

嘉实稳瑞纯债债券型证券投资基金更新招募说明书摘要

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：上海银行股份有限公司

重要提示

嘉实稳瑞纯债债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会

2016年3月7

日证监许可451号《关于准予嘉实稳瑞纯债债券型证券投资基金注册的批复》注册募集。本

基金基金合同于2016年3月18日正式生效，自该日起本基金管理人开始管理本基金。

本招募说明书是对原《嘉实稳瑞纯债债券型证券投资基金招募说明书》的定期更新，原

招募说明书与本招募说明书不一致的，以本招募说明书为准。基金管理人保证本招募说明书

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价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没

有风险。

证券投资基金（以下简称“基金”）是一种长期投资工具，其主要功能是分散投资，降

低投资单一证券所带来的个别风险。基金不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的

金融工具，投资者购买基金，既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益，也可能承担

基金投资所带来的损失。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资

本基金前，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，

并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险、本基金的特有风险等等。本基金投资中小企业私募债券，中小企业私募债是根据相关法律法规由非上市中小企业采用非公开方式发行的债券。由于不能公开交易，一般情况下，交易不活跃，潜在较大流动性风险。当发债主体信用质量恶化时，受市场流动性所限，本基金可能无法卖出所持有的中小企业私募债，由此可能给基金净值带来更大负面影响和损失。

嘉实基金管理有限公司

2

的负面影响和损失。

本基金为债券型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金，属于中等预期风险/收益的产品。投资者在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策。

投资者应当通过本基金管理人或代销机构购买和赎回基金。本基金在募集期内按 1.00 元面值发售并不改变基金的风险收益特征。投资者按 1.00 元面值购买基金份额以后，有可能面临基金份额净值跌破 1.00 元、从而遭受损失的风险。

本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，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。

本基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营

状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。

本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为 2016 年 9 月 18

日（特别事项注明除外），有关财务数据和净值表现截止日为 2016 年 6 月 30 日（未经审计）。

嘉实基金管理有限公司

3

目 录

一、绪言.

.....
..... 4

二、释义.

.....
..... 5

三、基金管理人

.....
..... 9

四、基金托管人

.....
..... 18

五、相关服务机构

.....
..... 22

六、基金的募集

.....
..... 25

七、基金合同的生效

.....
..... 27

八、基金份额的申购与赎回

.....
..... 28

九、基金的投资

.....	
.....	37
十、基金的业绩	
.....	
.....	43
十一、基金的财产	
.....	
.....	45
十二、基金资产的估值	
.....	
.....	46
十三、基金的收益与分配	
.....	
.....	51
十四、基金的费用与税收	
.....	
.....	53
十五、基金的会计与审计	
.....	
.....	55
十六、基金的信息披露	
.....	
.....	56
十七、风险揭示	
.....	
.....	62
十八、基金合同的变更、终止与基金财产的清算	
.....	
.....	64
十九、基金合同的内容摘要	
.....	
.....	66
二十、基金托管协议的内容摘要	

..... 80

二十一、对基金份额持有人的服务

..... 92

二十二、其他应披露事项

..... 94

二十三、招募说明书存放及查阅方式

..... 95

二十四、备查文件

..... 96

嘉实基金管理有限公司

4

一、绪言

《嘉实稳瑞纯债债券型证券投资基金招募说明书》（以下简称“本招募说明书”

）依据

《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金销售管理

办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》

（以下简称“《运

作办法》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办

法》”）、《证

券投资基金信息披露编报规则第 5 号〈招募说明书的内容与格式〉》等有关法律法

规以及《嘉

实稳瑞纯债债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，

并对其

真实性、准确性、完整性承担法律责任。本基金是根据本招募说明书所载明的资

料申请募集

的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信

息，或对本

招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写，并经中国证监会注册。基金合同是约定基金

合同当事人之间基本权利义务的法律文件，其他与本基金相关的涉及基金合同当事人之间权

利义务关系的任何文件或表述，均以基金合同为准。基金合同的当事人包括基金管理人、基

金托管人和基金份额持有人。基金投资者自依基金合同取得本基金基金份额，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。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为必要条件。基金合

同当事人按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者欲了

解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

嘉实基金管理有限公司

5

二、释义

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：指嘉实稳瑞纯债债券型证券投资基金
- 2、基金管理人：指嘉实基金管理有限公司
- 3、基金托管人：指上海银行股份有限公司
- 4、基金合同或《基金合同》：指《嘉实稳瑞纯债债券型证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充
- 5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《嘉实稳瑞纯债债券型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
- 6、招募说明书或本招募说明书：指《嘉实稳瑞纯债债券型证券投资基金招募说明书》及其定期的更新

7、基金份额发售公告：指《嘉实稳瑞纯债债券型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、通知等以及颁布机关对其不时做出的修订

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》修改的《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2013年3月15日颁布、同年6月1日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

11、《信息披露办法》：指中国证监会2004年6月8日颁布、同年7月1日实施的《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、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

14、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会
嘉实基金管理有限公司

6

15、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

- 16、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
- 17、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
- 18、合格境外机构投资者：指符合相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的
证券投资基金的中国境外的机构投资者
- 19、投资人：指个人投资者、机构投资者和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
- 20、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
- 21、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。
- 22、销售机构：指嘉实基金管理有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其
他条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务协议，办理
基金销售业
务的机构
- 23、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
- 24、登记机构：指办理登记业务的机构。基金的登记机构为嘉实基金管理有限公
司或接
受嘉实基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构
- 25、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
- 26、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

27、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

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

28、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

29、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

嘉实基金管理有限公司

7

30、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

31、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

32、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

33、T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日(不包含 T 日)

34、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

35、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

36、《业务规则》：指《嘉实基金管理有限公司开放式基金业务规则》，是规范基金管理

人所管理的开放式证券投资基金登记方面的业务规则，由基金管理人和投资人共同遵守

37、认购：指在基金募集期内，投资人根据基金合同及招募说明书的规定申请购买基金

份额的行为

38、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

39、赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件要

求将基金份额兑换为现金的行为

40、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

41、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

销售机构的操作

42、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、

金额及扣款方式，由销售机构于每期约定申购日在投资人指定银行账户内自动完

成扣款及基

金申购申请的一种投资方式

43、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%

44、元：指人民币元

45、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

46、基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购

款及其

他资产的价值总和

嘉实基金管理有限公司

8

47、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

48、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

49、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

50、指定媒介：指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站及其

他媒介

51、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。

嘉实基金管理有限公司

9

三、基金管理人

（一）基金管理人基本情况

1、基本信息

名称 嘉实基金管理有限公司

注册地址 中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心二期 53 层
09-11

单元

办公地址 北京市建国门北大街 8 号华润大厦 8 层

法定代表人 邓红国

总经理 赵学军

成立日期 1999 年 3 月 25 日

注册资本 1.5 亿元

股权结构 中诚信托有限责任公司 40%，德意志资产管理（亚洲）有限公司 30%，
立信

投资有限责任公司 30%。

存续期间 持续经营

电话 （010）65215588

传真 （010）65185678

联系人 胡勇钦

嘉实基金管理有限公司经中国证监会证监基字[1999]5 号文批准，于 1999 年 3
月 25 日

成立，是中国第一批基金管理公司之一，是中外合资基金管理公司。公司注册地
上海，总部

设在北京并设深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州分公司。公司获得首
批全国社保

基金、企业年金投资管理人、QDII 资格和特定资产管理业务资格。

嘉实基金管理有限公司无任何受处罚记录。

2、管理基金情况

截止 2016 年 10 月 17 日，基金管理人共管理 2 只封闭式证券投资基金、98 只

开放式证

券投资基金，具体包括嘉实丰和价值封闭、嘉实元和、嘉实成长收益混合、嘉实增长混合、

嘉实稳健混合、嘉实债券、嘉实服务增值行业混合、嘉实优质企业混合、嘉实货币、嘉实沪

深 300 指数（LOF）、嘉实超短债债券、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实海外中国混合

（QDII）、嘉实研究精选混合、嘉实多元债券、嘉实量化阿尔法混合、嘉实回报混合、嘉实

基本面 50 指数（LOF）、嘉实价值优势混合、嘉实稳固收益债券、嘉实 H 股指数（QDII-LOF）、

嘉实基金管理有限公司

10

嘉实主题新动力混合、嘉实多利分级债券、嘉实领先成长混合、嘉实深证基本面 120ETF、

嘉实深证基本面 120ETF 联接、嘉实黄金（QDII-FOF-LOF）、嘉实信用债券、嘉实周期优选混

合、嘉实安心货币、嘉实中创 400ETF、嘉实中创 400ETF 联接、嘉实沪深 300ETF、嘉实优化

红利混合、嘉实全球房地产（QDII）、嘉实理财宝 7 天债券、嘉实增强收益定期债券、嘉实

纯债债券、嘉实中证中期企业债指数（LOF）、嘉实中证 500ETF、嘉实增强信用定期债券、

嘉实中证 500ETF 联接、嘉实中证中期国债 ETF、嘉实中证金边中期国债 ETF 联接、嘉实丰

益纯债定期债券、嘉实研究阿尔法股票、嘉实如意宝定期债券、嘉实美国成长股票（QDII）、

嘉实丰益策略定期债券、嘉实丰益信用定期债券、嘉实新兴市场债券、嘉实绝对收益策略定

期混合、嘉实宝 A/B、嘉实活期宝货币、嘉实 1 个月理财债券、嘉实活钱包货币、嘉实泰和

混合、嘉实薪金宝货币、嘉实对冲套利定期开放混合、嘉实中证医药卫生 ETF、嘉实中证主

要消费 ETF、嘉实中证金融地产 ETF、嘉实 3 个月理财债券、嘉实医疗保健股票、嘉实新兴产业股票、嘉实新收益混合、嘉实沪深 300 指数研究增强、嘉实逆向策略股票、嘉实企业变革股票、嘉实新消费股票基金、嘉实全球互联网股票、嘉实先进制造股票、嘉实事件驱动股票、嘉实机构快线货币、嘉实新机遇混合发起式、嘉实低价策略股票、嘉实中证金融地产 ETF 联接、嘉实新起点灵活配置混合、嘉实腾讯自选股大数据股票、嘉实环保低碳股票、嘉实创新成长混合、嘉实智能汽车股票、嘉实新财富混合、嘉实新起航混合、嘉实稳瑞纯债债券、嘉实稳祥纯债债券、嘉实新常态混合、嘉实新优选混合、嘉实新趋势混合、嘉实新思路混合、嘉实稳泰债券、嘉实稳丰纯债债券、嘉实沪港深精选股票、嘉实稳盛债券、嘉实稳鑫纯债债券、嘉实安益混合、嘉实文体娱乐股票、嘉实稳泽纯债债券、嘉实惠泽定增混合。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券 3 只开放式基金属于嘉实理财通系列基金，同时，管理多个全国社保基金、企业年金、特定客户资产基金投资组合。

（二）主要人员情况

1、基金管理人董事、监事、总经理及其他高级管理人员基本情况

邓红国先生，董事长，硕士研究生，中共党员。曾任物资部研究室、政策体制法规司副处长；中国人民银行国际司、外资金融机构管理司、银行监管一司、银行管理司副处长、处长、副巡视员；中国银监会银行监管三部副主任、四部主任；中诚信托有限责任公司董事长、党委书记、法定代表人。2014 年 12 月 2 日起任嘉实基金管理有限公司董事长。

