

**中泰证券（上海）资产管理有限公司**

**中泰稳固周周购 12 周滚动持有债券型  
证券投资基金  
招募说明书（更新）  
2022 年第 1 号**

**基金管理人：中泰证券（上海）资产管理有限公司**

**基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司**

2022 年 6 月

## 目录

重要提示.....	1
第一部分 绪言.....	4
第二部分 释义.....	5
第三部分 基金管理人.....	11
第四部分 基金托管人.....	19
第五部分 相关服务机构.....	23
第六部分 基金的募集.....	31
第七部分 基金合同的生效.....	33
第八部分 基金份额的申购与赎回.....	34
第九部分 基金的投资.....	49
第十部分 基金的业绩.....	62
第十一部分 基金的财产.....	65
第十二部分 基金资产估值.....	66
第十三部分 基金的收益与分配.....	73
第十四部分 基金费用与税收.....	75
第十五部分 基金的会计与审计.....	78
第十六部分 基金的信息披露.....	79
第十七部分 侧袋机制.....	86
第十八部分 风险揭示.....	89
第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产清算.....	101
第二十部分 基金合同内容摘要.....	103
第二十一部分 托管协议内容摘要.....	121
第二十二部分 对基金份额持有人的服务.....	141
第二十三部分 其他应披露事项.....	143
第二十四部分 招募说明书存放及查阅方式.....	146
第二十五部分 备查文件.....	147

## 重要提示

本基金经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)2021 年 4 月 19 日证监许可【2021】1374 号文注册募集。基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值和市场前景做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

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。投资人在投资本基金前，需全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对投资本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资人根据所持有的基金份额享受基金的收益，但同时也需承担相应的投资风险。基金投资中的风险包括：由于经济、政治、社会等环境因素的变化对证券价格造成的市场风险，金融工具的一方到期无法履行约定义务致使本基金遭受损失的信用风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的运作管理风险，流动性风险，本基金的特定风险，本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险，启用侧袋机制的风险，其他风险等。

本基金的投资范围包括资产支持证券，它是一种债券性质的金融工具，其向投资者支付的本息来自于基础资产池产生的现金流或剩余权益。与股票和一般债券不同，资产支持证券不是对某一经营实体的利益要求权，而是对基础资产池所产生的现金流和剩余权益的要求权，是一种以资产信用为支持的证券。资产支持证券存在信用风险、利率风险、提前偿付风险、操作风险和法律风险等。

本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）或选择不将基金资产投资于港股通标的股票，本基金资产并非必然投资于港股通标的股票。

本基金投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有投资风险，包括但不限于港股市场股价波动较大的风险（港股市场实行 T+0 回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价

可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对基金的投资收益造成损失）、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险（在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险）等。

本基金可投资存托凭证，基金净值可能受到存托凭证的境外基础证券价格波动影响，存托凭证的境外基础证券的相关风险可能直接或间接成为本基金的风险。

本基金对于每份基金份额设置一定的滚动锁定期，锁定期内该基金份额不可申请赎回。每个运作期到期日，基金份额持有人方可提出赎回申请。如果基金份额持有人在当期运作期到期日未申请赎回，则自该运作期到期日下一日起该基金份额进入下一个运作期。故投资者面临在运作期到期日前无法赎回基金份额的风险，以及错过当期运作期到期日未能赎回基金份额而进入下一运作期的风险。

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

本基金采用证券公司交易模式和结算模式，即本基金将通过基金管理人选定的证券经营机构进行场内交易并由选定的证券经营机构作为结算参与人代理本基金进行结算，该种交易结算模式可能存在信息系统风险、操作风险、资金使用效率降低的风险、交易结算风险、投资信息安全保密风险等风险。

本基金是债券型基金，其预期风险与收益高于货币市场基金，低于股票型基金和混合型基金。

基金的过往业绩并不预示其未来表现，基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化导致的投资风险，由投资人自行承担。当投资人赎回时，所得或会高于或低于投资人先前所支付的金额。

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资产，

但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

投资有风险，投资人认购（或申购）本基金时应当认真阅读基金合同、基金招募说明书、基金产品资料概要等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。

本招募说明书所载内容截至 2022 年 5 月 20 日，基金投资组合报告和基金业绩表现截至 2022 年 3 月 31 日（财务数据未经审计）。

## 第一部分 绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国民法典》、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）、《公开募集证券投资基金侧袋机制指引（试行）》（以下简称“《侧袋指引》”）和其他有关法律法规的规定以及《中泰稳固周周购 12 周滚动持有债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

本招募说明书阐述了中泰稳固周周购 12 周滚动持有债券型证券投资基金（以下简称“本基金”或“基金”）的投资目标、策略、风险、费率等与投资人投资决策有关的必要事项，投资人在做出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

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。基金合同是规定基金合同当事人之间权利、义务的基本法律文件，如本招募说明书内容与基金合同有冲突或不一致之处，均以基金合同为准。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

## 第二部分 释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

- 1、基金或本基金：指中泰稳固周周购 12 周滚动持有债券型证券投资基金
- 2、基金管理人：指中泰证券（上海）资产管理有限公司
- 3、基金托管人：指上海浦东发展银行股份有限公司
- 4、基金合同：指《中泰稳固周周购 12 周滚动持有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《中泰稳固周周购 12 周滚动持有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《中泰稳固周周购 12 周滚动持有债券型证券投资基金招募说明书》及其更新
- 7、基金产品资料概要：指《中泰稳固周周购 12 周滚动持有债券型证券投资基金基金产品资料概要》及其更新
- 8、基金份额发售公告：指《中泰稳固周周购 12 周滚动持有债券型证券投资基金基金份额发售公告》
- 9、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
- 10、《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，经 2012 年 12 月 28 日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自 2013 年 6 月 1 日起实施，并经 2015 年 4 月 24 日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修正的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 11、《销售办法》：指中国证监会 2020 年 8 月 28 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 12、《信息披露办法》：指中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1

日实施的，并经 2020 年 3 月 20 日中国证监会《关于修改部分证券期货规章的决定》修正的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

13、《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

14、《流动性风险管理规定》：指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订

15、《侧袋指引》：指中国证监会 2020 年 7 月 10 日颁布、同年 8 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金侧袋机制指引（试行）》及颁布机关对其不时做出的修订

16、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

17、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行保险监督管理委员会

18、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

19、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

20、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

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

22、投资人、投资者：指个人投资者、机构投资者、合格境外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

23、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

24、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

**25、销售机构：**指基金管理人以及符合《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

**26、注册登记业务：**指基金注册登记、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、基金份额注册登记、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

**27、注册登记机构：**指办理注册登记业务的机构。基金的注册登记机构为中泰证券（上海）资产管理有限公司或接受中泰证券（上海）资产管理有限公司委托代为办理注册登记业务的机构

**28、港股通标的股票：**指内地投资者委托内地证券公司，经由境内证券交易所在香港设立的证券交易服务公司，向香港联合交易所进行申报（买卖盘传递），买卖规定范围内的香港联合交易所上市的股票

**29、基金账户：**指注册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

**30、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

**31、基金合同生效日：**指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期

**32、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

**33、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

**34、存续期：**指基金合同生效至终止之间的不定期期限

**35、运作期起始日：**每份认购基金份额的第一个运作期起始日，指基金合同生效日；每份申购基金份额的第一个运作期起始日，指该基金份额申购确认日；

上一运作期到期日未赎回的每份基金份额的下一运作期起始日，指该基金份额上一运作期到期日后的下一日；因红利再投资所得的份额与原份额适用相同的运作期起始日

36、运作期到期日：对于每份基金份额，第一个运作期到期日指基金合同生效日（对认购份额而言，下同）或基金份额申购申请确认日（对申购份额而言，下同）12 周后的对应日（指自然周，如该对应日为非工作日，则基金管理人可以选择顺延、提前或暂停开放，详见基金管理人届时的公告），第二个运作期到期日为基金合同生效日或基金份额申购申请确认日 24 周后的对应日（指自然周，如该对应日为非工作日，则基金管理人可以选择顺延、提前或暂停开放，详见基金管理人届时的公告，下同），以此类推

37、开放期：本基金自基金合同生效之日起 3 个月内开始办理申购业务，之后本基金将每周集中开放申购。首个开放期具体时间详见基金管理人公告，第二个开放期为首个开放期 1 周后的对应日（指自然周，如该对应日为非工作日，则基金管理人可以选择顺延、提前或暂停开放，详见基金管理人届时的公告，下同）。每个开放期不少于一个工作日、不超过二个工作日（若本基金参与港股通交易且该工作日为非港股通交易日时，则基金管理人可根据实际情况决定本基金是否集中开放申赎业务，详见基金管理人届时的公告）

38、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，开放期内集中办理申购的日期及办理赎回的运作期到期日均为本基金的开放日

39、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

40、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

41、T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日(不包含 T 日)

42、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

43、《业务规则》：指《中泰证券（上海）资产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注册登记方面的业务规则，由基金管理人和投资人共同遵守

44、认购：指在基金募集期内，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

45、**申购**：指本基金基金合同生效后，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

46、**赎回**：指本基金基金合同生效后，基金份额持有人根据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

47、**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

48、**转托管**：指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基金份额销售机构的操作

49、**基金份额分类**：本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别：**A 类基金份额**和**C 类基金份额**。两类基金份额分设不同的基金代码，并分别公布基金份额净值

50、**A 类基金份额**：指在投资者认购、申购时收取认购、申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额

51、**C 类基金份额**：指在投资者认购、申购时不收取认购、申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额

52、**销售服务费**：指从 C 类基金份额的基金资产中计提的，用于 C 类基金份额市场推广、销售以及 C 类基金份额持有人服务的费用

53、**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、申购金额及扣款方式，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受理基金申购申请的一种投资方式

54、**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)超过上一工作日基金总份额的 20%

55、**元**：指人民币元

56、**基金收益**：指基金投资所得红利、股息、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

57、基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券及票据价值、银行存款本息、基金应收款项及其他资产的价值总和

58、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

59、各类基金份额净值：指计算日各类基金资产净值除以计算日该类基金份额总数

60、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各类基金份额净值的过程

61、规定媒介：指符合中国证监会规定条件的用以进行信息披露的全国性报刊及《信息披露办法》规定的互联网网站（包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介

62、流动性受限资产：指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等

63、摆动定价机制：指当开放式基金遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待

64、侧袋机制：指将基金投资组合中的特定资产从原有账户分离至一个专门账户进行处置清算，目的在于有效隔离并化解风险，确保投资者得到公平对待，属于流动性风险管理工具。侧袋机制实施期间，原有账户称为主袋账户，专门账户称为侧袋账户

65、特定资产：包括（一）无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性的资产；（二）按摊余成本计量且计提资产减值准备仍导致资产价值存在重大不确定性的资产；（三）其他资产价值存在重大不确定性的资产

66、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

## 第三部分 基金管理人

### 一、基金管理人概况

名称：中泰证券（上海）资产管理有限公司

住所：上海市黄浦区延安东路 175 号 24 楼 05 室

办公地址：上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 1002-1003 室

成立时间：2014 年 8 月 13 日

法定代表人：黄文卿

注册资本：16,666.0000 万元人民币

联系电话：021-20521111

股权结构如下：

股东名称 持股比例

中泰证券股份有限公司 60%

深圳派特纳投资管理企业(有限合伙) 24%

深圳前海山小投资管理企业(有限合伙) 16%

中泰证券（上海）资产管理有限公司（以下简称“公司”或“本公司”）是经中国证监会证监许可[2014]355 号文批准，由齐鲁证券有限公司（现已更名为“中泰证券股份有限公司”）出资设立的资产管理子公司。2017 年 9 月，因公司发展需要，公司名称由“齐鲁证券(上海)资产管理有限公司”变更为“中泰证券(上海)资产管理有限公司”。

2017 年 12 月，根据中国证监会证监许可[2017]2342 号文批准，本公司获得开展公开募集证券投资基金管理业务资格。

### 二、主要人员情况

#### 1、董事会和监事成员

黄文卿先生，硕士研究生，董事长。曾任国泰君安证券股份有限公司证券分析研究员、衍生产品部投资经理、资产管理总部固定收益业务投资经理，上海国泰君安证券资产管理有限公司总经理助理兼固定收益部总经理兼金融市场部总经理，中泰证券(上海)资产管理有限公司拟任副总经理，中泰证券(上海)资产管理有限公司副总经理。2020 年 6 月至今，担任目前职务。

章飏先生，博士研究生，董事，2014 年 8 月起履行董事职务。曾任安徽财经大学计算机老师，国泰君安证券股份有限公司研究所金融工程部研究员、新产品开发小组组长、衍生产品部总经理、资产管理部总经理，上海国泰君安证券资产管理有限公司总裁、首席执行官，中泰证券股份有限公司顾问，中泰证券(上海)资产管理有限公司董事长。2020 年 6 月离任董事长，继续作为董事履行职务。

张晖女士，硕士研究生，董事，2016 年 4 月起履行董事职务。曾任山东省国际信托投资公司上海证券业务部交易部经理、总经理助理、副总经理、总经理；齐鲁证券经纪有限公司经纪业务总部总经理；中泰证券股份有限公司党群工作部主任、部长，企业文化部总经理，信访办公室主任（兼），女职工委员会主任，党务工作部部长，工会副主席、纪委副书记、副总经理。现任中泰证券股份有限公司职工董事、工会主席、董事会秘书。

胡开南先生，本科学历，董事，2021 年 4 月起履行董事职务。曾任济南铁路分局济西机务段计算机室员工；天同证券有限责任公司深圳红荔路营业部经理助理，天同证券有限责任公司监察稽核部员工；中泰证券股份有限公司（原齐鲁证券有限公司）合规管理总部高级业务经理、风险控制部高级业务经理，风控合规总部总经理助理、副总经理，风险管理部副总经理、首席风控经理。现任中泰证券股份有限公司风险管理部总经理。

林涛先生，博士研究生，独立董事，2020 年 6 月起履行董事职务。现任厦门大学管理学院会计系、厦门大学管理会计研究中心教授。

孙海昕女士，本科学历，硕士学位，监事，2014 年 9 月起履行监事职务。曾任山东银行学校实验银行职员；山东省国际信托投资公司展业证券营业部财务部经理，证券总部财务部副经理；中泰证券股份有限公司财务总部副总经理，登记结算部副总经理、登记结算部总经理。现任中泰证券股份有限公司总经理助理、运营中心总经理。

## 2、高级管理人员

徐建东先生，大学本科，公司总经理兼首席执行官。曾任泰安市信托投资公司上海证券业务部交易员，泰安市信托投资公司证券业务部副经理，中泰证券股份有限公司上海赤峰路营业部总经理、济南山大路营业部总经理、莱芜管理总部总经理、济南第二管理总部总经理、泰安管理总部总经理、经纪业务总部总经

理、北京证券资产管理分公司董事、总经理，中泰证券（上海）资产管理有限公司拟任副总经理、总经理。2020 年 6 月至今，担任目前职务。

王洪懿先生，大学本科，公司合规总监兼首席风险官兼督察长兼董事会秘书。曾任华星塑料制品有限公司职员，天同证券有限责任公司职员，中泰证券股份有限公司高级业务经理，万家基金管理有限公司财务总监，中泰证券(上海)资产管理有限公司拟任副总经理、副总经理兼财务负责人兼董事会秘书。2018 年 7 月至今，担任目前职务。

应晨奇先生，硕士研究生，公司副总经理兼首席信息官。曾任光大证券股份有限公司清算中心清算员、资产管理总部风控经理、清算中心主任、登记结算中心副总经理（主持工作）、运营管理总部董事副总经理、资产管理总部董事副总经理，上海光大证券资产管理有限公司运营总监，中泰证券(上海)资产管理有限公司拟任副总经理、副总经理兼合规总监兼首席风险官。2019 年 6 月至今，担任目前职务。

### 3、本基金基金经理

商园波先生，硕士研究生。现任基金业务部副总经理。曾任上海银行理财业务交易员、投资经理，上海国泰君安证券资产管理有限公司固定收益投资经理，中泰证券（上海）资产管理有限公司固定收益投资经理、金融市场部副总经理。2019 年 4 月 26 日至今担任中泰蓝月短债债券型证券投资基金基金经理，2019 年 8 月 9 日至今担任中泰青月中短债债券型证券投资基金基金经理，2021 年 7 月 21 日至今担任中泰稳固周周购 12 周滚动持有债券型证券投资基金基金经理，2022 年 2 月 28 日至今担任中泰锦泉汇金货币市场基金基金经理。

田瑀先生，复旦大学理学硕士。现任基金业务部副总经理。曾任安信基金管理有限责任公司特定资产管理部专户投资经理、中泰证券(上海)资产管理有限公司权益投资部高级投资经理、基金业务部总经理助理。2019 年 4 月 19 日至 2021 年 3 月 22 日担任中泰玉衡价值优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2019 年 9 月 6 日至今担任中泰开阳价值优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2021 年 2 月 8 日至今担任中泰兴诚价值一年持有期混合型证券投资基金基金经理，2021 年 6 月 2 日至今担任中泰星宇价值成长一年封闭运作混合型证券投资基金基金经理，2021 年 7 月 21 日至今担任中泰稳固周周购 12 周滚动持有债券

型证券投资基金基金经理。

#### 4、本公司投资决策委员会成员

徐建东先生，简历请参见上述关于高级管理人员的介绍。

应晨奇先生，简历请参见上述关于高级管理人员的介绍。

王洪懿先生，简历请参见上述关于高级管理人员的介绍。

徐志敏先生，总经理助理，权益投资部总经理。

史少杰先生，总经理助理。

姜诚先生，基金业务部总经理。

李玉刚先生，研究部总经理。

5、上述成员之间均不存在近亲属或家属关系。

### 三、基金管理人职责

1、依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和注册登记手续；

2、办理基金备案手续；

3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；

4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

6、编制季度报告、中期报告和年度报告；

7、计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回价格；

8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；

9、按照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；

10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

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它职责。

### 四、基金管理人承诺

1、基金管理人承诺不从事违反《中华人民共和国证券法》（以下简称“《证



券法》”）的行为，并承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反《证券法》行为的发生。

2、基金管理人承诺不从事违反《基金法》的行为，并承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止下列行为发生：

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

3、基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下活动：

- （1）越权或违规经营；
- （2）违反基金合同或托管协议；
- （3）故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益；
- （4）在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；
- （5）拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
- （6）玩忽职守、滥用职权，不按照规定履行职责；
- （7）违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

（8）违反证券交易场所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；

- （9）贬损同行，以抬高自己；
- （10）以不正当手段谋求业务发展；
- （11）有悖社会公德，损害证券投资基金从业人员形象；
- （12）在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
- （13）其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

