

# 易方达岁丰添利债券型证券投资基金 更新的招募说明书

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

二〇一二年十二月

## 重要提示

本基金根据 2010 年 10 月 11 日中国证券监督管理委员会《关于核准易方达岁丰添利债券型证券投资基金募集的批复》（证监许可[2010]1358 号）和 2010 年 10 月 21 日《关于易方达岁丰添利债券型证券投资基金募集时间安排的确认函》（基金部函[2010]630 号）的核准，进行募集。本基金的基金合同于 2010 年 11 月 9 日正式生效。

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》经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，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。

本基金主要投资于固定收益品种并参与新股申购（含增发），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，本基金持有的信用类固定收益品种违约带来的信用风险，新股发行数量减少及新股申购收益率降低带来的风险，债券投资和新股申购出现亏损的风险，等等；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实施过程中产生的基金管理风险，等等。此外，本基金以 1 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 元初始面值的风险。

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》。

投资有风险，投资者投资本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。

本招募说明书已经本基金托管人复核。除非另有说明，本招募说明书所载内容截止日

为 2012 年 11 月 9 日，有关财务数据截止日为 2012 年 9 月 30 日，净值表现截止日为 2012 年 6 月 30 日。（本报告中财务数据未经审计）

## 目 录

一、绪 言 .....	1
二、释 义 .....	2
三、基金管理人 .....	6
(一) 基金管理人基本情况 .....	6
(二) 主要人员情况 .....	6
(三) 基金管理人的职责 .....	9
(四) 基金管理人的承诺 .....	10
(五) 基金管理人的内部控制制度 .....	11
四、基金托管人 .....	15
(一) 基本情况 .....	15
(二) 基金托管部门及主要人员情况 .....	15
(三) 证券投资基金托管情况 .....	15
(四) 托管业务的内部控制制度 .....	17
(五) 托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序 .....	18
五、相关服务机构 .....	19
(一) 基金份额发售机构 .....	19
(二) 基金登记结算机构 .....	33
(三) 律师事务所和经办律师 .....	34
(四) 会计师事务所和经办注册会计师 .....	34
六、基金的募集 .....	35
七、基金合同的生效 .....	36
八、基金份额的上市交易 .....	36
(一) 基金的上市 .....	36
(二) 上市交易的时间和地点 .....	36
(三) 上市交易的规则 .....	37
(四) 上市交易的费用 .....	37
(五) 上市交易的行情揭示 .....	37
(六) 上市交易的停复牌 .....	37
(七) 暂停上市的情形和处理方式 .....	37
(八) 恢复上市的公告 .....	38

(九) 终止上市的情形和处理方式 .....	38
九、基金份额的申购、赎回和转换 .....	39
(一) 申购与赎回的期间 .....	39
(二) 申购与赎回的场所 .....	39
(三) 申购与赎回办理的开放日及时间.....	39
(四) 申购与赎回的原则 .....	40
(五) 申购与赎回的程序 .....	40
(六) 申购与赎回的数额限制 .....	41
(七) 基金的申购费和赎回费 .....	42
(八) 申购和赎回的数额和价格 .....	43
(九) 申购与赎回的登记结算 .....	44
(十) 巨额赎回的认定及处理方式 .....	45
(十一) 拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理.....	45
(十二) 基金转换 .....	47
(十三) 基金的定期定额投资计划 .....	47
十、基金的转托管、非交易过户、冻结与质押 .....	48
十一、基金的投资 .....	49
(一) 投资目标 .....	49
(二) 投资范围 .....	49
(三) 投资理念 .....	49
(四) 投资策略 .....	50
(五) 业绩比较基准 .....	52
(六) 风险收益特征 .....	52
(七) 投资决策 .....	52
(八) 投资禁止行为与限制 .....	53
(九) 投资组合比例调整 .....	54
(十) 基金的融资、融券 .....	55
(十一) 基金管理人代表基金行使所投资证券产生权利的处理原则及方法.....	55
(十二) 基金投资组合报告（未经审计） .....	55
十二、基金的业绩 .....	60
十三、基金的财产 .....	60