赵学军先生，董事、总经理，经济学博士，中共党员。曾就职于天津通信广播公司电视

设计所、外经贸部中国仪器进出口总公司、北京商品交易所、天津纺织原材料交易所、商鼎

期货经纪有限公司、北京证券有限公司、大成基金管理有限公司。2000 年 10 月至今任嘉实

嘉实基金管理有限公司

11

基金管理有限公司总经理。

高峰先生，董事，美国籍，美国纽约州立大学石溪分校博士。曾任所罗门兄弟公司利息

衍生品副总裁，美国友邦金融产品集团结构产品部副总裁。自 1996 年加入德意志银行以来，

曾任德意志银行（纽约、香港、新加坡）董事、全球市场部中国区主管、上海分行行长，

2008 年至今任德意志银行（中国）有限公司行长、德意志银行集团中国区总经理。

陈春艳女士，董事，硕士研究生。曾任中诚信托有限责任公司资金信贷部、信托开发部、

信托事务部、信托业务一部、投资管理部信托经理、高级经理。2010 年 11 月至今任中诚信

托有限责任公司股权管理部部门负责人、部门经理。

Jonathan Paul Eilbeck 先生，董事，英国籍，南安普顿大学学士学位。曾任 Sena

Consulting 公司咨询顾问，JP Morgan 固定收益亚太区 CFO、COO，JP Morgan Chase 固

定收益亚太区 CFO、COO，德意志银行资产与财富管理全球首席运营官。2008 年至今任

德意志银行资产管理全球首席运营官。

韩家乐先生，董事。1990 年毕业于清华大学经济管理学院，硕士研究生。1990 年 2 月

至 2000 年 5 月任海问证券投资咨询有限公司总经理；1994 年至今，任北京德恒有限责任公

司总经理；2001 年 11 月至今，任立信投资有限责任公司董事长。

王巍先生，独立董事，美国福特姆大学文理学院国际金融专业博士。曾任职于中

国建设

银行辽宁分行。曾任中国银行总行国际金融研究所助理研究员，美国化学银行分析师，美国

世界银行顾问，中国南方证券有限公司副总裁，万盟投资管理有限公司董事长。

2004 至今

任万盟并购集团董事长。

张维炯先生，独立董事、中共党员，教授、加拿大不列颠哥伦比亚大学商学院博士。曾

任上海交通大学动力机械工程系教师，上海交通大学管理学院副教授、副院长。

1997 年至

今任中欧国际工商学院教授、副院长。

汤欣先生，独立董事，中共党员，法学博士，清华大学法学院教授、清华大学商法研究

中心副主任、《清华法学》副主编，汤姆森路透集团“中国商法”丛书编辑咨询委员会成员。

曾兼任中国证券监督管理委员会第一、二届并购重组审核委员会委员，现兼任上海证券交易

所上市委员会委员、中国上市公司协会独立董事委员会首任主任。

朱蕾女士，监事，中共党员，硕士研究生。曾任首都医科大学教师，中国保险监督管理

委员会主任科员，国都证券有限责任公司高级经理，中欧基金管理有限公司发展战略官、北

京代表处首席代表、董事会秘书。2007 年 10 月至今任中诚信托有限责任公司国际业务部总

经理。

穆群先生，监事，经济师，硕士研究生。曾任西安电子科技大学助教，长安信息

产业（集
嘉实基金管理有限公司

12

团）股份有限公司董事会秘书，北京德恒有限责任公司财务主管。2001 年 11 月至今任立信

投资有限公司财务总监。

龚康先生，监事，中共党员，博士研究生。2005 年 9 月至今就职于嘉实基金管

理有限

公司人力资源部，历任人力资源高级经理、副总监、总监。

曾宪政先生，监事，法学硕士。1999年7月至2003年10月就职于首钢集团，2003年

10月至2008年6月，为国浩律师集团（北京）事务所证券部律师。2008年7月至今，就职

于嘉实基金管理有限公司法律稽核部、法律部，现任法律部总监。

宋振茹女士，副总经理，中共党员，硕士研究生，经济师。1981年6月至1996年10

月任职于中办警卫局。1996年11月至1998年7月于中国银行海外行管理部任副处长。1998

年7月至1999年3月任博时基金管理公司总经理助理。1999年3月至今任职于嘉实基金管

理有限公司，历任督察员和公司副总经理。

王炜女士，督察长，中共党员，法学硕士。曾就职于中国政法大学法学院、北京市陆通

联合律师事务所、北京市智浩律师事务所、新华保险股份有限公司。曾任嘉实基金管理有限

公司法律部总监。

邵健先生，副总经理，硕士研究生。历任国泰证券行业研究员，国泰君安证券行业研究

部副经理，嘉实基金管理有限公司基金经理、总经理助理。

李松林先生，副总经理，工商管理硕士。历任国元证券深圳证券部信息总监，南方证券

金通证券部总经理助理，南方基金运作部副总监，嘉实基金管理有限公司总经理助理。

2、基金经理

（1）现任基金经理

曲扬女士，经济学硕士，毕业于中央财经大学信息系，具有12年证券从业经验。2004

年至2007年，任中信基金固定收益研究员、交易员；2007年至2010年6月，任中国光大

银行债券自营投资业务副主管；2010年6月加入嘉实基金管理有限公司任基金

经理助理，

现任职于固定收益业务体系全回报策略组。2011 年 11 月 18 日起至 2012 年 11 月 21 日任嘉

实稳固收益债券基金经理。2011 年 11 月 18 日至今任嘉实债券基金经理。2012 年 12 月 11

日至今任嘉实纯债债券基金经理。2013 年 5 月 21 日至今任嘉实丰益纯债定期债券基金经理。

2014 年 4 月 18 日至今任嘉实稳固收益债券基金经理。2015 年 4 月 18 日至今任嘉实中证中

期企业债指数（LOF）、嘉实中证中期国债 ETF、嘉实中证金边中期国债 ETF 联接基金经理。

2016 年 3 月 18 日至今任嘉实稳祥纯债债券基金经理。2016 年 3 月 30 日至今任嘉实新财富

混合、嘉实新起航混合基金经理。2016 年 4 月 26 日至今任嘉实新常态混合、嘉实新优选混

合、嘉实新思路混合基金经理。2016 年 5 月 17 日至今任嘉实稳丰纯债债券基金经理。2016

嘉实基金管理有限公司

13

年 7 月 15 日至今任嘉实稳鑫纯债债券基金经理，2016 年 8 月 25 日至今任嘉实安益混合基

金经理，2016 年 9 月 13 日至今任嘉实稳泽纯债债券基金经理。2016 年 3 月 18 日至今任本

基金基金经理。

（2）历任基金经理：无。

3、债券投资决策委员会

本基金采取集体投资决策制度，债券投资决策委员会的成员包括：公司固定收益业务首

席投资官经雷先生、固定收益体系资深基金经理王茜女士、万晓西先生、胡永青先生、以及

投资经理王怀震先生、嘉实国际 CIO Thomas Kwan 先生。

4、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、依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回、转换和登记事宜；
- 2、办理基金备案手续；
- 3、对所管理的不同基金资产分别管理、分别记账，进行证券投资；
- 4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；
- 5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- 6、编制季度、半年度和年度基金报告；
- 7、计算并公告基金资产净值和基金份额累计净值，确定基金份额申购、赎回价格；
- 8、办理与基金资产管理业务活动有关的信息披露事项；
- 9、召集基金份额持有人大会；
- 10、保存基金资产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- 11、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- 12、有关法律法规和中国证监会规定的其他职责。

（四）基金管理人的承诺

- 1、本基金管理人承诺严格遵守相关法律法规、基金合同和中国证监会的有关规定，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反有关法律法规、基金合同和中国证监会有关规定的行为发生。
- 2、本基金管理人承诺严格遵守《中华人民共和国证券法》、《基金法》及有关法律法规，建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止下列行为发生：
 - （1）将其固有财产或者他人财产混同于基金资产从事证券投资；嘉实基金管理有限公司
- 14
 - （2）不公平地对待其管理的不同基金资产；
 - （3）利用基金资产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）法律法规或中国证监会规定禁止的其他行为。

3、本基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法

律法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不得将基金资产用于以下投资或活动：

- (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) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- (5) 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；
- (6) 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。

法律法规或监管部门调整上述禁止行为的，本基金不受上述限制。

4、基金经理承诺

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

大利益；

(2) 不利用职务之便为自己及其代理人、受雇人或任何第三人谋取利益；

(3) 不违反现行有效的有关法律法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，泄

漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资

计划等信息；

(4) 不从事损害基金资产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

(五) 基金管理人的内部控制制度

1、内部控制制度概述

为加强内部控制，防范和化解风险，促进公司诚信、合法、有效经营，保障基金

份额持

有人利益，根据《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》并结合公司具体情况，公司已

建立健全内部控制体系和内部控制制度。

公司内

部控制大纲是对公司章程规定的内控原则的细化和展开，是各项基本管理制度的纲要和总

揽。基本管理制度包括投资管理、信息披露、信息技术管理、公司财务管理、基金会计、人

力资源管理、资料档案管理、业绩评估考核、监察稽核、风险控制、紧急应变等制度。部门

嘉实基金管理有限公司

15

业务规章是对各部门的主要职责、岗位设置、岗位责任、操作守则等具体说明。

2、内部控制的原则

(1) 健全性原则：内部控制包括公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员，并涵

盖到决策、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，建立合理的内控程序，维护内控制度

的有效执行；

(3) 独立性原则：公司各机构、部门和岗位在职能上必须保持相对独立；

(4) 相互制约原则：组织结构体现职责明确、相互制约的原则，各部门有明确的授权

分工，操作相互独立。

(5) 成本效益原则：运用科学化的经营管理方法降低运作成本，提高经济效益，以合

理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

3、内部控制组织体系

(1) 公司董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任。董事会下设

审计与合规委员会，负责检查公司内部管理制度的合法合规性及内控制度的执行情况，充分

发挥独立董事监督职能，保护投资者利益和公司合法权益。

(2) 债券投资决策委员会为公司投资管理的最高决策机构，由首席投资官（固定收益）、

总监及资深基金经理组成，负责指导基金资产的运作、确定基本的投资策略和投资组合的原

则。

(3) 风险控制委员会为公司风险管理的最高决策机构，由公司总经理、督察长

及相关

总监组成，负责全面评估公司经营管理过程中的各项风险，并提出防范化解措施。

（4）督察长积极对公司各项制度、业务的合法合规性及公司内部控制制度的执行情况

进行监察、稽核，定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况。

（5）监察稽核部：公司管理层重视和支持监察稽核工作，并保证监察稽核部的独立性

和权威性，配备了充足合格的监察稽核人员，明确监察稽核部门及其各岗位的职责和工作流

程、组织纪律。监察稽核部具体负责公司各项制度、业务的合法合规性及公司内部

控制制度的

执行情况的监察稽核工作。

（6）业务部门：部门负责人为所在部门的风险控制第一责任人，对本部门业务

范围内

的风险负有管控及时报告的义务。

（7）岗位员工：公司努力树立内控优先和风险管理理念，培养全体员工的风险

防范意

识，营造一个浓厚的内控文化氛围，保证全体员工及时了解国家法律法规和公司

规章制度，

嘉实基金管理有限公司

16

使风险意识贯穿到公司各个部门、各个岗位和各个环节。员工在其岗位职责范围

内承担相应

的内控责任，并负有对岗位工作中发现的风险隐患或风险问题及时报告、反馈的

4、内部控制措施

公司确立“制度上控制风险、技术上量化风险”，积极吸收或采用先进的风险控

制技术

和手段，进行内部控制和风险管理。

（1）公司逐步健全法人治理结构，充分发挥独立董事和监事会的监督职能，严

禁不正

当关联交易、利益输送和内部人控制现象的发生，保护投资者利益和公司合法权

益。

(2) 公司设置的组织结构，充分体现职责明确、相互制约的原则，各部门均有明确的授权分工，操作相互独立。公司逐步建立决策科学、运营规范、管理高效的运行机制，包括民主、透明的决策程序和管理议事规则，高效、严谨的业务执行系统，以及健全、有效的内部监督和反馈系统。

