

# 西部利得添盈短债债券型证券投资基金

## 招募说明书（更新）

（2022年8月）

基金管理人：西部利得基金管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

二零二二年八月

## 【重要提示】

1、本基金的募集申请经中国证券监督管理委员会2017年11月10日证监许可【2017】2028号文准予西部利得得鑫债券型证券投资基金注册，并经中国证券监督管理委员会2018年12月6日证监许可【2018】2034号文准予西部利得得鑫债券型证券投资基金变更注册为西部利得添盈短债债券型证券投资基金。本基金的基金合同于2019年6月4日正式生效。

2、基金管理人保证《招募说明书》的内容真实、准确、完整。本《招募说明书》经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

3、本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的债券、货币市场工具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)，在正常市场环境下本基金的流动性风险适中。在特殊市场条件下，如证券市场的成交量发生急剧萎缩、基金发生巨额赎回以及其他未能预见的特殊情形下，可能导致基金资产变现困难或变现对证券资产价格造成较大冲击，发生基金份额净值波动幅度较大、无法进行正常赎回业务、基金不能实现既定的投资决策等风险。

本基金主要投资于短期债券和法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，投资者在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险。投资本基金可能遇到的风险包括：利率风险，本基金持有的信用品种违约带来的信用风险等；基金运作风险，包括由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理运作过程中产生的基金管理风险等。此外，本基金投资于短期债券的比例不低于非现金基金资产的80%，投资比例较高。如果债券市场出现整体下跌，本基金将无法完全避免债券市场系统性风险。

本基金以1.00元初始面值进行募集，在市场波动等因素的影响下，存在单位份额净值跌破1.00元初始面值的风险。本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于股票型基金和混合型基金。

当本基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，基金管理人履行相应程序后，可以启用侧袋机制，具体详见基金合同和本招募说明书的“侧袋机制”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。

4、本基金的业绩比较基准为中债综合财富（1年以下）指数收益率\*80%+一年期定期存款利率(税后)\*20%，但本基金的收益水平有可能不能达到或超过同期的目标收益率水平，

投资者面临获得低于目标收益率甚至亏损的风险。

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

6、基金的过往业绩并不预示其未来表现。

7、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。

8、投资有风险，投资人认购（申购）基金时应认真阅读本基金的招募说明书、基金合同及基金产品资料概要。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行负责。

本次招募说明书的更新内容中与托管相关的信息已经本基金托管人复核。所载内容截止日为2022年6月30日，基金投资组合报告和基金业绩表现截止至2022年6月30日（财务数据未经审计）。

## 目录

第一部分	绪言	1
第二部分	释义	2
第三部分	基金管理人	6
第四部分	基金托管人	17
第五部分	相关服务机构	20
第六部分	基金的募集	36
第七部分	基金合同的生效	37
第八部分	基金份额的申购与赎回	38
第九部分	基金的投资	48
第十部分	基金的财产	59
第十一部分	基金资产的估值	60
第十二部分	基金的收益与分配	64
第十三部分	基金费用与税收	66
第十四部分	基金的会计与审计	69
第十五部分	侧袋机制	70
第十六部分	基金的信息披露	73
第十七部分	风险揭示	78
第十八部分	基金合同的变更、终止与基金财产的清算	81
第十九部分	基金合同的内容摘要	83
第二十部分	基金托管协议的内容摘要	97
第二十一部分	对基金份额持有人的服务	110
第二十二部分	其他应披露的事项	111
第二十三部分	招募说明书存放及查阅方式	116
第二十四部分	备查文件	117

## 第一部分 绪言

《西部利得添盈短债债券型证券投资基金招募说明书》(以下简称“招募说明书”或“本招募说明书”)依照《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)以及《西部利得添盈短债债券型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”或“《基金合同》”)、《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》”)编写。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。

西部利得添盈短债债券型证券投资基金(以下简称“基金”或“本基金”)是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息,或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写,并经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)注册。基金合同是约定基金合同当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资者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。基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

投资有风险,投资者认购(或申购)基金时应认真阅读本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。

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。

## 第二部分 释义

在本招募说明书中，除非文义另有所指，下列词语具有以下含义：

- 1、基金或本基金：指西部利得添盈短债债券型证券投资基金
- 2、基金管理人：指西部利得基金管理有限公司
- 3、基金托管人：指平安银行股份有限公司
- 4、基金合同：指《西部利得添盈短债债券型证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充
- 5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《西部利得添盈短债债券型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
- 6、招募说明书或本招募说明书：指《西部利得添盈短债债券型证券投资基金招募说明书》及其更新
- 7、基金份额发售公告：指《西部利得添盈短债债券型证券投资基金基金份额发售公告》
- 8、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等
- 9、《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，2012 年 12 月 28 日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自 2013 年 6 月 1 日起实施，并经 2015 年 4 月 24 日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修改的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 10、《销售办法》：指中国证监会 2013 年 3 月 15 日颁布、同年 6 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 11、《信息披露办法》：指中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 12、《运作办法》：指中国证监会 2014 年 7 月 7 日颁布、同年 8 月 8 日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 13、《流动性风险管理规定》：指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订
- 14、中国证监会：指中国证券监督管理委员会
- 15、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行保险监督管理委员会
- 16、基金合同当事人：指受基金合同约束，根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人
- 17、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人
- 18、机构投资者：指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织

19、合格境外机构投资者：指符合现时有效的相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者

20、投资人：指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称

21、基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人

22、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务。

23、销售机构：指西部利得基金管理有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议，代为办理基金销售业务的机构

24、登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等

25、登记机构：指办理登记业务的机构。本基金的登记机构为西部利得基金管理有限公司或接受西部利得基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构

26、基金账户：指登记机构为投资人开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户

27、基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构办理认购、申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户

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

29、基金合同终止日：指基金合同规定的基金合同终止事由出现后，基金财产清算完毕，清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期

30、基金募集期：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过3个月

31、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

32、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

33、T日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日

34、T+n日：指自T日起第n个工作日（不包含T日），n为自然数

35、开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

36、开放时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

37、《业务规则》：指《西部利得基金管理有限公司开放式基金业务规则》，是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金登记方面的业务规则，由基金管理人和投资人共同遵守

38、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

39、申购：指基金合同生效后，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

40、赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同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

41、基金转换：指基金份额持有人按照基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金基金份额的行为

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

43、定期定额投资计划：指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期申购日、申购金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及受理基金申购申请的一种投资方式

44、巨额赎回：指本基金单个开放日，基金净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一开放日基金总份额的 10%

45、元：指人民币元

46、基金收益：指基金投资所得债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约

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

48、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

49、基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

50、基金资产估值：指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程

51、指定媒介：指中国证监会指定的用以进行信息披露的全国性报刊及指定互联网网站（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

52、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

53、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）、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

54、摆动定价机制：是指当本基金遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金



份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待

55、基金产品资料概要：指《西部利得添盈短债债券型证券投资基金基金产品资料概要》及其更新

56、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

57、特定资产：包括：（1）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；（2）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；（3）其他资产价值存在重大不确定性的资产

## 第三部分 基金管理人

### 一、基金管理人概况

名称：西部利得基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区耀体路 276 号 901 室-908 室

办公地址：上海市浦东新区耀体路 276 号晶耀商务广场 3 号楼 9 层

法定代表人：何方

成立时间：2010 年 7 月 20 日

注册资本：叁亿柒仟万元

存续期间：持续经营

联系人：陈眉媚

联系电话：（021）38572888

股权结构：

股东	出资额（万元）	出资比例
西部证券股份有限公司	18,870	51%
利得科技有限公司	18,130	49%
合计	37,000	100%

### 二、主要成员情况

#### 1、董事会成员

何方先生：董事长

何方先生，董事长，硕士研究生。毕业于清华大学五道口金融学院工商管理专业。20 年证券从业经历。历任汉唐证券资产管理部研究员、西部证券投资管理总部投资经理、西部证券投资管理总部副总经理、西部证券投资管理总部总经理、西部证券总经理助理兼上海第一分公司总经理。2010 年起任西部证券副总经理。2017 年 3 月至 9 月代为履行西部证券总经理职务。2017 年 9 月起任西部证券总经理。自 2019 年 3 月起任公司董事长。

贺燕萍女士：董事

贺燕萍女士，董事，硕士研究生，高级经济师。毕业于中国社会科学院研究生院，获经济学硕士学位，24 年证券从业经历。曾任北京市永安宾馆业务主管、华夏证券股份有限公司研究所客户部经理、中信建投证券股份有限公司机构销售部总经理助理、光大证券股份有限公司销售交易部副总经理、光大证券股份有限公司销售交易部总经理、光大证券资产管理有限公司总经理。2013 年 8 月起任国泰基金管理有限公司副总经理。自 2015 年 11 月起任公司总经理。

李兴春先生：董事

李兴春先生，董事，博士。毕业于南京大学，获管理科学与工程博士学位。曾先后就职于江西新余食品联合总公司、江西新余物资局、携程旅行网、富友证券有限责任公司和西部发展控股有限公司等。现任利得科技有限公司董事长兼总经理，山东晨鸣纸业集团股份有限公司副董事长兼执行董事，昆朋资产管理股份有限公司董事长兼总经理，华电国际电力股份有限公司独立董事。

曲莉女士：董事

曲莉女士，董事，硕士研究生。毕业于西北政法学院经济法专业。获法学硕士学位。曾任西部证券股份有限公司法律事务部副主任（主持工作）、风险管理部副总经理、风险管理部总经理、合规总监兼合规与法律事务部总经理，现任西部证券股份有限公司首席法律顾问兼法律事务部总经理。

吴弘先生：独立董事

吴弘先生，独立董事，本科学士。毕业于华东政法学院法律专业。曾任上海第一制药机械厂工人，上海光辉器材厂职员，现任华东政法大学教授、博士生导师。

张成虎先生：独立董事

张成虎先生，独立董事，博士研究生。毕业于西安交通大学工商管理专业。曾任陕西财经学院计算机站职员，陕西财经学院银行管理工程系助教、讲师、副系主任、副教授、教授，西安交通大学经济与金融学院银行信息管理系系主任、博士生导师、三级教授，现任西安交通大学经济与金融学院银行信息管理系二级教授，西安交通大学同花顺金融科技研究院院长。

吴海先生：独立董事

吴海先生，独立董事，硕士研究生。毕业于美国福坦莫大学国际工商管理专业。曾任航天部第三研究院 31 所职员，航天科技集团第三研究院高级工程师，航天科技集团第三研究院 303 所副处长、处长、副所长、副所长（正局级），青海省西宁市大通县市委常委、县委书记，青海省金融局党组织成员、副主任、副局长，青海省残疾人联合会党组成员、副理事长。现已退休。

## 2、监事会成员

刘彬先生：监事会主席

刘彬先生，监事会主席，毕业于北京大学光华管理学院产业经济学专业，获经济学博士学位。曾任中国证监会研究中心主任科员、办公室副处长、金融创新研究组副组长、金融创新研究组组长，中国华融资产管理股份有限公司上海自贸区分公司党委委员、总经理助理，海通创意资本管理有限公司副总经理，国泰君安创新投资有限公司董事总经理，国泰君安资本管理有限公司副总经理。现任西部利得基金管理有限公司监事会主席。

李嘉宁先生：股东监事

李嘉宁先生，股东监事。毕业于墨尔本大学信息技术专业，获硕士学位。曾任西安三元软件有限公司开发部项目经理，陕西金泰创业投资有限公司产品部员工，西部证券股份有限

公司稽核部助理审计师、信息技术审计岗，西部证券股份有限公司稽核部副总经理，现任西部证券股份有限公司职工监事、稽核部副总经理（临时主持部门工作），西部优势资本投资有限公司监事。

何晔女士：监事

何晔女士，监事。毕业于复旦大学应用数学专业。曾任友邦保险公司中国区呼叫中心副总经理，国泰基金管理有限公司客服部呼叫中心主管、客服部副总监（主持工作），现任公司电子商务部总经理。

徐蓉女士：监事

徐蓉女士，监事。毕业于上海财经大学会计专业，获硕士学位。曾任上海医药集团股份有限公司管培生，申银万国智富投资有限公司财务主管。历任公司财务主管、高级财务经理、财务部总经理助理、财务部副总经理、财务部副总经理（主持工作）。现任公司财务部总经理。

### 3、公司高级管理人员

贺燕萍女士：总经理

贺燕萍女士，总经理，硕士研究生，高级经济师。毕业于中国社会科学院研究生院，获经济学硕士学位，24年证券从业经历。曾任北京市永安宾馆业务主管、华夏证券股份有限公司研究所客户部经理、中信建投证券股份有限公司机构销售部总经理助理、光大证券股份有限公司销售交易部副总经理、光大证券股份有限公司销售交易部总经理、光大证券资产管理有限公司总经理。2013年8月起任国泰基金管理有限公司副总经理。自2015年11月起任公司总经理。

赵毅先生：督察长

赵毅先生，督察长，硕士研究生，毕业于加拿大卡尔加里大学工商管理硕士专业，26年证券从业经历。曾任北京大学社会科学处职员、北京市波姆红外技术公司总经理助理、华夏证券有限责任公司高级投资经理、华夏基金管理有限公司股票分析师、华夏基金管理有限公司风险管理部总经理助理。2015年12月加入西部利得基金管理有限公司，历任公司风险管理部总经理，自2016年9月起任公司督察长。

王宇先生：副总经理

王宇先生，副总经理、投资总监、公募投资部总经理。硕士研究生，毕业于南开大学金融学专业，16年证券从业经历。曾任上海银行股份有限公司交易员，光大证券股份有限公司投资经理，交银施罗德基金管理有限公司投资经理。自2016年9月加入西部利得基金管理有限公司，历任固定收益部副总监、专户投资部副总经理、专户投资部总经理、总经理助理。自2021年1月起任副总经理、投资总监、公募投资部总经理。

蔡晨研先生：副总经理

蔡晨研先生，副总经理、董事会秘书、工会主席。硕士研究生，毕业于复旦大学挪威管

理学院工商管理专业，22年证券从业经历。曾任上海浦东发展银行科员，SKF（中国）投资有限公司管理培训生，海康人寿保险有限公司财务主管，美联信金融租赁有限公司财务主管，阿卡商务咨询（上海）有限公司财务总监。自2010年9月加入西部利得基金管理有限公司，历任总经理助理、财务部总经理、营销服务部总经理、产品设计部总经理，现任副总经理、董事会秘书、工会主席。

孙威先生：副总经理

孙威先生，副总经理。本科学士，毕业于中国人民大学金融学专业，29年证券从业经历。曾任华夏证券股份有限公司职员、投资经理，中信建投证券股份有限公司投资经理、机构销售部投资顾问，光大证券股份有限公司销售交易部执行董事，川财证券有限责任公司机构业务部副总经理（主持工作），国泰基金管理有限公司市场副总监兼养老金业务部总监。2015年11月加入西部利得基金管理有限公司，历任北京分公司总经理、总经理助理、市场部总经理、战略发展部（筹）总经理、深圳分公司总经理、财富管理部（筹）总经理。现任副总经理。

艾书苹先生：首席信息官

艾书苹先生，首席信息官。硕士研究生，毕业于美国得克萨斯大学达拉斯分校计算机专业，16年证券从业经历。曾任美国达拉斯西南医学中心高级网络与系统工程师，如新（中国）日用保健品有限公司高级系统管理员，美国国际集团下属美亚财产保险公司高级系统分析师，2008年5月起担任国海富兰克林基金管理有限公司信息技术部副总经理、信息技术部总经理，2014年9月起担任上投摩根基金管理有限公司信息技术部总监，于2018年10月加入西部利得基金管理有限公司，历任信息技术部总经理，自2019年6月起作为公司总办成员，分管信息技术部和基金运营部工作。现任公司首席信息官。