(一) 基金资产总值 .....	60
(二) 基金资产净值 .....	60
(三) 基金财产的账户 .....	61
(四) 基金财产的保管及处分 .....	61
十四、基金资产的估值 .....	62
(一) 估值目的 .....	62
(二) 估值日 .....	62
(三) 估值对象 .....	62
(四) 估值方法 .....	62
(五) 估值程序 .....	64
(六) 暂停估值的情形 .....	64
(七) 基金份额净值的确认 .....	64
(八) 估值错误的处理 .....	64
(九) 特殊情形的处理 .....	65
十五、基金运作方式的变更及相关事项 .....	66
十六、基金的收益分配 .....	67
(一) 基金利润的构成 .....	67
(二) 基金可供分配利润 .....	67
(三) 收益分配原则 .....	67
(四) 收益分配方案 .....	68
(五) 收益分配方案的确定、公告与实施 .....	68
(六) 收益分配中发生的费用 .....	68
十七、基金的费用与税收 .....	69
(一) 基金费用的种类 .....	69
(二) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式 .....	69
(三) 不列入基金费用的项目 .....	70
(四) 基金管理费和基金托管费的调整 .....	70
(五) 税收 .....	70
十八、基金的会计与审计 .....	71
(一) 基金会计政策 .....	71
(二) 基金审计 .....	71

十九、基金的信息披露 .....	71
(一) 信息披露的形式 .....	71
(二) 信息披露的种类、披露时间和披露形式.....	72
(三) 信息披露文件的存放与查阅 .....	74
二十、风险揭示 .....	75
(一) 市场风险 .....	75
(二) 管理风险 .....	76
(三) 流动性风险 .....	76
(四) 特有风险 .....	76
(五) 其他风险 .....	76
二十一、基金合同的变更、终止与基金财产的清算 .....	78
(一) 基金合同的变更 .....	78
(二) 基金合同的终止 .....	78
(三) 基金财产的清算 .....	79
二十二、基金合同的内容摘要 .....	81
(一) 基金管理人的权利和义务 .....	81
(二) 基金托管人的权利和义务 .....	83
(三) 基金份额持有人的权利和义务 .....	84
(四) 基金份额持有人大会 .....	85
(五) 基金合同的变更、终止与基金财产的清算.....	91
(六) 争议的处理 .....	93
(七) 基金合同的效力 .....	93
二十三、基金托管协议的内容摘要 .....	95
(一) 托管协议当事人 .....	95
(二) 基金托管人对基金管理人的业务监督、核查.....	96
(三) 基金管理人对于基金托管人的业务核查.....	98
(四) 基金财产的保管 .....	99
(五) 基金资产净值计算与复核 .....	101
(六) 基金份额持有人名册的保管 .....	102
(七) 适用法律与争议解决方式 .....	102
(八) 托管协议的变更与终止 .....	103

二十四、对基金份额持有人的服务 .....	104
(一) 场外的基金份额持有人投资交易确认服务.....	104
(二) 场外的基金份额持有人交易记录查询服务.....	104
(三) 场外的基金份额持有人的对账单服务形式: .....	104
(四) 资讯服务 .....	104
二十五、其他应披露事项 .....	105
二十六、招募说明书的存放及查阅方式 .....	107
二十七、备查文件 .....	108



## 一、绪 言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《证券投资基金运作管理办法》（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》）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第5号〈招募说明书的内容与格式〉》、《易方达岁丰添利债券型证券投资基金基金合同》（以下简称基金合同）及其它有关规定等编写。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