(3) 公司设立了顺序递进、权责统一、严密有效的内控防线：

- ①各岗位职责明确，有详细的岗位说明书和业务流程，各岗位人员在上岗前均应知悉并以书面方式承诺遵守，在授权范围内承担责任；
- ②建立重要业务处理凭据传递和信息沟通制度，相关部门和岗位之间相互监督制衡。

(4) 公司建立有效的人力资源管理制度，健全激励约束机制，确保公司人员具备与岗位要求相适应的职业操守和专业胜任能力。

(5) 公司建立科学严密的风险评估体系，对公司内外部风险进行识别、评估和分析，及时防范和化解风险。

(6) 授权控制应当贯穿于公司经营活动的始终，授权控制的主要内容包括：

- ①股东会、董事会、监事会和管理层充分了解和履行各自的职权，建立健全公司授权标准和程序，确保授权制度的贯彻执行；
- ②公司各部门、分公司及员工在规定授权范围内行使相应的职责；
- ③重大业务授权采取书面形式，授权书应当明确授权内容和时效；
- ④对已获授权的部门和人员建立有效的评价和反馈机制，对已不适用的授权应及时修改或取消授权。

(7) 建立完善的基金财务核算与基金资产估值系统和资产分离制度，基金资产与公司自有资产、其他委托资产以及不同基金的资产之间实行独立运作，分别核算，及时、准确和

完整地反映基金资产的状况。

(8) 建立科学、严格的岗位分离制度，明确划分各岗位职责，投资和交易、交易和清

嘉实基金管理有限公司

17

算、基金会计和公司会计等重要岗位不得有人员重叠。投资、研究、交易、IT等重要业

务部门和岗位进行物理隔离。

(9) 建立和维护信息管理系统，严格信息管理，保证客户资料等信息安全、真实和完

整。积极维护信息沟通渠道的畅通，建立清晰的报告系统，各级领导、部门及员工均有明确

的报告途径。

(10) 建立和完善客户服务标准，加强基金销售管理，规范基金宣传推介，不得有不正

当销售行为和不正当竞争行为。

(11) 制订切实有效的应急应变措施，建立危机处理机制和程序，对发生严重影响基金

份额持有人利益、可能引起系统性风险、严重影响社会稳定的突发事件，按照预案妥善处理。

(12) 公司建立健全内部监控制度，督察长、监察稽核部对公司内部控制制度的执行情

况进行持续的监督，保证内部控制制度落实；定期评价内部控制的有效性并适时改进。

①对公司各项制度、业务的合法合规性核查。由监察稽核部设计各部门监察稽核点明

细，按照查核项目和查核程序进行部门自查、监察部核查，确保公司各项制度、业务符合有

关法律、行政法规、部门规章及行业监管规则；

②对内部风险控制制度的持续监督。由监察稽核部组织相关业务部门、岗位共同识别

风险点，界定风险责任人，设计内部风险点自我评估表，对风险点进行评估和分析，并由监

察稽核部监督风险控制措施的执行，及时防范和化解风险；

③督察长发现公司存在重大风险或者有违法违规行为，在告知总经理和其他有关高级
管理人员的同时，向董事会、中国证监会和公司所在地中国证监会派出机构报告。

5、基金管理人关于内部控制的声明

(1) 基金管理人承诺以上关于内部控制的披露真实、准确；

(2) 基金管理人承诺根据市场变化和基金管理人发展不断完善内部控制体系和内部控
制制度。

嘉实基金管理有限公司

18

四、基金托管人

(一) 基金托管人情况

1、基本情况

名称：上海银行股份有限公司（以下简称“上海银行”）

住所：上海市浦东新区银城中路 168 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号

法定代表人：金煜

成立时间：1995 年 12 月 29 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币 54.04 亿元

存续期间：持续经营

基金托管业务批准文号：中国证监会 证监许可[2009]814 号

托管部门联系人：叶忆红

电话：021-68475888

传真：021-68476936

上海银行成立于 1995 年 12 月 29 日，是一家由国有股份、中资法人股份、外资
股份及

个人股份共同组成的股份制商业银行，总行位于上海。

近年来，上海银行以“精品银行”为战略愿景，以“精诚至上，信义立行”为企业核心
价值观，

以“总体形成特色、区域兼顾差异、局部凸显亮点”为指导思想，持续

推进专业化

经营和精细化管理，经营实力和发展能力明显提升。根据市场和自身优势，上海银行形成了

“中小企业综合金融服务”、“城市居民财富管理和养老金融服务”、“金融市场领先交易

服务”、“两岸三地跨境金融服务”以及“最佳在线金融服务”等特色定位，通过培育和塑

造经营特色，推动结构调整和转型发展，增强可持续发展能力。

目前，上海银行在上海、宁波、南京、杭州、天津、成都、深圳、北京、苏州、无锡、

绍兴、南通等地拥有分支机构和营业网点 311 个，设有自助银行 211 个，布放自助服务类终

端设备 2167 台，初步形成了覆盖长三角、环渤海、珠三角、中西部重点城市的网络布局框

架。上海银行还发起设立闵行上银、衢江上银、江苏江宁上银和崇州上银村镇银行，发起成

立上银基金管理有限公司，在香港地区设立上海银行（香港）有限公司，并与全球 130 多个

国家和地区近 1600 多家境内外银行及其分支机构建立了代理行关系。

成立 20 年来，上海银行市场竞争力和影响力不断提高，在英国《银行家》全球前 1000

嘉实基金管理有限公司

19

家银行中排名持续提升，2015 年位列全球银行业第 108 位，较上年排名上升 22 位。多次被

《亚洲银行家》杂志评为“中国最佳城市零售银行”，先后荣获“上海市著名商标”、“小

企业优秀客户服务银行”、“全国再就业先进单位”、“全国银行间市场优秀交易成员”、

“全国敬老模范单位”、“最佳企业形象奖”、“中国银行业发展论坛-最佳城市商业银行”

等荣誉称号。

截至 2015 年底，上海银行资产总额 14491.40 亿元；存款总额 7926.80 亿元，

贷款和

垫款总额 5365.08 亿元；资本充足率为 12.65%；拨备覆盖率 237.70%。

2、主要人员情况

上海银行总行下设资产托管部，是从事资产托管业务的职能部门，内设产品管理部、

托管运作部（下设托管运作团队和运行保障团队）、稽核监督部，平均年龄 30 岁左右，100%

员工拥有大学本科以上学历，业务岗位人员均具有基金从业资格。

3、基金托管业务经营情况

上海银行于 2009 年 8 月 18 日获得中国证监会、中国银监会核准开办证券投资基金托

管业务，批准文号：中国证监会证监许可[2009]814 号。

截至 2016 年 6 月 30 日，上海银行已托管 23 只证券投资基金，分别为天治成长精选混

合型证券投资基金、浦银安盛稳健增利债券型证券投资基金（LOF）、中证财通中国可持续

发展 100（ECPI ESG）指数增强型证券投资基金、鹏华双债增利债券型证券投资基金、浦银

安盛季季添利定期开放债券型证券投资基金、鹏华双债保利债券型证券投资基金、鹏华丰信

分级债券型证券投资基金、前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金、万家现

金宝货币市场证券投资基金、中银安心回报半年定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛月

月盈安心养老定期支付债券型证券投资基金、申万菱信中证申万传媒行业投资指数分级证券

投资基金、华安添颐养老混合型发起式证券投资基金、万家瑞丰灵活配置混合型证券投资基

金、万家瑞兴灵活配置混合型证券投资基金基金、博时裕荣纯债债券型证券投资

基金、浙商惠盈纯债债券型证券投资基金、兴业福益债券型证券投资基金、大成慧成货币市

场证券投资

基金、嘉实稳瑞纯债债券型证券投资基金、嘉实稳祥纯债债券型证券投资基金、

博时裕弘纯

债债券型证券投资基金、鹏华兴益定期开放灵活配置混合型基金，托管基金的资产净值合计

255.07 亿元。

（二）基金托管人的内部控制制度

内部控制目标

严格遵守国家有关法律法规、行业监管规章和本行有关规定，守法经营、规范运作、

嘉实基金管理有限公司

20

严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金资产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、

完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

内部控制组织结构

上海银行基金托管业务内部风险控制组织结构是由总行风险管理部门和资产托管部共

同组成。托管业务风险控制纳入全行的风险管理体系；资产托管部配备专职人员负责托管业

务内控稽核工作，各业务部室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

内部控制的原则

（1）全面性原则：监督制约必须渗透到托管业务的全过程和各个操作环节，覆盖到资

产托管部所有的部室、岗位和人员。

（2）独立性原则：资产托管部内设独立的稽核监督团队，保持高度的独立性和权威性，

负责对托管业务风险控制工作进行指导和监督。

（3）相互制约原则：各业务部室在内部组织结构上形成相互制约，建立不同岗位之间

的制衡体系。

（4）审慎性原则：内控与风险管理必须以防范风险、审慎经营为前提，保证托管资产

的安全与完整；托管业务经营管理必须按照“内控优先”的原则，在新设机构或新增业务时，

做到先期完成相关制度建设。

(5) 有效性原则：内部控制体系应与所处的环境相适应，以合理的成本实现内部控制目标，
内部制度的制订应当具有前瞻性，并应当根据国家政策、法律及经营管理的需要，
适时进行
相应修改和完善；内部控制应当具有高度的权威性，任何人不得拥有不受内部控制
约束的权
力，内部控制存在的问题应当能够得到及时反馈和纠正。

内部控制制度及措施

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

(2) 建立托管业务前后台分离，不同岗位相互牵制的管理结构。

(3) 专门的稽核监督人员组织各业务部室进行风险识别、评估，制定并实施风险控制
措施。

(4) 托管业务操作间实施门禁管理和音像监控。

(5) 定期开展业务与职业道德培训，使员工树立风险防范与控制理念，并签订
承诺书。

(6) 制定完备的应急预案，并组织员工定期演练；建立异地灾备，保证业务连续不中
断。

嘉实基金管理有限公司

21

(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
基金托管人负有对基金管理人的投资运作行使监督权的职责。根据《基金法》、
《运作
办法》、基金合同及其他有关规定，托管人对基金的投资对象和范围、投资组合
比例、投资
限制、费用的计提和支付方式、基金会计核算、基金资产估值和基金净值的计算、
收益分配、
申购赎回以及其他有关基金投资和运作的事项，对基金管理人进行业务监督、核
查。

基金托管人发现基金管理人违反法律法规和基金合同的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时，通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

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投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。