#### 4、本基金基金经理

刘心峰先生，公募固定收益部副总经理、基金经理，英国曼彻斯特大学理学硕士。10年证券从业年限。曾任中德安联人寿保险有限公司交易员、华泰柏瑞基金管理有限公司交易员。2016年11月加入西部利得基金管理有限公司，现任公募固定收益部副总经理、基金经理。自2017年2月起担任西部利得天添富货币市场基金、西部利得合享债券型证券投资基金的基金经理，自2017年8月起担任西部利得天添益货币市场基金的基金经理，自2019年6月起担任西部利得添盈短债债券型证券投资基金的基金经理，自2019年12月起担任西部利得尊逸三年定期开放债券型证券投资基金的基金经理，自2020年7月起担任西部利得尊泰86个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理，自2021年1月起担任西部利得中债1-3年政策性金融债指数证券投资基金的基金经理。

#### 5、基金投资决策委员会成员

本基金采取集体投资决策制度。

投资决策委员会由下述委员组成：

投资决策委员会主任委员，王宇先生，副总经理、投资总监、公募投资部总经理。硕士毕业于南开大学金融学专业。曾任上海银行股份有限公司交易员、光大证券股份有限公司投资经理、交银施罗德基金管理有限公司投资经理。2016年9月起加入西部利得基金管理有限公司，历任固定收益部副总监、专户投资部副总经理、专户投资部总经理，总经理助理，现任公司副总经理、投资总监、公募投资部总经理。

投资决策委员会副主任委员，严志勇先生，公募固定收益部总经理、投资总监、基金经理，硕士毕业于复旦大学数量经济专业。曾任上海强生有限公司管理培训生、中国国际金融股份有限公司研究员、中证指数有限公司研究员、兴业证券股份有限公司研究员、鑫元基金管理有限公司债券研究主管。2017年5月加入西部利得基金管理有限公司，现任公募固定收益部总经理、投资总监、基金经理。

投资决策委员会副主任委员，何奇先生，公募权益投资部总经理、投资总监、基金经理。硕士毕业于武汉大学财政学专业。曾任长江证券股份有限公司研究部分析师、高级分析师，光大保德信基金管理有限公司投资部研究员、高级研究员、基金经理助理、基金经理。2020年6月加入西部利得基金管理有限公司，现任公募权益投资部总经理、投资总监、基金经理。

投资决策委员会委员，张可先生，公募投资部副总经理、公募指数投资部总经理、投资总监、基金经理助理。硕士毕业于上海财经大学工商管理专业。曾任建设银行洛阳分行业务主管、华宝兴业基金管理有限公司机构与海外销售部副总经理，国泰基金管理有限公司证券机构部总监，工银瑞信基金管理有限公司指数投资中心联席总经理，申万菱信基金管理有限公司指数与创新投资部总监。2020年2月加入西部利得基金管理有限公司，现任公募投资部副总经理、公募指数投资部总经理、投资总监、基金经理助理。

投资决策委员会委员，陈保国先生，研究部总经理、公募固收+投资部联席总经理、基金经理。硕士毕业于上海财经大学金融学专业。曾任西藏同信证券有限公司研究员、上海嘉华投资有限公司研究员。2016年1月加入西部利得基金管理有限公司，现任研究部总经理、公募固收+投资部联席总经理、基金经理。

投资决策委员会委员，盛丰衍先生，公募量化投资部总经理、投资总监、基金经理。硕士毕业于复旦大学计算机应用技术专业。曾任光大证券股份有限公司权益投资助理、上海光大证券资产管理有限公司研究员、兴证证券资产管理有限公司量化研究员。2016年10月加入西部利得基金管理有限公司，现任公募量化投资部总经理、投资总监、基金经理。

投资决策委员会委员，刘心峰先生，公募固定收益部副总经理、基金经理，硕士毕业于英国曼彻斯特大学数量金融专业。曾任中德安联人寿保险有限公司交易员、华泰柏瑞基金管理有限公司交易员。2016年11月加入西部利得基金管理有限公司，现任公募固定收益部副总经理、基金经理。

投资决策委员会委员，周帅先生，公募固收+投资部副总经理、基金经理。硕士毕业于南开大学金融学专业。曾任南京银行金融市场部高级交易员、资产管理部投资经理，江苏银

行投行与资产管理总部团队负责人,交银康联资产管理有限公司固定收益部副总经理。2020年1月加入西部利得基金管理有限公司,现任公募固收+投资部副总经理、基金经理。

投资决策委员会委员,周平先生,公募固收+投资部总经理、投资总监、基金经理。硕士毕业于复旦大学国际政治专业。曾任普华永道会计师事务所审计师,中信资本资产管理公司分析师,国联安基金管理有限公司高级研究员、基金经理,西部利得基金管理有限公司机构部联席总经理、总经理助理。2020年12月加入西部利得基金管理有限公司,现任公募固收+投资部总经理、投资总监、基金经理。

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

### 三、基金管理人的职责

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

2、办理基金备案手续;

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

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

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

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

7、依法接受基金托管人的监督;

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

9、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;

10、编制季度报告、中期报告和年度报告;

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

12、保守基金商业秘密,不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前应予保密,不向他人泄露;

13、按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案,及时向基金份额持有人分配基金收益;

14、按规定受理申购与赎回申请,及时、足额支付赎回款项;

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

16、按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上；

17、确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的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。

#### **四、基金管理人的承诺**

1、基金管理人承诺不从事违反《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风险控制制度，采取有效措施，防止下列行为的发生：

(1) 将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；

(2) 不公平地对待管理的不同基金财产；

(3) 利用基金财产或者职务之便为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；

(4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；

(5) 侵占、挪用基金财产；

(6) 泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

(7) 玩忽职守，不按照规定履行职责；



(8) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。

3、基金管理人承诺严格遵守基金合同，并承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反基金合同行为的发生；

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

5、基金管理人承诺不从事其他法规规定禁止从事的行为。

### **五、基金经理承诺**

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

2、不利用职务之便为自己、受雇人或任何其他第三人牟取不当利益；

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；

4、不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

### **六、基金管理人的内部控制制度**

#### **1. 内部控制制度概述**

公司内部控制是指公司为合理地评价和控制风险，保证经营运作符合公司的发展规划，防范和化解风险，保护投资人、公司和公司股东的合法权益，在充分考虑内外部环境的基础上，通过建立组织机制、运用管理方法、实施操作程序与控制措施所形成的风险导向型的内部控制制度。

#### **(1) 内部控制的原则**

1) 健全性原则：内部控制须覆盖公司的各项业务、各个部门或机构和各级岗位，并渗透到各项业务过程，涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个环节；

2) 有效性原则：通过科学的内控手段和方法，建立合理适用的内控程序，并适时调整和完善，维护内控制度的有效执行；

3) 独立性原则：公司各机构、部门和岗位的职责应当保持相对独立，公司基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离；

4) 防火墙原则：公司管理的基金资产、自有资产以及其他资产的运作应当分离，基金投资研究、决策、执行、清算、评估等部门和岗位，应当在物理上和制度上适当隔离，以达到风险防范的目的；

5) 相互制约原则：公司组织机构、内部部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡；

6) 成本效益原则：公司运用科学化的经营管理方法降低运营成本，提高经济效益，以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

#### **(2) 内部控制的制度系统**

公司内部控制制度系统包括四个层次：第一个层次是国家有关法律法规和公司章程；第

二个层次是包括内部控制大纲在内的基本管理制度；第三个层次是部门管理制度；第四个层次是各项具体业务规则。

1) 国家有关法律法规是公司一切制度的最高准则，公司章程是公司管理制度的基本原则，公司章程、董事会及其下属的专门委员会的管理规定是制订各项制度的基础和前提；

2) 内部控制大纲是依据国家相关法律法规、监管机构的有关规定以及公司章程规定的内控原则而确定的方针和策略，是内部控制纲领性文件，对制订各项基本管理制度和部门业务规章起着指导性的作用。公司内部控制是公司为实现内部控制目标而建立的一系列组织机制、管理办法、操作程序与控制措施的总称；

3) 公司基本管理制度包括了以下内容：内部控制大纲、风险控制制度、投资管理制度、监察稽核制度、基金会计制度、信息披露制度、信息技术管理制度、紧急应变制度、公司财务管理制度、人力资源管理制度和资料档案管理制度等；

4) 部门管理制度是根据公司章程和内控大纲等文件的要求，在基本管理制度的基础上，对各部门内部管理的具体说明，包括主要职责、岗位设置、岗位责任及操作规程等；

5) 各项具体业务规则是针对公司的某项具体业务，对该业务的操作要求、流程、授权等作出的详细完整的规定。

### (3) 内部控制的要素

公司内部控制的要素主要包括：控制环境、风险评估、控制活动、信息沟通及内部监控。

#### 1) 控制环境

公司设立董事会，向股东会负责。董事会由7名董事组成，其中独立董事3名。董事会下设合规审核委员会、资格审查委员会及薪酬与考核委员会等各专门委员会。董事会是股东会的执行机构，依照法律法规及公司章程的规定贯彻执行股东会的决议，行使决定公司经营和投资方案等重大职权。公司设立监事会，向股东会负责，依照《公司法》和公司章程对公司经营管理活动、董事和公司管理层的经营管理行为进行监督。公司的日常经营管理工作在总经理的领导下运行，总经理直接对董事会负责。

公司设立督察长，对董事会负责，负责监督检查基金和公司运作的合法合规情况及公司内部风险控制情况，行使法律法规及公司章程规定的职权。

#### 2) 风险评估

A、董事会下属的合规审核委员会对公司制度的合规性和有效性进行评估，并对公司与基金运作的合法合规性进行监督检查，以协助董事会确定风险管理目标，提出风险防范措施的建议，建立并有效维持公司内部控制系统，确保公司规范健康发展；

B、公司经营层下设风险控制委员会，向总经理负责，负责对基金投资风险控制及公司运作风险控制的有效性进行分析和评估，评估公司面临的风险事项将导致公司在承担法律责任、社会和公众责任、经济损失或是在以上三个领域的任何组合损失，以及对商业机会、运营基础以及法律责任等方面的影响，具体包括负责审核公司的风险控制制度和风险管理流

程, 识别、监控与管理公司整体风险;

C、公司经营层下设投资决策委员会, 负责对公司的基金产品及各投资品种的市场风险、流动性风险、信用风险等进行风险分析和评估, 采用风险量化技术和风险限额控制等方法把控基金投资整体风险;

D、各业务部门是公司内部控制的具体实施单位, 负责对职责范围内的业务所面临的风险进行识别和评估。各业务部门在公司基本管理制度的基础上, 根据具体情况制订本部门的业务管理规定、操作流程及内部控制规定, 对业务风险进行控制。部门管理层定期对部门内风险进行评估, 确定风险管理措施并实施, 监控风险管理绩效, 以不断改进风险管理能力。

### 3) 控制活动

公司根据自身经营的特点, 从组织结构、操作流程及报告制度等多种管理方式入手, 设立顺序递进、权责统一、严密有效的内控防线:

A、各岗位职责明确, 有详细的岗位说明书和业务流程, 各岗位人员在上岗前均应知悉并以书面方式承诺遵守, 在授权范围内承担责任;

B、建立重要业务处理凭据传递和信息沟通机制, 相关部门和岗位之间相互监督制衡;

C、公司督察长和内部监察稽核部门独立于其他部门, 对内部控制制度的执行情况实行严格的检查和反馈。

### 4) 信息与沟通

公司采用适当、有效的信息系统, 识别、采集、加工并相互交流经营活动所需的一切信息。信息系统须保证业务经营信息和财务会计资料的真实性、准确性和完整性, 必须能实现公司内部信息的沟通和共享, 促进公司内部管理顺畅实施。公司根据组织架构和授权制度, 建立清晰的业务报告系统, 保障信息的及时、准确的传递, 并且维护渠道的畅通。

### 5) 内部监控

公司内部控制的监督系统由监事会、督察长和监察稽核部等组成, 监督系统通过其监督职能的行使确保公司决策系统和执行系统合法、合规、高效地运作。根据市场环境、新的金融工具、新的技术应用和新的法律法规等情况, 公司组织专门部门对原有的内部控制进行全面的自查, 审查其合法合规性、合理性和有效性, 适时改进。

#### (4) 内部控制的检测

内部控制检测的过程包括如下:

- 1) 内控制度设计检测;
- 2) 内部控制执行情况测试;
- 3) 将测试结果与内控目标进行比较;
- 4) 形成测试报告, 得出继续运行或纠偏的结论。

#### (5) 风险控制体系

公司风险控制体系包括以下三个层次:

- 1) 第一层次为公司各业务相关部门对各自部门的风险控制负责;
- 2) 第二层次为总经理、风险控制委员会及监察稽核部;
- 3) 第三层次为董事会、合规审核委员会及督察长;

4) 为了有效地控制公司内部风险, 公司各业务部门建立第一道监控防线。独立的监察稽核部, 对各业务部门的各项业务全面实行监督反馈, 必要时对有关部门进行不定期突击检查。同时, 监察稽核部对于日常操作中发现的或认为具有潜在可能的问题出具监察稽核报告向风险控制委员会和总经理报告, 形成第二道监控防线。督察长在工作上向中国证监会和董事会负责, 并将检查结果汇报合规审核委员会和董事会, 形成第三道监控防线。

## 2. 基金管理人关于内部控制的声明

(1) 本基金管理人知晓建立、实施和维持内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任;

(2) 上述关于内部控制的披露真实、准确;

(3) 本公司承诺将根据市场环境变化及公司发展不断完善内部控制制度。

## 第四部分 基金托管人

### 一、基金托管人情况

#### 1、基本情况

名称：平安银行股份有限公司

注册住所：广东省深圳市罗湖区深南东路5047号

办公地址：广东省深圳市福田区益田路5023号平安金融中心B座26楼

法定代表人：谢永林

成立日期：1987年12月22日

组织形式：股份有限公司

注册资本：19,405,918,198元

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监许可[2008]1037号

联系人：刘华栋

联系电话：(0755) 22166388

#### 2、平安银行基本情况

平安银行股份有限公司是一家总部设在深圳的全国性股份制商业银行（深圳证券交易所简称：平安银行，证券代码 000001）。其前身是深圳发展银行股份有限公司，于 2012 年 6 月吸收合并原平安银行并于同年 7 月更名为平安银行。中国平安保险（集团）股份有限公司及其子公司合计持有平安银行 58% 的股份，为平安银行的控股股东。截至 2021 年末，平安银行有 109 家分行（含香港分行），共 1,177 家营业机构。

2021 年，平安银行实现营业收入 1693.83 亿元（同比增长 10.3%）、净利润 363.36 亿元（同比增长 25.6%）、资产总额 49,213.80 亿元（较上年末增长 10.1%）、吸收存款本金余额 29,618.19 亿元（较上年末增长 10.8%）、发放贷款和垫款总额 30,634.48 亿元（较上年末增长 14.9%）。

#### 3、主要人员情况

平安银行总行设资产托管事业部，下设市场拓展处、创新发展处、估值核算处、资金清算处、规划发展处、IT 系统支持处、督察合规处、基金服务中心 8 个处室，目前部门人员为 71 人，为客户提供专业化的托管服务。证券投资基金托管业务相关员工配置齐全且从业经验丰富，托管部核心管理层具备银行管理、证券或托管业务十年以上从业经验。

#### 4、基金托管业务经营情况

2008 年 8 月 15 日获得中国证监会、银监会核准开办证券投资基金托管业务。截至 2021 年末，平安银行股份有限公司托管证券投资基金净值规模合计 6,293 亿，平安银行已托管

191 只证券投资基金，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型、FOF 等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求。