4、基金管理人承诺严格遵守基金合同的规定，并承诺建立健全内部控制制

度，采取有效措施，防止违反基金合同行为的发生。

5、基金管理人承诺不从事其他法规规定禁止从事的行为。

#### 五、基金经理承诺

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

2、不利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者谋取利益；

3、不泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息，且不利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

4、不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

#### 六、基金管理人内部控制制度

公司董事会负责建立健全并有效实施内部控制。

公司严格按照《中华人民共和国公司法》、《证券法》、《基金法》等法律法规和监管规则，结合实际情况，制定了一系列内部控制制度以保证经营目标的实现，适应发展的需要。总体而言，公司建立了决策科学、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。同时，在制度中已就各部门控制措施进行明确规定。公司设立了民主、透明的风险控制体系、投资决策体系、经营决策体系等体系，风控合规体系独立运作，建立了健全、有效的内部监督和反馈系统。

##### 1、经营理念和内控文化

公司管理层牢固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，使风险意识贯穿到公司各个部门、各个岗位和各个环节。

##### 2、治理结构

公司建立了完善的法人治理结构，目前形成了一套科学合理、系统规范、行之有效的公司治理体系和行政决策体系，由股东、董事会、行政办公会议、各专业委员会构成。股东通过董事会对公司进行管理和监督。董事会由股东选举产生，对公司经营活动中的重大决策问题进行审议并做出决定，或根据权限分工提

交股东审议。监事对董事、公司首席执行官履行公司职责及对公司开展的重要业务进行监督。首席执行官由董事会聘任，在董事会的领导下，全面负责公司的日常经营管理活动，组织实施董事会决议。充分发挥公司监事的监督职能，严禁不正当关联交易、利益输送和内部人员控制现象的发生，保护投资者利益和公司合法权益。

### 3、组织架构

公司的组织结构体现了职责明确、相互制约的原则，各部门有明确的授权分工，操作相互独立。公司建立了决策科学、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。公司与中泰证券其他业务分离，有效保护客户权益，保障资产安全。公司建立了一套完整的投资管理和客户服务体系，下设各职能部门，有专业岗位负责产品开发、投资研究、投资管理、风险控制、绩效评估、咨询服务等工作。

### 4、内部控制制度

公司根据法律法规的规定，不断适应监管要求，建立了一系列内部控制制度，强化了部门之间和岗位之间的相互制约监督、相互制约机制，在组织上、职责上为内控管理提供了制度保障。其中《内部控制基本制度》，强化了公司的内控建设，明确了内控目标、内控原则、控制环境、内控措施等内容，并明确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，公司管理层对内部控制制度的有效执行承担责任。公司依据自身经营特点设立顺序递进、权责统一、严密有效的内控防线，确保相关业务运作均依法合规。为确保公司业务的运作和管理严格遵守国家有关法律、法规和行业监管规章，坚持守法经营、规范运作的经营思想和经营风格；公司先后出台了系列内部管理制度，涵盖公司治理、行政管理、人力管理、业务运行、风险控制等。

### 5、内控防线

公司根据资产管理行业的特点建立了顺序递进、权责统一、严密有效的内控防线：

（1）公司各部门均建立了详细岗位职责说明书和业务流程，明确了各岗位职责，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。公司建立了岗位职责说明，岗位权责分明，严格执行不相容岗位分离制度，岗位授权明确，前中后台部门相互制衡、部门岗位相互监督，关键岗位建立了复核流程。

（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。建立了完善的投资业务流程体系，保障业务处理传递凭证及信息沟通的有效性。公司建立了清晰的报告系统，根据业务条线、工作性质不同执行业务条线报告流程、合规条线报告流程、风控条线报告流程、市场条线报告流程、后台条线报告流程，根据业务性质不同及工作性质不同，执行不同的沟通报告路径，设定不同的报告层级，报告系统清晰有效。

## 6、风险管理体系

建立科学严密的风险评估体系，及时发现、评估、规避、处理公司业务运作中的各种风险，最大限度地降低公司业务运作过程中可能出现的各种风险对客户委托资产造成的损失，在有效管理风险的前提下，努力实现客户委托资产的保值增值。公司已建立了完善的四级风险管理体系，风险管理体系共分四个层次：第一层次为董事会，董事会是公司风险管理的最高决策机构，风险控制委员会为董事会风险管理的专门工作机构；第二层次为行政办公会，行政办公会是公司风险管理的决策监督机构，风险控制执行委员会为行政办公会风险管理的常设机构；第三层次为风险管理部相关职能部门；第四层次为各业务部门的一线风险管理。

为保证公司经营目标的实现，适应公司发展的需要，结合实际情况，公司制定了一系列内部控制制度。公司的各项业务严格按照各项内部控制制度运作。

## 7、基金管理人关于内部控制制度声明

- （1）本基金管理人承诺以上内部控制的披露真实、准确。
- （2）本基金管理人承诺将根据市场环境的变化及公司的发展不断完善内部控制制度。
- （3）本基金管理人承诺将积极配合外部风险监督工作。

## 第四部分 基金托管人

### 一、基金托管人概况

名称：上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市中山东一路 12 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：郑杨

成立时间：1992 年 10 月 19 日

经营范围：经中国人民银行和中国银行业监督管理委员会批准，公司主营业务主要包括：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱业务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外币兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代客外汇买卖；资信调查、咨询、见证业务；离岸银行业务；证券投资基金托管业务；全国社会保障基金托管业务；经中国人民银行和中国银行业监督管理委员会批准经营的其他业务。

组织形式：股份有限公司

注册资本：293.52 亿元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基金字[2003]105 号

联系人：胡波

联系电话：（021）61618888

上海浦东发展银行自 2003 年开展资产托管业务，是较早开展银行资产托管服务的股份制商业银行之一。经过二十年来的稳健经营和业务开拓，各项业务发展一直保持较快增长，各项经营指标在股份制商业银行中处于较好水平。

上海浦东发展银行总行于 2003 年设立基金托管部，2005 年更名为资产托管部，2013 年更名为资产托管与养老金业务部，2016 年进行组织架构优化调整，并更名为资产托管部，目前下设证券托管处、客户资产托管处、养老金业务处、

内控管理处、业务保障处、总行资产托管运营中心（含合肥分中心）六个职能处室。

目前，上海浦东发展银行已拥有客户资金托管、资金信托保管、证券投资基金托管、全球资产托管、保险资金托管、基金专户理财托管、证券公司客户资产托管、期货公司客户资产托管、私募证券投资基金托管、私募股权托管、银行理财产品托管、企业年金托管等多项托管产品，形成完备的产品体系，可满足多领域客户、境内外市场的资产托管需求。

## 二、主要人员情况

郑杨，男，1966 年出生，研究生学历，博士学位，高级经济师。曾任国家经贸委经济法规司调研处副处长；中国机电设备招标中心开发处处长、第七招标业务处处长；国家外汇管理局资本项目司副司长；中国人民银行上海分行党委委员、副行长、国家外汇管理局上海市分局副局长；中国人民银行上海总部党委委员、副主任兼外汇管理部主任；上海市金融工作党委副书记、市金融办主任；上海市金融工作党委书记、市金融办主任；上海市金融工作党委书记、市地方金融监管局（市金融工作局）局长。现任上海浦东发展银行党委书记、董事长。

潘卫东，男，1966 年出生，硕士研究生，高级经济师。曾任宁波证券公司业务一部副经理；上海浦东发展银行宁波分行资财部总经理兼任北仑办事处主任、宁波分行副行长；上海浦东发展银行产品开发部总经理；上海浦东发展银行昆明分行行长、党组书记；上海市金融服务办公室挂职并任金融机构处处长；上海国际集团党委委员、总经理助理，上海国际集团党委委员、副总经理，上海国际信托有限公司党委书记、董事长；上海浦东发展银行党委委员、执行董事、副行长、财务总监。现任上海浦东发展银行党委副书记、副董事长、行长，上海国际信托有限公司董事长。

孔建，男，1968 年出生，博士研究生。历任工商银行山东省分行资金营运处副处长，上海浦东发展银行济南分行信管处总经理，上海浦东发展银行济南分行行长助理、副行长、党委书记、行长。现任上海浦东发展银行总行金融市场业务党委委员，资产托管部总经理。

## 三、基金托管业务经营情况

截止 2022 年 3 月 31 日，上海浦东发展银行证券投资基金托管规模为

12197.42 亿元，比去年末下降 4.54%。托管证券投资基金共三百四十九支。

#### 四、基金托管人的内部控制制度

1、本行内部控制目标为：确保经营活动中严格遵守国家有关法律法规、监管部门监管规则和本行规章制度，形成守法经营、规范运作的经营思想。确保经营业务的稳健运行，保证基金资产的安全和完整，确保业务活动信息的真实、准确、完整，保护基金份额持有人的合法权益。

2、本行内部控制组织架构为：总行法律合规部是全行内部控制的牵头管理部门，指导业务部门建立并维护资产托管业务的内部控制体系。总行风险监控部是全行操作风险的牵头管理部门。指导业务部门开展资产托管业务的操作风险管控工作。总行资产托管部下设内控管理处。内控管理处是全行托管业务条线的内部控制具体管理实施机构，并配备专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，独立行使监督稽核职责。

3、内部控制制度及措施：本行已建立完善的内部控制制度。内控制度贯穿资产托管业务的决策、执行、监督全过程，渗透到各业务流程和各操作环节，覆盖到从事资产托管各级组织结构、岗位及人员。内部控制以防范风险、合规经营为出发点，各项业务流程体现“内控优先”要求。

具体内控措施包括：培育员工树立内控优先、制度先行、全员化风险控制的风险管理理念，营造浓厚的内控文化氛围，使风险意识贯穿到组织架构、业务岗位、人员的各个环节。制定权责清晰的业务授权管理制度、明确岗位职责和各项操作规程、员工职业道德规范、业务数据备份和保密等在内的各项业务管理制度；建立严格完善的资产隔离和资产保管制度，托管资产与托管人资产及不同托管资产之间实行独立运作、分别核算；对各类突发事件或故障，建立完备有效的应急预案，定期组织灾备演练，建立重大事项报告制度；在基金运作办公区域建立健全安全监控系统，利用录音、录像等技术手段实现风险控制；定期对业务情况进行自查、内部稽核等措施进行监控，通过专项/全面审计等措施实施业务监控，排查风险隐患。

#### 五、托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

##### 1、监督依据

托管人严格按照有关政策法规、以及基金合同、托管协议等进行监督。监督

依据具体包括：

- （1）《中华人民共和国证券法》；
- （2）《中华人民共和国证券投资基金法》；
- （3）《公开募集证券投资基金运作管理办法》；
- （4）《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》；
- （5）《基金合同》、《基金托管协议》；
- （6）法律、法规、政策的其他规定。

## 2、监督内容

我行根据基金合同及托管协议约定，对基金合同生效之后所托管基金的投资范围、投资比例、投资限制等进行严格监督，及时提示基金管理人违规风险。

## 3、监督方法

（1）资产托管部设置核算监督岗位，配备相应的业务人员，在授权范围内独立行使对基金管理人投资交易行为的监督职责，规范基金运作，维护基金投资人的合法权益，不受任何外界力量的干预；

（2）在日常运作中，凡可量化的监督指标，由核算监督岗通过托管业务的自动处理程序进行监督，实现系统的自动跟踪和预警；

（3）对非量化指标、投资指令、管理人提供的各种报表和报告等，采取人工监督的方法。

## 4、监督结果的处理方式

（1）基金托管人对基金管理人的投资运作监督结果，采取定期和不定期报告形式向基金管理人和中国证监会报告。定期报告包括基金监控周报等。不定期报告包括提示函、临时日报、其他临时报告等；

（2）若基金托管人发现基金管理人违规违法操作，以电话、邮件、书面提示函的方式通知基金管理人，指明违规事项，明确纠正期限。在规定期限内基金托管人再对基金管理人违规事项进行复查，如果基金管理人未予纠正，基金托管人将报告中国证监会。如果发现基金管理人投资运作有重大违规行为时，基金托管人应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正；

（3）针对中国证监会、中国人民银行对基金投资运作监督情况的检查，应及时提供有关情况和资料。



## 第五部分 相关服务机构

### 一、基金份额发售机构

#### 1、直销机构

（1）名称：中泰证券（上海）资产管理有限公司直销柜台

住所：上海市黄浦区延安东路 175 号 24 楼 05 室

办公地址：上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 1002-1003 室

法定代表人：黄文卿

网站：[www.ztzqzg.com](http://www.ztzqzg.com)

传真：021-68883868

联系人：崔稳

客服电话：400-821-0808

（2）名称：中泰证券（上海）资产管理有限公司网上直销平台

住所：上海市黄浦区延安东路 175 号 24 楼 05 室

办公地址：上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 1002-1003 室

法定代表人：黄文卿

网站：[www.ztzqzg.com](http://www.ztzqzg.com)

传真：021-68883868

联系人：江安仪

客服电话：400-821-0808

#### 2、其他销售机构

（1）中泰证券股份有限公司

住所：济南市经七路 86 号

办公地址：济南市经七路 86 号

网址：[www.zts.com.cn](http://www.zts.com.cn)

法定代表人：李峰

客服电话：95538

（2）交通银行股份有限公司

住所：上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：任德奇

网址：<http://www.bankcomm.com>

客服电话：95559

（3）阳光人寿保险股份有限公司

住所：海南省三亚市迎宾路 360-1 号三亚阳光金融广场 16 层

办公地址：北京市朝阳区朝阳门外大街乙 12 号院 1 号昆泰国际大厦 12 层

法定代表人：李科

网址：<http://fund.sinosig.com/>

客服电话：010-85632771

（4）中信建投证券股份有限公司

住所：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京东城区朝内大街 2 号凯恒中心 B 座 16 层

法定代表人：王常青

网址：<http://www.csc108.com>

客服电话：4008-888-108/95587

（5）北京雪球基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区创远路 34 号院 6 号楼 15 层 1501 室

办公地址：北京市朝阳区阜通东大街 1 号望京 SOHO T2 B 座 2507

法定代表人：李楠

网址：<https://danjuanfunds.com/>

客服电话：400-159-9288

（6）北京度小满基金销售有限公司

住所：北京市海淀区西北旺东路 10 号院西区 4 号楼 1 层 103 室

办公地址：北京市海淀区西北旺东路 10 号院西区 4 号楼

法定代表人：盛超

网址：[www.baiyingfund.com](http://www.baiyingfund.com)

客服电话：95055

（7）北京汇成基金销售有限公司

住所：北京市西城区宣武门外大街甲 1 号 4 层 401-2

办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲 1 号环球财讯中心 D 座 4 层

法定代表人：王伟刚

网址：[www.hcjijin.com](http://www.hcjijin.com)

客服电话：400-619-9059

（8）北京中植基金销售有限公司

住所：北京市北京经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室

办公地址：北京朝阳区大望路金地中心 A 座 28 层

法定代表人：武建华

网址：<http://www.zzfund.com>

客服电话：400-8180-888

（9）大连网金基金销售有限公司

住所：辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号诺德大厦 2 层 202 室

办公地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号诺德大厦 2 层 202 室

法定代表人：樊怀东

网址：[www.yibaijin.com](http://www.yibaijin.com)

客服电话：4000-899-100

（10）嘉实财富股份有限公司

住所：海南省三亚市天涯区凤凰岛 1 号楼 7 层 710 号

办公地址：北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座

法定代表人：张峰

网址：<https://www.harvestwm.cn>

客服电话：400-021-8850

（11）京东肯特瑞基金销售有限公司

住所：北京市海淀区西二旗建材中路 12 号 17 号平房 157

办公地址：北京市亦庄经济开发区科创十一街 18 号院 A 座

法定代表人：李骏

网址：[kenterui.jd.com](http://kenterui.jd.com)

客服电话：400-098-8511

(12) 和耕传承基金销售有限公司

住所：河南自贸试验区郑州片区（郑东）东风南路东康宁街北 6 号楼 5 楼  
503

办公地址：河南自贸试验区郑州片区（郑东）东风南路东康宁街北 6 号楼 5  
楼 503

法定代表人：温丽燕

网址：[www.hgccpb.com](http://www.hgccpb.com)

客服电话：4000-555-671

(13) 南京苏宁基金销售有限公司

住所：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

办公地址：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

法定代表人：王锋

网址：[www.snjjjin.com](http://www.snjjjin.com)

客服电话：95177

(14) 诺亚正行基金销售有限公司

住所：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

办公地址：上海市杨浦区长阳路 1687 号 2 号楼

法定代表人：汪静波

网址：[www.noah-fund.com](http://www.noah-fund.com)

客服电话：400-821-5399

(15) 上海好买基金销售有限公司

住所：上海市虹口区东大名路 501 号 6211 单元

办公地址：上海市浦东新区张杨路 500 号华润时代广场 12 层

法定代表人：杨文斌

网址：[www.howbuy.com](http://www.howbuy.com)

客服电话：400-700-9665

(16) 上海华夏财富投资管理有限公司

住所：上海市虹口区东大名路 687 号 1 幢 2 楼 268 室

办公地址：北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

法定代表人：毛准平

网址：<https://www.amcfortune.com/>

客服电话：400-817-5666

（17）上海基煜基金销售有限公司

住所：上海市黄浦区广东路 500 号 30 层 3001 单元

办公地址：上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 1503 室

法定代表人：王翔

网址：[www.jiyufund.com.cn](http://www.jiyufund.com.cn)

客服电话：400-820-5369

（18）上海利得基金销售有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区临港新片区海基六路 70 弄 1 号 208-36 室

办公地址：上海市虹口区东大名路 1098 号浦江国际金融广场 53 楼

法定代表人：李兴春

网址：<http://www.leadfund.com.cn/>

客服电话：400-032-5885

（19）上海联泰基金销售有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室

办公地址：上海市长宁区福泉北路 518 号 8 座 3 层

法定代表人：尹彬彬

网址：[www.66liantai.com](http://www.66liantai.com)

客服电话：400-166-6788

（20）上海陆金所基金销售有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区源深路 1088 号 7 层（实际楼层 6 层）

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号

法定代表人：陈祎彬

网址：[www.lufunds.com](http://www.lufunds.com)

客服电话：400-821-9031

（21）上海陆享基金销售有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区临港新片区环湖西二路 888 号 1 幢 1 区 14032 室

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 1196 号世纪汇广场二楼 16 楼

法定代表人：粟旭

网址：[www.luxxfund.com/](http://www.luxxfund.com/)

客服电话：400-168-1235

（22）上海天天基金销售有限公司

住所：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼二层

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号东方财富大厦

法定代表人：其实

网址：[www.1234567.com.cn](http://www.1234567.com.cn)

客服电话：95021 或 400-1818-188

（23）上海云湾基金销售有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路 27 号、明月路 1257 号 1 幢 1 层 103-1、103-2 办公区