嘉实基金管理有限公司

22

五、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、直销机构：

（1）嘉实基金管理有限公司直销中心

办公地址 北京市东城区建国门南大街7号万豪中心D座12层

电话 (010) 65215588 传真 (010) 65215577

联系人 赵佳

（2）嘉实基金管理有限公司上海直销中心

办公地址 上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心2期53层09-11单元

电话 (021) 38789658 传真 (021) 68880023

联系人 邵琦

(3) 嘉实基金管理有限公司成都分公司

办公地址 成都市高新区交子大道 177 号中海国际中心 A 座 2 单元 21 层 04-05 单元

电话 (028) 86202100 传真 (028) 86202100

联系人 王启明

(4) 嘉实基金管理有限公司深圳分公司

办公地址 深圳市福田区益田路 6001 号太平金融大厦 16 层

电话 (0755) 84362200 传真 (0755) 25870663

联系人 陈寒梦

(5) 嘉实基金管理有限公司青岛分公司

办公地址 青岛市市南区山东路 6 号华润大厦 3101 室

电话 (0532) 66777997 电话 (0532) 66777676

联系人 胡洪峰

(6) 嘉实基金管理有限公司杭州分公司

办公地址 杭州市江干区四季青街道钱江路 1366 号万象城 2 幢 1001A 室

电话 (0571) 88061392 传真 (0571) 88021391

嘉实基金管理有限公司

23

联系人 王振

(7) 嘉实基金管理有限公司福州分公司

办公地址 福州市鼓楼区五四路 158 号环球广场 25 层 04 单元

电话 (0591) 88013673 传真 (0591) 88013670

联系人 吴志锋

(8) 嘉实基金管理有限公司南京分公司

办公地址 南京市白下区中山东路 288 号新世纪广场 A 座 4202 室

电话 (025) 66671118 传真 (025) 66671100

联系人 徐莉莉

(9) 嘉实基金管理有限公司广州分公司

办公地址 广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心 50 层 05-06A 单元

电话 (020) 88832125 传真 (020) 81552120

联系人 周炜

2、代销机构

(1) 万得投资顾问有限公司

(二) 登记机构

办公地址 上海市浦东新区福山路 33 号建工大厦 8 楼

注册地址 中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

法定代表人 王廷富 联系人 姜吉灵

电话 021-68882280 传真 021-68882281

客服电话 400-821-0203

名称 嘉实基金管理有限公司

住所 中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心二期 53 层 09-11 单元

办公地址 北京市建国门北大街 8 号华润大厦 8 层

法定代表人 邓红国

联系人 彭鑫

电话 (010) 65215588

嘉实基金管理有限公司

24

(三) 出具法律意见书的律师事务所

(四) 审计基金财产的会计师事务所

传真 (010) 65185678

名称 上海市源泰律师事务所

住所、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 联系人 范佳斐

电话 (021) 51150298-827 传真 (021) 51150398

经办律师 刘佳、范佳斐

名称 普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住所 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 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

法定代表人 李丹 联系人 张勇

电话 (021) 23238888 传真 (021) 23238800

经办注册会计师 许康玮、张勇

嘉实基金管理有限公司

25

六、基金的募集

（一）基金募集的依据

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定募集。本基金募集申请已经中国证监会 2016 年 3 月 7 日证监许可[451] 号文注册。

（二）基金类型和存续期间

- 1、基金的类别：债券型证券投资基金。
- 2、基金的运作方式：契约型开放式。
- 3、基金存续期间：不定期。

（三）基金份额的募集期限、募集方式及场所、募集对象、募集目标

- 1、募集期限：2016 年 3 月 16 日
- 2、募集方式及场所

本基金将通过各销售机构公开发售，各销售机构的具体名单见基金份额发售公告以及基金管理人届时发布的调整销售机构的相关公告。

3、募集对象

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、机构投资者和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。

4、募集目标

本基金不设募集目标。

（四）基金的认购

- 1、认购程序：投资者认购时间安排、认购时应提交的文件和办理的手续，详见本基金的份额发售公告。
- 2、本基金认购费率按照认购金额递减，即认购金额越大，所适用的认购费率越低。投资者在一天之内如果有多笔认购，适用费率按单笔分别计算。具体认购费率如下：

投资者在认购基金份额时需交纳前端认购费，费率按认购金额递减，具体如下：

认购金额（含认购费） 认购费率

M<100 万元 0.6%

100 万元≤M<300 万元 0.4%

300 万元 \leq M<500 万元 0.2%

嘉实基金管理有限公司

26

M \geq 500 万元 按笔收取，1000 元/笔

本基金的认购费用由投资者承担，不列入基金资产，认购费用用于本基金的市场推广、

销售、注册登记等募集期间发生的各项费用。

3、募集资金利息的处理方式

有效认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有，其中利

息转份额以登记机构的记录为准。

4、认购份额的计算

本基金每份基金份额初始面值均为人民币 1.00 元。

认购份数的计算方法如下：

① 认购费用适用比例费率时，认购份额的计算方法如下：

净认购金额=认购金额/(1+认购费率)

认购费用=认购金额-净认购金额

认购份额=(净认购金额+认购资金利息)/1.00 元

② 认购费用为固定金额时，认购份额的计算方法如下：

认购费用=固定金额

净认购金额=认购金额-认购费用

认购份额=(净认购金额+认购资金利息)/1.00 元

其中：认购份额的计算保留到小数点后两位，小数点两位以后的部分舍去，由此误差产

生的收益或损失由基金财产承担。

例一：某投资者投资 10,000 元认购本基金，如果其认购资金的利息为 10 元，则其可得到

的基金份额计算如下：

净认购金额=10,000/(1+0.6%) = 9,940.35 元

认购费用=10,000 -9,940.35= 59.65 元

认购份数=(9,940.35 + 10)/1.00 = 9,950.35 份

即投资者投资 10,000 元认购本基金，可得到 9,950.35 份基金份额。

5、募集资金

基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。

嘉实基金管理有限公司

27

七、基金合同的生效

（一）基金备案的条件

本基金的基金合同于 2016 年 3 月 18 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）基金合同不能生效时募集资金的处理方式

如果募集期限届满，未满足募集备案条件，基金管理人应当承担下列责任：

- 1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；
- 2、在基金募集期限届满后 30 日内退还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息。

如基金募集失败，基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬。基金管理人、基

金托管人和销售机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。

（三）基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

《基金合同》生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金

资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日

出现前述情形的，基金管理人应当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。

法律法规另有规定时，从其规定。

嘉实基金管理有限公司

28

八、基金份额的申购与赎回

（一）申购、赎回的场所

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。具体的销售网点将由基金管理人在招募说明

书或其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并予以公告。基金

投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基

金份额的申购与赎回。

（二）申购、赎回的开放日及时间

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》的有关规定在指定媒介上公告。

2、申购、赎回开始日及业务办理时间

本基金自 2016 年 4 月 6 日起办理申购与赎回业务。

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》的有关规定在指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或者赎回或

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、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；

基金管理人可在法律法规允许的情况下，对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规

则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

嘉实基金管理有限公司

29

（四）申购、赎回的程序

1、申购和赎回的申请方式

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

的申请。

2、申购和赎回的款项支付

投资人申购基金份额时，必须全额交付申购款项，投资人全额交付申购款项，申购成立。

基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立。投资人赎回申请经登记机构确认后，基金管

理人将在 T+7 日(包括该日)内支付赎回款项。在发生巨额赎回时，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。本基金

登记机构确认申购或赎回的，申购或赎回生效。T 日提交的有效申请，投资人应在 T+2 日后

(包括该日)及时到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购

不成功，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申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收

到申请。申购、赎回的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资者应及时查询。

（五）申购、赎回的数额限制

1. 申请申购基金的金额

投资者通过代销机构或嘉实基金管理有限公司网上直销首次申购单笔最低限额为人民币 1.00 元，投资者通过直销中心柜台首次申购单笔最低限额为人民币 20,000 元；追加申购单笔最低限额为人民币 1.00 元。

投资者将当期分配的基金收益转购基金份额或采用定期定额投资计划时，不受最低申购金额的限制。

投资者可多次申购，对单个投资者累计持有份额不设上限限制。法律法规、中国证监会另有规定的除外。

2. 申请赎回基金的份额

单笔赎回不得少于 1.00 份（如该帐户在该销售机构托管的基金余额不足 1.00 份，则必

嘉实基金管理有限公司

30

须一次性赎回基金全部份额）；若某笔赎回将导致投资者在销售机构托管的基金余额不足

1.00 份时，基金管理人有权将投资者在该销售机构托管的剩余基金份额一次性全部赎回。

3. 基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整对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》的有关规定在中国证监会指定的媒介上刊登

公告并报中国证监会备案。

（六）申购、赎回的费率

1、本基金基金份额前端申购费率按照申购金额递减，即申购金额越大，所适用的申购

费率越低。投资者在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。具体如下：

申购金额（含申购费） 申购费率

M<100 万元 0.8%

100 万元≤M<300 万元 0.5%

300 万元≤M<500 万元 0.3%

M≥500 万元 按笔收取，单笔 1000 元

个人投资者通过本基金管理人直销网上交易系统申购本基金业务实行申购费率优惠，其

申购费率不按申购金额分档，统一优惠为申购金额的 0.6%，但中国银行长城借记卡、招商

银行借记卡、中国农业银行借记卡持卡人，申购本基金的申购费率优惠按照相关公告规定的

费率执行；机构投资者通过本基金管理人直销网上交易系统申购本基金，其申购费率不按申

购金额分档，统一优惠为申购金额的 0.6%。优惠后费率如果低于 0.6%，则按 0.6%执行。

基金招募说明书及相关公告规定的相应申购费率低于 0.6%时，按实际费率收取申购费。个人

投资者于本公司网上直销系统通过汇款方式申购本基金的，前端申购费率按照相关公告规定

的优惠费率执行。

本基金的申购费用由申购人承担，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项

费用，不列入基金财产。

注：2014 年 9 月 2 日，本基金管理人发布了《嘉实基金管理有限公司关于增加开通后端收

费基金产品的公告》，自 2016 年 4 月 6 日起，增加开通本基金在本公司基金网上直销系统的后

端收费模式（包括申购、定期定额投资、基金转换等业务），并对通过本公司基金网上直销系统

交易的后端收费进行费率优惠，本基金优惠后的费率见下表：

持有期限（T）

基金网上直销

后端申购优惠费率

$0 < t$

嘉实基金管理有限公司

31

1 年 $\leq T < 3$ 年

0.05%

$T \geq 3$ 年 0.00%

本公司直销中心柜台和代销机构暂不开通后端收费模式。具体请参见嘉实基金网站刊载的公告。

2、本基金对基金份额收取赎回费，在投资者赎回基金份额时收取。基金份额的赎回费

率按照持有时间递减，即相关基金份额持有时间越长，所适用的赎回费率越低。

本基金的赎回费用由基金份额持有人承担，赎回费 100% 计入基金财产。

本基金基金份额的赎回费率具体如下：

持有期限（T） 赎回费率

$0 \leq T < 1$ 年 0.1%

1 年 $\leq T < 2$ 年 0.05%

$T \geq 2$ 年 0%

注：1 年指 365 日

3、基金管理人可以在法律法规、基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟

应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

4、基金销售机构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，定期或不定期地开展基金促销活动。

（七）申购份额、赎回金额的计算方式

1、申购份额的计算

（1）当投资者选择申购基金份额时，申购份额的计算方法如下：

① 申购费用适用比例费率时，申购份额的计算方法如下：

净申购金额 = 申购金额 / (1 + 申购费率)

申购费用 = 申购金额 - 净申购金额

申购份额 = 净申购金额 / T 日基金份额净值

② 申购费用为固定金额时，申购份额的计算方法如下：

申购费用 = 固定金额

净申购金额 = 申购金额 - 申购费用

申购份额 = 净申购金额 / T 日基金份额净值

例一：某投资者投资 5 万元申购本基金基金份额，假设申购当日基金份额净值为 1.050 元，

则可得到的申购份额为：

嘉实基金管理有限公司

32

净申购金额 = $50,000 / (1 + 0.8\%) = 49,603.17$ 元

申购费用 = $50,000 - 49,603.17 = 396.83$ 元

申购份额 = $49,603.17 / 1.050 = 47,241.11$ 份

即：投资者投资 5 万元申购本基金基金份额，假设申购当日基金份额净值为 1.050 元，

则其可得到 47,241.11 份基金份额。

(2) 申购份额的计算保留小数点后两位，小数点后两位以后的部分舍去，舍去部分所

代表的资产计入基金资产。

2. 赎回金额的计算

采用“份额赎回”方式，赎回价格以赎回当日的基金份额净值为基准进行计算，计算公

式：

赎回总额 = 赎回份额 × 赎回当日基金份额净值

赎回费用 = 赎回总额 × 赎回费率

赎回金额 = 赎回总额 - 赎回费用

赎回金额保留至小数点后两位，小数点后两位以后的部分舍去，舍去部分所代表的资产

计入基金财产。

例二：假设两笔赎回申请赎回本基金份额均为 10,000 份，但持有时间长短不同，其中

基金份额净值为假设数，那么各笔赎回负担的赎回费用和获得的赎回金额计算如

下：

赎回 1 赎回 2 赎回 3

赎回份额（份，a） 10,000 10,000 10,000

基金份额净值（元，b） 1.100 1.200 1.300

持有时间 T $0 \leq T < 1$ 年 $1 \text{ 年} \leq T < 2$ 年 $T \geq 2$ 年

适用赎回费率（c） 0.1% 0.05% 0

赎回总额（元， $d=a*b$ ） 11,000 12,000 13,000

赎回费（ $e=c*d$ ） 11.6 0

赎回金额（ $f=d-e$ ） 10,989 11,994 13,000

（八）巨额赎回的认定及处理方式

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

嘉实基金管理有限公司

33

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) 暂停赎回：连续 2 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，并应当在指定媒介上进行公告。