## 二、基金托管人的内部风险控制制度说明

### 1、内部控制目标

作为基金托管人，平安银行股份有限公司严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管要求，自觉形成守法经营、规范运作的经营理念和经营风格；确保基金财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益；确保内部控制和风险管理的有效性；防范和化解经营风险，确保业务的安全、稳健运行，促进经营目标的实现。

### 2、内部控制组织结构

平安银行股份有限公司设有总行独立一级部门资产托管事业部，是全行资产托管业务的管理和运营部门，专门配备了专职内部监察稽核人员负责托管业务的内部控制和风险管理工

作，具有独立行使监督稽核工作的职权和能力。

### 3、内部控制制度及措施

资产托管事业部具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；取得基金从业资格的人员符合监管要求；业务管理严格实行复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

## 三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

### 1、监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。利用行业普遍使用的“资产托管业务系统——监控子系统”，严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督，并定期编写基金投资运作监督报告，报送中国证监会。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

### 2、监督流程

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

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

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

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

## 第五部分 相关服务机构

### 一、基金份额发售机构

#### 1、直销机构

西部利得基金管理有限公司直销柜台及电子交易平台

名称：西部利得基金管理有限公司直销柜台及电子交易平台

地址：上海市浦东新区耀体路 276 号晶耀商务广场 3 号楼 9 层

电话：(021) 38572888

传真：(021) 38572780

联系人：陈眉媚

#### 2、代销机构

##### (1) 五矿证券有限公司

地址：深圳市南山区粤海街道海珠社区滨海大道 3165 号五矿金融大厦 2401

法定代表人：黄海洲

联系人：赵晓棋

客服热线：40018-40028

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

##### (2) 招商银行股份有限公司

地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：缪建民

联系人：黄国航

客服热线：95555

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

##### (3) 泰信财富基金销售有限公司

地址：北京市朝阳区建国路乙 118 号 10 层 1206

法定代表人：彭浩

联系人：孔安琪

客服热线：400-004-8821

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

##### (4) 华宝证券股份有限公司

地址：中国（上海）自由贸易试验区浦电路 370 号 2、3、4 层

法人：刘加海

联系人：闪雨晴

客服电话：400-820-9898

公司网站：<https://www.cnhbstock.com>



## (5) 国联证券股份有限公司

地址：江苏省无锡市金融一街8号

法定代表人：葛小波

联系人：庞芝慧

客服热线：96670

网址：www.glsc.com.cn

## (6) 上海爱建基金销售有限公司

地址：上海市浦东新区民生路1299号丁香国际大厦西塔19层02/03室

法定代表人：马金

联系人：胡菁

客服热线：021-60608989

网址：www.ajwm.com

## (7) 鼎信汇金（北京）投资管理有限公司

地址：北京市朝阳区霄云路40号院1号楼3层306室

法定代表人：齐凌峰

联系人：陈臣

联系电话：010 8448 9855-8011

客服热线：400-158-5050

网址：www.9ifund.com

## (8) 京东肯特瑞基金销售有限公司

地址：北京市通州区亦庄经济开发区科创十一街十八号院京东集团总部A座15层

法定代表人：邹保威

联系人：赵德赛

客服热线：95118

网址：kenterui.jd.com

## (9) 华融融达期货股份有限公司

地址：郑州市郑东新区商务内环路27号楼1单元3层01号、2单元3层02号

法定代表人：苏小勇

联系人：杨玲玲

客服热线：400-6197-666

网址：www.cefcfco.com

## (10) 东方财富证券股份有限公司

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：戴彦

联系人：陈亚男

客服热线：95357

网址：<http://www.xzsec.com/>

(11) 华金证券股份有限公司

地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 759 号 30 层

法定代表人：燕文波

联系人：秦臻

客服热线：4008211357

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

(12) 北京新浪仓石基金销售有限公司

地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2 地块新浪总部科研楼 5 层 518 室

法定代表人：穆飞虎

联系人：韩宇琪

客服热线：010-62675369

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

(13) 北京度小满基金销售有限公司

地址：北京市海淀区西北旺东路 10 号院西区 4 号楼 1 层 103 室

法定代表人：葛新

联系人：孙博超

客服热线：95055-4

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

(14) 德邦证券股份有限公司

地址：上海市普陀区曹杨路 510 号南半幢 9 楼

法定代表人：武晓春

联系人：王芙佳

客服热线：021-68761616

网址：<http://www.tebon.com.cn>

(15) 国信证券股份有限公司

地址：深圳市福田区福华一路 125 号国信金融大厦 37 楼

法定代表人：张纳沙

联系人：周杨

客服热线：95536

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

## (16) 嘉实财富管理有限公司

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

联系人：闫欢

客服热线：400-021-8850

网址：www.harvestwm.cn

## (17) 北京创金启富基金销售有限公司

地址：北京市西城区白纸坊东街 2 号院 6 号楼 712 室

法定代表人：梁蓉

联系人：魏素清

客服热线：010-66154828

网址：www.5irich.com

## (18) 深圳众禄基金销售股份有限公司

地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

法定代表人：薛峰

联系人：童彩平

客服热线：400-6788-887

网址：www.zlfund.cn、www.jjmmw.com

## (19) 上海证券有限责任公司

地址：上海市黄浦区四川中路 213 号 7 楼

法定代表人：何伟

联系人：邵珍珍

客服热线：4008-918-918

网址：www.shzq.com

## (20) 东北证券股份有限公司

地址：吉林省长春市生态大街 6666 号

法定代表人：李福春

联系人：安岩岩

客服热线：95360

网址：www.nesc.cn

## (21) 福克斯（北京）基金销售有限公司

地址：北京市怀柔区怀北镇怀北路 308 号

法定代表人：谢亚凡

联系人：岳倩颖

客服热线：010-64081648

网址：<http://www.haofunds.com/>

(22) 宁波银行股份有限公司易管家

地址：浙江省宁波市鄞州区宁东路 345 号

法定代表人：陆华裕

客服热线：95574

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

(23) 中银国际证券股份有限公司

地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39F

法定代表人：宁敏

联系人：王炜哲

客服热线：400-620-8888

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

(24) 西部证券股份有限公司

地址：西安市新城区东大街 319 号 8 幢 10000 室

法定代表人：徐朝晖

联系人：梁承华

客服热线：95582

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

(25) 信达证券股份有限公司

地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人：祝瑞敏

联系人：王薇安

客服热线：95321

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

(26) 英大证券有限责任公司

地址：深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层

法定代表人：郝京春

联系人：郑荣州

客服热线：4000-188-688 转 5 号

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

(27) 珠海盈米基金销售有限公司

地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 1201-1203 室

法定代表人：肖雯

联系人：吴煜浩

客服热线：020-89629066

网址：<https://www.yingmi.cn>

(28) 武汉市伯嘉基金销售有限公司

地址：武汉市江汉区台北一路17-19号环亚大厦B座601室

法定代表人：陶捷

联系人：陆锋

客服热线：400-027-9899

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

(29) 申万宏源证券有限公司

地址：上海市徐汇区长乐路989号世纪商贸广场45层

法定代表人：杨玉成

联系人：陈宇

客服热线：95523 或 4008895523

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

(30) 申万宏源西部证券有限公司

地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室

法定代表人：王献军

联系人：梁丽

客服热线：95523 或 4008895523

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

(31) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

地址：浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路969号3幢5层599室

法定代表人：王珺

联系人：韩爱彬

客服热线：4000-766-123

网址：[www.fund123.cn](http://www.fund123.cn)

(32) 浙江同花顺基金销售有限公司

地址：杭州市余杭区五常街道同顺街18号同花顺大楼

法定代表人：吴强

联系人：费超超

客服热线：4008-773-772

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

(33) 和讯信息科技有限公司

地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

法定代表人：章知方

联系人：于杨

客服热线：400-920-0022

网址：www.licaike.com

(34) 泛华普益基金销售有限公司

地址：四川省成都市锦江区东大街 99 号平安金融中心 1501 室

法定代表人：于海锋

联系人：陈金红

客服热线：4008588588

网址：<https://www.puyifund.com/>

(35) 华瑞保险销售有限公司

地址：上海市嘉定区南翔镇众仁路 399 号运通星财富广场 1 号楼 B 座 14 层

法定代表人：杨新章

联系人：张爽爽

客服热线：952303

网址：www.huaruisales.com

(36) 中信建投证券股份有限公司

地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：王常青

联系人：魏明

客服热线：400-8888-108

网址：www.csc108.com

(37) 东海证券股份有限公司

地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦

法定代表人：钱俊文

联系人：王一彦

客服热线：95531；400-8888-588

网址：www.longone.com.cn

(38) 上海天天基金销售有限公司

地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号金座

法定代表人：其实

联系人：朱钰

客服热线：95021

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

(39) 北京中植基金销售有限公司

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

联系人: 丛瑞丰

客服热线: 400-8180-888

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

(40) 上海凯石财富基金销售有限公司

地址: 上海市黄浦区延安东路 1 号凯石大厦 4 楼

法定代表人: 陈继武

联系人: 冯强

客服热线: 400-643-3389

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

(41) 中信证券华南股份有限公司

地址: 广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层

法定代表人: 胡伏云

联系人: 陈靖

客服热线: (020) 95396

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

(42) 东吴证券股份有限公司

地址: 苏州工业园区星阳街 5 号

法定代表人: 范力

联系人: 陆晓

客服热线: 95330

网址: <http://www.dwjq.com.cn/>

(43) 中国银河证券股份有限公司

地址: 北京市丰台区西营街 8 号院 1 号楼青海金融大厦

法定代表人: 陈亮

联系人: 邓颜

客服热线: 4008-888-888 或 95551

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

(44) 中泰证券股份有限公司

地址: 济南市市中区经七路 86 号

法定代表人: 李峰

联系人: 许曼华

客服热线: 95538

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

(45) 上海基煜基金销售有限公司

地址: 上海市昆明路 518 号北美广场 A1002-A1003 室

法定代表人: 王翔

联系人: 吴鸿飞

客服热线: 400-820-5369

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

(46) 上海万得基金销售有限公司

地址: 中国(上海)自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

法定代表人: 宋晓言

联系人: 徐亚丹

客服热线: 400-799-1888

网址: [www.520fund.com.cn](http://www.520fund.com.cn)

(47) 大河财富基金销售有限公司

地址: 贵州省贵阳市高新区湖滨路 109 号瑜赛进丰高新财富中心 26 层、1 层

法定代表人: 赵鹰龙

联系人: 方凯鑫

客服热线: 0851-8823-5678

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

(48) 长城证券股份有限公司

地址: 深圳市福田区深南大道 6008 号报业大厦 14 楼、16 楼、17 楼

法定代表人: 张巍

联系人: 金夏

客服热线: 95514/400-6666-888

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

(49) 湘财证券股份有限公司

地址: 湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼

法定代表人: 高振营

联系人: 江恩前

客服热线: 95351

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

(50) 上海好买基金销售有限公司



地址：上海市浦东新区浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903~906 室

法定代表人：杨文斌

联系人：王诗琦

客服热线：400-700-9665

网址：www.howbuy.com

(51) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006#

法定代表人：CHEN ZHENG JAMES

联系人：文雯

客服热线：4001661188

网址：<http://www.new-rand.cn/>

(52) 奕丰基金销售有限公司

地址：深圳市南山区海德三道航天科技广场 A 座 17 楼 1704 室

法定代表人：TEO WEE HOWE

联系人：叶健

客服热线：400-684-0500

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

(53) 上海华夏财富投资管理有限公司

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：毛淮平

联系人：仲秋玥

客服热线：400-817-5666

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

(54) 中信期货有限公司

地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层

法定代表人：张皓

联系人：梁美娜

客服热线：400-990-8826

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

(55) 招商证券股份有限公司

地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 38-45 层

法定代表人：霍达

联系人：黄婵君

客服热线：95565、4008888111

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

(56) 中信证券（山东）有限责任公司

地址：青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座 5 层

法定代表人：冯恩新

联系人：孙秋月

客服热线：95548

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

(57) 民商基金销售(上海)有限公司

地址：上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区(东座)6 楼 A31 室

法定代表人：贲惠琴

联系人：杨一新

客服热线：021-50206003

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

(58) 上海陆金所基金销售有限公司

地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

法定代表人：陈祎彬

联系人：宁博宇

客服热线：4008219031

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

(59) 万家财富基金销售（天津）有限公司

地址：北京市西城区丰盛胡同 28 号太平洋保险大厦 5 层

法定代表人：戴晓云

联系人：邵玉磊

客服热线：010-59013825

网址：<http://www.wanjiawealth.com/>

(60) 和耕传承基金销售有限公司

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

联系人：董亚芳

客服热线：400-0555-671

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

(61) 天相投资顾问有限公司

地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 4 层

法定代表人：林义相

联系人：谭磊

客服热线：010-66045678

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

(62) 大连网金基金销售有限公司

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

联系人：杨雪松

客服热线：0411-39027802

网址：<http://www.yibaijin.com>

(63) 平安银行股份有限公司

地址：广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号

法定代表人：谢永林

联系人：鲁承文

客服热线：95511-3

网址：<http://bank.pingan.com/>

(64) 光大证券股份有限公司

地址：上海市静安区新闸路 1508 号

法定代表人：刘秋明

联系人：刘晨

客服热线：95525

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

(65) 联储证券有限责任公司

地址：北京市朝阳区安定路 5 号院 3 号楼中建财富国际中心 27 层

法定代表人：吕春卫

联系人：丁倩云

客服热线：956006

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

(66) 北京汇成基金销售有限公司

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 401

法定代表人：王伟刚

联系人：丁向坤

客服热线：400-619-9059

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

## (67) 上海长量基金销售有限公司

地址:上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层

法定代表人:张跃伟

联系人:何昶

客服热线:400-820-2899

网址:www.erichfund.com

## (68) 诺亚正行基金销售有限公司

地址:上海市杨浦区长阳路 1687 号 2 号楼

法定代表人:汪静波

联系人:李娟

客服热线:400-821-5399

网址:www.noah-fund.com

## (69) 中信证券股份有限公司

地址:北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人:张佑君

联系人:侯艳红

客服热线:95548

网址: <http://www.cs.ecitic.com/>

## (70) 世纪证券有限责任公司

地址:深圳市前海深港合作区南山街道桂湾五路 128 号前海深港基金小镇对冲基金中心

406

法定代表人:余维佳

联系人:王雯

客服热线:956019

网址:www.cscoco.com.cn

## (71) 上海利得基金销售有限公司

地址:上海市虹口区东大名路 1098 号浦江国际金融广场 53 层

法定代表人:李兴春

联系人:张仕钰

客服热线:400-032-5885

网址:www.leadfund.com.cn

## (72) 海银基金销售有限公司

地址:上海市浦东新区银城中路 8 号 4 楼

法定代表人:巩巧丽

联系人：毛林

客服热线：400-808-1016

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

(73) 北京雪球基金销售有限公司

地址：北京市朝阳区创远路 34 号院 6 号楼 15 层 1501 室

法定代表人：李楠

联系人：戚晓强

客服热线：400-159-9288

网址：<https://danjuanapp.com>

(74) 上海联泰基金销售有限公司

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

联系人：兰敏

客服热线：400-166-6788

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

(75) 上海挖财基金销售有限公司

地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 层 01、02、03 室

法定代表人：吕柳霞

联系人：李娟

客服热线：021-50810673

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

(76) 兴业银行股份有限公司

地址：福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦

法定代表人：吕家进

联系人：李博

客服热线：95561

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

(77) 安信证券股份有限公司

地址：深圳市福田区福田街道福华一路 119 号安信金融大厦

法定代表人：黄炎勋

联系人：陈剑虹

客服电话：95517

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

(78) 中国中金财富证券有限公司

地址：深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 4、18 层至 21 层

法定代表人：高涛

联系人：张丹桥

客服热线：95532/400 600 8008

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

(79) 阳光人寿保险股份有限公司

地址：北京市朝阳区朝外大街 20 号联合大厦 701A 室

法定代表人：李科

联系人：王超

客服热线：95510

网址：[life.sinosig.com](http://life.sinosig.com)