## 二、释 义

本招募说明书中除非文意另有所指，下列词语有如下含义：

- 基金或本基金：指易方达岁丰添利债券型证券投资基金；
- 基金合同或本基金合同：指《易方达岁丰添利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；
- 招募说明书：指《易方达岁丰添利债券型证券投资基金招募说明书》及其定期更新；
- 发售公告：指《易方达岁丰添利债券型证券投资基金份额发售公告》
- 托管协议：指《易方达岁丰添利债券型证券投资基金托管协议》及其任何有效修订和补充；
- 中国证监会：指中国证券监督管理委员会；
- 中国银监会：指中国银行业监督管理委员会；
- 《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过的自 2004 年 6 月 1 日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及不时做出的修订；
- 《销售办法》：指 2004 年 6 月 25 日由中国证监会公布并于 2004 年 7 月 1 日起实施的《证券投资基金销售管理办法》及不时做出的修订；
- 《运作办法》：指 2004 年 6 月 29 日由中国证监会公布并于 2004 年 7 月 1 日起实施的《证券投资基金运作管理办法》及不时做出的修订；
- 《信息披露办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 8 日颁布并于 2004 年 7 月 1 日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及不时作出的修订；
- 元：指人民币元；
- 基金管理人：指易方达基金管理有限公司；
- 基金托管人：指中国银行股份有限公司；
- 登记结算业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资者基金账户的建立和管理、基金份额登记结算、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等；
- 登记结算机构：易方达基金管理有限公司或其委托的其他符合条件的办理基金登记结算业务的机构；
- 投资者：指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和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者；
- 个人投资者：指依据中华人民共和国有关法律法规可以投资于证券投资基金的自然人；
- 机构投资者：指在中国境内合法登记或经有权政府部门批准设立和有效存续并依法可以投资于证券投资基金的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织；
- 合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》及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；
- 基金份额持有人大会：指按照本基金合同第九部分之规定召集、召开并由基金份额持有人或其合法的代理人进行表决的会议；
- 基金募集期：指基金合同和招募说明书中载明，并经中国证监会核准的基金份额募集期限，自基金份额发售之日起最长不超过 3 个月；
- 基金合同生效日：指募集结束，基金募集的基金份额总额、募集金额和基金份额持有人人数符合相关法律法规和基金合同规定的，基金管理人依据《基金法》向中国证监会办理备案手续后，中国证监会的书面确认之日；
- 存续期：指本基金合同生效至终止之间的不定期期限；
- 封闭期：指本基金采取封闭方式运作的期间，期间不开放申购、赎回；
- 开放期：指本基金采取开放方式运作的期间，期间本基金开放申购、赎回等业务；本基金的开放期是指，本基金依基金合同约定转为上市开放式基金(LOF)的，自转为上市开放式基金(LOF)之日起的不定期存续的期间；

日/天:	指公历日
工作日、交易日:	指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日;
认购:	指在基金募集期内,投资者按照本基金合同的规定申请购买本基金基金份额的行为;
申购:	指在本基金开放期内,投资者申请购买本基金基金份额的行为;
赎回:	指在本基金开放期内,基金份额持有人按基金合同规定的条件要求基金管理人购回本基金基金份额的行为;
基金转换:	指基金份额持有人按基金管理人规定的条件,申请将其持有的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的基金份额的行为;
注册登记系统:	指中国证券登记结算有限责任公司开放式基金注册登记系统;
证券登记结算系统:	指中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记结算系统;
系统内转托管:	指持有人将其持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构(网点)之间或证券登记结算系统内不同会员单位(席位)之间进行转托管的行为;
跨系统转托管:	指持有人将其持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统之间进行转托管的行为;
指令:	指基金管理人在运用基金财产进行投资时,向基金托管人发出的资金划拨及实物券调拨等指令;
场内销售:	指深圳证券交易所会员单位作为代销机构,通过深圳证券交易所交易系统办理基金份额认购等业务;
场外销售:	指销售机构不使用深圳证券交易所交易系统而通过自身的柜台或其他交易系统办理基金份额认购等业务;
销售场所:	指场外销售场所和场内销售场所,分别简称场外和场内;
代销机构:	指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件,取得基金代销业务资格并接受基金管理人委托,代为办理基金认