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路 27 号、明月路 1257 号 1 幢 1 层 103-1、103-2 办公区

法定代表人：冯轶明

网址：[www.zhengtongfunds.com](http://www.zhengtongfunds.com)

客服电话：400-820-1515

（24）上海长量基金销售有限公司

住所：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区东方路 1267 号陆家嘴金融服务广场二期 11 层

网址：<http://www.erichfund.com>

法定代表人：张跃伟

客服电话：400-820-2899

（25）腾安基金销售（深圳）有限公司

住所：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室

办公地址：深圳市南山区海天二路 33 号腾讯滨海大厦 38 层

法定代表人：林海峰

网址：[www.txfund.com](http://www.txfund.com)

客服电话：95017

（26）招商银行招赢通

住所：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦

网址：<https://fi.cmbchina.com>

法定代表人：缪建民

客服电话：95555

（27）浙江同花顺基金销售有限公司

住所：杭州市西湖区文二西路 1 号元茂大厦 903 室

办公地址：杭州市西湖区文二西路 1 号元茂大厦 903 室

法定代表人：吴强

网址：[www.5ifund.cn](http://www.5ifund.cn)

客服电话：952555

（28）珠海盈米基金销售有限公司

住所：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491（集中办公区）

办公地址：广东省广州市海珠区琶洲大道东路 1 号保利国际广场南塔

1201-1203

法定代表人：肖雯

网址：[www.yingmi.cn](http://www.yingmi.cn)

客服电话：020-89629066

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其它符合要求的机构销售本基金，具体名单详见基金管理人网站。

二、注册登记机构

名称：中泰证券（上海）资产管理有限公司

住所：上海市黄浦区延安东路 175 号 24 楼 05 室

办公地址：上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 1002-1003 室

法定代表人：黄文卿

传真：021-50933716

客户服务专线：021-20521115

### 三、出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：韩炯

联系电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：丁媛

经办律师：黎明、丁媛

### 四、审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 507

单元 01 室

办公地址：上海市黄浦区湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

执行事务合伙人：李丹

联系电话：021-23238888

传真：021-23238800

联系人：金诗涛

经办注册会计师：张振波、金诗涛



## 第六部分 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，并经中国证监会 2021 年 4 月 19 日证监许可【2021】1374 号文（《关于准予中泰稳固周周购 12 周滚动持有债券型证券投资基金注册的批复》）准予注册募集。

### 二、基金类别、运作方式、存续期限和份额类别

1、基金类别：债券型证券投资基金

2、基金运作方式：

契约型开放式

#### （1）本基金定期开放申购

本基金自基金合同生效之日起 3 个月内开始办理申购业务，之后本基金将每周集中开放申购。首个开放期具体时间详见基金管理人的公告，第二个开放期为首个开放期 1 周后的对应日（指自然周，如该对应日为非工作日，则基金管理人可以选择顺延、提前或暂停开放，详见基金管理人届时的公告，下同）。每个开放期不少于一个工作日、不超过二个工作日（若本基金参与港股通交易且该工作日为非港股通交易日时，则基金管理人可根据实际情况决定本基金是否集中开放申赎业务，详见基金管理人届时的公告）。

#### （2）运作期

对于每份基金份额，第一个运作期到期日指基金合同生效日（对认购份额而言，下同）或基金份额申购申请确认日（对申购份额而言，下同）12 周后的对应日（指自然周，如该对应日为非工作日，则基金管理人可以选择顺延、提前或暂停开放，详见基金管理人届时的公告，下同），第二个运作期到期日为基金合同生效日或基金份额申购申请确认日 24 周后的对应日（指自然周，如该对应日为非工作日，则管理人可以选择顺延、提前或暂停开放，详见基金管理人届时的公告，下同），以此类推。

#### （3）本基金赎回业务的办理时间

每个运作期到期日，基金份额持有人可提出赎回申请。如果基金份额持有人

在当期运作期到期日未申请赎回，则自该运作期到期日下一日起该基金份额进入下一个运作期。

如发生不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放或需依据基金合同暂停申购与赎回业务的，基金管理人有权合理调整申购或赎回业务的办理期间并及时公告。

3、基金的存续期限：不定期

4、基金份额类别：

本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购时收取认购费、申购费，赎回时根据持有期限收取赎回费用，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；在投资者认购、申购时不收取认购费、申购费，赎回时根据持有期限收取赎回费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额。

本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算并公告基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

投资者可自行选择认购、申购基金份额类别。

本基金有关基金份额类别的具体设置、费率水平等由基金管理人确定，并在招募说明书及基金产品资料概要中列明。在不违反法律法规、基金合同的约定以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，根据基金实际运作情况，在履行适当程序后，基金管理人可停止某类基金份额的销售、增加新的基金份额类别或对基金份额分类办法及规则进行调整等，此项调整无需召开基金份额持有人大会，但调整实施前基金管理人需及时公告。

三、基金份额的募集情况

本基金自 2021 年 7 月 5 日至 2021 年 7 月 16 日止向社会公开募集。经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）验资，按照每份基金份额面值人民币 1.00 元计算，募集期共募集 241,176,530.51（含利息）份基金份额，有效认购户数为 1,309 户。

---

---

## 第七部分 基金合同的生效

### 一、基金备案的条件

根据《基金法》及其配套法规和基金合同的有关规定，本基金的募集情况已符合基金合同生效的条件。本基金于 2021 年 7 月 21 日办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认，基金合同自该日起正式生效。自基金合同生效之日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

### 二、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

《基金合同》生效后，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，基金管理人应当在 10 个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并在 6 个月内召集基金份额持有人大会进行表决。

法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

## 第八部分 基金份额的申购与赎回

### 一、申购和赎回场所

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。具体的销售机构将在基金管理人网站列明。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并在基金管理人网站公示。若基金管理人或其指定的销售机构开通电话、传真或网上等交易方式，投资人可以通过上述方式进行申购与赎回，具体参见各销售机构的相关公告。投资人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、申购和赎回的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

基金管理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（若本基金参与港股通交易且该工作日为非港股通交易日时，则基金管理人可根据实际情况决定本基金是否集中开放申赎业务，详见基金管理人届时公告），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/期货交易市场、证券/期货交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

#### 2、申购、赎回开始日及业务办理时间

基金管理人已于 2021 年 8 月 11 日起开始办理本基金基金份额的日常申购业务，并于 2021 年 10 月 13 日起开始办理本基金基金份额的日常赎回业务，详情参见基金管理人 2021 年 8 月 4 日刊登的《中泰稳固周周购 12 周滚动持有债券型证券投资基金开放日常申购、转换转入和定期定额投资业务公告》及 2021 年 9 月 30 日刊登的《中泰稳固周周购 12 周滚动持有债券型证券投资基金开放日常赎回和转换转出业务公告》。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且注册登记机构确认接受的，其基金份额申购、赎回价格为下一开放日基金份额申购、赎回的价格。

### 三、申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的各类基金份额净值为基准进行计算；

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；

4、赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人认购、申购的先后次序进行顺序赎回；

5、办理申购、赎回业务时，应当遵循基金份额持有人利益优先原则，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待。

基金管理人可在法律法规允许的情况下，对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

### 四、申购与赎回的程序

#### 1、申购和赎回的申请方式

投资人必须根据销售机构规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。投资人在提交申购申请时须按销售机构规定的方式备足申购资金，投资人在提交赎回申请时须持有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回申请无效。

#### 2、申购和赎回的款项支付

投资人申购基金份额时，必须在规定的时间内全额交付申购款项，投资人交付申购款项，申购成立；注册登记机构确认基金份额时，申购生效。若资金在规定时间内未全额到账则申购不成立，申购款项将退回投资人账户，基金管理人、基金托管人和销售机构等不承担由此产生的利息等任何损失。

基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；注册登记机构确认赎回时，赎回生效。基金份额持有人赎回申请生效后，基金管理人将在 T+7 日(包括该日)内支付赎回款项。如遇交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障、港股通交易系统、港股通资金交收规则限制或其他非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程，则赎回款项划付时间相应顺延至该因素消除的最近一个工作日。在发生巨额赎回或基金合同载明的其他暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形时，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, 本基金注册登记机构在 T+1 日内对该交易的有效性进行确认。T 日提交的有效申请, 投资人应在 T+2 日后(包括该日)及时到销售机构柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功或无效, 则申购款项本金退还给投资人。

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、赎回的确认以注册登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况, 投资人应及时查询并妥善行使合法权利, 否则, 由此产生的投资人任何损失由投资人自行承担。

基金管理人可以在法律法规允许的范围内, 依法对上述申购和赎回申请的确认时间进行调整, 并在调整实施日前按照有关规定在规定媒介上公告。

### 五、申购和赎回的数量限制

#### 1、申购金额的限制

本基金每笔申购的最低金额为人民币 10.00 元(含申购费)。投资者通过本公司直销柜台申购本基金任一类基金份额时, 首次申购最低金额为人民币 100,000.00 元(含申购费), 已在直销柜台有该类别基金份额认购记录的投资者不受首次申购最低金额的限制, 追加申购最低金额为人民币 10,000.00 元(含申购费); 通过本公司网上直销平台申购本基金份额时, 每笔申购最低金额为人民币 100.00 元(含申购费)。各销售机构对本基金最低申购金额及交易级差有其他规定的, 以各销售机构的业务规定为准。

#### 2、赎回份额的限制

基金份额持有人可将其全部或部分基金份额赎回。单笔赎回申请最低份数为 1.00 份, 若某基金份额持有人赎回时在销售机构保留的基金份额不足 1.00 份, 则该次赎回时必须一起赎回。但各销售机构对交易账户最低份额余额有其他规定的, 以各销售机构的业务规定为准。

3、本基金不对投资人每个交易账户的最低基金份额余额进行限制, 但各销售机构对交易账户最低份额余额有其他规定的, 以各销售机构的业务规定为准。

4、本基金不对单个投资人累计持有的基金份额上限进行限制。法律法规、

中国证监会或基金合同另有规定的除外。

5、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。具体见基金管理人相关公告。

6、如启动侧袋机制的，则在侧袋机制实施期间，基金管理人不得办理侧袋账户申购赎回。基金管理人应当依法保障主袋账户份额持有人享有基金合同约定的赎回权利，并根据主袋账户运作情况合理确定申购政策。

7、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

## 六、申购和赎回的价格、费用及其用途

### 1、申购费用

本基金 A 类基金份额在申购时收取申购费，C 类基金份额不收取申购费。申购费不列入基金财产。投资人可多次申购本基金，申购费用按每笔申购申请单独计算。

本基金 A 类基金份额的申购费率如下：

申购金额（M）	申购费率
M < 100 万元	0.50%
100 万 ≤ M < 500 万元	0.30%
M ≥ 500 万元	每笔 1,000 元

本基金 A 类基金份额的申购费用由申购 A 类基金份额的投资人承担，在投资人申购 A 类基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、登记结算等各项费用；C 类基金份额不收取申购费用。

### 2、赎回费用

本基金的赎回费率具体如下：

赎回申请份额持有时间（N）	A 类基金份额赎回费率	C 类基金份额赎回费率
N < 7 日	1.50%	1.50%

7 日≤N<30 日	0.50%	0
N≥30 日	0	0

本基金各类基金份额的赎回费用由赎回相应类别基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回该类基金份额时收取。对持续持有期少于 30 日（不含）的基金份额持有人收取的赎回费用全额计入基金财产。

3、基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

4、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。

5、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对投资人定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以对基金销售费用实行一定的优惠。

## 七、申购份额和赎回金额的计算

### 1、申购份额的计算

（1）对于申购 A 类基金份额的投资者，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：

申购费用适用比例费率时，申购份额的计算方法如下：

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} / (1 + \text{申购费率})$$

$$\text{申购费用} = \text{申购金额} - \text{净申购金额}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{T 日 A 类基金份额净值}$$

②申购费用为固定金额时，申购份额的计算方法如下：

$$\text{申购费用} = \text{固定金额}$$

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} - \text{申购费用}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{T 日 A 类基金份额净值}$$

（2）对于申购本基金 C 类基金份额的投资者，申购份额的计算公式如下：

$$\text{申购份额} = \text{申购金额} / \text{T 日 C 类基金份额净值}$$



(3) 上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

例 3：某投资人投资 10,000.00 元申购本基金 A 类基金份额，申购费率为 0.50%，假设申购当日基金的 A 类基金份额的基金份额净值为 1.0400 元，则其可得到的申购份额为：

$$\text{净申购金额} = 10,000.00 / (1 + 0.50\%) = 9,950.25 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 10,000.00 - 9,950.25 = 49.75 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 9,950.25 / 1.0400 = 9,567.55 \text{ 份}$$

即：投资人投资 10,000.00 元申购本基金 A 类基金份额，对应申购费率为 0.50%，假设申购当日 A 类基金份额的基金份额净值为 1.0400 元，则可得到 9,567.55 份 A 类基金份额。

例 4：某投资人投资 10,000.00 元申购本基金 C 类份额，假设申购当日基金的 C 类基金份额的基金份额净值为 1.0300 元，则根据公式计算出：

$$\text{申购金额} = 10,000.00 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 10,000.00 / 1.0300 = 9,708.74 \text{ 份}$$

即：投资人投资 10,000.00 元申购本基金 C 类基金份额，假设申购当日基金的 C 类基金份额的基金份额净值为 1.0300 元，则可得到 9708.74 份 C 类基金份额。

## 2、赎回金额的计算

本基金的赎回金额为赎回总额扣减赎回费用。A 类基金份额与 C 类基金份额赎回金额的计算方法相同。赎回金额的计算方法如下：

$$\text{赎回费用} = \text{赎回份额} \times T \text{ 日 A 类或 C 类基金份额净值} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{赎回金额} = \text{赎回份额} \times T \text{ 日 A 类或 C 类基金份额净值} - \text{赎回费用}$$

上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

例 5：某基金份额持有人赎回 10,000.00 份 A 类基金份额，假设该 A 类基金份额的持有时间为 5 日，对应的赎回费率为 1.50%，假设 T 日 A 类基金份额的基金份额净值是 1.0200 元，则其可获得的赎回金额为：

$$\text{赎回费用} = 10,000.00 \times 1.0200 \times 1.50\% = 153.00 \text{ 元}$$

---

---

赎回金额 =  $10,000.00 \times 1.0200 - 153.00 = 10,047.00$  元

即：该基金份额持有人赎回 10,000.00 份 A 类基金份额，假设该 A 类基金份额的持有时间为 5 日、T 日 A 类基金份额的基金份额净值是 1.0200 元，则其可获得的赎回金额为 10,047.00 元。

例 6：某基金份额持有人赎回 10,000.00 份 C 类基金份额，假设该 C 类基金份额的持有时间为 35 日，对应的赎回费率为 0，假设 T 日 C 类基金份额的基金份额净值是 1.0200 元，则其可获得的赎回金额为：

赎回费用 =  $10,000.00 \times 1.0200 \times 0 = 0$  元

赎回金额 =  $10,000.00 \times 1.0200 - 0 = 10,200.00$  元

即：该基金份额持有人赎回 10,000.00 份 C 类基金份额，假设该 C 类基金份额的持有时间为 35 日、T 日 C 类基金份额的基金份额净值是 1.0200 元，则其可获得的赎回金额为 10,200.00 元。

3、本基金各类基金份额净值的计算，保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T 日的各类基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，经履行适当程序，可以适当延迟计算或公告。

#### 八、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转。
- 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。
- 3、证券、期货交易所交易时间非正常停市或者港股通临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
- 4、接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。
- 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，或发生其他损害现有基金份额持有人利益的情形。
- 6、基金管理人、基金托管人、基金销售机构或注册登记机构的异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。
- 7、当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上且与基金托管人协商确

认后，基金管理人应当暂停接受基金申购申请。

8、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过 50%，或者变相规避 50%集中度的情形。法律法规或中国证监会另有规定的除外。

9、港股通交易每日额度不足。

10、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第 1、2、3、5、6、7、9、10 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在规定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。发生上述第 8 项情形时，基金管理人可以采取比例确认等方式对该投资人的申购申请进行限制，基金管理人有权拒绝该等全部或者部分申购申请。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。

九、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基金份额持有人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受基金份额持有人的赎回申请或延缓支付赎回款项。

3、证券、期货交易所交易时间非正常停市或者港股通临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

4、发生继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时，基金管理人可暂停接受基金份额持有人的赎回申请。

5、当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上且与基金托管人协商确认后，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请。

6、法律法规规定、基金合同约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赎回或延缓支付赎回款项时，基金管理人应及时报中国证监会备案，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。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人

应及时恢复赎回业务的办理并公告。

## 十、巨额赎回的情形及处理方式

### 1、巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过前一工作日的基金总份额的 20%，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、延缓支付赎回款项或延期办理。

(1) 全额赎回：当基金管理人认为有能力支付基金份额持有人的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行；

(2) 延缓支付赎回款项：基金管理人应对当日全部赎回申请进行确认。但若基金管理人认为支付投资者的赎回申请有困难或认为因支付投资者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，当日按比例办理的赎回份额不得低于前一工作日基金总份额的 20%，其余赎回申请可以延缓支付赎回款项，最长不超过 20 个工作日。延缓支付的赎回申请以赎回申请当日的基金份额净值为基础计算赎回金额。

(3) 在开放期内，当基金出现巨额赎回时，在单个基金份额持有人赎回申请超过前一估值日基金总份额 40%的情形下，基金管理人认为支付该基金份额持有人的全部赎回申请有困难或者因支付该基金份额持有人的全部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，在当日接受该基金份额持有人的全部赎回的比例不低于前一估值日基金总份额 40%的前提下，其余赎回申请基金管理人有权延期办理，具体措施为：

1) 对于其未超过基金总份额 40%的赎回申请，基金管理人有权根据上述“(1) 全额赎回”或“(2) 延缓支付赎回款项”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。

2) 对于该基金份额持有人超过基金总份额 40%以上的赎回申请进行延期，基金份额持有人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销，对应的基金份额进入下一个运作期；

选择延期赎回的，当日未获受理的赎回申请对应的基金份额不进入下一个运作期，并以下一开放日的该类基金份额净值为基础计算赎回金额，直至全部赎回。如基金份额持有人在提交赎回申请时未作明确选择，基金份额持有人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

### 3、巨额赎回的公告

当发生上述巨额赎回并延缓支付赎回款项或延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真、刊登公告或者通知销售机构代为告知等方式在 3 个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，并于 2 日内在规定媒介上刊登公告。

## 十一、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

1、发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人应在规定期限内在规定媒介上刊登暂停公告。

2、如发生暂停的时间为 1 日，基金管理人应于重新开放日，在规定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近 1 个开放日的基金份额净值。