(80) 南京苏宁基金销售有限公司

地址：南京市玄武区徐庄软件园苏宁大道 1 号

法定代表人：钱燕飞

联系人：喻明明

客服热线：95177

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

(81) 中证金牛(北京)基金销售有限公司

地址：北京市西城区宣武门外大街甲 1 号环球财讯中心 A 座 5 层

法定代表人：钱昊旻

联系人：沈晨

客服热线：4008-909-998

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

(82) 浦领基金销售有限公司

地址：北京市朝阳区望京东园四区 2 号楼 10 层 1001 号 04 室

法定代表人：张昱

联系人：徐微

客服热线：400-012-5899

网址：<http://www.zscffund.com/>

(83) 国金证券股份有限公司

地址：成都市青羊区东城根上街 95 号

法定代表人：冉云

联系人：刘婧漪、贾鹏

客服热线：95310

网址: www.gjzq.com.cn

3. 基金管理人可根据有关法律法规要求, 选择其他符合要求的机构代理销售本基金或变更上述销售机构, 并在基金管理人网站公示。

## 二、登记机构

名称: 西部利得基金管理有限公司  
住所: 中国(上海)自由贸易试验区耀体路276号901室-908室  
办公地址: 上海市浦东新区耀体路276号晶耀商务广场3号楼9层  
法定代表人: 何方  
电话: (021) 38572888  
传真: (021) 38572750  
联系人: 张皞骏

## 三、出具法律意见书的律师事务所

名称: 上海源泰律师事务所  
注册地址: 上海市浦东南路256号华夏银行大厦1405室  
办公地址: 上海市浦东南路256号华夏银行大厦1405室  
电话: (021) 51150298  
传真: (021) 51150398  
联系人: 刘佳  
经办律师: 廖海、刘佳

## 四、审计基金财产的会计师事务所

名称: 毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)  
住所: 北京市东长安街1号东方广场毕马威大楼8层  
办公地址: 上海市南京西路1266号恒隆广场50楼  
法定代表人: 邹俊  
联系电话: (021) 22122888  
传真: (021) 62881889  
联系人: 黄小熠  
经办注册会计师: 黄小熠、张楠

## 第六部分 基金的募集

### 一、基金募集情况

本基金的募集申请经 2017 年 11 月 10 日中国证监会证监许可【2017】2028 号文和 2018 年 12 月 6 日中国证监会证监许可【2018】2034 号准予注册。募集期自 2019 年 5 月 14 日起至 2019 年 5 月 29 日止。募集期内，本基金的有效认购份额为 575,829,566.64 份，利息结转的基金份额为 4,161.89 份，两项合计共 575,833,728.53 份基金份额。

### 二、基金份额类别

1、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。在投资者认购、申购时收取认购、申购费用，且从本类别基金资产净值中不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、申购基金份额时不收取认购、申购费用，且从本类别基金资产净值中计提销售服务费的基金份额，称为C类、E类基金份额。

本基金A类、C类和E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、C类和E类基金份额将分别计算基金份额净值并分别公告，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、申购的基金份额类别。

2、基金份额类别的限制：基金管理人可以根据市场情况，基金管理人可以与基金托管人协商一致并在履行相关程序后，调整认/申购各类基金份额的最低限制及相互转换规则，基金管理人必须至少开始调整实施之日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

#### 3、基金份额的互相转换：

(1) 本基金A类、C类、E类基金份额不进行转换、自动份额类别调整。今后开通本基金C类、E类基金份额转换、自动份额类别调整业务时，本公司将另行公告。

(2) 投资者认购、申购及基金份额类别转换申请确认后，实际获得的基金份额等级以本基金的等级机构根据上述规则确认的基金份额类别为准。

4、基金份额分类及规则的调整：在不违反法律法规、基金合同的规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，经与基金托管人协商一致，基金管理人可增加、减少或调整基金份额类别设置、对基金份额分类办法及规则进行调整或者在法律法规和基金合同规定的范围内变更现有基金份额类别的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式等，并在调整实施之日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告，不需要召开基金份额持有人大会。



## 第七部分 基金合同的生效

### 一、基金合同生效

本基金基金合同于2019年6月4日生效。

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

法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

## 第八部分 基金份额的申购与赎回

### 一、申购与赎回的场所

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。具体的销售网点将由基金管理人在更新的招募说明书或其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并在基金管理人网站公示。基金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、申购与赎回办理的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

基金合同生效后，若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

#### 2、申购、赎回开始日及业务办理时间

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

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

在确定申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定进行公告。

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、赎回或转换申请且登记机构确认接受的，其基金份额申购、赎回或转换价格为下一开放日基金份额申购、赎回或转换的价格。

### 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。

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开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

### 四、申购和赎回的数额限制及余额的处理方式

1、原则上，投资者申购本基金A类基金份额，通过代销机构、基金管理人网上交易系统申购的，单个基金帐户单笔最低申购金额起点为人民币0.01元（含申购费），追加申购的最低金额为单笔人民币0.01元（含申购费）。基金管理人直销柜台接受首次申购申请的最低金额为单笔人民币50,000元（含申购费），追加申购的最低金额为单笔人民币20,000元（含申购费）。

投资者申购本基金C类基金份额的单笔最低金额为人民币500万元（含申购费），追加申购的最低金额为人民币20,000元（含申购费）。

投资者申购本基金E类基金份额，通过代销机构、基金管理人网上交易系统申购的，单笔最低金额为人民币0.01元（含申购费），追加申购的最低金额为人民币0.01元（含申购费）。基金管理人直销柜台接受首次申购申请的最低金额为单笔人民币50,000元（含申购费），追加申购的最低金额为单笔人民币20,000元（含申购费）。

实际操作中，以各销售机构的具体规定为准。

2、投资者当期分配的基金收益转购基金份额时，不受最低申购金额的限制。

3、投资者可多次申购，对单个投资者的累计持有份额不设上限限制。但单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的50%（在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过50%的除外）。

4、基金份额持有人在销售机构赎回A类基金份额时，每次对本基金的赎回申请不得低于50份基金份额。基金份额持有人赎回时或赎回后在销售机构（网点）保留的基金份额余额不足50份的，在赎回时需一次全部申请赎回。

基金份额持有人在销售机构赎回C类基金份额时，每次对本基金的赎回申请不得低于20,000份基金份额。基金份额持有人赎回时或赎回后在销售机构（网点）保留的基金份额余额不足20,000份的，在赎回时需一次全部申请赎回。

基金份额持有人在赎回E类基金份额时，每次对本基金的赎回申请不得低于1份基金份额。基金份额持有人赎回时或赎回后在销售机构（网点）保留的基金份额余额不足1份的，在赎回时需一次全部申请赎回。

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，具体请参见相关公告。

6、基金转换的限制

基金转换分为转换转入和转换转出。

对于A类基金份额，每次转出份额不得低于50份。留存份额不足50份的，只能一次性赎回，不能进行转换。

对于C类基金份额，每次转出份额不得低于20,000份。留存份额不足20,000份的，只能

一次性赎回，不能进行转换。

对于E类基金份额，每次转出份额不得低于1份；留存份额不足1份的，只能一次性赎回，不能进行转换。

#### 7、定期定额投资计划

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

8、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》的有关规定进行公告。

9、申购份额、余额的处理方式：申购的有效份额为净申购金额除以当日该类基金份额的基金份额净值，有效份额单位为份。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。

10、赎回金额的处理方式：赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日该类基金份额的基金份额净值，并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。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。

### 五、申购与赎回的程序

#### 1、申购和赎回的申请方式

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

#### 2、申购和赎回的款项支付

投资人申购基金份额时，必须全额交付申购款项，投资人全额交付申购款项，申购申请成立；登记机构确认基金份额时，申购生效。

基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；登记机构确认赎回时，赎回生效。投资人赎回申请生效后，基金管理人将在T+7日(包括该日)内支付赎回款项。在发生巨额赎回或基金合同约定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。

遇交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其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。

#### 3、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T日)，在正常情况下，本基金登记机构在T+1日内对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请，投资人应在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。若申购不成立或无效，则申购款项本金退还给投资人。

基金销售机构对申购、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

接收到申购、赎回申请。申购、赎回申请的确认以登记机构的确认结果为准。

基金管理人可以在法律法规和基金合同允许的范围内，对上述业务办理时间进行调整，并在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

## 六、申购费率、赎回费率

### 1、申购费率

本基金A类基金份额在申购时收取申购费用，C类、E类基金份额不收取申购费用，但从本类别基金资产中计提销售服务费。

本基金A类基金份额对申购设置级差费率。投资者在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。具体费率如下：

申购金额 (M)	申购费率
M<100万元	0.10%
100万元≤M	每笔1000元

注：投资者通过基金管理人网上交易系统、直销柜台申购本基金实行优惠费率，详见基金管理人公告；部分代销机构如实行优惠费率，请投资人参见代销机构公告。

本基金A类基金份额的申购费用应在投资人申购A类基金份额时收取。

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，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用。

### 2、赎回费率

赎回费用由赎回基金份额的各类基金份额赎回人承担，其中针对持有期限少于7日的投资者收取的赎回费用将全额计入基金财产，针对持有期限不少于7日的投资者收取的赎回费用的25%的部分归基金财产，其余用于支付登记费和其他必要的手续费。赎回费率随赎回基金份额持有年份的增加而递减，具体费率如下：

A、C、E类份额	持有期限 (N为日历日)	赎回费率
	N<7日	1.50%
	7日≤N≤30日	0.10%
	N>30日	0

3、基金管理人可以根据法律法规规定及基金合同调整申购费率、赎回费率或收费方式，最新的申购费率、赎回费率或收费方式在招募说明书(更新)或相关公告中列示。费率或收费方式如发生变更，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式开始实施日前依照《信息披露办法》的有关规定进行公告。

4、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定且对现有基金份额持有人权益不产生实质性不利影响的情形下根据市场情况制定基金促销计划，定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金销售费率，并进行公告。

5、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可采用摆动定价机制，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，具体见基金管理人届时的相关公告。

### 七、申购份额与赎回金额的计算方式

(1) 若投资者选择A类基金份额，则申购份额的计算公式为：

申购费用适用比例费率：

净申购金额=申购金额/（1+申购费率）

申购费用=申购金额-净申购金额

申购份额=净申购金额/申购当日A类基金份额净值

申购费用适用固定金额：

申购费用=固定金额

净申购金额=申购金额-申购费用

申购份额=净申购金额/申购当日A类基金份额净值

申购份额的计算结果均按照四舍五入方法，保留小数点后2位，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

例：某投资人投资人民币50,000元申购本基金A类基金份额，对应费率为0.10%，假设申购当日A类基金份额净值为1.0160元，则其可得到的申购份额为：

净申购金额=50,000/（1+0.10%）=49,950.05元

申购费用=50,000-49,950.05=49.95元

申购份额=49,950.05/1.0160=49,163.44份

即：投资者投资人民币50,000元申购本基金A类基金份额，对应费率为0.10%，假设申购当日A类基金份额净值为1.0160元，则可得到49,163.44份A类基金份额。

(2) 若投资人选择申购C类、E类基金份额，则申购份额的计算公式为：

申购份额=申购金额/申购当日该类基金份额净值

例：某投资者投资人民币50,000元申购本基金的E类基金份额，假设申购当日E类基金份额净值为1.0160元，则可得到的申购份额为：

申购份额=50,000/1.0160=49,212.60份

即：投资者投资人民币50,000元申购本基金E类基金份额，假设申购当日E类基金份额净值为1.0160元，则可得到49,212.60份E类基金份额。

2、赎回金额的计算方式：

赎回总金额=赎回份额×T日该类基金份额净值

赎回费用=赎回总金额×赎回费率

净赎回金额=赎回总金额-赎回费用

赎回金额的计算结果均按照四舍五入方法，保留小数点后2位，由此误差产生的收益或

损失由基金财产承担。

例：某投资者赎回10万份A类基金份额，份额持有期限20天，对应赎回费率为0.10%，假设赎回当日A类基金份额净值是1.2130元，则其可得到的赎回金额为：

赎回总金额=100,000×1.2130=121,300.00元

赎回费用=121,300.00×0.10%=121.30元

净赎回金额=121,300.00-121.30=121,178.70元

即：投资者赎回本基金10万份A类基金份额，份额持有期限20天，假设赎回当日A类基金份额净值是1.2130元，则其可得到的净赎回金额为121,178.70元。

例：某投资者赎回10万份C类基金份额，份额持有期限40天，对应赎回费率为0，假设赎回当日C类基金份额净值是1.1000元，则其可得到的赎回金额为：

赎回金额=100,000×1.1000=110,000.00元

赎回费用=110,000.00×0=0.00元

净赎回金额=110,000.00-0.00=110,000.00元

即：投资者赎回10万份C类基金份额，份额持有期限40天，对应赎回费率为0，假设赎回当日C类基金份额净值是1.1000元，则其可得到的净赎回金额为110,000.00元。

### 3、T日基金份额净值的计算

T日某类基金份额净值=T日该类基金资产净值/ T日该类基金份额总数。

T日的基金份额净值在当天收市后计算，精确到0.0001元，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，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

## 八、拒绝或暂停申购的情形及处理

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

- 1、因不可抗力导致基金无法正常运作。
- 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况。
- 3、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
- 4、基金管理人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或对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时。
- 5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人利益的情形。
- 6、基金管理人、基金托管人、基金销售机构或登记机构的异常情况导致基金销售系统、基金登记系统或基金会计系统无法正常运行。

7、当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当

暂停接受基金申购申请。

8、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过 50%，或者变相规避 50%集中度的情形时。

9、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第 1、2、3、5、6、7、9 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项本金将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

### 九、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形及处理

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况。

3、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

5、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请。

6、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。

7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定拒绝接受或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时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，未支付部分可延期支付。若出现上述第 4 项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

### 十、巨额赎回的情形及处理方式

1、巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过前一开放日的基金总份额的 10%，即认为是发生了巨额赎回。

2、巨额赎回的处理方式

当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。

(1) 全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时，按正常赎回



程序执行。

(2) 部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额 10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。部分延期赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

(3) 本基金发生巨额赎回时，对于单个基金份额持有人当日赎回申请超过上一开放日基金总份额 10%以上的部分，基金管理人有权对其进行延期办理（被延期赎回的赎回申请，将自动转入下一个开放日继续赎回，延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日某一类别的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止）；对于该基金份额持有人申请赎回的份额中未超过上一开放日基金总份额 10%的部分，基金管理人根据前段“（1）全额赎回”或“（2）部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。但是，如该持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。

(4) 暂停赎回：连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒介上进行公告。

### 3、巨额赎回的公告

当发生上述巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个工作日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，并在 2 日内在指定媒介上刊登公告。

## 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指定媒介上刊登暂停公告。

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

3、如果发生暂停的时间超过 1 日但少于两周，暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应最迟于重新开放日在指定媒介刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开始办理申购或赎回的开放日公告最近一个工作日的基金份额净值。

## 十二、基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换业务,基金转换可以收取一定的转换费,相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及基金合同的规定制定并公告,并提前告知基金托管人与相关机构。

## 十三、基金份额的转让

在法律法规允许且条件具备的情况下,基金管理人可受理基金份额持有人通过中国证监会认可的交易场所或者交易方式进行份额转让的申请并由登记机构办理基金份额的过户登记。基金管理人拟受理基金份额转让业务的,将提前公告,基金份额持有人应根据基金管理人公告的业务规则办理基金份额转让业务。