- 购、申购、赎回和其他基金业务的机构，包括场内代销机构和场外代销机构；
- 销售机构：指基金管理人及本基金代销机构；
- 基金销售网点：指基金管理人的直销网点及基金代销机构的代销网点；
- 指定媒体：指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊和互联网网站或其它媒体；
- 基金账户：指登记结算机构为基金投资者开立的记录其持有的由该登记结算机构办理登记结算的基金份额余额及其变动情况的账户；
- 交易账户：指销售机构为投资者开立的记录投资者通过该销售机构办理认购、申购、赎回、转换及转托管等业务而引起的基金份额的变动及结余情况的账户；
- 开放日：指为投资者办理基金申购、赎回等业务的工作日；
- T 日：指销售机构受理投资者申购、赎回或其他业务申请的日期；
- T+n 日：指 T 日后（不包括 T 日）第 n 个工作日，n 指自然数；
- 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；
- 基金份额净值：指以计算日基金资产净值除以计算日基金份额余额所得的单位基金份额的价值；
- 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；
- 法律法规：指中华人民共和国现行有效的法律、行政法规、司法解释、地方法规、地方规章、部门规章及其他规范性文件以及对于该等法律法规的不时修改和补充；
- 不可抗力：指任何无法预见、无法克服、无法避免的事件和因素，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、疫情、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律变化、突发停电、电脑系统或数据传输系统非正常停止以及其他突发事件、证券交易场所非正常暂停或停止交易等。

### 三、基金管理人

#### (一) 基金管理人基本情况

1. 基金管理人：易方达基金管理有限公司

注册地址：广东省珠海市香洲区情侣路 428 号九洲港大厦 4001 室

办公地址：广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼

设立日期：2001 年 4 月 17 日

法定代表人：叶俊英

联系电话：400 881 8088

联系人：陈晓梅

注册资本：12,000 万元人民币

2. 股权结构：

股东名称	出资比例
广东粤财信托有限公司	1/4
广发证券股份有限公司	1/4
盈峰投资控股集团有限公司	1/4
广东省广晟资产经营有限公司	1/6
广州市广永国有资产经营有限公司	1/12
总 计	100%

#### (二) 主要人员情况

1. 董事、监事及高级管理人员

叶俊英先生，经济学博士，董事长。曾任中国南海石油联合服务总公司条法部科员、副科长、科长，广东省烟草专卖局专卖办公室干部，广发证券有限责任公司投资银行部总经理、公司董事、副总裁，易方达基金管理有限公司董事兼总裁、副董事长兼总裁。现任易方达基金管理有限公司董事长。

刘晓艳女士，经济学博士，董事、总裁。曾任广发证券有限责任公司投资理财部副经理、基金经理，基金投资理财部副总经理、基金资产管理部总经理，易方达基金管理有限公司督察员兼监察部总经理、总裁助理兼市场部总经理、公司副总裁、常务副总裁。现任易方达基金管理有限公司董事、总裁，兼任易方达资产管理（香港）有限公司董事长。

秦力先生，经济学博士，董事。曾任广发证券投资银行部常务副总经理、投资理财部总经理、资金营运部总经理、规划管理部总经理、投资自营部总经理、公司总经理助理、副总经理。现任广发证券股份有限公司董事、常务副总经理，兼任广发信德投资管理有限公司董事长、广发控股（香港）有限公司董事。

邓斌先生，经济学硕士，董事。曾任广东粤财信托投资公司计划资金部副经理、广东粤财信托投资有限公司信托管理一部总经理、广东粤财信托有限公司副总经理、广东粤财投资控股有限公司总经理助理。现任广东粤财投资控股有限公司副总经理，兼任广东粤财信托有限公司总经理。

杨力先生，EMBA，董事。曾任美的集团空调事业部技术主管、企划经理，佛山顺德百年科技有限公司行政总监，美的空调深圳营销中心区域经理，佛山顺德创佳电器有限公司董事、副总经理，长虹空调广州营销中心营销总监，广东盈峰投资控股集团有限公司战略总监、董事、副总裁。现任盈峰投资控股集团有限公司董事、首席战略官。