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、传真或者招募说明书规

定的其他方式在 3 个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在指定媒介上

刊登公告。

(九) 拒绝或暂停申购、赎回的情形及处理方式

1、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人的申购申请：

1、因不可抗力导致基金无法正常运作。

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接收投资人的申

购申请。

嘉实基金管理有限公司

34

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、基金管理人认为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

有人利益时。

5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，从而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、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或基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。

7、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 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停基金投资者

的申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。

如果投资者的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资者。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。

2、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者的赎回申请或延缓支付赎回款项：

1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。

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收投资者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投资者的赎回申请。

6、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决定暂停接受基金份额持有人的赎回申请时，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。

3、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，基金管理人当日应立即向中国证监会备案，并

嘉实基金管理有限公司

35

在规定期限内指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，在指定媒介上刊登基金

重新开放申购或赎回公告，并公布最近 1 个开放日的基金份额净值。

(3) 若暂停时间超过 1 日，基金管理人可以根据《信息披露办法》自行确定公告的增

加次数，但基金管理人须依照《信息披露办法》，最迟于重新开放日在指定媒介上刊登重新

开放申购或赎回的公告，或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) 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。

(十一) 基金份额的转让

在法律法规允许且条件具备的情况下，基金管理人可受理基金份额持有人通过中

国证监

会认可的交易场所或者交易方式进行份额转让的申请并由登记机构办理基金份额的过户登

记。基金管理人拟受理基金份额转让业务的，将提前公告，基金份额持有人应根据基金管理

人公告的业务规则办理基金份额转让业务。

（十二）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公益性质的基金会或社会团体；司法强制执行是

指司法机关依据生效司法文书和协助执行通知书要求登记机构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。

（十三）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。

（十四）定期定额投资计划

嘉实基金管理有限公司

36

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申购金额，每期申购金额必须不

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。

（十五）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。

嘉实基金管理有限公司

37

九、基金的投资

（一）投资目标

在严格控制组合风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳定投资回报。

（二）投资范围

本基金主要投资于债券（国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期

融资券、超短期融资券、中小企业私募债、次级债、地方政府债、政府支持机构债券、可分

离交易可转债的纯债部分等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类品种，以

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（但须符合中国证监会的

相关规定）。

本基金不投资于股票、权证等权益类资产，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债

的纯债部分除外）、可交换债券。

基金的投资组合比例为：本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%；本基金持

有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。

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。

（三）投资策略

本基金采用自上而下与自下而上相结合的投资策略，在科学分析与有效管理风险

的基础

上，实现风险与收益的最佳匹配。

（1）资产配置策略

本基金通过对宏观经济指标、货币政策与财政政策、商业银行信贷扩张、国际资本流动

和其他影响短期资金供求状况等因素的分析，预判对未来利率市场变化情况。

根据对未来利率市场变化的预判情况，分析不同类别资产的收益率水平、流动性特征和

风险水平特征，并以此决定各类资产的配置比例和期限匹配。

（2）固定收益类资产投资策略

1) 久期策略

本基金通过对影响市场利率的各种因素（如宏观经济状况、货币政策走向、资金供求情

况等）的分析，判断市场利率变化趋势，以确定基金组合的久期目标。当预期未来市场利率

嘉实基金管理有限公司

38

水平下降时，本基金将通过增持剩余期限较长的债券等方式提高基金组合久期；

当预期未来

市场利率水平上升时，本基金将通过增加持有剩余期限较短债券并减持剩余期限较长债券等

方式缩短基金组合久期，以规避组合跌价风险。

2) 期限结构配置策略

本基金将根据对利率走势、收益率曲线的变化情况的判断，适时采用哑铃型、梯形或子

弹型投资策略，在长期、中期和短期债券间进行配置，以最大限度避免投资组合收益受债券

利率变动的负面影响。

3) 类属配置策略

类属配置是指债券组合中国债、金融债、企业债、公司债等不同债券投资品种之间的配

置比例。

本基金将综合分析各类属相对收益情况、利差变化状况、信用风险评级、流动性

风险管

理等因素来确定各类属配置比例，发掘具有较好投资价值的投资品种，增持相对低估并能给组合带来相对较高回报的类属，减持相对高估并给组合带来相对较低回报的类属。

4) 个券选择策略

本基金在个券选择上将安全性因素放在首位，优先选择高信用等级的债券品种，防范违约风险。其次，在具体的券种选择上，将根据拟合收益率曲线的实际情况，挖掘收益率明显偏高的券种，若发现该类券种主要由于市场波动原因所导致的收益率高于公允水平，则该券种价格属于相对低估，本基金将重点关注此类低估品种，并选择收益率曲线上定价相对低估的期限段进行投资。

(3) 资产支持证券投资策略

本基金通过对资产支持证券资产池结构和质量的跟踪考察，分析资产支持证券底层资产信用状况变化，并预估提前偿还率变化对资产支持证券未来现金流的影响情况，评估其内在价值进行投资。

(4) 中小企业私募债投资策略

与传统信用债券相比，一方面，中小企业私募债由于以非公开方式发行和交易，并且限制投资人数量上限，整体流动性相对较差；另一方面，受到发债主体资产规模较小、经营波动性较高、信用基本面稳定性较差影响，整体的信用风险相对较高。鉴于中小企业私募债的弱流动性和高风险性，本基金将运用基本面研究，结合财务分析方法对债券发行人信用风险进行分析和度量，综合考虑信用基本面、债券收益率和流动性等因素的基础上，选择风险与收益相匹配的品种进行投资。

嘉实基金管理有限公司

（四）投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

- （1）本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%；
- （2）本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%；
- （3）本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；
- （4）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；
- （5）本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不展期；
- （6）本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；
- （7）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；
- （8）本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；
- （9）本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；
- （10）本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；
- （11）本基金持有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%；
- （12）本基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

(13) 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。

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。

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上述限制，或者修改或调整涉及本基金的投资比例、投资限制

嘉实基金管理有限公司

40

等，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按调整后的规定执行，但需提前公告，不需要基金份额持有人大会审议。

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) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- (5) 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；
- (6) 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。

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

易须事先履

行相关程序，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过

三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

法律、行政法规或监管部门取消或变更上述禁止性规定，如适用于本基金，基金管理人

在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按变更后的规定执行。

（五）业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：一年期银行定期存款收益率(税后)+1%本基金选择上述业绩

比较基准的原因为本基金是通过债券等固定收益资产来获取的收益，力争获取相对稳健的绝

对回报，追求委托财产的保值增值。

如果相关法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推

出，或者市场发生变化导致本业绩比较基准不再适用，经基金管理人与基金托管人协商，本

基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告，而无须召开基金份额持有人

大会。

（六）风险收益特征

本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股

票型基金，属于中等预期风险/收益的产品。

（七）基金管理人代表基金行使相关权利的处理原则及方法

嘉实基金管理有限公司

41

1、有利于基金资产的安全与增值；

2、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；

3、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟

取任何
不当利益。

(八) 基金投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或
重大遗漏

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。

基金托管人上海银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 7 月 18 日
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。

本投资组合报告所载数据截至 2016 年 6 月 30 日（“报告期末”），本报告所
列财务数

据未经审计。

1、 报告期末基金资产组合情况

序号 项目 金额（元） 占基金总资产的比例（%）

1 权益投资 --

其中：股票 --

2 基金投资 --

3 固定收益投资 --

其中：债券 --

资产支持证券 --

4 贵金属投资 --

5 金融衍生品投资 --

6 买入返售金融资产 --

其中：买断式回购的买入返售

金融资产

--

7 银行存款和结算备付金合计 725,331.56 98.62

8 其他资产 10,135.15 1.38

合计 735,466.71 100.00

2、 报告期末按行业分类的股票投资组合

报告期末，本基金未持有股票。

3、 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细
报告期末，本基金未持有股票。

嘉实基金管理有限公司

42

4、 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

报告期末，本基金未持有债券。

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
报告期末，本基金未持有债券。

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

报告期末，本基金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
报告期末，本基金未持有贵金属投资。

8、 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
报告期末，本基金未持有权证。

9、 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与股指期货交易。

10、 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

11、 投资组合报告附注

(1)

报告期内本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，在本报告
编制日

前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

(2)

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

(3) 其他资产构成

序号 名称 金额(元)

1 存出保证金 -

2 应收证券清算款 -

3 应收股利 -

4 应收利息 135.15

5 应收申购款 10,000.00

6 其他应收款 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

嘉实基金管理有限公司

43

合计 10,135.15

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末,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

报告期末,本基金未持有股票。

十、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。

1. 本报告期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

嘉实稳瑞纯债债券

阶段

净值增

长率①

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

2016 年 3 月

18 日（基金

合同生效日）

至 2016 年 6

月 30 日

8.80% 0.64% 0.72% 0.01% 8.08% 0.63%

2. 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

嘉实基金管理有限公司

44

图：嘉实稳瑞纯债债券累计份额净值增长率的历史走势对比图

（2016 年 3 月 18 日至 2016 年 6 月 30 日）

注：本基金基金合同生效日 2016 年 3 月 18 日至报告期末未满 1 年。按基金合同和招募

说明书的约定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期，本报告期处于建仓期内。

嘉实基金管理有限公司

45

十一、基金的财产

（一）基金资产总值

基金资产总值是指购买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，基金托管人不对处于其实际控制之外的账户及财产承担责任。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。

嘉实基金管理有限公司

46

十二、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）估值方法

1、证券交易所上市的有价证券的估值

（1）除本部分另有约定的品种外，交易所上市的有价证券，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) 交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（基金合同另有规定的除外），选取估

值日第三方估值机构提供的相应品种对应的估值净价估值，具体估值机构由基金管理人与基

金托管人另行协商约定；

(3) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上

市的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况

下，按成本估值。

2、首次公开发行未上市的债券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计

量公允价值的情况下，按成本估值。

3、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确

定公允价值。

4、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

5、中小企业私募债，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。

6、债券回购：持有的回购协议以成本列示，按商定利率在实际持有期间内逐日计提利

息；

嘉实基金管理有限公司

47

7、定期存款：以本金列示，按商定的存款利率在实际持有期间内逐日计提应收利息，

在利息到账日以实收利息入账；

8、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管

理人可

根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

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

规定估值。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法

律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，

双方协商解决。

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。

本基

金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方

在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对基金资产净值的计算

结果对外予以公布。

（四）估值程序

1、基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数

量计算，精确到 0.001 元，小数点后第四位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人应每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，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。

（五）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。

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。

嘉实基金管理有限公司

48

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

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。

嘉实基金管理有限公司

49

(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。

(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，如事后证明基金托

管人计算正确的，基金托管人不承担责任。

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，而且基金托管人

未对计算过程提出疑义或要求基金管理人书面说明，基金份额净值出错且造成基金

份额持有人损失的，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管理费和托管费的比例各自承担相应的

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

核对或

对基金管理人采用的估值方法，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，如事后证明基金托管人计算正确，由此

给基金份额

持有人和基金造成的损失，基金托管人不承担责任。

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）基金管理人和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差，

以基金

管理人计算结果为准。

（5）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。

（六）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、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