3、如发生暂停的时间超过 1 日，基金管理人可以根据暂停申购或赎回的时间，依照《信息披露办法》的有关规定，最迟于重新开放日在规定媒介上刊登重新开放申购或赎回的公告；也可以根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间，届时不再另行发布重新开放的公告。

## 十二、基金转换

### （一）基金转换

基金转换（以下简称“转换”）是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。

### （二）转换业务办理时间

投资人可在基金开放日申请办理基金转换业务，具体办理时间与基金申购、赎回业务办理时间相同。由于各销售机构的系统差异以及业务安排等原因，开展该业务的时间可能有所不同，投资人应以各销售机构公告的时间为准。

### （三）基金转换的程序

#### 1、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

转换申请。

## 2、基金转换申请的确认

基金管理人或基金管理人委托的注册登记机构应以交易时间结束前受理有效转换申请的当天作为转换申请日（T 日），正常情况下，本基金注册登记机构在 T+1 日内（包括该日）对该交易的有效性进行确认。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及时查询申请的确认情况。

投资人申请转换时，注册登记机构按先进先出的原则对该投资人基金账户在该销售机构托管的基金份额进行处理，即先确认的份额先转换，后确认的份额后转换。

销售机构对转换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。转换申请的确认以注册登记机构的确认结果为准。

### （四）基金转换的基本规则

1、基金转换只能在同一销售机构进行。转换的两只基金必须都是该销售机构代理的同一基金管理人管理的、在同一注册登记机构处注册登记的基金。投资者办理基金转换业务时，转出方的基金必须处于可赎回状态，转入方的基金必须处于可申购状态。

2、基金转换采取“未知价”法，即基金的转换价格以申请受理当日各转出、转入基金的基金份额净值为基准进行计算。

3、转换后，转入基金份额的持有时间将重新计算，即转入基金份额的持有期将自转入基金份额确认日起重新开始计算。

### （五）基金转换的数额限制

基金转换遵循“份额转换”的原则，以份额为单位进行申请。基金持有人可将其全部或部分基金份额转换成其它基金，单笔转换申请的转出份额、转入金额的具体限制以各销售机构规定为准。因为转换等非赎回原因导致投资人在销售机构（网点）保留的基金份额余额少于该基金最低保留份额数量限制的，注册登记机构不作强制赎回处理。

### （六）基金转换费用

基金转换分为转换转入（以下简称“转入”）和转换转出（以下简称“转出”）。

每笔基金转换视为一笔赎回和一笔申购，基金转换费用由转出基金的赎回费用及转出、转入基金的申购补差费用两部分组成。

### 1、转出基金的赎回费用

赎回费用按照转出基金最新的更新招募说明书及相关公告规定的赎回费率收取，赎回费用按一定比例归入转出基金基金资产，其余部分用于支付注册登记费等相关手续费。

### 2、转出基金与转入基金的申购补差费用

基金转换费用按照转出基金赎回费用加上转出与转入基金申购费用补差的标准收取。当转出基金申购费率低于转入基金申购费率时，费用补差为按照转出基金金额(不含转出基金赎回费)计算的申购费用差额；当转出基金申购费率高于转入基金申购费率时，不收取费用补差。

3、基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整上述费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

### （七）基金转换份额的计算公式

转出金额=转出基金份额×转出基金 T 日基金份额净值

转出基金赎回费用=转出金额×转出基金赎回费率

转入金额=转出金额-转出基金赎回费用

补差费用=转入基金申购费-转出基金申购费

如计算所得补差费用小于 0，则补差费用为 0

转入基金申购费=转入金额/(1+转入基金申购费率)×转入基金申购费率

如果转入基金申购费适用固定费用时，则转入基金申购费=转入基金固定申购费

转出基金申购费=转入金额/(1+转出基金申购费率)×转出基金申购费率

如果转出基金申购费适用固定费用时，则转出基金申购费=转出基金固定申购费

净转入金额=转入金额-补差费用

转入份额=净转入金额÷转入基金 T 日基金份额净值

转入份额按照四舍五入方法保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由

基金资产承担。

例：假设某投资者将持有时间为 12 周的 10 万份中泰稳固周周购 12 周滚动持有债券型证券投资基金 A 类基金份额(以下简称“中泰稳固周周购 12 周滚动债 A”)转换为中泰星元价值优选灵活配置混合型证券投资基金 A 类基金份额(以下简称“中泰星元灵活配置混合 A”)，中泰稳固周周购 12 周滚动债 A 对应申请日基金份额净值为 1.0416 元，对应申购费率为 0.50%，对应赎回费率为 0%，中泰星元灵活配置混合 A 对应申请日基金份额净值假设为 1.6242 元，对应申购费率为 1.5%，则该笔转换投资者得到的中泰星元灵活配置混合 A 基金份额计算方法为：

$$\text{转出金额} = 100,000.00 \times 1.0416 = 104,160.00 \text{ 元}$$

$$\text{转出基金赎回费用} = 104,160.00 \times 0\% = 0 \text{ 元}$$

$$\text{转入金额} = 104,160.00 - 0 = 104,160.00 \text{ 元}$$

$$\text{转入基金申购费} = 104,160.00 / (1 + 1.5\%) \times 1.5\% = 1,539.31 \text{ 元}$$

$$\text{转出基金申购费} = 104,160.00 / (1 + 0.5\%) \times 0.5\% = 518.21 \text{ 元}$$

$$\text{补差费用} = \text{转入基金申购费} - \text{转出基金申购费} = 1,539.31 - 518.21 = 1,021.10 \text{ 元}$$

$$\text{净转入金额} = 104,160.00 - 1,021.10 = 103,138.90 \text{ 元}$$

$$\text{转入份额} = 103,138.90 / 1.6242 = 63,501.35 \text{ 份}$$

根据以上方法计算，该投资者将持有时间为 12 周的 10 万份中泰稳固周周购 12 周滚动债 A 转换为中泰星元灵活配置混合 A，投资者需要支付中泰稳固周周购 12 周滚动债 A 基金转换赎回费 0 元，需要支付基金转换补差费用 1,021.10 元，转换后获得中泰星元灵活配置混合 A 基金份额为 63,501.35 份。

#### （八）拒绝或暂停基金转换的情形及处理方式

基金转换视同为转出基金的赎回和转入基金的申购，因此暂停基金转换适用有关转出基金和转入基金关于暂停或拒绝申购、暂停赎回和巨额赎回的有关规定。

发生巨额赎回时，基金转出与基金赎回具有相同的优先级，基金管理人可根据基金资产组合情况，决定全额转出或部分转出，并且对于基金转出和基金赎回，将采取相同的比例确认。在转出申请得到部分确认的情况下，未确认部分的转出申请将自动予以撤销，不再视为下一开放日的基金转换申请。



### 十三、基金的非交易过户

基金的非交易过户是指基金注册登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及注册登记机构认可、符合法律法规的其他非交易过户。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资人。

继承是指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；捐赠指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体；司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供基金注册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注册登记机构的规定办理，并按基金注册登记机构规定的标准收费。

### 十四、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。

### 十五、定期定额投资计划

基金管理人可以为投资人办理定期定额投资计划，具体规则由基金管理人另行规定。投资人在办理定期定额投资计划时可自行约定每期申购金额，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。

### 十六、基金份额的冻结和解冻

基金注册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，以及注册登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。

基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益一并冻结，被冻结部分份额仍然参与收益分配。法律法规或监管机构另有规定的除外。

### 十七、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注册登记机构办理基金份额的过户注册登记。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。

十八、如相关法律法规允许基金管理人办理基金份额的质押业务或其他基金业务，基金管理人将制定和实施相应的业务规则。

十九、在不违反相关法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人可根据具体情况对上述申购和赎回以及相关业务的安排进行补充和调整并提前公告，无需召开基金份额持有人大会审议。

二十、实施侧袋机制期间本基金的申购与赎回

本基金实施侧袋机制的，侧袋机制实施期间的申购和赎回安排详见本招募说明书“侧袋机制”章节或届时发布的相关公告。

## 第九部分 基金的投资

### 一、投资目标

在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，力求实现基金资产的长期稳定增值，为投资者实现超越业绩比较基准的收益。

### 二、投资范围

本基金投资于国内依法发行上市的债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换公司债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、国债期货、股票（包含主板、中小板、创业板、存托凭证及其他依法发行上市的股票）、港股通标的股票、现金以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

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

本基金的投资组合比例为：本基金投资债券资产的比例不低于基金资产的 80%，投资股票资产的比例不高于基金资产的 20%（其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%）。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，应当保持不低于基金资产净值的 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

国债期货及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

当法律法规的相关规定变更时，基金管理人在履行适当程序后可对上述资产配置比例进行适当调整。

### 三、投资策略

本基金在充分考虑基金资产的安全性、收益性、流动性及严格控制风险的前提下，通过分析经济周期变化、货币政策、债券供求等因素，持续研究债券市场运行状况、研判市场风险，制定债券投资策略，挖掘价值被低估的标的券种，力争实现超越业绩比较基准的投资收益。

#### （一）资产配置策略

本基金在综合判断宏观经济形势以及微观市场的基础上，分析不同类别固定

收益类资产的收益率水平、流动性特征和风险水平特征，确定信用类固定收益资产、非信用类固定收益资产、其他大类资产的配置，同时，根据市场的变化，动态调整各类资产的投资比例，以规避市场风险，提高投资收益。

## （二）债券投资策略

### 1、久期配置策略

本基金采用积极管理的久期配置策略，在严格控制风险并满足流动性的前提下，提高资产收益率。具体久期配置策略上，主要通过控制组合久期和个券久期等方面进行投资管理。

#### （1）组合久期策略

##### ①久期配置策略

本基金通过对宏观经济环境运行趋势、经济周期、政策导向和债券市场资金供求状况等多方面因素进行综合分析，包括通过跟踪经济增长、固定资产投资、居民收入、工业增加值、社会消费品零售总额等反映宏观经济运行态势的重要指标判断宏观经济运行趋势及其在经济周期中所处位置，以此预测国家货币政策、财政政策取向及当前利率在利率周期中所处位置。基于对宏观经济运行状态以及利率变动趋势的判断，同时考量债券市场资金面供应状况、市场主流预期等因素，预测债券收益率变化趋势，对未来市场利率走势进行判断，决定投资组合的久期。

##### ②久期调整策略

本基金密切跟踪影响债券投资的宏观经济状况和货币政策等因素，研判利率在长中短期内变动趋势及国家可能采取的调控政策，并根据市场变化动态积极调整债券组合的平均久期及期限分布，以有效提高投资组合的总投资收益。当预期市场总体利率水平降低时，本基金将适度延长所持有的债券组合的久期值，从而可以在市场利率实际下降时获得债券价格上升收益；反之，当预期市场总体利率水平上升时，则适度缩短组合久期，以规避债券价格下降的风险带来的资本损失，获得较高的再投资收益。

#### （2）个券久期策略

##### ①个券精选策略

本基金在保持资产较好的流动性前提下，通过对个券进行深入的基本面分析，并根据利率债、信用债等不同品种的市场容量、信用风险状况、信用利差水

平和流动性情况，判断各类属债券资产的预期回报，在不同债券品种之间进行配置。

## ②个券久期套利调整策略

由于投资标的的差异、信息不对称、投资者对于某种期限的偏好等因素可能会造成市场对于不同期限的相似投资标的错误定价，本基金将在保持流动性的基础上，动态调整个券的久期，实施跨期限套利，力争获取投资收益。

## 2、收益率曲线策略

在确定了组合的整体久期后，组合将基于宏观经济研究和债券市场跟踪，结合收益率曲线的拟合和波动模拟模型，对未来的收益率曲线移动进行情景分析，从而根据不同期限的收益率变动情况，在期限结构配置上适时采取子弹型、哑铃型或者阶梯型等策略，进一步优化组合的期限结构，增强基金的收益。

## 3、类属资产配置策略

根据不同债券资产类品种收益与风险的估计和判断，通过分析各类属资产的相对收益和风险因素，确定不同债券种类的配置比例。主要决策依据包括未来的宏观经济和利率环境研究和预测，利差变动情况、市场容量、信用等级情况和流动性情况等。在结合目标久期管理的基础上，定期对投资组合类属资产进行最优化配置和调整，确定类属资产的最优权重。

## 4、息差策略

本基金将择机通过正回购，融资买入收益率高于回购成本的债券，适当运用杠杆息差方式来获取主动管理回报，选取具有较好流动性的债券作为杠杆买入品种，灵活控制杠杆组合仓位，降低组合波动率。

## （三）股票投资策略

本基金通过对上市公司基本面的深入研究作为投资基础，精选具有高成长性的优质成长性企业。一方面，本基金将通过分析上市公司的公司治理结构、经营模式、自主创新等多方面的运营管理能力，判断公司的核心价值与成长能力，选择具有清晰的成长战略、良好经营状况、在技术、品牌、产品或服务等方面具备领先优势的上市公司股票。另一方面，本基金将通过对上市公司的盈利能力、成长和股本扩张能力以及现金流管理水平的定量分析，选择优良财务状况且预期未来两年上市公司主营业务收入增长率或上市公司利润增长率高于国内 A 股市场

平均水平的上市公司股票。

港股通标的股票，作为本基金的投资范围，其选股原则与非港股通标的股票无异，主要通过公司基本面研究选取具备宽阔护城河、竞争优势巨大、行业前景明确的标的股票来配置。

本基金将根据法律法规和监管机构的要求，制定存托凭证投资策略，关注发行人有关信息披露情况，关注发行人基本面情况、市场估值等因素，通过定性分析和定量分析相结合的办法，参与存托凭证的投资，谨慎决定存托凭证的权重配置和标的选择。

#### （四）资产支持证券投资策略

本基金将分析资产支持证券的资产特征，估计违约率和提前偿付比率，并利用收益率曲线和期权定价模型，对资产支持证券进行估值。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。

#### （五）国债期货投资策略

本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对债券交易市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

### 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）本基金投资债券资产的比例不低于基金资产的 80%，投资股票资产的比例不高于基金资产的 20%（其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%）；

（2）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，保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

(3) 本基金持有一家公司发行的证券（A 股和港股通标的股票合并计算），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（A 股和港股通标的股票合并计算），不超过该证券的 10%，完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金品种可以不受此条款规定的比例限制；

(5) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；

(6) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

(7) 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；

(8) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

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

(10) 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；

(11) 本基金资产总值不超过基金资产净值的 140%；

(12) 本基金债券正回购资金余额或逆回购资金余额不得超过其上一日基金资产净值的 40%，进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

(13) 本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述比例限制；

(14) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值

的 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合该比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

（15）本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

（16）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%；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%；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）应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定；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%；

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

（18）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除第（2）、（9）、（14）、（15）项外，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，但法律法规、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变更上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准。

## 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) 从事可能使基金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) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- (6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

法律、行政法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则基金管理人在履行适当程序后，本基金投资不再受相关限制。

### 3、关联交易

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

### 五、业绩比较基准

本基金业绩比较基准 = 中债综合财富（总值）指数收益率  $\times$  95% + 沪深 300 指数收益率  $\times$  5%

中债综合指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制的具有代表性的债券市场指数，样本债券涵盖的范围全面，具有广泛的市场代表性，涵盖主要交易市场（银行间市场、交易所市场等）、不同发行主体（政府、企业等）和期限（长期、中期、短期等），能够很好地反映中国债券市场总体价格水平和变动趋势。

沪深 300 指数是由中证指数有限公司编制的反映 A 股市场整体走势的指数，该指数从上海和深圳证券交易所中选取 300 只交易活跃、代表性强的 A 股作为成份股，是目前中国证券市场中市值覆盖率高、代表性强且公信力较好的股票指数。

根据本基金的投资范围和投资比例，选用上述业绩比较基准目前能够客观、合理地反映本基金的风险收益特征。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数，本基

金可以变更业绩比较基准，但基金管理人应与基金托管人协商一致，在履行适当程序后报中国证监会备案，并在中国证监会规定媒介上及时公告，无需召开基金份额持有人大会审议。

## 六、风险收益特征

本基金是债券型基金，其预期风险与收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

本基金投资于港股通标的股票时，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

## 七、基金管理人代表基金行使股东或债权人权利的处理原则及方法

1、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东或债权人权利，保护基金份额持有人的利益；

2、不谋求对上市公司的控股；

3、有利于基金财产的安全与增值；

4、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

## 八、侧袋机制的实施和投资运作安排

当基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，根据最大限度保护基金份额持有人利益的原则，基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制，无需召开基金份额持有人大会审议。侧袋机制实施期间，基金的各项投资运作指标和基金业绩指标应当以主袋账户资产为基准。基金管理人原则上应当在侧袋机制启用后 20 个交易日内完成对主袋账户投资组合的调整，因资产流动性受限等中国证监会规定的情形除外。

侧袋机制实施期间，本部分约定的投资组合比例、投资策略、组合限制、业绩比较基准、风险收益特征等约定仅适用于主袋账户。

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

## 九、基金投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人根据本基金合同规定，复核了本投资组合报告，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取自本基金 2022 年第 1 季度报告，所载数据截至 2022 年 3 月 31 日，本报告中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	1,386,494,450.80	91.09
	其中：债券	1,386,494,450.80	91.09
	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	64,531,376.27	4.24
	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	56,656,734.68	3.72
8	其他资产	14,468,593.49	0.95
9	合计	1,522,151,155.24	100.00

#### 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

##### (1) 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有境内股票。

##### (2) 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	96,483,406.19	6.78
2	央行票据	-	-
3	金融债券	228,020,856.43	16.02
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	153,392,978.86	10.78
5	企业短期融资券	380,275,041.10	26.72
6	中期票据	430,268,604.38	30.23
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	98,053,563.84	6.89
9	其他	-	-
10	合计	1,386,494,450.80	97.41

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	112206015	22交通银行CD015	1,000,000	98,053,563.84	6.89
2	019658	21国债10	391,910	39,722,548.07	2.79
3	101556015	15青交投MTN001(7年期)	300,000	31,793,230.68	2.23
4	1780042	17鄂高投债	300,000	31,722,205.48	2.23
5	101764013	17焦作投资MTN001	300,000	30,965,219.18	2.18

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资  
 明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明  
 细

本基金本报告期末未持有权证。

9、 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(1) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

(2) 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

10、 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(1) 本期国债期货投资政策

本基金在进行国债期货投资时，根据风险管理原则，以套期保值为目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

(2) 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险指标说明
----	----	----------	---------	-----------	--------

-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计（元）					-
国债期货投资本期收益（元）					-56,874.00
国债期货投资本期公允价值变动（元）					-