谢亮先生，EMBA，董事。曾任53011、53061部队财务部门助理员，广州军区生产管理部财务部门助理员、处长，广东省广晟资产经营有限公司总经理助理兼计划财务部部长。现任广东省广晟资产经营有限公司副总经理。

谢石松先生，法学博士，独立董事。现任中山大学法学院教授、国际法研究所所长，兼任中国国际私法学会副会长，武汉大学法学院、西北政法大学兼职教授，中国国际经济贸易仲裁委员会仲裁员及专家咨询委员会成员，上海、广州、深圳、厦门、珠海、佛山、肇庆、惠州等仲裁委员会仲裁员。

王化成先生，经济学博士，独立董事。曾任中国人民大学商学院助教、讲师、副教授。现任中国人民大学商学院教授、博士生导师。

何小锋先生，经济学硕士，独立董事。曾任广东省韶关市教育局干部，中共广东省韶关市委宣传部干部，北京大学经济学院讲师、副教授、金融系主任兼教授及博士生导师。现任北京大学经济学院教授、博士生导师。

陈国祥先生，经济学硕士，监事会主席。曾任交通银行广州分行江南西营业部经理，广东粤财信托投资公司证券部副总经理、基金部总经理，易方达基金管理有限公司总裁助理兼



市场拓展部总经理、市场总监。现任易方达基金管理有限公司监事会主席。

李舫金先生，经济学硕士，监事。曾任华南师范大学外语系党总支书记，中国证监会广州证管办处长。现任广州国际控股集团有限公司副总经理，广州市广永国有资产经营有限公司党支部书记、董事长兼总裁，万联证券有限责任公司董事长(兼)、广州银行副董事长(兼)。

廖智先生，经济学硕士，监事。曾任广东证券股份有限公司基金部主管，易方达基金管理有限公司综合管理部副总经理、人力资源部副总经理。现任易方达基金管理有限公司市场部总经理。

张优造先生，MBA，常务副总裁。曾任南方证券交易中心业务发展部经理，广东证券公司发行上市部经理、深圳证券业务部总经理、基金部总经理，易方达基金管理有限公司董事兼副总裁。现任易方达基金管理有限公司常务副总裁，兼任易方达资产管理(香港)有限公司董事。

肖坚先生，经济学硕士，副总裁。曾任广东粤财信托投资公司职员，香港安财投资有限公司财务部经理，粤信(香港)投资有限公司业务部副经理，广东粤财信托投资公司基金部经理，易方达基金管理有限公司投资管理部常务副总经理、研究部总经理兼任基金投资部总经理、总裁助理兼任基金投资部总经理、总裁助理兼专户投资总监、专户首席投资官、基金科翔基金经理、易方达策略成长证券投资基金基金经理、易方达策略成长二号混合型证券投资基金基金经理、投资经理。现任易方达基金管理有限公司副总裁。

陈志民先生，法学硕士、公共管理硕士，副总裁。曾任厦门国际信托投资公司信托部经理助理，南方基金管理有限公司研究员、基金经理助理、投资部副总经理(主管研究)，易方达基金管理有限公司基金投资部副总经理、机构理财部总经理、基金投资部总经理、总裁助理兼任基金投资部总经理、总裁助理兼任基金投资总监及基金投资部总经理、总裁助理兼任基金投资总监、基金首席投资官、基金科翔基金经理、基金科瑞基金经理、基金科汇基金经理、易方达积极成长证券投资基金基金经理、机构理财部投资经理。现任易方达基金管理有限公司副总裁。

陈彤先生，经济学博士，副总裁。曾任中国经济开发信托投资公司成都营业部研发部副经理、交易部经理、研发部经理、证券总部研究部行业研究员，易方达基金管理有限公司市场拓展部主管、基金科瑞基金经理、市场部华东区大区销售经理、市场部总经理助理兼华东区大区销售经理及南京分公司总经理、上海分公司总经理兼南京分公司及成都分公司总经理、总裁助理兼上海分公司和南京分公司以及成都分公司的总经理、市场总监兼上海分公司和南京分公司以及成都分公司的总经理。现任易方达基金管理有限公司公司副总裁。