## 十四、基金的非交易过户

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

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

## 十五、基金的转托管

基金份额持有人可办理已持有基金份额在不同销售机构之间的转托管,基金销售机构可以按照规定标准收取转托管费。

## 十六、定期定额投资计划

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

## 十七、基金份额的冻结、解冻和质押

基金登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻,以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。基金份额被冻结的,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与支付。法律法规或基金合同另有规定的除外。

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。

## 十八、实施侧袋机制期间本基金的申购与赎回

本基金实施侧袋机制的,本基金的申购和赎回安排详见本招募说明书“侧袋机制”章节或相关公告。



## 第九部分 基金的投资

### 一、投资目标

本基金主要通过重点投资短期债券，在严格控制风险和保持较高流动性的基础上，力求获得超越业绩比较基准的投资回报。

### 二、投资范围

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、短期融资券、超短期融资券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、央行票据、中期票据）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、通知存款以及定期存款等其它银行存款）、同业存单、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）。

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

本基金的投资组合比例为：本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的80%，其中投资于短期债券的比例不低于非现金基金资产的80%。持有现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金所指的短期债券是指剩余期限不超过397天（含）的债券资产，包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分。

如果法律法规或中国证监会允许基金投资其他品种或变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围或可以调整上述投资品种的投资比例。

### 三、投资策略

#### 1、组合久期配置策略

为保持本基金明显的收益风险特征，本基金将通过对宏观经济变量（包括GDP增长率、CPI走势、远期利率水平、市场短期资金流向、央行公开市场操作力度、货币供应量变动等）、债券市场整体收益率曲线变化、申购赎回现金流情况等因素的综合分析和判断。同时，本基金通过预测收益率曲线的形状和变化趋势，对各类型债券进行久期配置；当收益率曲线走势难以判断时，参考基准指数的样本券久期构建组合久期，确保组合收益超过基准收益。

在目标久期的执行过程中，将特别注意对信用风险、流动性风险及类属资产配置的管理，以使得组合的各种风险在控制范围之内。

#### 2、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。通过情景分析的方法，

判断各个债券类属的预期持有期回报,在不同债券品种之间进行配置。

在类属资产配置层面上,本基金根据市场和类属资产的信用水平,在判断各类属的利率期限结构与国债利率期限结构应具有合理利差水平基础上,将市场细分为交易所国债、交易所企业债、银行间国债、银行间金融债等子市场。结合各类属资产的市场容量、信用等级和流动性特点,在目标久期管理的基础上,运用修正的均值-方差等模型,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。

同时,本基金针对债券市场所涉及行业在同样宏观周期背景下不同行业的景气度的情况,通过分散化投资和行业预判进行,具体表现为:1)分散化投资:发行人涉及众多行业,本组合将保持在各行业配置比例上的分散化结构,避免过度集中配置在产业链高度相关的上中下游行业。2)行业投资:本组合将依据对下一阶段各行业景气度特征的研判,确定在下一阶段在各行业的配置比例,卖出景气度降低行业的债券,提前布局景气度提升行业的债券。

### 3、息差策略

本基金将通过正回购,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。

### 4、个券选择策略

在个券选择过程中,本基金将根据市场收益率曲线的定位情况和个券的市场收益率情况,综合判断个券的投资价值,选择风险收益特征最匹配的品种,构建具体的个券组合。

#### 1) 信用债投资策略

在信用债的选择方面,本基金将通过对行业经济周期、发行主体内外部评级和市场利差分析等判断,并结合税收差异和信用风险溢价综合判断个券的投资价值,加强对企业债、公司债等品种的投资,通过对信用利差的分析和管理,获取超额收益。

本基金还将利用目前的交易所和银行间两个投资市场的利差不同,密切关注两个市场之间的利差波动情况,积极寻找跨市场中现券和回购操作的套利机会。

#### 2) 资产支持证券投资策略

深入分析资产支持证券的市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等基本因素,估计资产违约风险和提前偿付风险,并根据资产证券化的收益结构安排,模拟资产支持证券的本金偿还和利息收益的现金流过程,辅助采用蒙特卡罗方法等数量化定价模型,评估其内在价值,并结合资产支持证券类资产的市场特点,进行此类品种的投资。

## 四、投资限制

### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制:

- (1) 本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%,其中投资于短期债券的比

例不低于非现金基金资产的 80%；

(2) 本基金保持现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。前述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，其市值不超过基金资产净值的 10%；

(4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；

(5) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不展期；

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

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

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

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

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

(11) 基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

(12) 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、证券停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合本款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(13) 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；

(14) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述第（2）、（10）、（12）、（13）项外，因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但法律法规或中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

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

法律法规或监管部门取消或调整上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或以调整后的规定执行，但须提前公告，不需要经基金份额持有人大会审议。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- (6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

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

法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，则履行适当程序后本基金投资不再受相关限制或按变更后的规定执行。

## 五、业绩比较基准

本基金业绩比较基准：中债综合财富（1年以下）指数收益率\*80%+一年期定期存款利率(税后)\*20%

本基金为债券型证券投资基金，重点投资短期债券，所以本基金选取中债综合财富（1年以下）指数收益率作为债券投资部分的业绩比较基准。中债综合财富（1年以下）指数是中债金融估值中心有限公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的短期债券指数，旨在反映短期债券的整体价格和投资回报情况。

若未来市场发生变化导致此业绩比较基准不再适用或有更加适合的业绩比较基准，基金管理人有权根据市场发展状况及本基金的投资范围和投资策略，调整本基金的业绩比较基准。业绩基准的变更须经基金管理人和基金托管人协商一致，并在更新的招募说明书中列示，而无需召开基金份额持有人大会。

## 六、风险收益特征

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

## 七、基金管理人代表基金行使相关权利的处理原则及方法

1、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使相关权利，保护基金份额持有人的利益；

- 2、有利于基金财产的安全与增值；
- 3、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

#### 八、侧袋机制的实施和投资运作安排

当基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时,根据最大限度保护基金份额持有人利益的原则,基金管理人经与基金托管人协商一致,并咨询会计师事务所意见后,可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制,无需召开基金份额持有人大会审议。

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

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

基金托管人平安银行股份有限公司根据基金合同规定,复核了本报告中的投资组合报告内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。本投资组合报告所载数据截止 2022 年 6 月 30 日,本报告所列财务数据未经审计。

##### 1. 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	162,402,011.22	77.40
	其中:债券	162,402,011.22	77.40
	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	40,005,269.32	19.07
	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	7,279,451.63	3.47
8	其他资产	124,603.05	0.06
9	合计	209,811,335.22	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股票。

###### (2) 报告期末积极投资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投资。

### 3. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

### 4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,236,657.33	9.65
	其中：政策性金融债	20,236,657.33	9.65
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	115,375,928.82	55.03
6	中期票据	26,789,425.07	12.78
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	162,402,011.22	77.46

### 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	012103720	21 云能投 SCP011	100,000	10,352,158.90	4.94
2	190308	19 进出 08	100,000	10,261,498.63	4.89
3	2203676	22 进出 676	100,000	9,975,158.70	4.76
4	012103948	21 康欣新材 SCP002	60,000	6,143,600.55	2.93
5	012281966	22 云建投 SCP005	60,000	6,021,322.19	2.87

### 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国债期货交易情况说明

#### （1）本期国债期货投资策略

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

(2) 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

(3) 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

## 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受到调查以及处罚的情况的说明

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

(2) 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

(3) 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	345.63
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	124,257.42
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	124,603.05

(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。

## 十、基金的业绩

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

1. 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1) 西部利得添盈短债债券 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
2019年6月4日-2019年12月31日	1.85%	0.01%	1.71%	0.01%	0.14%	0.00%
2020年1月1日-2020年12月31日	0.20%	0.02%	2.28%	0.02%	-2.08%	0.00%
2021年1月1日-2021年12月31日	0.90%	0.02%	2.58%	0.01%	-1.68%	0.01%
2022年1月1日-2022年6月30日	1.45%	0.02%	1.26%	0.01%	0.19%	0.01%
2019年6月4日-2022年6月30日	4.46%	0.02%	8.06%	0.01%	-3.60%	0.01%

## 2) 西部利得添盈短债债券 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
2019年6月4日-2019年12月31日	1.82%	0.01%	1.71%	0.01%	0.11%	0.00%
2020年1月1日-2020年12月31日	0.23%	0.02%	2.28%	0.02%	-2.05%	0.00%
2021年1月1日	-0.09%	0.06%	2.58%	0.01%	-2.67%	0.05%

日-2021年12月31日						
2022年1月1日-2022年6月30日	1.42%	0.02%	1.26%	0.01%	0.16%	0.01%
2019年6月4日-2022年6月30日	3.41%	0.04%	8.06%	0.01%	-4.65%	0.03%

## 2) 西部利得添盈短债债券 E:

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
2019年6月4日-2019年12月31日	1.70%	0.01%	1.71%	0.01%	-0.01%	0.00%
2020年1月1日-2020年12月31日	-0.11%	0.02%	2.28%	0.02%	-2.39%	0.00%
2021年1月1日-2021年12月31日	0.65%	0.02%	2.58%	0.01%	-1.93%	0.01%
2022年1月1日-2022年6月30日	1.31%	0.02%	1.26%	0.01%	0.05%	0.01%
2019年6月4日-2022年6月30日	3.59%	0.02%	8.06%	0.01%	-4.47%	0.01%

2. 自基金合同生效以来基金份额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

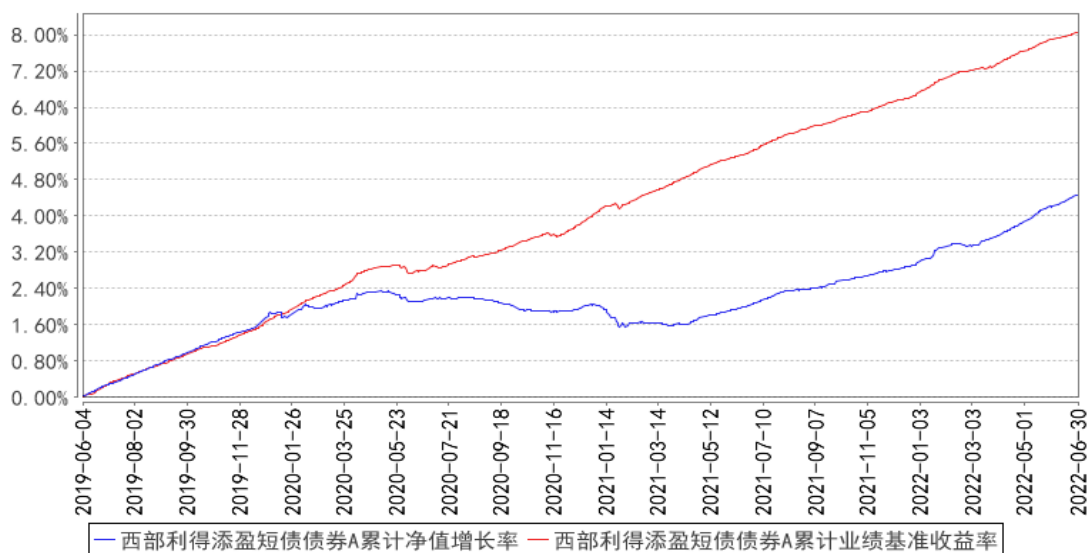
西部利得合赢债券型证券投资基金份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对

比图

1) 西部利得添盈短债债券 A:

(2019年6月4日至2022年6月30日)

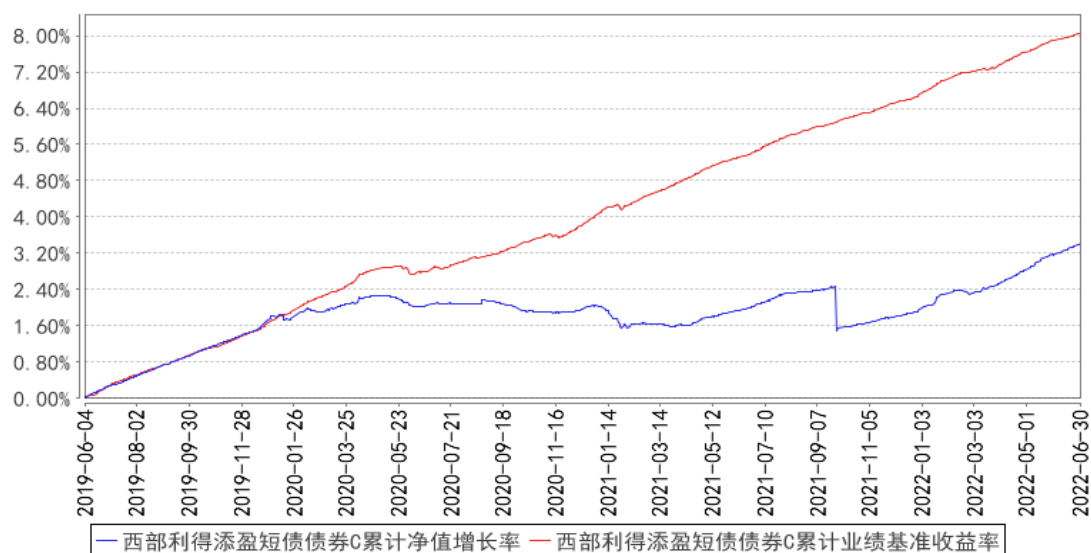
西部利得添盈短债债券A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



2) 西部利得添盈短债债券 C:

(2019年6月4日至2022年6月30日)

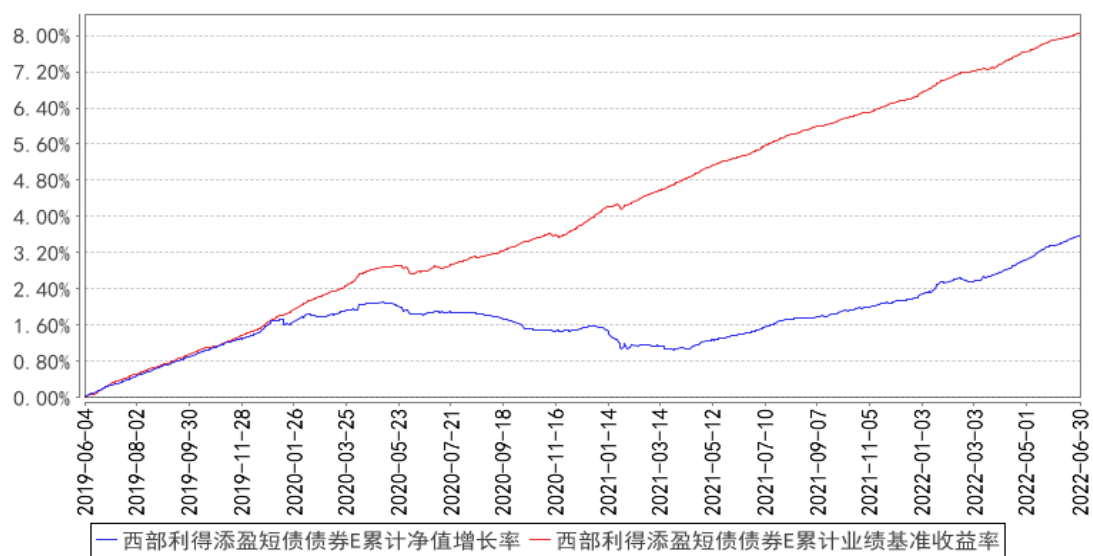
西部利得添盈短债债券C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



2) 西部利得添盈短债债券 E:

(2019年6月4日至2022年6月30日)

西部利得添盈短债债券E累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



## 第十部分 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有价证券、银行存款本息和基金应收款项以及其他资产的价值总和。

### 二、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### 三、基金财产的账户

基金托管人根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立资金账户、证券账户以及投资所需的其他专用账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