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

### （3）本期国债期货投资评价

本基金投资国债期货以套期保值为目的，并较好地实现了套期保值的功能。

## 11、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出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责的情形。

本基金投资的前十名证券的发行主体在报告编制日前一年内受到处罚的情形如下：

1) 本基金投资的前十名证券之一“22 交通银行 CD015”的发行主体交通银行股份有限公司因违规行为受到中国银行保险监督管理委员会及中国人民银行处罚；

2) 本基金投资的前十名证券之一“19 中金公司金融债 01”的发行主体中国国际金融股份有限公司因违规行为受到中国人民银行处罚。

基金管理人认为，上述处罚未对相关证券的投资价值构成实质性负面影响。本基金对上述证券的投资决策程序符合基金管理人内部投资管理制度的规定。

### （2）本基金本报告期末投资股票。

### （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	-

5	应收申购款	14,468,593.49
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	14,468,593.49

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细  
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明  
本基金本报告期末未持有股票。

(6) 投资组合报告附注的其他文字描述部分  
由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## 第十部分 基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

下述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。本基金基金合同生效日为 2021 年 7 月 21 日，基金业绩截至 2022 年 3 月 31 日。

本基金自基金合同生效以来的业绩表现如下：

### 一、本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

#### 中泰稳固周周购 12 周滚动债 A：

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
2021年7月21日 （基金合同生效日）至2021年12月31日	1.56%	0.01%	1.78%	0.07%	-0.22%	-0.06%
2022年1月1日至 2022年3月31日	0.79%	0.02%	-0.03%	0.10%	0.82%	-0.08%
2021年7月21日 （基金合同生效日）至2022年3月31日	2.36%	0.02%	1.76%	0.08%	0.60%	-0.06%

#### 中泰稳固周周购 12 周滚动债 C：

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
2021年7月21日 （基金合同生效日）至2021年12月31日	1.43%	0.01%	1.78%	0.07%	-0.35%	-0.06%



2022年1月1日至2022年3月31日	0.70%	0.02%	-0.03%	0.10%	0.73%	-0.08%
2021年7月21日 (基金合同生效日)至2022年3月31日	2.14%	0.02%	1.76%	0.08%	0.38%	-0.06%

二、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

中泰稳固周周购 12 周滚动债 A:

中泰稳固周周购12周滚动债A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2021年07月21日-2022年03月31日)



中泰稳固周周购 12 周滚动债 C:

中泰稳固周周购12周滚动债C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2021年07月21日-2022年03月31日)



---

---

## 第十一部分 基金的财产

### 一、基金资产总值

基金资产总值是指基金拥有的各类证券及票据价值、银行存款本息和基金应收款项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注册登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

### 四、基金财产的保管和处分

本基金财产独立于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人、基金注册登记机构和基金销售机构以其自有的财产承担其自身的法律责任，其债权人不得对本基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。除依法律法规和《基金合同》的规定处分外，基金财产不得被处分。

基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。基金管理人管理运作基金财产所产生的债权，不得与其固有资产产生的债务相互抵销；基金管理人管理运作不同基金的基金财产所产生的债权债务不得相互抵销。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

## 第十二部分 基金资产估值

### 一、估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券、期货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

基金所拥有的股票、债券、资产支持证券、国债期货合约、银行存款本息、应收款项、其他投资等资产及负债。

### 三、估值原则

基金管理人在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，应符合《企业会计准则》、监管部门有关规定。

（一）对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会计准则规定的例外情况外，应将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

（二）对不存在活跃市场的投资品种，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

（三）如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25%以上的，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 四、估值方法

##### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

（1）交易所上市的有价证券（包括股票等），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）交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种（《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当日的估值净价进行估值；

（3）交易所上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种（《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当日的唯一估值净价或推荐估值净价进行估值；

（4）交易所上市交易的可转换债券以每日收盘价作为估值全价；

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

##### 2、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，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）在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、

首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3、本基金投资存托凭证的估值核算，依照境内上市交易的股票执行。

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

5、同一证券同时在两个或两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。

6、同业存单按估值日第三方估值机构提供的估值净价估值；选定的第三方估值机构未提供估值价格的，按成本估值。

7、本基金投资的国债期货合约，一般以估值当日的结算价进行估值，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。

8、估值计算中涉及港币或其他外币币种对人民币汇率的，将依据下列信息提供机构所提供的汇率为基准：当日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率的中间价，或其他可以反映公允价值的汇率进行估值。

9、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。

10、当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。

11、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，按照基金管理人对外予以公布。

## 五、估值程序

1、各类基金份额净值是按照每个工作日闭市后，各类基金资产净值除以当日该类基金份额的余额数量计算，精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入。基金管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人于每个工作日计算基金资产净值及各类基金份额净值，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，将各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。

## 六、估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当任一类基金份额的基金份额净值小数点后 4 位以内(含第 4 位)发生估值错误时，视为基金份额净值错误。若造成损失，由基金管理人先行赔付，基金管理人按差错情形，有权向其他当事人追偿。

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、或注册登记机构、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，需要修改基金注册登记机构交易数据的，由基金注册登记机构进行更正，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）某类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）各类基金份额的基金份额净值计算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，并报中国证监会备案。

（3）当基金份额净值计算错误给基金和基金份额持有人造成损失需要进行赔偿时，基金管理人和基金托管人应根据实际情况界定双方承担的责任，经确认后按以下条款进行赔偿：

①本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，与本基金有关的会计问题，如经双方在平等基础上充分讨论后，尚不能达成一致时，按基金管理人的建议执行，由此给基金份额持有人和基金财产造成的损失，由基金管理人负责赔付。

②若基金管理人计算的基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告，由此给基金份额持有人造成损失的，应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金，就实际向投资者或基金支付的赔偿金额，基金管理人与基金托管人按照过错程度各自承担相应的责任。

③如基金管理人和基金托管人对基金份额净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对，尚不能达成一致时，为避免不能按时公布基金份额净值的情形，以基金管理人的计算结果对外公布，由此给基金份额持有人和基金造成的损失，由基金管理人负责赔付。

④由于基金管理人提供的信息错误（包括但不限于基金申购或赎回金额等），进而导致基金份额净值计算错误而引起的基金份额持有人和基金财产的损失，由基金管理人负责赔付。

（4）前述内容如法律法规或监管机构另有规定的，从其规定处理。

#### 七、暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券、期货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、当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上的，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停估值；

4、法律法规、中国证监会和基金合同认定的其他情形。

#### 八、基金净值的确认

基金资产净值和各类基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金资产净值和各类基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金净值予以公布。

#### 九、特殊情况的处理

1、基金管理人或基金托管人按基金合同规定的估值方法的第 9 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/期货经营机构、证券/期货交易所及登记结算公司发送的数据错误等，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。

#### 十、实施侧袋机制期间的基金资产估值

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

## 第十三部分 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的孰低数。

### 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，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，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，基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按除权后的各类基金份额净值自动转为该类基金份额进行再投资，因红利再投资所得的份额与原份额适用相同的运作期起始日；若基金份额持有人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后各类基金份额净值均不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、本基金各类基金份额在费用收取上不同，其对应的可供分配利润可能有所不同；本基金同一类别的每份基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

### 四、收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截至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收益分配总额，依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

## 六、基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由基金份额持有人自行承担。当基金份额持有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，基金注册登记机构可将各类基金份额持有人的现金红利自动转为该类基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。

## 七、实施侧袋机制期间的收益分配

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

## 第十四部分 基金费用与税收

### 一、基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、C 类基金份额的销售服务费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券/期货交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、基金的开户费用、账户维护费用；
- 10、因投资港股通标的股票而产生的各项合理费用；
- 11、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 0.30% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。基金管理人与基金托管人核对无误后，由基金托管人根据与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。基金管理人与基金托管人核对无误后，由基金托管人根据与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

### 3、C 类基金份额的销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.30% 的年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。基金管理人与基金托管人核对无误后，由基金托管人根据与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，基金管理人代收后再按照相关协议支付给各销售机构。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类”中第 4—11 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

### 三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

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

### 四、实施侧袋机制期间的基金费用

本基金实施侧袋机制的，与侧袋账户有关的费用可以从侧袋账户中列支，但应待侧袋账户资产变现后方可列支，有关费用可酌情收取或减免，但不得收取侧袋账户的管理费，详见本招募说明书“侧袋机制”章节或相关公告。

#### 五、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。基金财产投资的相关税收，由基金份额持有人承担，基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

---

---

## 第十五部分 基金的会计与审计

### 一、基金会计政策

1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；

2、基金的会计年度为公历年度的 1 月 1 日至 12 月 31 日；基金首次募集的会计年度按如下原则：如果《基金合同》生效少于 2 个月，可以并入下一个会计年度披露；

3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；

4、会计制度执行国家有关会计制度；

5、本基金独立建账、独立核算；

6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；

7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以约定方式确认。

### 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符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所及其注册会计师对本基金年度报告中的财务会计报告进行审计。

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依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。



## 第十六部分 基金的信息披露

一、本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《流动性风险管理规定》、《基金合同》及其他有关规定。相关法律法规关于信息披露的规定发生变化时，本基金从其最新规定。

### 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、法人和非法人组织。

本基金信息披露义务人以保护基金份额持有人利益为根本出发点，按照法律法规和中国证监会的规定披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性、完整性、及时性、简明性和易得性。

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过符合中国证监会规定条件的全国性报刊（以下简称“规定报刊”）及《信息披露办法》规定的互联网网站（以下简称“规定网站”）等媒介披露，并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

三、本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

- 1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；
- 2、对证券投资业绩进行预测；
- 3、违规承诺收益或者承担损失；
- 4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构；
- 5、登载任何自然人、法人和非法人组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；
- 6、法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。

四、本基金公开披露的信息应采用中文文本。如同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证不同文本的内容一致。不同文本之间发生歧义的，以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

## 五、公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

（一）基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议、基金产品资料概要

1、《基金合同》是界定《基金合同》当事人的各项权利、义务关系，明确基金份额持有人大会召开的规则及具体程序，说明基金产品的特性等涉及基金投资者重大利益的事项的法律文件。

2、基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。《基金合同》生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在规定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。

3、基金托管协议是界定基金托管人和基金管理人在基金财产保管及基金运作监督等活动中的权利、义务关系的法律文件。

4、基金产品资料概要是基金招募说明书的摘要文件，用于向投资者提供简明的基金概要信息。《基金合同》生效后，基金产品资料概要的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金产品资料概要，并登载在规定网站及基金销售机构网站或营业网点；基金产品资料概要其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金产品资料概要。

5、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三日前，将基金份额发售公告、基金招募说明书提示性公告和《基金合同》提示性公告登载在规定报刊上，将基金份额发售公告、基金招募说明书、基金产品资料概要、《基金合同》和《托管协议》登载在规定网站上，并将基金产品资料概要登载在基金销售机构网站或营业网点；基金托管人应当同时将《基金合同》、基金托管协议登载在规定网站上。

（二）基金份额发售公告

基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于规定媒介上。

### （三）《基金合同》生效公告

基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日在规定媒介上登载《基金合同》生效公告。

### （四）基金净值信息

《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周在规定网站披露一次各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过规定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日的各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。

基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在规定网站披露半年度和年度最后一日的各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。

### （五）基金份额申购、赎回价格

基金管理人应当在《基金合同》、招募说明书等信息披露文件上载明各类基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资者能够在基金销售机构网站或营业网点查阅或者复制前述信息资料。

### （六）基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告

基金管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载在规定网站上，并将年度报告提示性公告登载在规定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计。

基金管理人应当在上半年结束之日起两个月内，编制完成基金中期报告，将中期报告登载在规定网站上，并将中期报告提示性公告登载在规定报刊上。

基金管理人应当在季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，将季度报告登载在规定网站上，并将季度报告提示性公告登载在规定报刊上。

《基金合同》生效不足 2 个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。

如报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额 20% 的情形，为保障其他投资者的权益，基金管理人至少应当在定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告

期内持有份额变化情况及本基金的特定风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

基金管理人应当在基金年度报告和中期报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。

基金管理人应当在基金定期报告中披露报告期内特定资产处置进展情况，披露报告期末特定资产可变现净值或净值区间的，应同时注明不作为特定资产最终变现价格的承诺。

#### （七）临时报告

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当依照《信息披露办法》的有关规定编制临时报告书，并登载在规定报刊和规定网站上。

前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件：

- 1、基金份额持有人大会的召开及决定的事项；
- 2、《基金合同》终止、基金清算；
- 3、转换基金运作方式、基金合并；
- 4、更换基金管理人、基金托管人、基金注册登记机构、基金改聘会计师事务所；
- 5、基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；
- 6、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- 7、基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人变更实际控制人；
- 8、基金募集期延长或提前结束募集；
- 9、基金管理人的高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；
- 10、基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十；基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十；
- 11、涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁；
- 12、基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到

重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；

13、基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易事项，但中国证监会另有规定的除外；

14、基金收益分配事项；

15、管理费、托管费、销售服务费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；

16、任一类基金份额净值计价错误达该类基金份额净值百分之零点五；

17、本基金进入开放期，开始办理申购、赎回；

18、本基金发生巨额赎回并延缓支付赎回款项或延期办理；

19、本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；

20、发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；

21、调整本基金的份额类别设置；

22、基金推出新业务或服务；

23、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；

24、基金信息披露义务人认为可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的其他事项或中国证监会规定和基金合同约定的其他事项。

#### （八）澄清公告

在基金合同期限内，任何公共媒介中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动的，以及可能损害基金份额持有人权益的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会。

#### （九）清算报告

基金合同终止的，基金管理人应当依法组织基金财产清算小组对基金财产进行清算并作出清算报告。基金财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

#### （十）基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

#### （十一）投资港股通标的股票信息披露

基金管理人应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露参与港股通交易的相关情况。若中国证监会另有规定的，从其规定。

#### （十二）投资资产支持证券信息披露

基金管理人应在本基金中期报告及年度报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细。

基金管理人应在本基金季度报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期末按市值占基金净资产比例大小排序的前 10 名资产支持证券明细。

#### （十三）投资国债期货信息披露

基金管理人应在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露国债期货交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示国债期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标等。

#### （十四）实施侧袋机制期间的信息披露

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

#### （十五）中国证监会规定的其他信息。

### 六、信息披露事务管理

基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度，指定专门部门及高级管理人员负责管理信息披露事务。

基金信息披露义务人公开披露基金信息，应当符合中国证监会相关基金信息披露内容与格式准则等法规的规定。

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、各类基金份额净值、各类基金份额申购赎回价格、基金定期报告、更新的招募说明书、基金产品资料概要、基金清算报告等相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人进行书面或电子确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定报刊中选择披露信息的报刊。基金管理人、基金托管人应当向中国证监会基金电子披露网站报送拟披露的基金信息，并保证相关报送信息的真实、准确、完整、及时。

基金管理人、基金托管人除依法在指定媒介上披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒介披露信息，但是其他公共媒介不得早于指定媒介披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

基金管理人、基金托管人除按法律法规要求披露信息外，也可着眼于为投资者决策提供有用信息的角度，在保证公平对待投资者、不误导投资者、不影响基金正常投资操作的前提下，自主提升信息披露服务的质量。具体要求应当符合中国证监会及自律规则的相关规定。前述自主披露如产生信息披露费用，该费用不得从基金财产中列支。

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，法律法规另有规定的从其规定。

#### 七、信息披露文件的存放与查阅

依法必须披露的信息发布后，基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将基金信息置备于各自住所，供社会公众查阅、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相关信息：

- 1、不可抗力；
- 2、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 3、法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情况。

## 第十七部分 侧袋机制

### 一、侧袋机制的实施条件、实施程序

当基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，根据最大限度保护基金份额持有人利益的原则，基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制，无需召开基金份额持有人大会。基金管理人应当在启用侧袋机制当日报中国证监会及公司所在地中国证监会派出机构备案。

启用侧袋机制当日，基金管理人应以基金份额持有人的原有账户份额为基础，确认基金份额持有人的相应侧袋账户份额。

### 二、侧袋机制实施期间的基金运作安排

#### （一）基金份额的申购与赎回

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

#### 1、侧袋账户

侧袋机制实施期间，基金管理人不得办理侧袋账户的申购、赎回和转换业务。基金份额持有人申请申购、赎回或转换侧袋账户基金份额的，该申购、赎回或转换申请将被拒绝。

#### 2、主袋账户

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

#### （二）基金的投资

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

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

#### （三）基金的费用

侧袋机制实施期间，侧袋账户资产不收取管理费。



基金管理人可以将与侧袋账户有关的费用从侧袋账户资产中列支，但应待特定资产变现后方可列支。

#### （四）基金的收益分配

侧袋机制实施期间，在主袋账户份额满足基金合同收益分配条件的情形下，基金管理人可对主袋账户份额进行收益分配。侧袋账户不进行收益分配。

#### （五）基金的信息披露

##### 1、基金净值信息

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

##### 2、定期报告

基金管理人应当在基金定期报告中披露报告期内特定资产处置进展情况，披露报告期末特定资产可变现净值或净值区间的，该净值或净值区间并不代表特定资产最终的变现价格，不作为基金管理人对特定资产最终变现价格的承诺。

##### 3、临时报告

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

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

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

#### （六）特定资产处置清算

基金管理人将按照基金份额持有人利益最大化原则，采取将特定资产予以处置变现等方式，及时向侧袋账户份额持有人支付对应款项。

#### （七）侧袋的审计

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

三、本部分关于侧袋机制的相关规定，凡是直接引用法律法规或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人经与基金托管人协商一致并履行适当程序后，在对基金份额持有人利益无实质

性不利影响的前提下，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

## 第十八部分 风险揭示

### 一、市场风险

市场风险是指由于经济、政治、社会等环境因素的变化对证券价格造成的影响，其主要包括政策风险、经济周期风险、利率风险、上市公司经营风险、购买力风险、再投资风险。

1、政策风险：政策风险指政府各种经济和非经济政策的变化给公司所管理的基金资产带来的风险。政策风险包括：货币政策、财政政策、产业政策、税收政策、进出口政策、证券市场监管政策等国家政策的变化引发的市场价格波动，对公司所管理的基金资产带来的风险。

2、经济周期风险：宏观经济运行具有周期性的特点，宏观经济的运行状况将直接影响上市公司的经营、盈利情况。基金所投资的证券市场随着宏观经济运行状况的变化而变化，本基金的收益水平也会随之波动，从而产生风险。

3、利率风险：金融市场利率的波动会导致证券市场波动和收益率的变动，从而给基金的投资带来风险。利率直接影响着债券的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润，更影响着基于利率基础的各种利率产品。对于股票投资而言，利率的变化将导致证券市场资金供求状况、上市公司的融资成本和利润水平等发生变化，同时改变市场参与者对于后市利率变化方向及幅度的预期，这将直接影响证券价格发生变化，进而影响本基金的收益水平。

4、上市公司经营风险：上市公司的经营状况受多种因素影响，如市场前景、行业竞争、管理能力、财务状况、人员素质等因素都会导致公司盈利发生变化。如果基金所投资的上市公司经营不善，其股票价格可能下跌，或股息、红利减少，从而导致基金投资收益下降，从而给基金的投资带来风险。