（七）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开放日交易结束后计算当日的基金资产净值和基金份额

嘉实基金管理有限公司

50

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。

（八）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 8 项进行估值时，所造成的误差

不作为基金资产估值错误处理。

（2）由于不可抗力原因，或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误等原因，

基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误

的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任，但基金管理人、

基金托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

嘉实基金管理有限公司

51

十三、基金的收益与分配

（一）基金利润的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后

的余额，基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

（二）基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益

孰低数。

（三）基金收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金可以进行收益分配，本基金每年收益分

配次数最多为 4 次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额

可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资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；

3、基金收益分配后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、每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

本基金每次收益分配比例详见届时基金管理人发布的公告。

（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，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。

（六）基金收益分配中发生的费用

嘉实基金管理有限公司

52

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基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。

嘉实基金管理有限公司

53

十四、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、《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、诉讼费和仲裁费；
- 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、基金的证券账户开户费用、账户维护费用；
- 9、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0.3%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.3\% \div \text{当年天数}$$

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，经基金管理人和基金托管人双

方核对后，由基金管理人向基金托管人发送划款指令，基金托管人于次月前3个

工作日内从

基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支

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 0.1% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

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，经管理人和基金托管人双方核

对后，由基金管理人向基金托管人发送划款指令，基金托管人于次月前 3 个工作日内从基金

嘉实基金管理有限公司

54

财产中一次性支取。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。

上述“（一）基金费用的种类中第 3—9 项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按

费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

（三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

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

（四）基金税收

本基金运作过程中涉及各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

嘉实基金管理有限公司

十五、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；
- 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托管协议约定的方式确认。

（二）基金的年度审计

- 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的具有证券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在2个工作日内在指定媒介公告并报中国证监会备案。
- 嘉实基金管理有限公司

十六、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》、《基金合同》及其他有关规定。

（二）信息披露义务人

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

本基金信息披露义务人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、准确性和完整性。

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过中国

证监会指定的媒介和基金管理人、基金托管人的互联网网站（以下简称“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、法人或者其他组织的祝贺性、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

义务人应保证两种文本的内容一致。两种文本发生歧义的，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：

- 1、基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议

（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。

嘉实基金管理有限公司

57

（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，基金管理人在每 6 个月结束之日起 45 日内，更新招募说

明书并登载在网站上，将更新后的招募说明书摘要登载在指定媒介上；基金管理人在公告的

15 日前向主要办公场所所在地的中国证监会派出机构报送更新的招募说明书，并就有关更

新内容提供书面说明。

(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。

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》摘要登载在指定媒介和网站上；基金管理人、基金托管人应当将《基

金合同》、基金托管协议登载在网站上。

2、基金份额发售公告

基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露招募说明

书的当日登载于指定媒介和网站上。

3、《基金合同》生效公告

基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日在指定媒介和网站上登载《基金合

同》生效公告。

4、基金资产净值、基金份额净值

《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

公告一次基金资产净值和基金份额净值。

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、

基金份额发售网点以及其他媒介，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。

基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，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介上。

5、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份额发售网点查阅或者复制前述信息资料。

6、基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告 嘉实基金管理有限公司

58

基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定媒介上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。

基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定媒介上。

基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定媒介和网站上。

《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、半年度报告或者年度报告。

基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。

7、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 个工作日内编制临时报告书，予以

公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地的中国证监会派

出机构备案。

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；
- (2) 终止《基金合同》；
- (3) 转换基金运作方式；
- (4) 更换基金管理人、基金托管人；
- (5) 基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- (6) 基金管理人股东及其出资比例发生变更；
- (7) 基金募集期延长；
- (8) 基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管

人基金

托管部门负责人发生变动；

- (9) 基金管理人的董事在一年内变更超过百分之五十；
- (10) 基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过百分之三十；
- (11) 涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼或仲裁；

嘉实基金管理有限公司

59

- (12) 基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查；
- (13) 基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚，

基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚；

- (14) 重大关联交易事项；
- (15) 基金收益分配事项；
- (16) 管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- (17) 基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；
- (18) 基金改聘会计师事务所；
- (19) 变更基金销售机构；

- (20) 更换基金登记机构;
- (21) 本基金开始办理申购、赎回;
- (22) 本基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更;
- (23) 本基金发生巨额赎回并延期办理;
- (24) 本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请;
- (25) 本基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回;
- (26) 中国证监会或基金合同规定的其他事项。

8、澄清公告

在《基金合同》存续期限内，任何公共媒体中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动的，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。

9、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。

10、中国证监会规定的其他信息。

基金管理人应在基金招募说明书的显著位置披露投资中小企业私募债券的流动性风险和信用风险，说明投资中小企业私募债券对基金总体风险的影响。本基金投资中小企业私募债券后两个交易日内，基金管理人应在中国证监会指定媒介披露所投资中小企业私募债券的名称、数量、期限、收益率等信息，并在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露中小企业私募债券的投资情况。

本基金投资资产支持证券，基金管理人应在基金年报及半年报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总资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细。基

嘉实基金管理有限公司

60

基金管理人应在基金季度报告中披露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。

（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，指定专人负责管理信息披露

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

格式准则的规定。

基金

托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定，

管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期

报告和定期

更新的招募说明书等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人

出具书面文

件或者盖章确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定媒介中选择披露信息的报刊。

基金管理人、基金托管人除依法在指定媒介上披露信息外，还可以根据需要在其他公共

媒体披露信息，但是其他公共媒体不得早于指定媒介披露信息，并且在不同媒介

上披露同一

信息的内容应当一致。

为基金信息披露义务人公开披露的基金信息出具审计报告、法律意见书的专业机

构，应

当制作工作底稿，并将相关档案至少保存到《基金合同》终止后 10 年。

（七）信息披露文件的存放与查阅

招募说明书公布后，应当分别置备于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的

住所，

供公众查阅、复制。

基金定期报告公布后，应当分别置备于基金管理人和基金托管人的住所，以供公

众查阅、

复制。

（八）暂停或延迟信息披露的情形

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信息：

- 1、基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；
- 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基金份额持有人的利益，已决定延迟估值；
- 4、出现会导致基金管理人不能出售或评估基金资产的紧急事故的任何情况；
- 5、法律法规规定、中国证监会或《基金合同》认定的其他情形。

嘉实基金管理有限公司

61

嘉实基金管理有限公司

62

十七、风险揭示

（一）市场风险

证券市场价格因受各种因素的影响而引起的波动，将对本基金资产产生潜在风险，主要

包括：

1、政策风险

货币政策、财政政策、产业政策等国家政策的变化对证券市场产生一定的影响，导致市

场价格波动，影响基金收益而产生风险。

2、经济周期风险

证券市场是国民经济的晴雨表，而经济运行具有周期性的特点。宏观经济运行状况将对

证券市场的收益水平产生影响，从而产生风险。

3、利率风险

金融市场利率波动会导致证券市场的价格和收益率的变动。

4、购买力风险

本基金投资的目的是使基金资产保值增值，如果发生通货膨胀，基金投资于证券所获得

的收益可能会被通货膨胀抵消，从而影响基金资产的保值增值。

5、再投资风险。

再投资风险反映了利率下降对固定收益证券利息收入再投资收益的影响，这与利

率上升

所带来的价格风险（即利率风险）互为消长。

（二）信用风险

信用风险主要指债券、资产支持证券等信用证券发行主体信用状况恶化，导致信用评级

下降甚至到期不能履行合约进行兑付的风险，另外，信用风险也包括证券交易对手因违约而

产生的证券交割风险。

（三）流动性风险

指基金资产不能迅速转变成现金，或者不能应付可能出现的投资者大额赎回的风险。在

开放式基金交易过程中，可能会发生巨额赎回的情形。巨额赎回可能会产生基金仓位调整的

困难，导致流动性风险，甚至影响基金份额净值。

（四）管理风险

嘉实基金管理有限公司

63

在基金管理运作过程中，可能因基金管理人经济形势和证券市场等判断有误、获取的

信息不全等影响基金的收益水平。基金管理人的管理水平、管理手段和管理技术等对基金收

益水平存在影响。

（五）操作或技术风险

指相关当事人在业务各环节操作过程中，因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失

误或违反操作规程等引致的风险，例如，越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误、IT 系统

故障等风险。

在开放式基金的各种交易行为或者后台运作中，可能因为技术系统的故障或者差错而影

响交易的正常进行或者导致投资者的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理公司、

登记机构、代销机构、证券交易所、证券登记结算机构等等。

（六）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。

（七）本基金特有的风险

本基金为纯债债券型基金，债券的投资比例不低于基金资产的 80%，该类债券的特定风

险即成为本基金及投资者主要面对的特定投资风险。债券的投资收益会受到宏观经济、政府

产业政策、货币政策、市场需求变化、行业波动等因素的影响，可能存在所选投资标的的成

长性与市场一致预期不符而造成个券价格表现低于预期的风险。

本基金投资中小企业私募债，中小企业私募债是根据相关法律法规由非上市中小企业采

用非公开方式发行的债券。由于不能公开交易，一般情况下，交易不活跃，潜在较大流动性

风险。当发债主体信用质量恶化时，受市场流动性所限，本基金可能无法卖出所持有的中小

企业私募债，由此可能给基金净值带来更大的负面影响和损失。

本基金投资资产支持证券，资产支持证券存在一定的信用风险、利率风险、流动性风险、

提前偿付风险、操作风险和法律风险。

（八）其他风险

战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致基金

资产的损失。

金融市场危机、行业竞争、代理商违约、托管行违约等超出基金管理人自身直接控制能

力之外的风险，可能导致基金或者基金持有人利益受损。

嘉实基金管理有限公司

64

十八、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通

过之日起生效，并在决议生效后按《信息披露办法》的规定在指定媒体公告。

（二）《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，《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）基金财产清算小组成立后，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。

嘉实基金管理有限公司

65

(7) 对基金财产进行分配；

5、基金财产清算的期限为 6 个月。

(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。

嘉实基金管理有限公司

66

十九、基金合同的内容摘要

(一) 基金合同当事人的权利与义务

A. 基金份额持有人的权利和义务

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

者自依据《基金合同》取得的基金份额，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。

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

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) 根据基金合同的约定，依法申请赎回或转让其持有的基金份额；

(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

于：

(1) 认真阅读并遵守《基金合同》、《招募说明书》、《业务规则》以及基金管理人按照

规定就本基金发布的相关公告；

(2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，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、申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；

嘉实基金管理有限公司

67

(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。

B. 基金管理人的权利和义务

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) 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与赎回申请；
- (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

嘉实基金管理有限公司

68

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。

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；

嘉实基金管理有限公司

69

(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前提下得到有关资料的复印件；

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

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

(20) 因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益

时，应

当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(21) 监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金托管人违

反《基金合同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追

偿；

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

为承担责任；

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

(24) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金

管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后

30 日内退还基金认购人；

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(26) 建立并保存基金份额持有人名册；

(27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

C. 基金托管人的权利和义务

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，为基金开设证券账户、资金账户等投资所需账户，为基金办

嘉实基金管理有限公司

70

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，不对处于托管人实际控

制之外的账户及财产承担责任；

(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的其他账户，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) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

(13) 依据基金管理人的指令或有关规定支付基金收益和赎回款项；

(14) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，召集基金份额持有人大会或配合

基金管理人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

嘉实基金管理有限公司

71

(15) 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；

(16) 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；

(17) 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；

(18) 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；

(19) 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；

(20) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(21) 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

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。

A. 召开事由

1、除法律法规，或基金合同，或中国证监会另有规定外，当出现或需要决定下列事由

之一的，应当召开基金份额持有人大会：

- (1) 终止《基金合同》；
- (2) 更换基金管理人；
- (3) 更换基金托管人；
- (4) 转换基金运作方式；
- (5) 调整基金管理人、基金托管人的报酬标准；
- (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；

