债丰利两年定期开放债券型证券投资基金托管协议;
- (四) 国投瑞银双债丰利两年定期开放债券型证券投资基金招募说明书;
- (五) 法律意见书;
- (六) 基金管理人业务资格批件、营业执照;
- (七) 基金托管人业务资格批件和营业执照;
- (八) 中国证监会要求的其他文件。

存放地点: 基金管理人和基金托管人的住所

查阅方式: 基金投资者可在营业时间免费查阅, 或通过指定的信息披露媒体、本基金管理人网站 (www.ubssdic.com) 查阅。

附件: 基金合同摘要

- (一) 基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

1、基金管理人的权利与义务

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) 依法募集基金；
- (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) 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人的利益；
- (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与赎回或转换申请；
- (12) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- (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、融券；
- (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、转换和非交易过户的业务规则；
- (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。

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) 依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
- (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资产净值，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、半年度和年度基金报告；
- (11) 严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
- (12) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；
- (13) 按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；
- (14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
- (15) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
- (16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上；
- (17) 确保需要向基金投资人提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资人能够按照《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。

2、基金托管人的权利与义务

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，为基金开设证券账户、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。

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，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、半年度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；

(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管理人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

(16) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；

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

(18) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人；

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

(20) 按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，

基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿；

(21) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

3、基金份额持有人的权利与义务

基金投资人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，基金投资人自依据《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。

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。

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) 缴纳基金认购、申购、赎回款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；

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

- (6) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；
- (7) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- (8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(二) 基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

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

1、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（法律法规或基金合同另有规定的除外）：

- 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) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；
- 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) 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、基金托管费或销售服务费率和其他应由基金承担的费用；
- 2) 法律法规要求增加的基金费用的收取；
- 3) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式；

- 4) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改;
- 5) 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生重大变化;
- 6) 按照法律法规和《基金合同》规定应当召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

(3) 基金合同生效后的存续期内, 有下列情形之一的, 基金管理人可与基金托管人协商一致后, 将本基金转为“国投瑞银双债丰利债券型证券投资基金(LOF)”, 不再以定期开放的方式运作:

- 1) 某个开放期期满时, 本基金份额持有人数量不满 200 人的;
- 2) 某个开放期期满时, 本基金资产净值低于 5000 万元的。

由上述情形导致本基金运作方式转换的, 无需召开基金份额持有人大会。

2、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;

(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。

3、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

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

4、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、中国证监会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 50%（含 50%）。

(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，在两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 50%（含 50%）；
- 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，并与基金登记注册机构记录相符；
- 5) 会议通知公布前报中国证监会备案。

(3) 在不与法律法规冲突的前提下，基金份额持有人大会可通过网络、电话或其他方式召开，基金份额持有人可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式进行表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

(4) 基金份额持有人授权他人代为出席会议并表决的，授权方式可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式，具体方式在会议通知中列明。

(5) 重新召集基金份额持有人大会的条件

基金份额持有人大会应当有代表二分之一以上基金份额的持有人参加，方可召开。

参加基金份额持有人大会的持有人的基金份额低于上述规定比例的，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内，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基金份额的持有人参加，方可召开。

5、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 7 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两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。

6、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 50%以上（含 50%）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 2/3 以上（含 2/3）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》、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人身份文件的表决视为有效出席的投资人，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。

7、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。

8、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 个工作日内在指定媒介上公告。

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。

9、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，基金管理人提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

（三）基金收益分配原则、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基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

3、基金收益分配原则

（1）基金收益分配方式为现金方式；

（2）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，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同。本基金同一类别的每份基金份额享有同等分配权；

（3）基金收益分配后每一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基金份额收益分配金额后不能低于面值；

（4）基金合同生效满 6 个月后，若基金在每月最后一个交易日收盘后同一类别的每 10 份基金份额可分配收益金额高于或等于 0.05 元，该类基金份额至少进行收益分配 1 次，在次月 10 个工作日之内对该类基金份额进行收益分配，每次基金收益分配比例不低于该类基金份额可分配收益的 50%；

（5）若基金合同生效不满 6 个月则可不进行收益分配；

（6）法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

本基金转型后，基金的收益分配原则根据本基金合同第二十章相关约定进行调整。

4、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。

5、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，在 2 个工作日内在指定媒介公告并报中国证监会备案。

基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过 15 个工作日。

6、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人自行承担。当投资人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，按基金管理人相关业务规则进行处理。

（四）与基金财产管理、运作有关费用的提取、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》生效后与基金相关的信息披露费用；
- （4）《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- （5）基金份额持有人大会费用；
- （6）基金的证券交易费用；
- （7）基金的银行汇划费用；
- （8）基金上市费及年费；
- （9）证券账户开户费和银行账户维护费；
- （10）基金收益分配中发生的费用；
- （11）基金的开户费用、账户维护费用；
- （12）从 C 类基金份额的基金财产中计提的销售服务费；
- （13）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。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

2、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 0.60% 年费率计提。管理费的计算方法

如下：

$$H=E \times 0.60 \% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

（2）基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.20 \% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

（3）基金份额的销售服务费

本基金 C 类基金份额收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.4%。

本基金销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.4% 年费率计提。

计算方法如下：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

基金销售服务费用用于支付销售机构佣金、基金的营销费用以及基金份额持有人服务费等。

基金销售服务费不包括基金募集期间的上述费用。

上述“（一）基金费用的种类中第3—13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。

3、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。

4、基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

5、费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后，可按照基金发展情况，并根据法律法规规定和基金合同约定酌情调低基金管理费率、基金托管费率或销售服务费率等相关费率，无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人须于新的费率实施日前在指定媒介上公告。