5、购买力风险：购买力风险又称通货膨胀风险，基金的收益主要通过现金的形式来分配，而现金可能因为通货膨胀、货币贬值导致购买力下降，从而造成投资人实际收益水平下降。

6、再投资风险：再投资获得的收益又被称作利息的利息，这一收益取决于再投资时的市场利率水平和再投资的策略。未来市场利率的变化可能会引起再投资收益的不确定性并可能影响到基金投资策略的顺利实施。

## 二、信用风险

指金融工具的一方到期无法履行约定义务致使本基金遭受损失的风险。本基金的信用风险主要来源于金融工具的发行者或是交易对手不能履行约定义务的行为。无论是整体市场投资者的信用偏好变化，还是基金具体投资债券和上市公司的信用恶化，都会对本基金的回报带来负面影响。另外，信用评级调整也会带来相应风险。当信用评级机构调低本基金所持有的债券的信用级别时，债券的价格会下跌，从而导致本基金的收益下降。

## 三、运作管理风险

1、管理风险：指在基金管理运作过程中，由于基金管理人的知识、经验、判断、决策等主观因素的限制而影响其对信息的占有以及对经济形势、证券价格走势的判断而产生的风险，或者由于基金管理人内部控制不完善而导致基金财产损失的风险。

2、交易风险：指在基金投资交易过程中由于各种原因造成的风险。

3、运作风险：由于运营系统、网络系统、计算机或交易软件等发生技术故障等突发情况而造成的风险，或者由于操作过程中的疏忽和错误而产生的风险。

4、道德风险：指业务人员道德行为违规产生的风险，包括由内幕交易、违规操作、欺诈行为等原因造成的风险。

## 四、流动性风险

流动性风险包括两类。一是指在市场中的投资操作由于市场的深度限制或由于市场剧烈波动而导致投资交易无法实现或不能以当前合理的价格实现，从而可能为基金带来投资损失的风险。二是指开放式基金由于申购赎回要求可能导致流动资金不足的风险。

### （一）本基金拟投资市场、行业及资产的流动性风险

1、本基金投资于国内依法发行上市的债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换公司债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、国债期货、股票（包含主板、中小板、创业板、存托凭证及其他依法发行上市的股票）、港股通标的股票、现金以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

1) 本基金的投资市场主要为证券交易所、全国银行间债券市场等流动性较好的规范型交易场所，主要投资对象为具有良好流动性的金融工具，同时本基金基于分散投资的原则在个券方面未有高集中度的特征，在正常市场环境下本基金的流动性良好。

2) 从投资限制上看，本基金基金合同约定：“本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%”，本基金流动性受限资产的比例设置符合《流动性风险管理规定》。

2、资产支持证券只能通过特定的渠道进行转让交易，存在市场交易不活跃导致的流动性风险。

基金管理人将密切关注各类资产及投资标的的交易活跃程度与价格的连续性情况，评估各类资产及投资标的占基金资产的比例并进行动态调整，以满足基金运作过程中的流动性要求，应对流动性风险。

综上所述，本基金拟投资市场、行业及资产的流动性良好，流动性风险相对可控。

## （二）本基金的申购、赎回安排

本基金自基金合同生效之日起 3 个月内开始办理申购业务，之后本基金将每周集中开放申购。对于每份基金份额，每个运作期到期日，基金份额持有人可提出赎回申请。如果基金份额持有人在当期运作期到期日未申请赎回，则自该运作期到期日下一日起该基金份额进入下一个运作期。

为切实保护存量基金份额持有人的合法权益，遵循基金份额持有人利益优先原则，本基金管理人将合理控制基金份额持有人集中度，审慎确认申购赎回业务申请，包括但不限于：

1、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。

2、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。

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

项。

提示投资人注意本基金的申购赎回安排和相应的流动性风险，合理安排投资计划。

### （三）巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

1、当基金管理人认为支付基金份额持有人的赎回申请有困难或认为因支付基金份额持有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前一工作日基金总份额的 20% 的前提下，可对其余赎回申请延缓支付赎回款项。

2、在发生巨额赎回，且单个基金份额持有人赎回申请超过前一估值日基金总份额 40% 的情形下，对单个基金份额持有人超过前一估值日基金总份额 40% 以上的赎回申请，基金管理人可以延期办理赎回。对该单个基金份额持有人 40% 以内（含 40%）的赎回申请按照基金合同约定的正常赎回程序办理，或按照本招募说明书“第八部分基金份额的申购与赎回”中的“十、巨额赎回的情形及处理方式/2、巨额赎回的处理方式/（2）延缓支付赎回款项”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。对于未能赎回部分，该基金份额持有人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回，如基金份额持有人在提交赎回申请时未作明确选择，基金份额持有人未能赎回部分作自动延期赎回处理。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该类别的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。

### （四）备用的流动性风险管理工具的实施情形、程序及对投资者的潜在影响

基金管理人经与基金托管人协商，在确保投资者得到公平对待的前提下，可依照法律法规及基金合同的约定，综合运用各类流动性风险管理工具，对赎回申请进行适度调整，作为特定情形下基金管理人流动性风险管理的辅助措施。备用的流动性风险管理工具的实施情形包括：

- 1、发生基金合同规定的暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形；
- 2、基金发生巨额赎回；
- 3、基金发生巨额赎回，且单个基金份额持有人超过基金总份额 40% 以上的赎回申请的情形；

4、发生基金合同规定的暂停估值的情形；

5、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定；

6、法律法规规定、中国证监会认定或基金合同约定的其他情形。

实施备用流动性风险管理工具的决策程序依照基金管理人流动性风险管理制度的规定办理。基金管理人应时刻防范可能产生的流动性风险，对流动性风险进行日常监控，切实保护持有人的合法权益。

采取备用流动性风险管理工具，可能对投资人造成无法赎回、赎回延期办理、赎回款项延期支付、赎回时承担冲击成本产生资金损失等影响。

## 五、本基金特定风险

1、本基金是债券型基金，本基金投资债券资产的比例不低于基金资产的 80%，投资股票资产的比例不高于基金资产的 20%（其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%），股票市场和债券市场的波动均会对本基金的净值产生影响。

### 2、资产支持证券投资风险

本基金的投资范围包括资产支持证券，它是一种债券性质的金融工具，其向投资者支付的本息来自于基础资产池产生的现金流或剩余权益。与股票和一般债券不同，资产支持证券不是对某一经营实体的利益要求权，而是对基础资产池所产生的现金流和剩余权益的要求权，是一种以资产信用为支持的证券。资产支持证券存在信用风险、利率风险、提前偿付风险、操作风险和法律风险等。

### 3、通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于港股通标的股票的风险

本基金的投资范围包括内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的港股通标的股票，除与其他投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临以下特有风险，包括但不限于：

#### （1）投资于香港证券市场的特有风险

（A）香港证券市场与内地证券市场规则差异的风险。香港证券市场与内地证券市场存在诸多差异，本基金参与港股通交易需遵守内地与香港相关法律、行

政法规、部门规章、规范性文件和业务规则，对香港证券市场有所了解。以上情形可能增加本基金的投资风险。

（B）股价波动较大的风险。港股股票可能出现因公司基本面变化、第三方研究分析报告的观点、异常交易情形等原因引起股价较大波动。此外，港股市场实行 T+0 回转交易机制，且个股涨跌幅不设限制，加之香港市场结构性产品和衍生品种类相对丰富以及做空机制的存在，港股股价受到意外事件影响可能表现出更为剧烈的股价波动，由此增加本基金净值的波动风险。

（C）中小市值公司投资风险。中小市值公司存在业绩不稳定、股价波动性较大、市场流动性较差等风险，若本基金投资中小市值股票，本基金的投资风险可能增加。

（D）股份数量、股票面值大幅变化的风险。部分港股上市公司基本面变化大，股票价格低，可能存在大比例折价供股或配股、频繁分拆合并股份的行为，投资者持有的股份数量、股票面值可能发生大幅变化，由此可能增加本基金的投资风险。

（E）停牌风险。与内地市场相比，香港市场股票停牌制度存在一定差异，港股股票可能出现长时间停牌现象，由此可能增加本基金的投资风险。

（F）直接退市风险。与内地市场相比，香港市场股票交易没有退市风险警示、退市整理等安排，相关股票存在直接退市的风险。港股股票一旦退市，本基金将面临无法继续通过港股通买卖相关股票的风险。此外，港股通股票退市后，中国证券登记结算有限责任公司通过香港结算继续为本基金提供的退市股票名义持有人服务可能会受限。以上情况可能增加本基金的投资风险。

（G）交收制度带来的风险。香港证券市场与内地证券市场在证券资金的交收期安排上存在差异，香港证券市场的交收期为 T+2 日，卖出资金回到本基金人民币账户的周期比内地证券市场要长，此外港股的交收可能因香港出现台风或黑色暴雨等发生延迟交易。因此，本基金可能面临卖出港股后资金不能及时到账，而造成支付赎回款日期比正常情况延后而带来流动性风险。

## （2）通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的特有风险

（A）港股通规则变动带来的风险。本基金将通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港市场，在市场进入、投资额度、可投资对象、税务政策



等方面都有一定的限制，而且此类限制可能会不断调整，这些限制因素的变化可能对本基金进入或退出当地市场造成障碍，从而对投资收益以及正常的申购赎回产生直接或间接的影响。

（B）港股通股票范围受限及动态调整的风险。本基金可以通过港股通买卖的股票存在一定的范围限制，且港股通股票名单会动态调整。对于被调出的港股通股票，自调整之日起，本基金将不得再行买入。以上情形可能对本基金带来不利影响。

（C）基金净值波动风险。在内地与香港股票市场交易互联互通机制下，只有内地和香港两地均为交易日且能够满足结算安排的交易日才为港股通交易日，存在港股通交易日不连贯的情形，而导致基金所持的港股组合在后续港股通交易日开市交易中集中体现市场反应而造成其价格波动骤然增大，进而导致本基金所持港股组合在资产估值上出现波动增大的风险。

（D）交易失败及交易中断的风险。在内地与香港股票市场交易互联互通机制下，港股通交易存在每日额度限制，本基金可能面临每日额度不足而交易失败的风险。若香港联交所与内地交易所的证券交易服务公司之间的报盘系统或者通信链路出现故障，可能导致 15 分钟以上不能申报和撤销申报的交易中断风险；

（E）无法进行交易的风险。香港出现台风、黑色暴雨或者联交所规定的其他情形时，香港证券市场将可能停市，本基金将面临在停市期间无法进行港股交易的风险；出现内地证券交易服务公司认定的交易异常情况时，将可能暂停提供部分或者全部港股通服务，本基金将面临在暂停服务期间无法进行港股通交易的风险。

（F）汇率风险。在内地与香港股票市场交易互联互通机制下，港股的买卖是以港币报价、人民币支付，本基金承担港币对人民币汇率波动的风险；同时，由于在交易时间内提交订单依据的港币买入参考汇率和卖出参考汇率，并不等于最终结算汇率，最终结算汇率为相关机构日终确定的数值。此外，若因汇率大幅波动等原因，可能会导致本基金的账户透支风险。因此，本基金面临汇率波动的不确定性风险，由此可能增加本基金的风险。

（G）交易价格受限的风险。港股通股票不设置涨跌幅限制，但根据联交所业务规则，适用市场波动调节机制的港股通股票的买卖申报可能受到价格限制。

此外，对于适用收市竞价交易的港股通股票，收市竞价交易时段的买卖申报也将受到价格限制。以上情形可能增加本基金的投资风险。

（H）港股通制度下对公司行为的处理规则带来的风险。本基金因所持香港证券市场股票权益分派、转换、上市公司被收购等情形或者异常情况，所取得的港股通股票以外的香港联交所上市证券，只能通过港股通卖出，但不得买入；因港股通股票权益分派或者转换等情形取得的香港联交所上市股票的认购权利在联交所上市的，可以通过港股通卖出，但不得行权；因港股通股票权益分派、转换或者上市公司被收购等所取得的非联交所上市证券，可以享有相关权益，但不得通过港股通买入或卖出。本基金存在因上述规则，利益得不到最大化甚至受损的风险。

（I）结算风险。香港结算机构可能因极端情况存在无法交付证券和资金的结算风险；另外港股通境内结算实施分级结算原则，本基金可能面临以下风险：因结算参与人未完成与中国结算的集中交收，导致本基金应收资金或证券被暂不交付或处置；结算参与人对本基金出现交收违约导致本基金未能取得应收证券或资金；结算参与人向中国结算发送的有关本基金的证券划付指令有误的导致本基金权益受损；其他因结算参与人未遵守相关业务规则导致本基金利益受到损害的情况。

### 3) 其他可能的风险

除上述风险外，本基金投资内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的香港证券市场股票，还可能面临的其他风险，包括但不限于：

（A）本基金的开放日为上海证券交易所、深圳证券交易所的交易日，若本基金参与港股通交易且该工作日为非港股通交易日时，则基金管理人可根据实际情况决定本基金是否开放申购、赎回及转换业务，届时投资人可能面临无法进行申购或赎回的风险。

（B）因港股通交易当日额度使用完毕而暂停或停止接受买入申报，或者发生因港股通交易当日额度使用完毕而暂停或停止接受买入申报，或者发生证券交易服务公司等机构认定的交易异常情况并决定暂停提供部分或者全部港股通服务，或者发生其他影响通过股票市场交易互联互通机制进行正常交易的情形，本基金可能发生拒绝或暂停申购，暂停赎回或延缓支付赎回款的情形，可能影响投

资人的申购以及份额持有人的赎回。

4) 本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股，基金资产并非必然投资港股。

### 3、国债期货投资风险

本基金的投资范围包括国债期货，国债期货的投资可能面临市场风险、基差风险、流动性风险。市场风险是因期货市场价格波动使所持有的期货合约价值发生变化的风险。基差风险是期货市场的特有风险之一，是指由于期货与现货间价差的波动，影响套期保值或套利效果，使之发生意外损益的风险。流动性风险可分为两类：一类为流通量风险，是指期货合约无法及时以所希望的价格建立或了结头寸的风险，此类风险往往是由市场缺乏广度或深度导致的；另一类为资金量风险，是指资金无法满足保证金要求，使得所持有的头寸面临被强制平仓的风险。

### 4、投资存托凭证的风险

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

### 5、特殊运作期安排的风险

本基金对于每份基金份额设置一定的滚动锁定期，锁定期内该基金份额不可申请赎回。每个运作期到期日，基金份额持有人方可提出赎回申请。如果基金份额持有人在当期运作期到期日未申请赎回，则自该运作期到期日下一日起该基金份额进入下一个运作期。故投资者面临在运作期到期日前无法赎回基金份额的风险，以及错过当期运作期到期日未能赎回基金份额而进入下一运作期的风险。

## 6、运作期期限或有变化的风险

本基金名称为中泰稳固周周购 12 周滚动持有债券型证券投资基金，但是考虑到周末、法定节假日等原因，每份基金份额的实际运作期期限或有不同，可能长于或短于 12 周。

7、本基金采用证券公司交易模式和结算模式，即本基金将通过基金管理人选定的证券经营机构进行场内交易，并由选定的证券经营机构作为结算参与人代理本基金进行结算，该种交易结算模式可能存在信息系统风险、操作风险、效率降低风险、交易结算风险、投资信息安全保密风险等风险。

1) 信息系统风险。证券公司交易结算模式的交易系统架构较为复杂，相比传统模式，交易链路增加了很多对接证券公司系统的实时子系统，一旦系统出现故障，将对正常的场内投资交易业务造成较大影响。

2) 操作风险。本基金的场内投资采用证券公司交易结算模式，场外投资仍然采用传统模式。两种模式对投资和交易的系统设置要求不同，因此在系统设置上的操作工作将同步增加，同时也增加了操作风险。

3) 效率降低风险。本基金采用证券公司交易模式和结算模式，与传统模式相比可能会导致基金投资运作等方面效率的降低。具体表现为：

基金管理人通过投资管理系统向证券经营机构专用交易系统发送交易指令，由证券经营机构交易系统验资验券、通过交易规则检查后向交易所申报交易指令，然后将交易所的成交回报推送给基金管理人投资管理系统，增加了交易下单数据传输环节，可能会降低投资交易效率；另外场内和场外交易需分别使用不同的交易系统完成，日间的系统切换也可能会降低投资交易效率。

资金存管需遵循客户交易结算资金三方存管规则，在参与交易委托前需要进行银转证资金调拨，增加了资金划拨的工作量，同时场内场外交易切换中的在途资金将无法使用，可能会降低资金使用效率。

估值清算时，基金管理人、基金托管人则须从证券经营机构获取交易结算数据，同时还需获取证券经营机构的对账单数据用于处理清算尾差，增加了数据获取的工作量，在一定程度上影响了业务处理的效率。

4) 交易结算风险。在证券公司交易模式和结算模式下，基金管理人使用其投资管理系统进行投资管理，与证券经营机构的交易系统进行对接，通过专用交

易单元进行报盘交易。若出现通讯线路网络不稳定、系统响应慢等问题，将影响交易速度和报盘效率，存在相应风险；证券经营机构负责基金的场内交易的清算交收，由于交易品种繁多，业务交互复杂，可能会出现未合理安排头寸，影响交收进度的情况，存在交易结算风险。

5) 投资信息安全保密风险。在证券公司交易模式和结算模式下，证券经营机构负责本基金的交易数据和账户信息的安全保障，接触交易信息、持仓信息、其他敏感信息的业务人员及岗位较多，虽然证券经营机构对客户信息和商业机密的保密均有明确的要求和责任追究规定，但是仍然可能存在投资信息安全保密风险。

#### 六、本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险

本基金法律文件投资章节有关风险收益特征的表述是基于投资范围、投资比例、证券市场普遍规律等做出的概述性描述，代表了一般市场情况下本基金的长期风险收益特征。销售机构（包括基金管理人直销机构和其他销售机构）根据相关法律法规对本基金进行风险评价，不同的销售机构采用的评价方法也不同，因此销售机构的风险等级评价与基金法律文件中风险收益特征的表述可能存在不同，投资人在购买本基金时需按照销售机构的要求完成风险承受能力与产品风险之间的匹配检验。

#### 七、启用侧袋机制的风险

若本基金启用侧袋机制，实施侧袋机制期间，基金管理人将暂停披露侧袋账户的基金份额净值，并不办理侧袋账户的申购、赎回和转换业务。因特定资产的变现时间具有不确定性，最终变现价格也具有不确定性并且有可能大幅低于启用侧袋机制时的特定资产的估值，基金份额持有人可能因此面临损失。