嘉实基金管理有限公司

72

(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) 基金管理人或基金托管人主动要求调低基金管理费、基金托管费或其他由基金资

产承担的费用；

(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》规定的范围内且在对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下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变化;

(6) 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。

B. 会议召集人及召集方式

1、本基金基金份额持有人大会不设日常机构。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六

十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

嘉实基金管理有限公司

73

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。

C. 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。

D. 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或通讯开会方式或法律法规及监管机关允许

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

嘉实基金管理有限公司

74

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 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 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 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；

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、若到会者在权益登记日所持有的有效基金份额低于本条第 1 款第（2）项、第 2 款第

（3）项规定比例的，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、

嘉实基金管理有限公司

75

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，到会者所持有的基金份额不少于在权益登记日基金份额总数的三分之一（含
三分之一）。

E. 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 G 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

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。

F. 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

嘉实基金管理有限公司

76

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。除基金合同另有约定外，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。

G. 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

嘉实基金管理有限公司

77

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。

H. 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。该表决通过之日为基金份额持有人

大会计票完成且计票结果符合法律法规和基金合同规定的决议通过条件之日。

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。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。

I. 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，无需召开

基金份额持有人大会审议。

（三）基金合同的变更、终止与基金财产的清算

A. 《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经中国证监会备案并自决议

通过之日起生效，并在决议生效后按《信息披露办法》的规定在指定媒体公告。

B. 《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，《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。

嘉实基金管理有限公司

78

C. 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) 基金财产清算小组成立后，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) 对基金财产进行分配；

5、基金财产清算的期限为 6 个月 。

D. 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。

E. 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。

F. 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。

G. 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。

嘉实基金管理有限公司

79

(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上海国际经济贸易仲裁委员会，按照上海国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为上海市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力。除非仲裁裁决另有规定，仲裁费用由败诉方承担。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，各自继续忠实、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（为本协议之目的，在此不包括香港、澳门特别行政区和台湾地区法律）管辖。

（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》是约定基金当事人之间、基金与基金当事人之间权利义务关系的法律文件。

1、《基金合同》经基金管理人、基金托管人双方加盖公章或合同专用章以及双方法定代表人或授权代表签字（或盖章）并在募集结束后经基金管理人向中国证监会办理基金备案手续，并经中国证监会书面确认后生效。

2、《基金合同》的有效期自其生效之日起至基金财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止。

3、《基金合同》自生效之日起对包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人在内的

《基金合同》各方当事人具有同等的法律约束力。

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

5、《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。

嘉实基金管理有限公司

80

二十、基金托管协议的内容摘要

（一）托管协议当事人

A、基金管理人

名称：嘉实基金管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心二期53层

09-11

单元

办公地址：北京市东城区建国门北大街8号华润大厦8层

法定代表人：邓红国

邮政编码：100005

成立日期：1999年3月25日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字【1999】5号

组织形式：有限责任公司（中外合资）

注册资本：1.5亿元人民币

存续期限：持续经营

电话：010-65215588

B、基金托管人

名称：上海银行股份有限公司（简称：上海银行）

注册地址：上海市浦东新区银城中路168号办公地址：上海市浦东新区银城中路

168号

邮政编码：200120

法定代表人：金煜成立日期：1995年12月29日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监许可[2009]814号

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币54.04亿元

存续期间：持续经营

经营范围：人民币存贷款等

（二）基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

A、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金投资范围、投

资对象进行监督。《基金合同》明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应按

嘉实基金管理有限公司

81

照基金托管人要求的格式提供投资品种池，以便基金托管人运用相关技术系统，对基金实际

投资是否符合《基金合同》关于证券选择标准的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。

本基金主要投资于债券（国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期

融资券、超短期融资券、中小企业私募债、次级债、地方政府债、政府支持机构债券、可分

离交易可转债的纯债部分等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类品种，以

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（但须符合中国证监会的

相关规定）。

本基金不投资于股票、权证等权益类资产，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债

的纯债部分除外）、可交换债券。

基金的投资组合比例为：本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%；本基金持

有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，

可以将其纳入投资范围。

B、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金投资、融资

比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督：

（1）本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%；

（2）本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产

净值的 5%；

- (3) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；
- (4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；
- (5) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不展期；
- (6) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；
- (7) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；
- (8) 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；
- (9) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；
- (10) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；
- (11) 本基金持有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%；

嘉实基金管理有限公司

82

- (12) 基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；
 - (13) 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。
- 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。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同

的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金

托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或调整上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程

序后，则本基金投资不再受相关限制或按调整后的规定执行。但需提前公告，不需要基金份

额持有人大会审议。

C、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对本托管协议第十五

条第九款基金投资禁止行为通过事后监督方式进行监督。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者

与其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交

易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先的原则，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。相关交易必须履

行相关程序，符合中国证监会的规定，并履行信息披露义务。

D、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金管理人参与银

行间债券市场进行监督。基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供符合法律法规

及行业标准的、经慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手名单，并约定各交易

对手所适用的交易结算方式。基金管理人应严格按照交易对手名单的范围在银行间债券市场

选择交易对手。基金托管人监督基金管理人是否按事前提供的银行间债券市场交易对手名单

进行交易。基金管理人可以每半年对银行间债券市场交易对手名单及结算方式进

行更新，新名单确定前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。如基金管理人根据市场情况需要临时调整银行间债券市场交易对手名单及结算方式的，应向基金托管人说明理由，并在与交易对手发生交易前 3 个工作日内与基金托管人协商解决。基金管理人负责对交易对手的资信控制，按银行间债券市场的交易规则进行交易，并负责解决因交易对手不履行合同而造成的纠纷及损失，基金托管人不承担由此造成的任何法律责任及损失。若未履约的交易对手在基金托管人与基金管理人确定的时间前仍未承担违约责任及其他相关法律责任的，基金管理人可以对相应损失先行予以承担，然后再向相关交易对手追偿。基金托管人则根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督。如事后发现基金管理人没有按照事先约定的交易对手或交易方式进行交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人，基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任。

嘉实基金管理有限公司

83

E、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金管理人投资流通受限证券进行监督。基金管理人投资流通受限证券，应事先根据中国证监会相关规定，明确基金投资流通受限证券的比例，制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险。基金托管人对基金管理人是否遵守相关制度、流动性风险处置预案以及相关投资额度和比例等的情况进行监督。

1. 本基金投资的流通受限证券须为经中国证监会批准的非公开发行股票、公开发

行股票

网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其

他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。本基

金不投资有锁定期但锁定期不明确的证券。

本基金投资的流通受限证券限于可由中国证券登记结算有限责任公司或中央国债登记

结算有限责任公司负责登记和存管，并可在证券交易所或全国银行间债券市场交易的证券。

本基金投资的流通受限证券应保证登记存管在本基金名下，基金管理人负责相关工作的

落实和协调，并确保基金托管人能够正常查询。因基金管理人原因产生的受限证券登记存管

问题，造成基金托管人无法安全保管本基金资产的责任与损失，及因受限证券存管直接影响

本基金安全的责任及损失，由基金管理人承担。

本基金投资受限证券，不得预付任何形式的保证金。

2. 基金托管人根据有关规定有权对基金管理人进行以下事项监督：

（1）本基金投资受限证券时的法律法规遵守情况。

（2）在基金投资受限证券管理工作方面有关制度、流动性风险处置预案的建立与完善情况。

（3）有关比例限制的执行情况。

（4）信息披露情况。

3. 相关法律法规对基金投资受限证券有新规定的，从其规定。

F、基金投资中小企业私募债券，基金管理人应根据审慎原则，制定严格的投资决策流

程、风险控制制度和信用风险、流动性风险处置预案，并经董事会批准，以防范信用风险、

流动性风险等各种风险。

基金托管人对基金投资中小企业私募债券是否符合比例限制进行事后监督，如发现异常

情况，应及时通知基金管理人。基金管理人应积极配合和协助乙方的监督和核查。

基金因投

资中小企业私募债券导致的信用风险、流动性风险，基金托管人不承担任何责任。

如因基金

管理人原因导致基金出现损失致使基金托管人承担连带赔偿责任的，基金管理人

应赔偿基金

托管人由此遭受的损失。

G、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金资产净

值计算、

基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、

相关信息披

嘉实基金管理有限公司

84

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。

H、基金托管人发现基金管理人的上述事项及实际投资运作违反法律法规、《基金合同》

和本托管协议的规定，应及时以电话提醒或书面提示等方式通知基金管理人限期纠正。基金

管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到书面通知后应在下一工

作日前及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函，就基金托管人的疑义进行解释或举

证，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金托

管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对于基金托

管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

I、基金管理人有义务配合和协助基金托管人依照法律法规、《基金合同》和本托管协议

对基金业务执行核查。对基金托管人发出的书面提示，基金管理人应在规定时间内答复并改

正，或就基金托管人的疑义进行解释或举证；对基金托管人按照法律法规、《基金合同》和

本托管协议的要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项，基金管理人应积极配合提供相

关数据资料和制度等。

J、对于依据交易程序尚未成交的投资指令，基金托管人根据法律法规及本托管协议的

约定进行投资监督时发现该投资指令违反法律法规规定或者违反《基金合同》约定的，应当

拒绝执行，立即通知基金管理人，并向中国证监会报告。

若基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律、行政法规和其他

有关规定，或者违反《基金合同》约定的，应当立即通知基金管理人，由此造成的损失由基

金管理人承担。

K、基金托管人发现基金管理人重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基

金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠对

方根据本托管协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节

严重或经基金托管人提出警告仍不改正的，基金托管人应报告中国证监会。

（三）基金管理人对于基金托管人的业务核查

A、基金管理人对于基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括基金托管人

安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户等投资所需账户、复核基金管理人

计算的基金资产净值和基金份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和

监督基金投资运作等行为。

B、基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、未执

行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、《基金合

同》、本协议及其他有关规定时，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正。

基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式给基金管理人发出回函，说明违规原因

及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金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。

嘉实基金管理有限公司

85

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，在规定时间内答复基金管理人并改正。

C、基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基

金托管人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。基金托管人无正当理由，拒绝、阻挠对

方根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重

或经基金管理人提出警告仍不改正的，基金管理人应报告中国证监会。

（四）基金财产的保管

A、基金财产保管的原则

1. 基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。
2. 基金托管人应安全保管基金财产，不对处于托管人实际控制之外的账户或财产承担责任。
3. 基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户、证券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与独立。
5. 基金托管人按照《基金合同》和本协议的约定保管基金财产，如有特殊情况双方可另行协商解决。基金托管人未经基金管理人的指令，不得自行运用、处分、分配本基金的任何资产（不包含基金托管人依据中国证券登记结算有限责任公司结算数据完成场内交易交收、托管资产开户银行扣收结算费和账户维护费等费用）。

6. 对于因为基金投资产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期

并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金账户的，基金托管人应及时通知基金管理人

人采取措施进行催收。由此给基金财产造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基

金财产的损失，基金托管人对此不承担任何责任。

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

B、基金募集期间及募集资金的验资

1. 基金募集期间募集的资金应存于基金管理人开立的“基金募集专户”。该账户由基金

管理人开立并管理。

2. 基金募集期满或基金停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持

有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，基金管理人应将属于基金财产的全部

资金划入基金托管人开立的基金银行账户，同时在规定时间内，聘请具有从事证券相关业务

资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的 2 名或 2 名

以上中国注册会计师签字方为有效。

3. 若基金募集期限届满，未能达到《基金合同》生效的条件，由基金管理人按规定办理

退款等事宜。

C、基金银行账户的开立和管理

1. 基金托管人应以基金的名义在其营业机构开立基金的银行账户，并根据基金管理人合

嘉实基金管理有限公司

86

法合规的指令办理资金收付。2. 基金银行账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需

要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立任何其他银行账户；亦

不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

3. 基金银行账户的开立和管理应符合银行业监督管理机构的有关规定。

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

D、基金证券账户和结算备付金账户的开立和管理

1. 基金托管人在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司为基金开立证券账户。

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

3. 基金证券账户的开立和证券账户卡的保管由基金托管人负责，账户资产的管理和运用由基金管理人负责。

证券账户开户费由本基金财产承担，若因基金银行存款余额不足导致证券账户开户费无法扣收，由基金管理人先行垫付。

4. 基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户，并代表所托管的基金完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级法人清算工作，基金管理人应予以积极协助。结算备付金、结算互保基金、交收价差资金等的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