### 四、基金财产的保管和处分

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

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

## 第十一部分 基金资产的估值

### 一、估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券交易场所的交易日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非交易日。

### 二、估值对象

基金所拥有的债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

### 三、估值方法

#### 1、证券交易所市场交易的债券的估值

(1) 交易所上市实行全价交易的债券品种(可转债除外), 选取第三方估值机构提供的估值全价减去估值全价中所含的债券(税后)应收利息得到的净价估值; 对在交易所市场上市交易或挂牌转让的实行净价交易的固定收益品种, 选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值;

(2) 交易所上市交易的可转换债券, 以每日收盘价减去可转换债券收盘价中所含的债券(税后)应收利息得到的净价进行估值; 估值日没有交易的, 且最近交易日后经济环境未发生重大变化, 按最近交易日可转换债券收盘价减去可转换债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的, 可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素, 调整最近交易市价, 确定公允价格;

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

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

#### 2、全国银行间市场交易品种的估值:

(1) 全国银行间市场交易的固定收益品种, 以第三方估值机构提供的价格数据估值;

(2) 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。

3、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的, 按债券所处的市场分别估值。

4、基金投资同业存单, 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。

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

6、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。



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。

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

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

#### 四、估值程序

1、基金份额净值是按照每个工作日闭市后,基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算,精确到0.0001元,小数点后第5位四舍五入。国家另有规定的,从其规定。

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

#### 五、估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当任一类基金份额净值小数点后4位以内(含第4位)发生估值错误时,视为基金份额净值错误。

基金合同的当事人应按照以下约定处理:

##### 1、估值错误类型

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

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

##### 2、估值错误处理原则

(1)估值错误已发生,但尚未给当事人造成损失时,估值错误责任方应及时协调各方,及时进行更正,因更正估值错误发生的费用由估值错误责任方承担;由于估值错误责任方未及时更正已产生的估值错误,给当事人造成损失的,由估值错误责任方对直接损失承担赔偿责任;若估值错误责任方已经积极协调,并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正,则其应当承担相应赔偿责任。估值错误责任方应对更正的情况向有关当事人进行确

认, 确保估值错误已得到更正。

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

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

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

### 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后, 有关的当事人应当及时进行处理, 处理的程序如下:

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

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

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

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

### 4、基金份额净值估值错误处理的方法如下:

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

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

(3) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的, 从其规定处理。

## 六、暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;

2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时;

3、当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上的, 经与基金托管人协商一致的, 应当暂停估值;

4、法律法规规定、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

## 七、基金净值的确认

基金资产净值和各类基金份额的基金份额净值由基金管理人负责计算, 基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的基金资产净值和各类基金份额

的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。

#### **八、特殊情形的处理**

1、基金管理人按估值方法规定的第 5 项条款进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

2、由于证券交易所及其登记结算公司发送的数据错误，或由于其他不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，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。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

#### **九、实施侧袋机制期间的基金资产估值**

本基金实施侧袋机制的，基金管理人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，暂停披露侧袋账户份额净值。

## 第十二部分 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、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金份额持有人可对其持有的A类、C类和E类基金份额分别选择不同的收益分配方式；

同一投资人持有的同一类别的基金份额只能选择一种分红方式，如投资人在不同销售机构选择的分红方式不同，则基金登记机构将以投资人最后一次选择的分红方式为准；

2、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

3、由于本基金A类基金份额不收取销售服务费，而C类、E类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

4、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在符合法律法规及基金合同约定，并对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则和支付方式进行调整，不需召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在指定媒介公告。

### 四、收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

### 五、收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

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

### 六、基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人的现金

红利小于一定金额,不足以支付银行转账或其他手续费用时,基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为相应类别的基金份额。红利再投资的计算方法,依照《业务规则》执行。

#### **七、实施侧袋机制期间的收益分配**

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

## 第十三部分 基金费用与税收

### 一、与基金运作有关的费用

#### (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、本基金C类、E类基金份额的销售服务费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、基金的开户费用、账户维护费用；
- 10、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

#### (二) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

##### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.30%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，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起3个工作日内或不可抗力情形消除之日起3个工作日内支付。

##### 2、基金托管人的托管费

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

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

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起3个工作日内或不可抗力情形消除之日起3个工作日内支付。

### 3、基金销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费, C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.10%, E 类基金份额的销售服务费年费率为 0.25%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务, 基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。

本基金销售服务费按前一日 C 类、E 类基金资产净值的销售服务年费率计提。

计算方法如下:

$H = E \times \text{销售服务年费率} \div \text{当年天数}$

H 为 C 类、E 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类、E 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提, 按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令, 经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性划出, 由登记机构代收, 登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的, 顺延至法定节假日、休息日结束之日起 3 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 3 个工作日内支付。

销售服务费主要用于本基金持续销售以及基金份额持有人服务等各项费用。

上述“(一)基金费用的种类”中第 4—10 项费用, 根据有关法规及相应协议规定, 按费用实际支出金额列入当期费用, 由基金托管人从基金财产中支付。

### 二、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。

### 三、费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后, 可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率、基金销售服务费率等相关费率。

调整基金管理费率、基金托管费率或调高基金销售服务费率, 须召开基金份额持有人大会审议; 调低基金销售服务费率等费率, 无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前 2 个工作日在至少一种指定媒介上公告。

### 四、实施侧袋机制期间的基金费用

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

## 五、基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。



## 第十四部分 基金的会计与审计

### 一、基金会计政策

- 1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；
- 2、基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日，基金首次募集的会计年度按如下原则：如果《基金合同》生效少于2个月，可以并入下一个会计年度披露；
- 3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
- 4、会计制度执行国家有关会计制度；
- 5、本基金独立建账、独立核算；
- 6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；
- 7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

### 二、基金的年度审计

- 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的具有证券、期货相关从业资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意。
- 3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所需按《信息披露办法》的规定在指定媒介公告。

## 第十五部分 侧袋机制

### 一、侧袋机制的实施条件和程序

当基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时,根据最大限度保护基金份额持有人利益的原则,基金管理人经与基金托管人协商一致,并咨询会计师事务所意见后,可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制,无需召开基金份额持有人大会。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。

基金管理人应当在启用侧袋机制后及时发布临时公告,并及时聘请符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所进行审计并披露专项审计意见,内容应包含侧袋账户的初始资产、份额、净资产等信息。

### 二、实施侧袋机制期间基金份额的申购、赎回与登记

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

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

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

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

侧袋账户资产完全清算后,基金管理人将注销侧袋账户。

### 三、实施侧袋机制期间的基金投资及业绩

侧袋机制实施期间,招募说明书“基金的投资”部分约定的投资组合比例、投资策略、组合限制、业绩比较基准、风险收益特征等约定仅适用主袋账户,基金管理人计算各项投资运作指标和基金业绩指标时仅需考虑主袋账户资产。基金管理人不得在侧袋账户中进行除特定资产处置变现以外的其他投资操作。

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

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

### 四、实施侧袋机制期间的基金估值

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

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

### 五、实施侧袋账户期间的基金费用

1、本基金实施侧袋机制的,主袋账户的管理费和托管费按主袋账户基金资产净值作为基数计提。

2、与侧袋账户有关的费用可从侧袋账户中列支,但应待侧袋账户资产变现后方可列支,有关费用可酌情收取或减免,但不得收取管理费。因启用侧袋机制产生的咨询、审计费用等由基金管理人承担。

### 六、侧袋账户中特定资产的处置变现和支付

特定资产以可出售、可回售、可转让、恢复交易等可变现方式恢复流动性后,基金管理人应当按照基金份额持有人利益最大化原则,采取将特定资产予以处置变现等方式,及时向侧袋账户份额持有人支付对应变现款项。

侧袋账户资产全部完成变现并终止侧袋机制后,基金管理人及时聘请符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所进行审计并披露专项审计意见。

### 七、侧袋机制的信息披露

#### 1、临时公告

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

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

处置特定资产的临时公告内容应当包括特定资产处置价格和时间、向侧袋账户份额持有人支付的款项、相关费用发生情况等重要信息。若侧袋账户资产无法一次性完成处置变现,基金管理人在每次处置变现后均应按照相关法律法规要求及时发布临时公告。

#### 2、基金净值信息

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

#### 3、定期报告

侧袋账户实施期间,基金管理人应当在基金定期报告中披露报告期内特定资产处置进展

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。侧袋账户相关信息在定期报告中单独进行披露,包括但不限于:

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

八、本部分关于侧袋机制的相关规定,凡是直接引用法律法规或监管规则的部分,如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的,或将来法律法规或监管规则针对侧袋机制的内容有进一步规定的,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》、《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、行政法规和中国证监会规定的自然人、法人和非法人组织。

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

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的全国性报刊（以下简称“指定报刊”）及指定互联网网站（以下简称“指定网站”）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、中国证监会禁止的其他行为。

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

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

### 五、公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

#### （一）基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议、基金产品资料概要

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

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

基金募集申请经中国证监会注册后，基金管理人在基金份额发售的3日前，将基金招募说明书、《基金合同》摘要登载在指定媒介上；基金管理人、基金托管人应当将《基金合同》、基金托管协议登载在网站上。

#### （二）基金份额发售公告

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

#### （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指定媒介上登载《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指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，通过指定网站、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，在指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，将年度报告登载在指定网站上，并将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计。

基金管理人应当在上半年结束之日起两个月内，编制完成基金中期报告，将中期报告登

载在指定网站上，并将中期报告提示性公告登载在指定报刊上。

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，将季度报告登载在指定网站上，并将季度报告提示性公告登载在指定报刊上。

《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。

本基金持续运作过程中，应当在基金年度报告和半年度报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。

如报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额 20% 的情形，为保障其他投资者的权益，基金管理人至少应当在基金定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本基金的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

#### （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按规定编制临时报告书，并登载在指定报刊和指定网站上。

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

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

或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券,或者从事其他重大关联交易事项,但中国证监会另有规定的除外;

14、基金收益分配事项;

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

16、任一类基金份额净值计价错误达该类基金份额净值百分之零点五;

17、本基金开始办理申购、赎回;

18、本基金发生巨额赎回并延期办理;

19、本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项;

20、本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请;

21、发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时;

22、调整基金份额类别的设置;

23、基金推出新业务或服务;

24、基金管理人采用摆动定价机制进行估值;

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

#### (八) 澄清公告

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

#### (九) 基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项,应当依法报中国证监会备案,并予以公告。

#### (十) 资产支持证券的投资情况

本基金投资资产支持证券,基金管理人应在基金年报及中期报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细。基金管理人应在基金季度报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期末按市值占基金净资产比例大小排序的前10名资产支持证券明细。

#### (十一) 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指定网站上,并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

#### (十二) 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。

(十三) 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、基金清算报告等公开披露的相关基金信息进行复核、审查, 并向基金管理人进行书面或电子确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定报刊中选择一家报刊披露本基金信息。基金管理人、基金托管人应当向中国证监会基金电子披露网站报送拟披露的基金信息, 并保证相关报送信息的真实、准确、完整、及时。

基金管理人、基金托管人除依法在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。

为基金信息披露义务人公开披露的基金信息出具审计报告、法律意见书的专业机构, 应当制作工作底稿, 并将相关档案至少保存到《基金合同》终止后 10 年。

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

## 七、信息披露文件的存放与查阅

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

八、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;
- 2、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;
- 3、法律法规、基金合同或中国证监会规定的情况。

九、本基金信息披露事项以法律法规规定及本章节约定的内容为准。

## 第十七部分 风险揭示

### 一、投资于本基金的主要风险

投资于本基金的主要风险有：

#### 1、市场风险

证券市场价格受到各种因素的影响，导致基金收益水平变化而产生风险，主要包括：

(1) 政策风险。因国家宏观政策（如货币政策、财政政策、行业政策、地区发展政策等）发生变化，导致市场价格波动而产生风险。

(2) 经济周期风险。随着经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化。本基金主要投资于债券，收益水平也会随之变化，从而产生风险。

(3) 利率风险。金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。

(4) 通货膨胀风险。如果发生通货膨胀，基金投资于证券所获得的收益可能会被通货膨胀抵消，从而影响基金资产的保值增值。

(5) 再投资风险。再投资风险反映了利率下降对固定收益证券利息收入再投资收益的影响，这与利率上升所带来的价格风险（即利率风险）互为消长。

#### 2、信用风险

信用风险主要指债券、资产支持证券等信用证券发行主体信用状况恶化，导致信用评级下降甚至到期不能履行合约进行兑付的风险，另外，信用风险也包括证券交易对手因违约而产生的证券交割风险。

#### 3、流动性风险

流动性风险是指因证券市场交易量不足，导致证券不能迅速、低成本地变现的风险。流动性风险还包括基金出现巨额赎回，致使没有足够的现金应付赎回支付所引致的风险。

##### (1) 基金申购、赎回安排

本基金在客户集中度控制、巨额赎回监测及应对在投资者申购赎回方面均明确了管理机制，在接受申购申请对存量客户利益构成潜在重大不利影响，以及市场大幅波动、流动性枯竭等极端情况下发生无法应对投资者巨额赎回的情形时，基金管理人在保障投资者合法权益的前提下可按照法律法规及基金合同的规定，审慎确认申购赎回申请并综合运用各类流动性风险管理工具作为辅助措施，全面应对流动性风险。

##### (2) 拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

本基金以短期债券为主要投资对象，投资于短期债券的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%，本基金所指的短期债券是指剩余期限不超过 397 天（含）的债券资产，包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分。总体来看，投资标的规模较大、流动性充足。此外，

本基金通过投资组合的限制约定了各类资产占本基金资产净值或者占其发行数量的比例。同时,本基金持有的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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。

### (3) 巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

基金出现巨额赎回情形下,基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况或巨额赎回份额占比情况决定全额赎回或部分延期赎回。同时,如本基金单个基金份额持有人在单个开放日申请赎回基金份额超过基金总份额一定比例以上的,基金管理人有权对其采取延期办理赎回申请的措施。

### (4) 实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响

在市场大幅波动、流动性枯竭等极端情况下发生无法应对投资者巨额赎回的情形时,基金管理人将以保障投资者合法权益为前提,严格按照法律法规及基金合同的规定,谨慎选取延期办理巨额赎回申请、暂停接受赎回申请、延缓支付赎回款项、收取短期赎回费、摆动定价、实施侧袋机制等流动性风险管理工具作为辅助措施。对于各类流动性风险管理工具的使用,基金管理人将依照严格审批、审慎决策的原则,及时有效地对风险进行监测和评估,使用前经过内部审批程序并与基金托管人协商一致。在实际运用各类流动性风险管理工具时,投资者的赎回申请、赎回款项支付等可能受到相应影响,基金管理人将严格依照法律法规及基金合同的约定进行操作,全面保障投资者的合法权益。

本基金实施侧袋机制的具体措施,详见招募说明书“侧袋机制”章节的相关内容。

## 4、操作风险

操作风险是指基金运作过程中,因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险,例如,越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误、IT系统故障等风险。

## 5、管理风险

在基金管理运作过程中,基金管理人的研究水平、投资管理水平直接影响基金收益水平,如果基金管理人经济形势和证券市场判断不准确、获取的信息不充分、投资操作出现失误等,都会影响基金的收益水平。

## 6、合规风险

合规风险指基金管理或运作过程中,违反国家法律、法规的规定,或者违反《基金合同》有关规定的风险。

## 7、本基金的特有风险

本基金为债券型基金,债券的投资比例不低于基金资产的80%,该等债券的特定风险即成为本基金及投资者主要面对的特定投资风险。债券的投资收益会受到宏观经济、政府产业政策、货币政策、市场需求变化、行业波动等因素的影响,可能存在所选投资标的成长性与