#### 八、其他风险

除以上主要风险以外，基金还可能遇到以下风险：

1、因技术因素而产生的风险，如基金在交易时所采用的电脑系统可能因突发事件或不可抗原因出现故障，由此给基金投资带来风险；

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

3、因人为因素而产生的风险，如基金经理违反职业操守的道德风险，以及因内幕交易、欺诈行为等产生的违规风险；

4、人才流失风险，公司主要业务人员的离职如基金经理的离职等可能会在一定程度上影响工作的连续性，并可能对基金运作产生影响；

5、因业务竞争压力可能产生的风险；

6、因不可预见或不可抗力因素导致的风险，如战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金资产的损失，影响基金收益水平；

7、其他意外导致的风险。

## 第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产清算

### 一、《基金合同》的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于法律法规规定和基金合同约定可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，自决议生效后依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

### 二、《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：

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

### 三、基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内成立基金财产清算小组，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、符合《中华人民共和国证券法》规定的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

#### 4、基金财产清算程序：

- (1) 《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；
- (2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- (3) 对基金财产进行估值和变现；

(4) 制作清算报告；

(5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；

(6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；

(7) 对基金剩余财产进行分配。

5、基金财产清算的期限为 6 个月，但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的，清算期限相应顺延。

#### 四、清算费用

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

#### 五、基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

#### 六、基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经符合《中华人民共和国证券法》规定的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，基金财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

#### 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 20 年以上，法律法规另有规定的从其规定。



## 第二十部分 基金合同内容摘要

### 一、基金管理人、基金托管人、基金份额持有人的权利、义务

#### （一）基金管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

（1）依法募集资金；

（2）自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；

（3）依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；

（4）销售基金份额；

（5）按照规定召集基金份额持有人大会；

（6）依据《基金合同》及有关法律、法规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律、法规规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

（7）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

（8）选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；

（9）担任或委托其他符合条件的机构担任基金注册登记机构办理基金注册登记业务并获得《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；

（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/期货经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；

(16) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换和非交易过户等业务规则；

(17) 在法律法规和基金合同规定的范围内决定调整基金费率结构和收费方式；

(18) 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、赎回和注册登记手续；

(2) 办理基金备案手续；

(3) 自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；

(4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

(5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；

(6) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

(7) 依法接受基金托管人的监督；

(8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回的价格；

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(10) 编制季度报告、中期报告和年度报告；

(11) 严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

(12) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露，因向审计、法律等外部专业顾问及应监管部门要求提供的情况除外；

(13) 按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有

人分配基金收益；

（14）按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

（15）依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

（16）按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 20 年以上，法律法规另有规定的从其规定；

（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。

（二）基金托管人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：

（1）自《基金合同》生效之日起，依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产；

（2）依《基金合同》约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用；

（3）监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人违反《基金合同》及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

（4）根据相关市场规则，为基金开设证券账户、资金账户等投资所需账户，为基金办理场外证券交易资金清算；

（5）提议召开或召集基金份额持有人大会；

（6）在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

（7）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：

（1）以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

（2）设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；

（3）建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

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

（5）保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

（6）按规定开设基金财产的资金账户、证券账户等投资所需账户，按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

（7）保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有

规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露，因向审计、法律等外部专业顾问及应监管部门要求提供的情况除外；

（8）复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、各类基金份额净值、各类基金份额申购、赎回价格；

（9）办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

（10）对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行；如果基金管理人未执行《基金合同》规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

（11）保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 20 年以上，法律法规另有规定的从其规定；

（12）从基金管理人或其委托的注册登记机构处接收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业监督管理机构，并通知基金管理人；

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

（20）按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿；

（21）执行生效的基金份额持有人大会的决议；

（22）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

### （三）基金份额持有人

基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受，基金投资者自依据《基金合同》取得基金份额，即成为本基金份额持有人和《基金合同》的当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为《基金合同》当事人并不以在《基金合同》上书面签章或签字为必要条件。

除法律法规另有规定或基金合同另有约定外，同一类别每份基金份额具有同等的合法权益。

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：

- （1）分享基金财产收益；
- （2）参与分配清算后的剩余基金财产；
- （3）依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；
- （4）按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会；
- （5）出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- （6）查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- （7）监督基金管理人的投资运作；
- （8）对基金管理人、基金托管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；
- （9）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：

- （1）认真阅读并遵守《基金合同》、招募说明书等信息披露文件；
- （2）了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；
- （3）关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；
- （4）交纳基金认购、申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；
- （5）在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的

有限责任；

- (6) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；
- (7) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- (8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
- (9) 提供基金管理人和监管机构依法要求提供的信息，以及不时的更新和补充，并保证其真实性；
- (10) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## 二、基金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。除法律法规另有规定或基金合同另有约定外，基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

本基金份额持有人大会不设日常机构。

### （一）召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会（法律法规、《基金合同》或中国证监会另有规定的除外）：

- (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) 调整基金管理人、基金托管人的报酬标准、提高销售服务费率；
- (6) 变更基金类别；
- (7) 本基金与其他基金的合并；
- (8) 变更基金投资目标、范围或策略；
- (9) 变更基金份额持有人大会程序；
- (10) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- (11) 单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；
- (12) 对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；
- (13) 法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额

持有人大会的事项。

2、在法律法规规定和《基金合同》约定的范围内且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

- （1）法律法规要求增加的基金费用的收取；
- （2）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、调低销售服务费率或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变更收费方式；
- （3）增加或调整本基金的基金份额类别设置；
- （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）基金管理人、注册登记机构、基金销售机构在法律法规规定或中国证监会许可的范围内调整有关认购、申购、赎回、转换、基金交易、非交易过户、定期定额投资、转托管等业务规则；
- （7）在中国证监会允许的范围内推出新业务或服务；
- （8）按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

## （二）会议召集人及召集方式

1、除法律法规规定或《基金合同》另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。

3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集，并自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

4、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当



自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

5、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

6、基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

（三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

- （1）会议召开的时间、地点和会议形式；
- （2）会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；
- （3）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
- （4）授权委托证明的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；
- （5）会务常设联系人姓名及联系电话；
- （6）出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- （7）召集人需要通知的其他事项。

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人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表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。

#### （四）基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式或法律法规、监管机构允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托证明委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或基金托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

（1）亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的注册登记资料相符；

（2）经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）。若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效的基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之一（含三分之一）。

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式或基金合同约定的其他方式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址或系统。通讯开会应以书面方式或基金合同约定的其他方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

（1）会议召集人按《基金合同》约定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告；

(2) 召集人按基金合同约定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对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表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取表决意见的，不影响表决效力；

(3) 本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）；若本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）基金份额的持有人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见；

(4) 上述第(3)项中直接出具表决意见的基金份额持有人或受托代表他人出具表决意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具表决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，并与注册登记机构记录相符。

3、在法律法规和监管机构允许的情况下，本基金的基金份额持有人亦可采用其他非书面方式授权其代理人出席基金份额持有人大会，具体方式在会议通知中列明。

4、在会议召开方式上，在法律法规和监管机构允许的情况下，本基金亦可采用其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开基金份额持有人大会，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。表决方式上，基金份额持有人也可以采用网络、电话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载明。

## (五) 议事内容与程序

### 1、议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如《基金合同》的重大修改、决定终止《基金合同》、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合

并、法律法规及《基金合同》规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开前及时公告。

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

## 2、议事程序

### （1）现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第（七）条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名（或单位名称）、身份证明文件号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）和联系方式等事项。

### （2）通讯开会

在通讯开会的情况下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后 2 个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

### （六）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。涉及实施侧袋机制期间的表决权安排，详见本部分第十条“实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定”。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1、一般决议，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过方为有效；除下列第 2 项所规定的须以

特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。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，除非在计票时监督员及公证机关均认为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基金份额持有人身份文件的表决视为有效出席的基金份额持有人，表面符合会议通知规定的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，但应当计入出具表决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。

#### （七）计票

##### 1、现场开会

（1）如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

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

（3）如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有怀疑，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

（4）计票过程应由公证机关予以公证，基金管理人或基金托管人拒不出席

大会的，不影响计票的效力。

## 2、通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

### （八）生效与公告

基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

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

（九）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和监管规则的部分，如将来法律法规和监管规则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。

### （十）实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定

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

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

2、现场开会的到会者在权益登记日代表的基金份额不少于本基金在权益登

记日相关基金份额的二分之一（含二分之一）；

3、通讯开会的直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日相关基金份额的二分之一（含二分之一）；

4、在参与基金份额持有人大会投票的基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日相关基金份额的二分之一、召集人在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内就原定审议事项重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）相关基金份额的持有人参与或授权他人参与基金份额持有人大会投票；

5、现场开会由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人；

6、一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过；

7、特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过。

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

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

### 三、基金合同解除和终止的事由、程序

#### （一）《基金合同》的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于法律法规规定和基金合同约定可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自生效后执行，

自决议生效后依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

（二）《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：

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

（三）基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内成立基金财产清算小组，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、符合《中华人民共和国证券法》规定的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

4、基金财产清算程序：

- （1）《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；
- （2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- （3）对基金财产进行估值和变现；
- （4）制作清算报告；
- （5）聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- （6）将清算报告报中国证监会备案并公告；
- （7）对基金剩余财产进行分配。

5、基金财产清算的期限为 6 个月，但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的，清算期限相应顺延。

（四）清算费用



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

#### （五）基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

#### （六）基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经符合《中华人民共和国证券法》规定的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，基金财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

#### （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 20 年以上，法律法规另有规定的从其规定。

### 四、争议的处理

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，应经友好协商解决。如经友好协商未能解决的，则任何一方有权将争议提交位于上海市的上海国际经济贸易仲裁委员会，按照其届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

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

《基金合同》受中国（为本基金合同之目的，不含香港特别行政区、澳门特别行政区、台湾地区，下同）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》正本一式三份，除上报有关监管机构一份外，基金管理人、基金托管人各持有一份，每份具有同等的法律效力。

《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，但应以基金合同的正本为准。

## 第二十一部分 托管协议内容摘要

### 一、基金托管协议当事人

#### （一）基金管理人

基金管理人：中泰证券（上海）资产管理有限公司

住所：上海市黄浦区延安东路 175 号 24 楼 05 室

办公地址：上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 1002-1003 室

法定代表人：黄文卿

成立日期：2014 年 8 月 13 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监许可[2014]355 号

开展公开募集证券投资基金管理业务批准文号：中国证监会证监许可[2017]2342 号

组织形式：其他有限责任公司

注册资本：壹亿陆仟陆佰陆拾陆万元整

存续期限：持续经营

#### （二）基金托管人

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：郑杨

成立日期：1992 年 10 月 19 日

基金托管业务资格批准机关：中国证监会

基金托管业务资格文号：证监基金字[2003]105 号

组织形式：股份有限公司（上市）

注册资本：人民币 293.52 亿元

经营期限：永久存续

### 二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

#### （一）基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权

1.基金托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定，对下述基金投资范围、投资对象进行监督。

本基金将投资于以下金融工具：

本基金投资于国内依法发行上市的债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换公司债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、国债期货、股票（包含主板、中小板、创业板、存托凭证及其他依法发行上市的股票）、港股通标的股票、现金以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

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。

《基金合同》已明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应严格按照基金托管人要求的格式提供投资品种，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。

本基金不得投资于相关法律、法规、部门规章及《基金合同》禁止投资的投资工具。

2.基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投融资比例进行监督：

（1）按法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金的投资资产配置比例为：

本基金的投资组合比例为：本基金投资债券资产的比例不低于基金资产的 80%，投资股票资产的比例不高于基金资产的 20%（其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%）。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，应当保持不低于基金资产净值的 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

国债期货及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

当法律法规的相关规定变更时，基金管理人在履行适当程序后可对上述资产配置比例进行适当调整。

因基金规模或市场变化等因素导致投资组合不符合上述规定的，基金管理人应在合理的期限内调整基金的投资组合，以符合上述比例限定。法律法规另有规

定时，从其规定。

如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。

(2) 根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金投资组合遵循以下投资限制：

1) 本基金投资债券资产的比例不低于基金资产的 80%，投资股票资产的比例不高于基金资产的 20%（其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%）；

2) 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，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

3) 本基金持有一家公司发行的证券（A 股和港股通标的股票合并计算），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（A 股和港股通标的股票合并计算），不超过该证券的 10%，完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金品种可以不受此条款规定的比例限制；

5) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；

6) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

7) 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；

8) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

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

10) 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；

11) 本基金资产总值不超过基金资产净值的 140%;

12) 本基金债券正回购资金余额或逆回购资金余额不得超过其上一日基金资产净值的 40%，进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期;

13) 本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%; 本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%; 完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述比例限制;

14) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%; 因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合该比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;

15) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致;

16) 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%; 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%; 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）应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定; 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%;

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

18) 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。

基金托管人对上述指标的监督义务，仅限于监督由基金管理人管理且由基金托管人托管的全部公募基金是否符合上述比例限制。《基金法》及其他有关法律法规或监管部门取消上述限制的，履行适当程序后，基金不受上述限制。

(3) 法律法规允许的基金投资比例调整期限

除上述第 2)、9)、14)、15) 项投资限制外, 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, 但法律法规、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对上述投资限制、投资禁止等作出强制性调整的, 本基金应当按照法律法规或监管部门的规定执行; 如法律法规或监管部门修改或调整上述投资限制、投资禁止性规定, 且该等调整或修改属于非强制性的, 基金管理人有权在履行适当程序后按照法律法规或监管部门调整或修改后的规定执行, 并向投资者履行信息披露义务。如本基金增加投资品种, 投资限制以法律法规和中国证监会的规定为准。

基金管理人应在出现可预见资产规模大幅变动的情况下, 至少提前 2 个工作日正式向基金托管人发函说明基金可能的变动规模和公司应对措施, 便于基金托管人实施交易监督。

(4) 相关法律、法规或部门规章规定的其他比例限制。

基金托管人对基金投资的监督和检查自本托管协议生效之日起开始。

3. 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投资禁止行为进行监督:

根据法律法规的规定及《基金合同》的约定, 本基金禁止从事下列行为:

- (1) 承销证券;
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保;
- (3) 从事可能使基金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) 向其基金管理人、基金托管人出资;
- (6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;

(7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

如法律、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可不受上述规定的限制。

4.基金托管人依据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定对于基金关联交易限制进行监督。

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有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

如法律、法规或《基金合同》有关于基金从事关联交易的规定，基金管理人和基金托管人事先相互提供与本机构有控股关系的股东、与本机构有其他重大利害关系的公司名单及有关关联方发行的证券清单，加盖公章并书面提交。双方有责任确保关联交易名单的真实性、准确性、完整性，并负责及时将更新后的名单发送给对方。名单变更发送后，经对方确认后，新的关联交易名单开始生效。如果基金托管人或基金管理人隐瞒其关联方发行的证券，并造成基金资产损失的，由隐瞒方承担责任。

5.基金托管人依据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。

基金托管人根据基金管理人提供的银行间债券市场交易对手名单进行监督。基金管理人有责任控制交易对手的资信风险，由于交易对手的资信风险引起的损失，基金管理人应当负责向相关责任人追偿。

6.基金托管人依据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定，对基金银行存款业务进行监督。

基金管理人应当加强对基金投资银行存款风险的评估与研究，严格测算与控制投资银行存款的风险敞口，针对不同类型存款银行建立相关投资限制制度。对于基金投资的银行存款，由于存款银行发生信用风险事件而造成损失时，先由基



金管理人负责赔偿，之后有权要求相关责任人进行赔偿。如果基金托管人在运作过程中遵循有关法律法规的规定和《基金合同》的约定监督流程，则对于由于存款银行信用风险引起的损失，不承担赔偿责任。

#### 7. 基金托管人对基金投资流通受限证券的监督

如下所指“流通受限证券”与本协议以及基金合同所指“流动性受限资产”定义存在不同。就流动性受限资产定义，请参照基金合同的“第二部分 释义”部分。

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。

(2) 基金管理人投资非公开发行股票，应制订流动性风险处置预案并经其董事会批准。风险处置预案应包括但不限于因投资流通受限证券需要解决的基金投资比例限制失调、基金流动性困难以及相关损失等问题的应对解决措施，以及有关异常情况的处置。基金管理人应在首次投资流通受限证券前向基金托管人提供基金投资非公开发行股票的相关流动性风险处置预案。

基金管理人对本基金投资流通受限证券的流动性风险负责，确保对相关风险采取积极有效的措施，在合理的时间内有效解决基金运作的流动性问题。如因基金巨额赎回或市场发生剧烈变动等原因而导致基金现金周转出现困难时，基金管理人应保证提供足额现金确保基金的支付结算。对本基金因投资流通受限证券导致的流动性风险，基金托管人不承担任何责任。如因基金管理人原因导致本基金出现损失的，基金托管人不承担任何责任。

(3) 基金管理人应在基金投资非公开发行股票后两个交易日内，在中国证监会规定媒介披露所投资非公开发行股票的名称、数量、总成本、账面价值，以及总成本和账面价值占基金资产净值的比例、锁定期等信息。

有关基金投资的流通受限证券应保证登记存管在相关基金名下，基金管理人负责相关工作的落实和协调，并保证基金托管人能够正常查询。如因流通受限证券的登记存管不能保证基金托管人正常履行资产保管责任，有关此项基金资产存管的责任由基金管理人承担。

如基金管理人未遵守相关制度、流动性风险处置方案以及投资额度和比例限制要求，导致基金出现风险使乙方承担连带赔偿责任的，若基金托管人此前已切实履行监督职责的，基金管理人应赔偿基金托管人由此遭受的损失。

（4）本基金投资非公开发行股票，基金管理人应至少于执行投资指令之前两个工作日将有关资料书面提交基金托管人，并保证向基金托管人提供的有关资料真实、准确、完整。有关资料如有调整，基金管理人应及时提供调整后的资料。上述书面资料包括但不限于：

- 1) 中国证监会批准发行非公开发行股票的批准文件。
- 2) 有关非公开发行股票的发行数量、发行价格、锁定期等发行资料。
- 3) 基金拟认购的数量、价格、总成本、账面价值。
- 4) 本基金投资流通受限证券的投资额度和投资比例控制

5) 基金托管人应按照《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》规定，对基金管理人是否遵守法律法规进行监督，并审核基金管理人提供的有关书面信息。基金托管人认为上述资料可能导致基金出现风险的，有权要求基金管理人在投资流通受限证券前就该风险的消除或防范措施进行补充书面说明，并保留查看基金管理人风险管理部门就基金投资流通受限证券出具的风险评估报告等资料的权利。否则，基金托管人有权拒绝执行有关指令。因拒绝执行该指令造成基金财产损失的，基金托管人不承担任何责任，并有权报告中国证监会。