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

E、债券托管专户的开设和管理

《基金合同》生效后，基金管理人负责以基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆

借市场的交易资格，并代表基金进行交易；基金托管人根据中国人民银行、银行间市场登记

结算机构的有关规定，在银行间市场登记结算机构开立债券托管账户，持有人账

户和资金结

算账户，并代表基金进行银行间市场债券的结算。基金管理人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。

F、其他账户的开立和管理

1. 在本托管协议订立日之后，本基金被允许从事符合法律法规规定和《基金合同》约

定的其他投资品种的投资业务时，如果涉及相关账户的开设和使用，按有关规则进行开立和

使用。

2. 法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

嘉实基金管理有限公司

87

G、基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的有关实物证券、银行存款开户证实书等有价凭证由基金托管人存放于基

金托管人的保管库，也可存入中央国债登记结算有限责任公司、中国证券登记结算有限责任

公司上海分公司/深圳分公司、银行间市场清算所股份有限公司或票据营业中心的代保管库，

保管凭证由基金托管人持有。实物证券、银行定期存款证实书等有价凭证的购买和转让，按

基金管理人和基金托管人双方约定办理。基金托管人对由基金托管人以外机构实际有效控制

的资产不承担保管责任。

H、与基金财产有关的重大合同的保管

与基金财产有关的重大合同的签署，由基金管理人负责。由基金管理人代表基金

签署的、

与基金财产有关的重大合同的原件分别由基金管理人、基金托管人保管。除本协议另有规定

外，基金管理人代表基金签署的与基金财产有关的重大合同包括但不限于基金年度审计合

同、基金信息披露协议及基金投资业务中产生的重大合同，基金管理人应保证基金管理人和

基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人应在重大合同签署后及时以加密方式将

重大合同传真给基金托管人，并在三十个工作日内将正本送达基金托管人处。重大合同的保

管期限为《基金合同》终止后 15 年。

对于无法取得二份以上的正本的，基金管理人应向基金托管人提供合同复印件，并在复

印件上加盖公章或预留印鉴，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

A、基金资产净值的计算、复核与完成的时间及程序

1. 基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的金额。基金份额净值是按照每个交易日

闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到 0.001 元，小数点后第

四位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

每个交易日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

2. 基金管理人应每交易日对基金资产估值。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。基金管理人每个交易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。

B、基金资产估值方法和特殊情形的处理

1. 估值对象

基金所拥有的债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

2. 估值方法

1、证券交易所上市的有价证券的估值

(1) 除本部分另有约定的品种外，交易所上市的有价证券，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
嘉实基金管理有限公司

88

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

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

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

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

4、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

5、中小企业私募债券，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。

6、债券回购：持有的回购协议以成本列示，按商定利率在实际持有期间内逐日计提利息。

7、定期存款：以本金列示，按商定的存款利率在实际持有期间内逐日计提应收利息，在利息到账日以实收利息入账。

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

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

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

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

3. 特殊情形的处理

基金管理人、基金托管人按估值方法的第 8 项进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

由于不可抗力原因，或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误等原因，基金管

嘉实基金管理有限公司

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。

C、基金份额净值错误的处理方式

1. 当基金份额净值小数点后 3 位以内(含第 3 位)发生差错时，视为基金份额净值错误；

基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的

措施防止损失进一步扩大；错误偏差达到基金份额净值的 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；当发生净值计算错误时，由基金管理人负责处理，由此给基金份额持有

人和基金造成损失的，应由基金管理人先行赔付，基金管理人按差错情形，有权向基金托管

人或其他当事人追偿。

2. 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，如事后证明基金

托管人计算正确的，基金托管人不承担责任。

(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，而且基金托管

人未对计算过程提出疑义或要求基金管理人书面说明，基金份额净值出错且造成基金份额持

有人损失的，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管理费和托管费的比例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，如事后证明基金托管人计算正确，由此给基金份额持有人和基金造成的损失，基金托管人不承担责任。

(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。

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

4. 前述内容如法律法规或者监管部门另有规定的，从其规定。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。

D、暂停估值与公告基金份额净值的情形

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；
- 嘉实基金管理有限公司

90

3. 中国证监会和《基金合同》认定的其他情形。

E、基金会计制度

按国家有关部门规定的会计制度执行。

F、基金账册的建立

基金管理人进行基金会计核算并编制基金财务会计报告。基金管理人独立地设置、记录
和保管本基金的全套账册。若基金管理人和基金托管人对会计处理方法存在分歧，应以基金

管理人的处理方法为准。若当日核对不符，暂时无法查找到错账的原因而影响到基金资产净

值的计算和公告的，以基金管理人的账册为准。

G、基金财务报表与报告的编制和复核

1. 财务报表的编制

基金财务报表由基金管理人编制，基金托管人复核。

2. 报表复核

基金托管人在收到基金管理人编制的基金财务报表后，进行独立的复核。核对不符时，

应及时通知基金管理人共同查出原因，进行调整，直至双方数据完全一致。

3. 财务报表的编制与复核时间安排

(1) 报表的编制

基金管理人应当在每月结束后 5 个工作日内完成月度报表的编制；在每个季度结束之

日起 15 个工作日内完成基金季度报告的编制；在上半年结束之日起 60 日内完成基金半年

度报告的编制；在每年结束之日起 90 日内完成基金年度报告的编制。基金年度

报告的财务

会计报告应当经过审计。《基金合同》生效不足两个月的，基金管理人可以不编制当期季度

(2) 报表的复核

基金管理人应及时完成报表编制，将有关报表提供基金托管人复核；基金托管人在复核

过程中，发现双方的报表存在不符时，基金管理人和基金托管人应共同查明原因，

进行调整，

调整以国家有关规定为准。

(六) 基金份额持有人名册的保管

基金份额持有人名册至少应包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册由基金登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，基金管理人应

保管基金份额持有人名册，保存期不少于 15 年。如不能妥善保管，则按相关法

规承担责任。

在基金托管人要求或编制半年报和年报前，基金管理人应将有关资料送交基金托管人，

不得无故拒绝或延误提供，并保证其真实性、准确性和完整性。基金管理人不得将所保管

的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。

（七）争议解决方式

嘉实基金管理有限公司

91

因本协议产生或与之相关的争议，双方当事人应通过协商、调解解决，协商、调解不能

解决的，任何一方均有权将争议提交上海国际经济贸易仲裁委员会，仲裁地点为上海市，按

照上海国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对当事

人均有约束力，除非仲裁裁决另有规定，仲裁费用、律师费用由败诉方承担。

争议处理期间，双方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责，各自继续忠实、勤勉、

尽责地履行《基金合同》和本托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本协议受中国法律管辖。

（八）托管协议的修改与终止

A、托管协议的变更程序

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。基金托管协议的变更报中国证监会备案。

B、基金托管协议终止出现的情形

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

C、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) 基金财产清算小组成立后，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) 将清算结果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。

嘉实基金管理有限公司

92

6. 清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用

由基金财产清算小组优先从基金剩余财产中支付。

7. 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。

8. 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。

9. 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。

二十一、对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务，并将根据基金份额持有人的需要

和市场的变化，增加或变更服务项目。主要服务内容如下：

（一）资料寄送

1、开户确认书和交易对账单

首次基金交易（除基金开户外其他交易类型）后的 15 个工作日内向基金份额持有人寄

送开户确认书和交易对账单。

2、基金份额持有人对账单

基金管理人在每年第 1-3 季度结束后向定制纸质对账单且在季度内有交易的投资者寄

送季度对账单，在每年第 4 季度结束后向定制纸质对账单且季度内有交易或最后一个交易日

仍持有份额的投资者寄送年度对账单；每月向定制电子对账单服务的份额持有人发送电子对

账单。

3、由于投资者提供的邮寄地址、手机号码、电子邮箱不详、错误、未及时变更或邮局

投递差错、通讯故障、延误等原因有可能造成对账单无法按时或准确送达。因上述原因无法

正常收取对账单的投资者，敬请及时通过本公司网站，或拨打本公司客服热线查询、核对、

变更您的预留联系方式。

（二）定期定额投资计划

嘉实基金管理有限公司

基金管理人可通过销售机构为投资者提供定期定额投资服务。通过定期定额投资计划，

投资者可以通过销售渠道定期定额申购基金份额。定期定额投资计划的有关规则另行公告。

（三）手机短信服务

基金管理人向定制净值短信的基金份额持有人提供基金净值短信服务。基金份额持有人

可通过拨打客户服务电话 400-600-8800（免长途话费）、(010)85712266，也可通过基金管理

人网站定制短信服务。

（四）在线服务

通过本公司网站 www.jsfund.cn，基金份额持有人还可获得如下服务：

1、查询服务

基金份额持有人均可通过基金管理人网站实现基金交易查询、账户信息查询和基金信息

查询。

2、信息资讯服务

投资者可以利用基金管理人网站获取基金和基金管理人的各类信息，包括基金的法律文

件、业绩报告及基金管理人最新动态等资料。

3、网上交易

本基金管理人已开通个人和机构投资者的网上直销交易业务。个人和机构投资者通过基

金管理人网站 www.jsfund.cn 可以办理基金认购、申购、赎回、账户资料修改、交易密码

修改、交易申请查询和账户资料查询等各类业务。

（五）咨询服务

1、投资者或基金份额持有人如果了解申购与赎回的交易情况、基金账户余额、基金产

品与服务等信息，可拨打基金管理人全国统一客服电话：400-600-8800（免长途话费）、

(010)85712266，传真：(010) 65182266。

2、网站和电子信箱

公司网址：<http://www.jsfund.cn>

电子信箱：service@jsfund.cn

嘉实基金管理有限公司

94

二十二、其他应披露事项

自 2016 年 3 月 12 日首次披露本基金招募说明书至 2016 年 9 月 18 日，本基金的临时报

告刊登于《证券时报》。

序号 临时报告名称 披露日期 备注

1 嘉实稳瑞纯债债券型证券投资基金基金合同生效公告

2016 年 3 月 19 日

2 关于嘉实稳瑞纯债债券型证券投资基金开放日常申购及赎回业务的公告

2016 年 4 月 5 日

3 嘉实稳瑞纯债债券型证券投资基金暂停大额申购业务的公告

2016 年 4 月 5 日

4 关于增加“万得投顾”为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务及参加费率优惠的公告

2016 年 8 月 5 日 含本基金

5 嘉实基金管理有限公司关于对中国银行借记卡持卡人调整基金直销交易优惠费率的公告

2016 年 9 月 1 日 含本基金

嘉实基金管理有限公司

95

二十三、招募说明书存放及查阅方式

本基金招募说明书公布后，分别置备于基金管理人、基金托管人和基金代销机构的住所，

投资者可免费查阅。投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印

件。

嘉实基金管理有限公司

96

二十四、备查文件

（一）备查文件目录

- 1、中国证监会准予注册嘉实稳瑞纯债债券型证券投资基金募集的文件。
- 2、《嘉实稳瑞纯债债券型证券投资基金基金合同》。
- 3、《嘉实稳瑞纯债债券型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。

（二）存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人处。

（三）查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅备查文件。在支付工本费后，可在合理时间内取得备查文

件的复制件或复印件。

嘉实基金管理有限公司

2016年11月1日