张南女士，经济学博士，督察长。曾任广东省经济贸易委员会主任科员、副处长，易方达基金管理有限公司市场拓展部副总经理、督察长兼监察部总经理。现任易方达基金管理有限公司督察长。

## 2. 基金经理

钟鸣远先生，经济学硕士。曾任国家开发银行深圳分行资金计划部职员，联合证券有限责任公司固定收益部投资经理，泰康人寿保险股份有限公司固定收益部研究员，新华资产管理股份有限公司固定收益部高级投资经理，易方达基金管理有限公司固定收益部经理、固定收益部总经理助理、固定收益部副总经理。现任易方达基金管理有限公司固定收益部总经理、易方达增强回报债券型证券投资基金基金经理（自2008年3月19日起任职）、易方达岁丰添利债券型证券投资基金基金经理（自2010年11月9日起任职）、易方达安心回报债券型证券投资基金基金经理（自2011年6月21日起任职）。

## 3. 投资决策委员会成员

本公司投资决策委员会成员包括：刘晓艳女士、肖坚先生、陈志民先生、马骏先生。

刘晓艳女士，同上。

肖坚先生，同上。

陈志民先生，同上。

马骏先生，高级管理人员工商管理硕士(EMBA)。曾任君安证券有限公司营业部职员，深圳众大投资有限公司投资部副总经理，广发证券有限责任公司研究员，易方达基金管理有限公司固定收益部总经理、固定收益投资总监、总裁助理、基金科讯基金经理、易方达50指数证券投资基金基金经理、易方达深证100交易型开放式指数基金基金经理。现任易方达基金管理有限公司固定收益首席投资官兼任易方达资产管理（香港）有限公司人民币合格境外投资者(RQFII)业务负责人。

4. 上述人员之间均不存在近亲属关系。

## （三）基金管理人的职责

1. 依法募集基金，办理或者委托经国务院证券监督管理机构认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回、转换和登记事宜；
2. 办理基金备案手续；
3. 对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；

4. 按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；
5. 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
6. 编制半年度和年度基金报告；
7. 计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；
8. 办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；
9. 召集基金份额持有人大会；
10. 保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
11. 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
12. 国务院证券监督管理机构规定的其他职责。

#### （四）基金管理人的承诺

1. 本基金管理人承诺严格遵守现行有效的相关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会有关规定的行为发生。
2. 本基金管理人承诺严格遵守《证券法》、《基金法》及有关法律法规，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止下列行为发生：
  - （1） 将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
  - （2） 不公平地对待其管理的不同基金财产；
  - （3） 利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人谋取利益；
  - （4） 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
  - （5） 法律法规或中国证监会禁止的其他行为。
3. 本基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下活动：
  - （1） 越权或违规经营；
  - （2） 违反基金合同或托管协议；
  - （3） 故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益；
  - （4） 在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；
  - （5） 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
  - （6） 玩忽职守、滥用职权；

- (7) 违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，  
泄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；
- (8) 违反证券交易场所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场  
秩序；
- (9) 贬损同行，以抬高自己；
- (10) 以不正当手段谋求业务发展；
- (11) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；
- (12) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
- (13) 其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

#### 4. 基金经理承诺

- (1) 依照有关法律、法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取  
最大利益；
- (2) 不利用职务之便为自己及其代理人、受雇人或任何第三人谋取利益；
- (3) 不违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，  
泄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) 不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

### (五) 基金管理人的内部控制制度

为保证公司规范化运作，有效地防范和化解经营风险，促进公司诚信、合法、有效经营，保障基金份额持有人利益，维护公司及公司股东的合法权益，本基金管理人建立了科学、严密、高效的内部控制体系。

#### 1. 公司内部控制的总体目标

- (1) 保证公司经营管理活动的合法合规性；
- (2) 保证基金份额持有人的合法权益不受侵犯；
- (3) 实现公司稳健、持续发展，维护股东权益；
- (4) 促进公司全体员工恪守职业操守，正直诚信，廉洁自律，勤勉尽责；
- (5) 保护公司最重要的资本：公司声誉。