如基金管理人和基金托管人无法就上述问题达成一致，应及时上报中国证监会请求解决。基金托管人履行了本协议规定的监督职责后，不承担任何责任。

(5)相关法律法规对基金投资流通受限证券有新规定的，从其规定。

（二）基金托管人应根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进

行监督和核查。

（三）基金托管人发现基金管理人的投资运作及其他运作违反《基金法》、《基金合同》、基金托管协议等有关规定时，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在下一个工作日及时核对，并以书面形式向基金托管人发出回函，进行解释或举证。

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。

基金管理人应积极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的监督和核查，对基金托管人发出的书面提示，必须在规定时间内答复基金托管人并改正，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，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

若基金托管人发现基金管理人发出但未执行的投资指令或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，并报告中国证监会。基金管理人的上述违规失信行为给基金财产或基金份额持有人造成的损失，由基金管理人承担。

对于必须于估值完成后方可获知的监控指标或依据交易程序已经成交的投资指令，基金托管人发现该投资指令违反法律法规或者违反《基金合同》约定的，应当立即通知基金管理人，并报告中国证监会。

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。

基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠基金托管人根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍基金托管人进行有效监督，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

基金管理人对于基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括但不限于基金托管人是否安全保管基金财产、是否分别开设基金财产的资金账户和证券账户及投资所需其他账户、是否复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额

净值、是否根据基金管理人指令办理清算交收、进行相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

基金管理人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、无故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》、本托管协议及其他有关规定时，基金管理人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向基金管理人发出回函。在限期内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应报告中国证监会。基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应立即报告中国证监会和银行业监督管理机构，同时通知基金托管人限期纠正。

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。

基金托管人无正当理由，拒绝、阻挠基金管理人根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍基金管理人进行有效监督，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

##### （一）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.基金托管人应按本协议规定安全保管托管财产。未经基金管理人的指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何财产（基金托管人主动扣收的汇划费除外）。基金托管人不对处于自身实际控制之外的账户及财产承担责任。
- 3.基金托管人按照规定为托管的基金财产开设资金账户和证券账户及投资所需其他账户。
- 4.基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，与基金托管人的其他业务和其他基金的托管业务实行严格的分账管理，确保基金财产的完整与独立。
- 5.对于因基金认（申）购、基金投资过程中产生的应收财产，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

基金托管人处的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失，基金托管人对基金管理人的追偿行为应予以必要的协助与配合，但对基金财产的损失不承担责任。

## （二）募集资金的验证

募集期内销售机构按销售与服务代理协议的约定，将认购资金划入基金管理人在具有托管资格的商业银行开设的“基金募集专户”。该账户由基金管理人开立并管理。基金募集期满，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，由基金管理人聘请符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所进行验资，出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的 2 名以上（含 2 名）中国注册会计师签字方为有效。验资完成，基金管理人应将募集的属于本基金财产的全部资金划入基金托管人为基金开立的资产托管专户中，并确保划入的资金与验资金额相一致。基金托管人收到有效认购资金当日以书面形式确认资金到账情况，并及时将资金到账凭证传真给基金管理人，双方进行账务处理。

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事宜。

## （三）基金资产托管专户的开立和管理

基金托管人以基金的名义在其营业机构开设资产托管专户，并根据基金管理人合法合规的有效指令办理资金收付。基金管理人应根据法律法规及托管行的相关要求，提供开户所需的资料并提供其他必要协助。本基金的资产托管专户的预留印鉴的印章由基金托管人刻制、保管和使用。

本基金的一切货币收支活动，均需通过基金托管人或基金的资产托管专户进行。基金的资产托管专户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。除因本基金业务需要，基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立其他任何银行账户；亦不得使用以基金名义开立的银行账户进行本基金业务以外的活动。

资产托管专户的管理应符合《人民币银行结算账户管理办法》、《现金管理暂行条例》、《人民币利率管理规定》、《利率管理暂行规定》、《支付结算办法》以及银行业监督管理机构的其他有关规定。

#### （四）基金证券账户的开立和管理

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基金托管人与基金联名的证券账户。

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、变更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.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。

#### （五）证券资金账户的开立与管理

基金管理人以基金名义在基金管理人选择的证券经营机构营业网点开立证券资金账户。证券经营机构根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立证券资金账户，并按照该证券经营机构开户的流程和要求与基金管理人签订相关协议。

交易所证券交易资金采用第三方存管模式，即用于证券交易的结算资金全额存放在基金管理人为基金开立的证券资金账户中，场内的证券交易资金清算由基金管理人选择的证券经营机构负责。证券资金账户内的资金，只能通过证银转账方式将资金划转至基金托管账户，不得将资金划转至任何其他银行账户。基金托管人不负责办理场内的证券交易资金清算，也不负责保管证券资金账户内存放的资金。

#### （六）银行间市场债券托管和资金结算专户的开立和管理及市场准入备案

《基金合同》生效后，在符合监管机构要求的情况下，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、中央国债登记结算有限责任公司、银行间市场清算所股份有限公司的有关规定，以本基金的名义分别在中央国债登记结算有限责任公司、银行间市场清算所股份有限公司开立债券托管账户和资金结算账

户，并代表基金进行银行间市场债券交易的结算。基金托管人协助基金管理人完成银行间债券市场准入备案。

#### （七）其他账户的开设和管理

1、因业务发展而需要开立的其它账户，可以根据《基金合同》或有关法律、法规的规定，经基金管理人和基金托管人协商一致后，由基金托管人负责为基金开立。新账户按有关规则使用并管理。

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。

#### （八）基金投资银行存款账户的开立和管理

基金投资银行定期存款，基金管理人与基金托管人应比照相关规定，就本基金投资银行存款业务签订书面协议。

基金投资银行定期存款应由基金管理人与存款银行总行或其授权分行签订总体合作协议，并将资金存放于存款银行总行或其授权分行指定的分支机构。

存款账户必须以基金名义开立，账户名称为基金名称，存款账户开户文件上加盖预留印鉴及基金管理人公章。

本基金投资银行存款时，基金管理人应当与存款银行签订具体存款协议，明确存款的类型、期限、利率、金额、账号、对账方式、支取方式、账户管理等细则。

为防范特殊情况下的流动性风险，定期存款协议中应当约定提前支取条款。

基金所投资定期存款存续期间，基金管理人、基金托管人应当与存款银行建立定期对账机制，确保基金银行存款业务账目及核对的真实、准确。

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

基金财产投资的有关实物证券由基金托管人存放于基金托管人的保管库；其中实物证券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。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。属于基金托管人实际有效控制下的实物证券在基金托管人保管期间的损坏、灭失，由此产生的责任应由基金托管人承担。基金托管人对基金托管人以外机构实际有效控制或保管的实物证券、银行定期存款存单对应的财产不承担保管责

任。

#### （十）与基金财产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同的原件分别应由基金托管人、基金管理人保管。除本协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时，应保证基金一方持有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人在合同签署后 5 个工作日内通过专人送达、挂号邮寄等安全方式将合同原件送达基金托管人处。合同原件应存放于基金管理人和基金托管人各自文件保管部门 20 年以上。

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与合同原件核对一致的并加盖基金管理人公章的合同传真件或复印件，未经双方协商一致，合同原件不得转移。

### 五、基金资产净值计算、估值和会计核算

#### （一）基金资产净值的计算、复核的时间和程序

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。各类基金份额净值是指计算日各类基金资产净值除以该计算日该类基金份额总额后的数值。各类基金份额净值的计算保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，基金管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的，从其规定。

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，基金托管人复核、审查基金管理人计算的基金份额净值。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，仍无法达成一致意见的，按照基金管理人对基金净值信息的计算结果对外予以公布。每个工作日，基金管理人应对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或基金合同的规定暂停估值时除外。估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算业务指引》及其他法律、法规的规定。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的各类基金份额净值和基金资产净值并以双方认可的方式发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核后以双方认可的方式发送给基金管理人，由基金管理人按约定对外公布。

如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### （二）基金资产估值



估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算业务指引》及其他法律法规的规定。

当相关法律法规或《基金合同》规定的估值方法不能客观反映基金财产公允价值时，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

### （三）估值错误处理

1. 某类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. 各类基金份额的基金份额净值计算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，并报中国证监会备案。

3. 当基金份额净值计算错误给基金和基金份额持有人造成损失需要进行赔偿时，基金管理人和基金托管人应根据实际情况界定双方承担的责任，经确认后按以下条款进行赔偿：

（1）本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，与本基金有关的会计问题，如经双方在平等基础上充分讨论后，尚不能达成一致时，按基金管理人的建议执行，由此给基金份额持有人和基金财产造成的损失，由基金管理人负责赔付。

（2）若基金管理人计算的基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告，由此给基金份额持有人造成损失的，应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金额，就实际向投资者或基金支付的赔偿金额，基金管理人与基金托管人按照过错程度各自承担相应的责任。

（3）如基金管理人和基金托管人对基金份额净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对，尚不能达成一致时，为避免不能按时公布基金份额净值的情形，以基金管理人的计算结果对外公布，由此给基金份额持有人和基金造成的损失，由基金管理人负责赔付。

（4）由于基金管理人提供的信息错误（包括但不限于基金申购或赎回金额等），进而导致基金份额净值计算错误而引起的基金份额持有人和基金财产的损失，由基金管理人负责赔付。

4. 由于证券/期货经营机构、证券/期货交易所及登记结算公司发送的数据错

误、有关会计制度变化或由于其他不可抗力原因，致使基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是仍未能发现该错误而造成的基金份额净值计算错误，基金管理人、基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

5.基金管理人、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。

6.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。

#### （四）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、期货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.当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上的，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停估值；

4.法律法规、中国证监会和基金合同认定的其他情形。

#### （五）基金账册的建立

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

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

#### （六）基金定期报告的编制和复核

基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。月度报表的编制，应于每月终了后 5 个工作日内完成。

基金合同生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当

在 3 个工作日内，更新基金招募说明书并登载在规定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。基金管理人应在季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告并公告；在上半年结束之日起两个月内，编制完成基金中期报告并公告；在每年结束之日起三个月内，编制完成基金年度报告并公告。

基金管理人在月度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核；基金托管人应及时复核，并将复核结果及时书面通知基金管理人。基金管理人在季度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人应及时复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在中期报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到后应及时复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在年度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人应及时复核，并将复核结果书面通知基金管理人。

基金托管人在复核过程中，发现相关各方的报表存在不符时，基金管理人和基金托管人应共同查明原因，进行调整，调整以相关各方认可的账务处理方式为准。核对无误后，基金托管人在基金管理人提供的报告上加盖印鉴或者出具加盖托管业务部门业务章的复核意见书，相关各方各自留存一份。如果基金管理人与基金托管人不能于应当发布公告之日之前就相关报表达成一致，基金管理人有权按照其编制的报表对外发布公告，基金托管人有权就相关情况报中国证监会备案。

## 六、基金份额持有人名册的保管

基金管理人妥善保管的基金份额持有人名册，包括《基金合同》生效日、《基金合同》终止日、基金份额持有人大会权益登记日、每年 6 月 30 日、12 月 31 日的基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容必须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的基金注册登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，基金管理人应按照国家相关规则保管基金份额持有人名册。保管方式可以采用电子或文档的形式。保管期限为 20 年，法律法规或监管部门另有规定的除外。

在基金托管人编制中期报告和年度报告前，基金管理人应将每年 6 月 30 日、

12 月 31 日的基金持有人名册送交基金托管人，文件方式可以采用电子或文档的形式并且保证其的真实、准确、完整。基金托管人应妥善保管，不得将持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途。

#### 七、适用法律及争议解决方式

（一）本协议适用中华人民共和国法律（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），并从其解释。

（二）相关各方当事人同意，因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议，除经友好协商可以解决的，应提交上海国际经济贸易仲裁委员会，根据该会届时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点在上海，仲裁裁决是终局性的并对相关各方均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，相关各方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行《基金合同》和本托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

#### 八、托管协议的变更、终止与基金财产的清算

##### （一）托管协议的变更与终止

##### 1. 托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议的内容进行变更。变更后的托管协议，其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突，并需经基金管理人、基金托管人加盖公章或合同专用章以及双方法定代表人或授权代理人签字（或盖章）确认。基金托管协议的变更报中国证监会备案。

##### 2. 基金托管协议终止的情形

发生以下情况，本托管协议终止：

- （1）《基金合同》终止；
- （2）基金托管人解散、依法被撤销、破产或有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、破产或有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。

##### （二）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.在基金财产清算小组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照《基金合同》和本托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

3.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、符合《中华人民共和国证券法》规定的注册会计师、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。

4.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。

5.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。

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财产中支付。

7.基金财产按下列顺序清偿：

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

基金财产未按前款(1)－(3)项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

(三) 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符合《中华人民共和国证券法》规定的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，基金财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

#### （四）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 20 年以上，法律法规另有规定的从其规定。

## 第二十二部分 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。以下是主要的服务内容，基金管理人根据基金份额持有人的需要和市场的变化，有权增加、修改这些服务项目。

### 一、基金份额持有人交易资料的寄送服务

本基金成立后每次交易结束后，投资者可在 T+2 个工作日后通过销售机构的网点查询和打印确认单。

基金交易对账单的寄送频率为按季度寄送，每季度对基金份额持有人寄送一次对账单（要求不予寄送的除外）。季度对账单于每季度结束后 15 个工作日内以书面或电子邮件形式寄送，记录基金持有人最近一季度内所有认购、申购、赎回、修改分红方式等交易发生的时间、金额、数量、价格以及当前账户余额等。

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

通过定期定额投资计划，投资者可以通过固定的渠道，定期定额申购基金份额。定期定额投资计划的有关规则和开放时间另行公告。

### 三、客户中心电话服务

客户中心坐席提供每周 5 天、每天不少于 8 小时的坐席服务，投资者可以通过该热线获得业务咨询、信息查询、服务投诉、信息定制、资料修改等专项服务。

### 四、免费信息定制服务

基金客户可以通过拨打电话、发送邮件等方式定制每周基金净值、季度电子对账单等服务，基金管理人通过手机短信、电子邮件定期为客户发送所定制的信息。

### 五、客户投诉受理服务

投资者可以通过各销售机构网点柜台、客户呼叫中心人工热线、书信等方式对基金管理人和销售机构所提供的服务以及基金管理人的政策规定进行投诉。

## 六、联系基金管理人

1、网址：[www.ztzqzg.com](http://www.ztzqzg.com)

2、电子邮箱：[jiangay@ztzqzg.com](mailto:jiangay@ztzqzg.com)

3、客户服务热线：4008210808

4、客户服务传真：021-68883772

5、基金管理人办公地址：上海浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 1002-1003 室。

6、邮编：200120

七、如本招募说明书存在任何您/贵机构无法理解的内容，请通过上述方式联系基金管理人。请确保投资前，您/贵机构已经全面理解了本招募说明书。



## 第二十三部分 其他应披露事项

### 一、相关基金公告

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中泰稳固周周购12周滚动持有债券型证券投资基金基金合同生效公告	证券时报、中国证监会规定网站	2021-07-22
2	关于中泰稳固周周购12周滚动持有债券型证券投资基金开展申购费率优惠活动的公告	证券时报、中国证监会规定网站	2021-08-04
3	中泰稳固周周购12周滚动持有债券型证券投资基金开放日常申购、转换转入和定期定额投资业务公告	证券时报、中国证监会规定网站	2021-08-04
4	中泰证券（上海）资产管理有限公司关于旗下部分基金新增北京度小满基金销售有限公司为销售机构并参加费率优惠活动的公告	证券时报、中国证监会规定网站	2021-08-09
5	中泰证券（上海）资产管理有限公司关于旗下部分基金新增腾安基金销售（深圳）有限公司为销售机构并参加费率优惠活动的公告	证券时报、中国证监会规定网站	2021-08-16
6	中泰稳固周周购12周滚动持有债券型证券投资基金开放日常赎回和转换转出业务公告	证券时报、中国证监会规定网站	2021-09-30
7	中泰稳固周周购12周滚动持有债券型证券投资基金2021年第3季度报告	中国证监会规定网站	2021-10-27
8	中泰证券（上海）资产管理有限公司关于调整旗下部分基金网上直销最低认/申购金额的公告	证券时报、中国证监会规定网站	2022-01-10

9	关于中泰证券（上海）资产管理有限公司旗下部分证券投资基金开展直销渠道申购费率优惠活动的公告	证券时报、中国证监会规定网站	2022-01-14
10	中泰稳固周周购12周滚动持有债券型证券投资基金2021年第4季度报告	中国证监会规定网站	2022-01-20
11	中泰证券（上海）资产管理有限公司关于旗下部分基金新增交通银行股份有限公司为销售机构并参加费率优惠活动的公告	证券时报、中国证监会规定网站	2022-02-08
12	中泰证券（上海）资产管理有限公司关于调整旗下部分基金单笔最低赎回份额和最低持有份额数额限制的公告	证券时报、中国证监会规定网站	2022-02-17
13	中泰证券（上海）资产管理有限公司关于旗下部分基金新增华夏财富投资管理有限公司为销售机构并参加费率优惠活动的公告	证券时报、中国证监会规定网站	2022-02-24
14	中泰证券（上海）资产管理有限公司关于旗下部分基金新增上海利得基金销售有限公司为销售机构并参加费率优惠活动的公告	证券时报、中国证监会规定网站	2022-03-17
15	中泰稳固周周购12周滚动持有债券型证券投资基金2021年年度报告	中国证监会规定网站	2022-03-30
16	中泰证券（上海）资产管理有限公司关于旗下部分基金新增嘉实财富管理有限公司为销售机构并参加费率优惠活动的公告	证券时报、中国证监会规定网站	2022-04-19
17	中泰证券（上海）资产管理有限公司关于旗下部分基金新增招商银行股份有限公司为销售机构并参加费率优惠活动的公告	证券时报、中国证监会规定网站	2022-04-19

	有限公司招赢通平台为销售渠道并参加费率优惠活动的公告		
18	中泰稳固周周购12周滚动持有债券型证券投资基金2022年第1季度报告	中国证监会规定网站	2022-04-21

## 第二十四部分 招募说明书存放及查阅方式

本招募说明书存放在本基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所，投资人可在办公时间免费查阅；也可按工本费购买本招募说明书复制件或复印件，但应以招募说明书正本为准。基金管理人和基金托管人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

## 第二十五部分 备查文件

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

一、中国证监会关于准予中泰稳固周周购 12 周滚动持有债券型证券投资基金注册的批复文件

二、《中泰稳固周周购 12 周滚动持有债券型证券投资基金基金合同》

三、《中泰稳固周周购 12 周滚动持有债券型证券投资基金托管协议》

四、法律意见书

五、基金管理人业务资格批件、营业执照

六、基金托管人业务资格批件、营业执照

七、中国证监会要求的其他文件

中泰证券（上海）资产管理有限公司

2022 年 6 月