市场一致预期不符而造成个券价格表现低于预期的风险。

本基金投资资产支持证券，资产支持证券具有一定的价格波动风险、流动性风险、信用风险等风险。价格波动风险指的是市场利率波动会导致资产支持证券的收益率和价格波动。流动性风险指的是受资产支持证券市场规模及交易活跃程度的影响，资产支持证券可能无法在同一价格水平上进行较大数量的买入或卖出，存在一定的流动性风险。信用风险指的基金所投资的资产支持证券之债务人出现违约，或在交易过程中发生交收违约，或由于资产支持证券信用质量降低导致证券价格下降，造成基金财产损失。

## 二、实施侧袋机制对投资者的影响

侧袋机制是一种流动性风险管理工具，是将特定资产分离至专门的侧袋账户进行处置清算，并以处置变现后的款项向基金份额持有人进行支付，目的在于有效隔离并化解风险。但基金启用侧袋机制后，侧袋账户份额将停止披露基金份额净值，并不得办理申购、赎回和转换，仅主袋账户份额正常开放赎回，因此启用侧袋机制时持有基金份额的持有人将在启用侧袋机制后同时持有主袋账户份额和侧袋账户份额，侧袋账户份额不能赎回，其对应特定资产的变现时间具有不确定性，最终变现价格也具有不确定性并且有可能大幅低于启用侧袋机制时的特定资产的估值，基金份额持有人可能因此面临损失。

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

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

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

## 三、其他风险

- 1、因技术因素而产生的风险，如电脑系统出现问题产生的风险；
- 2、因基金业务快速发展但在人员配备、内控等方面不完善而产生的风险；
- 3、因人为因素而产生的风险，如内幕交易、欺诈行为等产生的风险；
- 4、对主要业务人员如基金经理的依赖而可能产生的风险；
- 5、因业务竞争压力可能产生的风险；
- 6、战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金财产损失并影响基金收益水平，从而带来风险；
- 7、其他意外导致的风险。

## 第十八部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### 一、《基金合同》的变更

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

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议须报中国证监会备案，自表决通过之日起生效，并自决议生效后按规定在指定媒介公告。

### 二、《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

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

### 三、基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内成立基金财产清算小组，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、具有证券、期货相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

#### 4、基金财产清算程序：

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

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

#### 四、清算费用

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

#### 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具有证券、期货相关业务资格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。

#### 七、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 第十九部分 基金合同的内容摘要

### 一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

#### (一) 基金份额持有人的权利、义务

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

除法律法规另有规定或本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) 缴纳基金认购、申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用;
- (5) 在其持有的基金份额范围内,承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任;
- (6) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动;
- (7) 执行生效的基金份额持有人大会的决议;
- (8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利;

(9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(二) 基金管理人的权利、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》及有关法律规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- (7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- (8) 选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；
- (9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；
- (10) 依据《基金合同》及有关法律规规定决定基金收益的分配方案；
- (11) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购、赎回或转换申请；
- (12) 依照法律法规为基金的利益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) 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；
- (14) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；
- (15) 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、定期定额投资和非交易过户等业务规则；
- (16) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

- (1) 依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
- (2) 办理基金备案手续；
- (3) 自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；
- (4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式



管理和运作基金财产；

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

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

(7) 依法接受基金托管人的监督；

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

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(10) 编制季度报告、中期报告和年度报告；

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

(12) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；

(13) 按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；

(14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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

(16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上；

(17) 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间内发出，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。

### (三) 基金托管人的权利与义务

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

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

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

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

(4)根据相关市场规则,为基金开设证券账户、资金账户,为基金办理证券交易资金清算;

(5)提议召开或召集基金份额持有人大会;

(6)在基金管理人更换时,提名新的基金管理人;

(7)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

(1)以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产;

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

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

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

(5)保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证;

(6)按规定开设基金财产的资金账户和证券账户,按照《基金合同》的约定,根据基

基金管理人的投资指令,及时办理清算、交割事宜;

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

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

(9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项;

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

(11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上;

(12) 建立并保存基金份额持有人名册;

(13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对;

(14) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项;

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

(16) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作;

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

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

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

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

(21) 执行生效的基金份额持有人大会的决议;

(22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## 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同一类别每一基金份额拥有平等的投票权。若将来法律法规对基金份额持有人大会另有规定的,以届时有效的法律法规为准。

本基金份额持有人大会不设日常机构。

### (一) 召开事由

1、除法律法规另有规定或《基金合同》另有约定外,当出现或需要决定下列事由之一

的,应当召开基金份额持有人大会:

- (1) 终止《基金合同》;
- (2) 更换基金管理人;
- (3) 更换基金托管人;
- (4) 转换基金运作方式;
- (5) 调整基金管理人、基金托管人的报酬标准或提高销售服务费率;
- (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、在不违反法律法规规定和基金合同约定的前提下,以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改,不需召开基金份额持有人大会:

- (1) 调低除管理费、基金托管费外其他应由基金承担的费用;
- (2) 法律法规要求增加的基金费用的收取;
- (3) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下,调整本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式,调整基金份额类别的设置;
- (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) 在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、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申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务规则;
- (7) 按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

## (二) 会议召集人及召集方式

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

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集；

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

4、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开，并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

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

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

（三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

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

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、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和监管机关允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

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

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

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

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式或大会公告载明的其他方式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式或大会公告载明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，并与基金登记机构记录相符。

3、在法律法规和监管机关允许的情况下，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，授权方式可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明；在会议召开方式上，本基金亦可采用其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开基金份额持有人大会，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。基金份额持有人可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式进行表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

#### (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。

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。除另有规定外，转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》、本基金与其他基金合并以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的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异议，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按规定在指定媒介上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

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

### （九）实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定

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

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

2、现场开会的到会者在权益登记日代表的基金份额不少于本基金在权益登记日相关基金份额的二分之一（含二分之一）；

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

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

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

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

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

(含三分之二)通过。

侧袋机制实施期间,基金份额持有人大会审议事项涉及主袋账户和侧袋账户的,应分别由主袋账户、侧袋账户的基金份额持有人进行表决,同一主侧袋账户内的每份基金份额具有平等的表决权。表决事项未涉及侧袋账户的,侧袋账户份额无表决权。

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

(十)本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定,凡是直接引用法律法规或监管规则的部分,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,基金管理人与基金托管人协商一致并提前公告后,可直接对本部分内容进行修改和调整,无需召开基金份额持有人大会审议。

### 三、基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

#### (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。对于法律法规和基金合同规定的可不经基金份额持有人大会决议通过的事项,由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告,并报中国证监会备案。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议须报中国证监会备案,自表决通过之日起生效,并自决议生效后按规定在指定媒介公告。

#### (二)《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的,《基金合同》应当终止:

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

#### (三)基金财产的清算

1、基金财产清算小组:自出现《基金合同》终止事由之日起30个工作日内成立基金财产清算小组,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、具有证券、期货相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

4、基金财产清算程序:

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

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

#### (四) 清算费用

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

#### (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具有证券、期货相关业务资格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。

#### (七) 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。

### 四、争议解决方式

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

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

《基金合同》受中国法律(为本基金合同之目的, 在此不包括香港、澳门特别行政区和台湾地区法律)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》可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅。

## 第二十部分 基金托管协议的内容摘要

### 一、托管协议当事人

#### (一) 基金管理人

名称：西部利得基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区耀体路 276 号 901 室-908 室

法定代表人：何方

成立时间：2010 年 7 月 20 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监许可【2010】864 号

注册资本：叁亿柒仟万元

组织形式：有限责任公司

经营范围：基金募集；基金销售；资产管理以及中国证监会许可的其他业务

存续期间：持续经营

电话：021-38572888

传真：021-38572780

联系人：陈眉媚

#### (二) 基金托管人

名称：平安银行股份有限公司

住所：广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号

法定代表人：谢永林

联系人：刘华栋

联系电话：(0755) 22166388

成立时间：1987 年 12 月 22 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：19,405,918,198 元

批准设立机关和设立文号：中国人民银行总行银复【1987】365 号

存续期间：持续经营

经营范围：办理人民币存、贷、结算、汇兑业务；人民币票据承兑和贴现各项信托业务；经监管机构批准发行或买卖人民币有价证券；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；外汇存款、汇款；境内境外借款；从事同业拆借；外汇借款；外汇担保；在境内境外发行或代理发行外币有价证券；买卖或代客买卖外汇及外币有价证券、自营外汇买卖；贸易、非贸易结算；办理国内结算；国际结算；外币票据的承兑和贴现；外汇贷款；资信调查、咨询、见证业务；保险兼业代理业务；代理收付款项；黄金进口业务；提

供信用证服务及担保；提供保管箱服务；外币兑换；结汇、售汇；信用卡业务；经有关监管机构批准或允许的其他业务。

## 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：

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、短期融资券、超短期融资券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、央行票据、中期票据）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、通知存款以及定期存款等其它银行存款）、同业存单、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）。

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

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：本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%，其中投资于短期债券的比例不低于非现金基金资产的 80%。持有现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金所指的短期债券是指剩余期限不超过 397 天（含）的债券资产，包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分。

如果法律法规或中国证监会允许基金投资其他品种或变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围或可以调整上述投资品种的投资比例。

(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：

a、本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%，其中投资于短期债券的比例不低于非现金基金资产的 80%；

b、本基金保持现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

c、本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；

d、本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；

e、本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不展期；

f、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%；

g、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%；

h、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%；

i、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%；

j、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；

k、基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

l、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、证券停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

m、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；

n、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。

除投资资产配置外，基金托管人对基金的投资的监督和检查自基金合同生效之日起开始。

### （3）法规允许的基金投资比例调整期限

除上述第（2）条第 b、j、l、m 项外，因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但法律法规或中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。

法律法规或监管部门取消或调整上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或以调整后的规定执行，但须提前公告，不需要经基金份额持有人大会审议。

基金托管人对基金投资的监督和检查自《基金合同》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限制行为进行监督：

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提供担保;
- (3) 从事承担无限责任的投资;
- (4) 买卖其他基金份额,但中国证监会另有规定的除外;
- (5) 向基金管理人、基金托管人出资;
- (6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;
- (7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

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的原则,防范利益冲突,建立健全内部审批机制和评估机制,按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意,并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议,并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

法律法规或监管部门取消或变更上述限制,如适用于本基金,则履行适当程序后本基金投资不再受相关限制或按变更后的规定执行。

(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。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的,基金托管人应报告中国证监会。基金托管人有义务要求基金管理人赔偿因其违反《基金合同》而致使投资者遭受的损失。

对于依据交易程序尚未成交的且基金托管人在交易前能够监控的投资指令,基金托管人发现该投资指令违反法律法规规定或者违反《基金合同》约定的,应当拒绝执行,立即通知基金管理人,并向中国证监会报告。

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。

基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查,必须在规定时间内答复基金托管人并改正,就基金托管人的疑义进行解释或举证,对基金托管人按照法规要求需向中国证



监会报送基金监督报告的,基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

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

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、基金管理人对基金托管人的业务监督、核查

基金管理人对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安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、根据管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

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确认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,并予协助配合。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。基金管理人有权要求基金托管人赔偿基金因此所遭受的损失。

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、基金托管人应安全保管基金财产。未经基金管理人的正当指令,不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。
- 3、基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户。
- 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、除依据《基金法》、《运作办法》、《基金合同》及其他有关法律法规规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

## （二）募集资金的验证

基金募集期满或基金管理人宣布停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，由基金管理人在法定期限内聘请具有从事证券业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的2名以上（含2名）中国注册会计师签字有效。验资完成，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，基金托管人在收到资金当日出具确认文件。

若基金募集期限届满，未能达到基金备案的条件，由基金管理人按规定办理退款事宜，基金托管人应给予必要协助。

## （三）基金的银行账户的开立和管理

基金托管人以本基金的名义在其营业机构开设资产托管专户，保管基金的银行存款。该账户的开设和管理由基金托管人承担。本基金的一切货币收支活动，均需通过基金托管人的资产托管专户进行。

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。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；亦不得使用基金的任何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规定。

## （四）基金证券账户与证券交易资金账户的开设和管理

基金托管人以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限公司上海分公司/深圳分公司开设证券账户。

基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司开立基金证券交易资金账户，用于证券清算。

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

## （五）债券托管账户的开立和管理

1、《基金合同》生效后，基金管理人负责以本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；基金托管人负责以本基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司和银行间市场清算所股份有限公司开设银行间债券市场债券托管账

户,并由基金托管人负责基金的债券的后台匹配及资金的清算。

2、基金管理人和基金托管人应一起负责为基金对外签订全国银行间债券市场回购主协议,正本由基金托管人保管,基金管理人保存副本。

#### (六) 其他账户的开设和管理

在本托管协议订立日之后,本基金被允许从事符合法律法规规定和《基金合同》约定的其他投资品种的投资业务时,如果涉及相关账户的开设和使用,由基金管理人协助托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定,开立有关账户。该账户按有关规则使用并管理。

#### (七) 基金财产投资的有关实物证券、银行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或中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分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证券不承担保管责任。

#### (八) 与基金财产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同的原件分别应由基金托管人、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当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15年以上,法律法规另有规定的从其规定。

对于无法取得二份以上的正本的,基金管理人应向基金托管人提供加盖公章的合同复印件或传真件,未经双方协商一致,合同原件不得转移。

## 五、基金资产净值计算与复核

### (一) 基金资产净值的计算

#### 1、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。基金份额净值是指计算日基金资产净值除以该计算日基金份额总份额后的数值。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,由此产生的误差计入基金财产。国家另有规定的,从其规定。

基金管理人应每工作日对基金资产估值。估值原则应符合《基金合同》及相关法律、法规的规定。用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算,基金托管人复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金份额资产净值并以双方

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，由基金管理人对基金净值予以公布。

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

## （二）基金资产估值方法

### 1、估值对象

基金所拥有的债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

### 2、估值方法

本基金的估值方法为：

#### （1）证券交易所市场交易的债券的估值

①交易所上市实行全价交易的债券品种（可转债除外），选取第三方估值机构提供的估值全价减去估值全价中所含的债券（税后）应收利息得到的净价估值；对在交易所市场上市交易或挂牌转让的实行净价交易的固定收益品种，选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；

②交易所上市交易的可转换债券，以每日收盘价减去可转换债券收盘价中所含的债券（税后）应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日可转换债券收盘价减去可转换债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

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

④首次公开发行未上市的债券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

#### （2）全国银行间市场交易品种的估值：

①全国银行间市场交易的固定收益品种，以第三方估值机构提供的价格数据估值；

②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。

（3）同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

（4）基金投资同业存单，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。

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

(6) 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。

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。

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

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

### (三) 估值差错处理

因基金估值错误给投资者造成损失的应先由基金管理人承担, 基金管理人对其不应由其承担的责任, 有权向过错人追偿。

当基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告的, 由此造成的投资者或基金的损失, 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, 由基金管理人与基金托管人按照管理费率 and 托管费率的比列各自承担相应的责任。

由于一方当事人提供的信息错误, 另一方当事人在采取了必要合理的措施后仍不能发现该错误, 进而导致基金资产净值、基金份额净值计算错误造成投资者或基金的损失, 以及由此造成以后交易日基金资产净值、基金份额净值计算顺延错误而引起的投资者或基金的损失, 由提供错误信息的当事人一方负责赔偿。

由于证券交易所及其登记结算公司发送的数据错误, 或由于其他不可抗力原因, 基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查, 但是未能发现该错误的, 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。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

当基金管理人计算的基金资产净值与基金托管人的计算结果不一致时, 相关各方应本着勤勉尽责的态度重新计算核对, 如果最后仍无法达成一致, 应以基金管理人的计算结果为准对外公布, 由此造成的损失以及因该交易日基金资产净值计算顺延错误而引起的损失由基金管理人承担赔偿责任, 基金托管人不负赔偿责任。