（五）基金资产的投资方向和投资限制

1、投资目标

本基金在有效控制风险的基础上，通过积极主动的投资管理，力争为投资者实现超越业绩比较基准的投资业绩。

2、投资范围

本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的可转债（含可分离交易可转债）、信用债（金融债、企业债、公司债、次级债、短期融资券、中期票据、资产支持证券、地方政府债、中小企业私募债券等非国家信用的固定收益类金融工具）、国债、央行票据、债券回购、银行存款、股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证、国债期货等金融工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种。

本基金投资于债券资产的投资比例不低于基金资产的80%，其中，可转债、信用债合计投资比例不低于债券资产的80%；本基金投资于权益类资产的比例不超过

基金资产的 20%；但在每个开放期的前 3 个月和后 3 个月以及开放期期间不受前述投资组合比例的限制。本基金在运作周期内在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应保持不低于交易保证金一倍的现金；在开放期内每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金转型后，投资范围根据本基金合同第二十章相关约定进行调整。

3、投资限制

（1）组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

- 1) 本基金投资于债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%。其中，可转债、信用债合计投资比例不低于债券资产的 80%。但在每个开放期的前 3 个月和后 3 个月以及开放期期间不受前述投资组合比例的限制；
- 2) 本基金在开放期内每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；
- 3) 本基金投资于权益类资产的比例不超过基金资产的 20%；
- 4) 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%；
- 5) 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%；
- 6) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；
- 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，不得超过基金资产净值的 10%；
- 8) 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%；
- 9) 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%；
- 10) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；
- 11) 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；
- 12) 本基金财产参与股票发行申购，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；
- 13) 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%；债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

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

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

16) 本基金所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合本基金投资范围中关于债券资产的投资比例，即不低于基金资产的 80%；

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

18) 本基金在运作周期内每个交易日日终在扣除国债期货需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；

19) 本基金持有的单只中小企业私募债券，其市值不得超过基金资产净值的 10%；

20) 本基金投资中小企业私募债券的剩余期限，不得超过本基金的剩余运作周期；

21) 开放期内，本基金总资产不得超过基金净资产的 140%，运作周期内，本基金总资产不得超过基金净资产的 200%；

22) 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。

如果法律法规对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制，但须提前公告，不需要经基金份额持有人大会审议。

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

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

本基金转型后，投资限制根据本基金合同第二十章相关约定进行调整。

（2）禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

1) 承销证券；

2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；

- 3) 从事承担无限责任的投资;
- 4) 买卖其他基金份额, 但是法律法规或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;
- 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。

本基金运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或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的原则, 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。

法律法规或监管部门调整上述限制的, 本基金从其规定。

(六) 基金资产净值的计算方法和公告方式

1、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。

2、估值对象

基金所拥有的股票、权证、债券和银行存款本息、国债期货、应收款项、其它投资等资产及负债。

3、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或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的, 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或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的, 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估值方法估值；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估值方法估值；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) 全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

(4) 交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量。

(5) 对只在上海证券交易所固定收益平台或只在深圳证券交易所综合协议平台进行交易的债券，采用估值技术确定公允价值或按成本法进行估值。

(6) 中小企业私募债采用估值技术确定公允价值或按成本法进行估值。

(7) 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。

(8) 本基金持有的回购以成本列示，按合同利率在回购期间内逐日计提应收或应付利息。

(9) 本基金持有的银行存款和备付金余额以本金列示，按相应利率逐日计提利息。

(10) 国债期货合约一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

(11) 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。

(12) 相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按

国家最新规定估值。

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

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

4、估值程序

(1) 两类基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日该类基金份额的余额数量计算，A类和C类基金份额净值均精确到0.001元，小数点后第4位四舍五入。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。

每个工作日计算基金资产净值及两类基金份额净值，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本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，将两类基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

5、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A类或C类基金份额净值小数点后3位以内(含第3位)发生估值错误时，视为基金份额净值错误。

本基金合同的当事人应按照以下约定处理：

(1) 估值错误类型

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

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

(2) 估值错误处理原则

1) 估值错误已发生，但尚未给当事人造成损失时，估值错误责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正估值错误发生的费用由估值错误责任方承担；由于估值错误责任方未及时更正已产生的估值错误，给当事人造成损失的，由估值错

误责任方对直接损失承担赔偿责任；若估值错误责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责任。估值错误责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保估值错误已得到更正。

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

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

4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

(3) 估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

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

(4) 基金份额净值估值错误处理的方法如下：

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

2) 错误偏差达到该类基金份额净值的 0.25%时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到该类基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告。

3) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

6、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) 占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障投资人的利益，已决定延迟估值；如果出现基金管理人认为属于紧急事故的任何情况，导致基金管理人不能出售或评估基金资产时；
- (4) 中国证监会和基金合同认定的其它情形。

7、基金净值的确认

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，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金资产净值和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。

8、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（11）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由此造成的影响。

（七）基金合同的变更、终止与基金财产的清算

1、《基金合同》的变更

(1) 变更基金合同涉及法律法规规定或本合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于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须报中国证监会备案，并自决议生效后两个工作日内在指定媒介公告。

2、《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行适当程序后，《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。

3、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 个月或根据登记结算公司的规定完成。

4、清算费用

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

5、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。

6、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。

7、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，对各方当事人均有约束力，仲裁费用和律师费用由败诉方承担。

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。

本基金合同受中国法律管辖。

（九）基金合同存放地和投资者取得合同的方式

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

国投瑞银基金管理有限公司

2016年2月22日