### (四) 暂停估值的情形

- 1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;

- 2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；
- 3、当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上的，经与基金托管人协商一致的，应当暂停估值；
- 4、法律法规规定、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

#### (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资产净值的计算和公告的，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。

在《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指定网站上；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。基金管理人在季度结束之日起 15 个工作日内完成季度报告编制并公告；在上半年结束之日起两个月内完成中期报告编制并公告；在每年结束之日起三个月内完成年度报告编制并公告。

基金管理人在月度报告完成当日，对报告加盖公章后，以加密传真方式将有关报告提供基金托管人复核；基金托管人在 3 个工作日内进行复核，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，以电子文件方式将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到后 7 个工作日内进行复核，并将复核结果以书面通知和电子文件签名的方式通知基金管理人。基金管理人在中期报告完成当日，以电子文件方式将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到后 30 日内进行复核，并将复核结果以书面和电子文件签名的方式通知基金管理人。基金管理人在年度报告完成当日，以电子文件方式将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到后 45 日内复核，并将复核结果以书面和电子文件签名的方式通知基金管理人。

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业务印鉴或者出具加盖托管业务部门公章的复核意见书，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证监会备案。

基金托管人在对财务会计报告、中期报告或年度报告复核完毕后,需盖章确认或出具相应的复核确认书,以备有权机构对相关文件审核时提示。

## 六、基金份额持有人名册的登记与保管

基金管理人和基金托管人须分别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登记机构根据基金管理人的指令编制和保管,基金管理人和基金托管人应按照目前相关规则分别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15年,法律法规或监管部门另有规定的,从其规定。

基金管理人应当及时向基金托管人提交下列日期的基金份额持有人名册:《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、每年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。其中每年12月31日的基金份额持有人名册应于下月前十个工作日内提交;《基金合同》生效日、《基金合同》终止日等涉及到基金重要事项日期的基金份额持有人名册应于发生日后十个工作日内提交。

基金托管人以电子版形式妥善保管基金份额持有人名册,并定期刻成光盘备份,保存期限为15年,法律法规或监管部门另有规定的,从其规定。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途,并应遵守保密义务。

若基金管理人或基金托管人由于自身原因无法妥善保管基金份额持有人名册,应按有关法规规定各自承担相应的责任。

## 七、争议解决方式

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,应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当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,仲裁费用和律师费由败诉方承担。

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》和托管协议规定的义务,维护基金份额持有人的合法权益。

本协议受中国法律(为本协议之目的,在此不包括香港、澳门特别行政区和台湾地区法律)管辖。

## 八、托管协议的修改与终止

### (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。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、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、具有证券、期货相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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剩余财产中支付。



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具有证券、期货相关业务资格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。基金财产清算报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。

(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 15 年以上。

## 第二十一部分 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、客户服务专线

#### (一) 理财咨询

人工理财咨询、账户查询、投资人个人资料完善等。

(二) 全天候的7×24小时电话自助查询(基金净值、账户信息、公司介绍、产品介绍等)。

(三) 7×24小时留言信箱。若不在人工服务时间或座席繁忙，可留言，基金管理人会尽快在2个工作日内回电。

### 二、客户投诉及建议受理服务

投资人可以通过信函、电邮、传真等方式提出咨询、建议、投诉等需求，基金管理人将尽快给予回复，并在处理进程中随时给予跟踪反馈。

### 三、短信提示发送服务

投资人可以通过拨打基金管理人客户服务电话申请订制(退订)免费的手机短信资讯。基金管理人定期或不定期向投资人发送短信资讯。

### 四、电子邮件电子刊物发送服务

投资人可以通过拨打基金管理人客户服务电话申请订制(退订)免费的电子邮件资讯。基金管理人定期或不定期向投资人发送电子资讯。

### 五、联系基金管理人

(一) 网址: [www.westleadfund.com](http://www.westleadfund.com)

(二) 电子邮箱: [service@westleadfund.com](mailto:service@westleadfund.com)

(三) 客户服务热线: 400-700-7818(全国免长途话费), 021-38572666

(四) 客户服务传真: 021-38572750

(五) 基金管理人办公地址: 上海市浦东新区耀体路276号晶耀商务广场3号楼9层 邮编: 200126

六、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。

## 第二十二部分 其他应披露的事项

序号	公告事项	披露日期
1	西部利得添盈短债债券型证券投资基金招募说明书	2019-05-11
2	西部利得添盈短债债券型证券投资基金托管协议	2019-05-11
3	西部利得添盈短债债券型证券投资基金基金合同(摘要)	2019-05-11
4	西部利得添盈短债债券型证券投资基金基金合同	2019-05-11
5	西部利得添盈短债债券型证券投资基金基金份额发售公告	2019-05-11
6	关于新增兴业银行股份有限公司为西部利得添盈短债债券型证券投资基金代销机构的公告	2019-05-18
7	关于新增上海陆金所基金销售有限公司为西部利得添盈短债债券型证券投资基金代销机构的公告	2019-05-18
8	关于新增民商基金销售(上海)有限公司为西部利得基金管理有限公司旗下部分基金代销机构并开通定期定额投资、转换业务及参与其费率优惠活动的公告	2019-05-24
9	西部利得添盈短债债券型证券投资基金基金合同生效公告	2019-06-05
10	西部利得基金管理有限公司关于增加西部利得添盈短债债券型证券投资基金销售机构的公告	2019-06-27
11	西部利得添盈短债债券型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定投业务的公告	2019-07-01
12	关于旗下部分基金参加天天基金网费率优惠的公告	2019-07-10
13	关于新增浦领基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构并开通定期定额投资、转换业务的公告	2019-08-16
14	关于微信交易系统升级维护的公告	2019-08-22
15	关于新增北京肯特瑞基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构的公告	2019-09-03
16	关于新增江苏汇林保大基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构并开通定期定额投资、转换业务及参与其费率优惠活动的公告	2019-09-03
17	关于新增诺亚正行基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构并开通定期定额投资、转换业务及参与其费率优惠活动的公告	2019-09-07
18	关于开展直销柜台费率优惠活动的公告	2019-09-12
19	关于新增华瑞保险销售有限公司为旗下部分基金代销机构并开通定期定额投资、转换业务及参与其费率优惠活动的公告	2019-09-17
20	关于新增和耕传承基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构并开通定期定额投资、转换业务及参与其费率优惠活动的公告	2019-09-17

21	关于新增中国中金财富证券有限公司为旗下部分基金代销机构并开通定期定额投资、转换业务及参与其费率优惠活动的公告	2019-09-18
22	关于新增上海云湾基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构的公告	2019-09-24
23	西部利得添盈短债债券型证券投资基金 2019 年第 3 季度报告	2019-10-24
24	关于新增北京植信基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构并开通定期定额投资、转换业务及参与其费率优惠活动的公告	2019-12-11
25	关于微信交易系统升级维护的公告	2019-12-20
26	关于网上交易系统的上线公告	2019-12-21
27	根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修改旗下 33 只公募基金基金合同及托管协议并更新招募说明书及摘要的公告	2019-12-25
28	西部利得添盈短债债券型证券投资基金招募说明书(更新)(2019 年 12 月)	2019-12-25
29	西部利得添盈短债债券型证券投资基金基金合同	2019-12-25
30	西部利得添盈短债债券型证券投资基金托管协议	2019-12-25
31	西部利得添盈短债债券型证券投资基金招募说明书(更新)(2019 年 12 月)(摘要)	2019-12-25
32	关于旗下部分基金参加中国工商银行股份有限公司费率优惠的公告	2019-12-27
33	关于旗下开放式基金 2019 年年度最后一个自然日基金份额净值和基金份额累计净值的公告	2020-01-01
34	西部利得添盈短债债券型证券投资基金 2019 年第 4 季度报告	2020-01-17
35	关于新增英大证券有限责任公司为旗下部分基金代销机构并开通定期定额投资、转换业务及参与其费率优惠活动的公告	2020-01-20
36	关于旗下部分基金参加万家财富基金销售(天津)有限公司费率优惠的公告	2020-02-25
37	关于新增湘财证券股份有限公司为旗下部分基金代销机构并开通定期定额投资、转换业务及参与其费率优惠活动的公告	2020-03-06
38	关于旗下基金持有的停牌股票调整估值的提示性公告	2020-03-25
39	关于推迟披露旗下基金 2019 年年度报告的公告	2020-03-25
40	西部利得添盈短债债券型证券投资基金 2019 年年度报告	2020-03-31
41	西部利得添盈短债债券型证券投资基金 2019 年年度报告摘要	2020-03-31
42	旗下部分基金 2019 年度报告提示性公告	2020-03-31

43	旗下基金 2020 年第 1 季度报告提示性公告	2020-04-22
44	西部利得添盈短债债券型证券投资基金 2020 年第 1 季度报告	2020-04-22
45	关于暂停成都华羿恒信基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	2020-04-23
46	关于旗下部分基金参加恒泰证券股份有限公司费率优惠的公告	2020-06-17
47	关于旗下开放式基金 2020 年半年度最后一个自然日基金份额净值和基金份额累计净值的公告	2020-07-01
48	关于旗下部分基金参加交通银行股份有限公司费率优惠的公告	2020-07-01
49	关于提示旗下网上交易直销平台投资者及时上传身份证照片并完善个人信息的公告	2020-07-09
50	关于旗下部分基金参加申万宏源证券有限公司费率优惠的公告	2020-07-21
51	西部利得添盈短债债券型证券投资基金 2020 年第 2 季度报告	2020-07-21
52	旗下基金 2020 年第 2 季度报告提示性公告	2020-07-21
53	西部利得添盈短债债券型证券投资基金 2020 年中期报告	2020-08-31
54	西部利得添盈短债债券型证券投资基金 2020 年中期报告摘要	2020-08-31
55	旗下基金 2020 年中期报告提示性公告	2020-08-31
56	西部利得添盈短债债券型证券投资基金招募说明书(更新)(2020 年 8 月)	2020-08-31
57	西部利得添盈短债债券型证券投资基金(A 类份额)基金产品资料概要更新	2020-08-31
58	西部利得添盈短债债券型证券投资基金(C 类份额)基金产品资料概要更新	2020-08-31
59	西部利得添盈短债债券型证券投资基金(E 类份额)基金产品资料概要更新	2020-08-31
60	西部利得添盈短债债券型证券投资基金 2020 年第 3 季度报告	2020-10-28
61	旗下基金 2020 年第 3 季度报告提示性公告	2020-10-28
62	高级管理人员变更公告	2020-10-31
63	关于旗下开放式基金 2020 年年度最后一个自然日基金份额净值和基金份额累计净值的公告	2021-01-01
64	关于公司董事及独立董事变更公告	2021-01-07
65	基金行业高级管理人员变更公告(蔡晨研)	2021-01-11

66	基金行业高级管理人员变更公告(孙威)	2021-01-11
67	基金行业高级管理人员变更公告(王宇)	2021-01-11
68	关于即将终止大泰金石基金销售有限公司办理相关销售业务并为投资者办理转托管业务的提示性公告	2021-01-14
69	旗下基金 2020 年第 4 季度报告提示性公告	2021-01-21
70	西部利得添盈短债债券型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	2021-01-21
71	关于旗下基金参与招赢通平台费率优惠活动的公告	2021-03-11
72	西部利得添盈短债债券型证券投资基金 2020 年年度报告	2021-03-30
73	西部利得添盈短债债券型证券投资基金 2020 年年度报告摘要	2021-03-30
74	旗下基金 2021 年第 1 季度报告提示性公告	2021-04-20
75	西部利得添盈短债债券型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	2021-04-20
76	关于官网和网上交易系统停机维护的公告	2021-04-28
77	关于官网和网上交易系统停机维护的公告	2021-04-30
78	关于官网和网上交易系统停机维护的公告	2021-06-04
79	西部利得添盈短债债券型证券投资基金 A 类份额暂停大额申购、大额转换转入、大额定期定额投资业务的公告	2021-06-17
80	西部利得添盈短债债券型证券投资基金 A 类份额分红公告	2021-06-18
81	关于旗下部分基金参加交通银行股份有限公司费率优惠的公告	2021/7/1
82	基金管理人住所变更公告	2021/7/2
83	根据《公开募集证券投资基金侧袋机制指引(试行)》修改旗下 15 只公募基金基金合同有关条款的公告	2021/7/16
84	西部利得添盈短债债券型证券投资基金 2021 年第 2 季度报告	2021/7/20
85	旗下基金 2021 年第 2 季度报告提示性公告	2021/7/20
86	西部利得添盈短债债券型证券投资基金 A 类份额恢复大额申购、大额转换转入、大额定期定额投资业务的公告	2021/7/28
87	旗下基金 2021 年中期报告提示性公告	2021/8/30
88	西部利得添盈短债债券型证券投资基金 2021 年中期报告	2021/8/30
89	旗下基金 2021 年度招募说明书更新及产品资料概要(更新)提示性公告	2021/8/31

90	西部利得添盈短债债券型证券投资基金招募说明书更新(2021年8月)	2021/8/31
91	西部利得添盈短债债券型证券投资基金(A类份额)基金产品资料概要更新	2021/8/31
92	西部利得添盈短债债券型证券投资基金(C类份额)基金产品资料概要更新	2021/8/31
93	西部利得添盈短债债券型证券投资基金(E类份额)基金产品资料概要更新	2021/8/31
94	关于信息技术突发事件发生时投资者可替代交易方式的公告	2021/9/14
95	关于官网和网上交易系统停机维护的公告	2021/10/15
96	旗下基金2021年第3季度报告提示性公告	2021/10/26
97	西部利得添盈短债债券型证券投资基金2021年第三季度报告	2021/10/26
98	关于西部利得基金网上交易客户隐私政策更新提示	2021/12/7
99	关于网上交易系统停机维护的公告	2021/12/8
100	关于北京分公司地址变更的公告	2021/12/27
101	关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关准则的公告	2022/1/5
102	旗下基金2021年第4季度报告提示性公告	2022/1/21
103	西部利得添盈短债债券型证券投资基金2021年第四季度报告	2022/1/21
104	西部利得添盈短债债券型证券投资基金2021年年度报告	2022/3/30
105	旗下基金2021年年度报告提示性公告	2022/3/30
106	关于旗下基金持有的停牌股票估值调整的公告	2022/4/20
107	旗下基金2022年第1季度报告提示性公告	2022/4/21
108	西部利得添盈短债债券型证券投资基金2022年第一季度报告	2022/4/21
109	关于旗下基金持有的停牌股票估值调整的公告	2022/4/26
110	关于终止北京植信基金销售有限公司办理相关销售业务的提示性公告	2022/4/28
111	关于旗下基金持有的停牌股票估值调整的公告	2022/4/30
112	关于网上交易系统停机维护的公告	2022/6/24

## 第二十三部分 招募说明书存放及查阅方式

招募说明书存放在基金管理人的办公场所，投资者可在办公时间查阅；投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。对投资者按此种方式所获得的文件及其复印件，基金管理人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

投资者还可以直接登录基金管理人的网站（[www.westleadfund.com](http://www.westleadfund.com)）查阅和下载招募说明书。



## 第二十四部分 备查文件

以下备查文件存放在基金管理人的办公场所，在办公时间可供免费查阅。

- (一) 中国证监会准予西部利得添盈短债债券型证券投资基金募集的文件
- (二) 《西部利得添盈短债债券型证券投资基金基金合同》
- (三) 《西部利得添盈短债债券型证券投资基金托管协议》
- (四) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- (五) 基金托管人业务资格批件、营业执照
- (六) 法律意见书
- (七) 中国证监会要求的其他文件

查阅方式：投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

西部利得基金管理有限公司

2022年8月