## 2. 公司内部控制遵循的原则

- (1) 全面性原则：内部控制必须覆盖公司的所有部门和岗位，渗透各项业务过程和业务环节，并普遍适用于公司每一位职员；
- (2) 审慎性原则：内部控制的核心是有效防范各种风险，公司组织体系的构成、内部管理制度的建立都要以防范风险、审慎经营为出发点；
- (3) 相互制约原则：公司设置的各部门、各岗位权责分明、相互制衡。
- (4) 独立性原则：公司根据业务的需要设立相对独立的机构、部门和岗位；公司内部部门和岗位的设置必须权责分明；
- (5) 有效性原则：各种内部管理制度具有高度的权威性，应是所有员工严格遵守的行动指南；执行内部管理制度不能有任何例外，任何人不得拥有超越制度或违反规章的权力；
- (6) 适时性原则：内部控制应具有前瞻性，并且必须随着公司经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律、法规、政策制度等外部环境的改变及时进行相应的修改和完善；
- (7) 成本效益原则：公司运用科学化的经营管理方法降低运作成本，提高经济效益，力争以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

## 3. 内部控制的制度体系

公司制定了合理、完备、有效并易于执行的制度体系。公司制度体系由不同层面的制度构成。按照其效力大小分为四个层面：第一个层面是公司章程；第二个层面是公司内部控制大纲，它是公司制定各项规章制度的基础和依据；第三个层面是公司基本管理制度；第四个层面是公司各机构、部门根据业务需要制定的各种制度及实施细则等。它们的制订、修改、实施、废止应该遵循相应的程序，每一层面的内容不得与其以上层面的内容相违背。公司重视对制度的持续检验，结合业务的发展、法规及监管环境的变化以及公司风险控制的要求，不断检讨和增强公司制度的完备性、有效性。

## 4. 关于授权、研究、投资、交易等方面的控制点

### (1) 授权制度

公司的授权制度贯穿于整个公司活动。股东会、董事会、监事会和管理层必须充分履行各自的职权，健全公司逐级授权制度，确保公司各项规章制度的贯彻执行；各项经济经营业务和管理程序必须遵从管理层制定的操作规程，经办人员的每一项工作必须是在业务授权范围内进行。公司重大业务的授权必须采取书面形式，授权书应当明确授权内容和时效。公司

授权要适当，对已获授权的部门和人员应建立有效的评价和反馈机制，对已不适用的授权应及时修改或取消授权。

#### (2) 公司研究业务

研究工作应保持独立、客观，不受任何部门及个人的不正当影响；建立严密的研究工作业务流程，形成科学、有效的研究方法；建立投资产品备选库制度，研究部门根据投资产品的特征，在充分研究的基础上建立和维护备选库。建立研究与投资的业务交流制度，保持畅通的交流渠道；建立研究报告质量评价体系，不断提高研究水平。

#### (3) 基金投资业务

基金投资应确立科学的投资理念，根据决策的风险防范原则和效率性原则制定合理的决策程序；在进行投资时应有明确的投资授权制度，并应建立与所授权限相应的约束制度和考核制度。建立严格的投资禁止和投资限制制度，保证基金投资的合法合规性。建立投资风险评估与管理制，将重点投资限制在规定的风险权限额度内；对于投资结果建立科学的投资管理业绩评价体系。

#### (4) 交易业务

建立集中交易室和集中交易制度，投资指令通过集中交易室完成；应建立交易监测系统、预警系统和交易反馈系统，完善相关的安全设施；集中交易室应对交易指令进行审核，建立公平的交易分配制度，确保各基金利益的公平；交易记录应完善，并及时进行反馈、核对和存档保管；同时应建立科学的投资交易绩效评价体系。

#### (5) 基金会计核算

公司根据法律法规及业务的要求建立会计制度，并根据风险控制点建立严密的会计系统，对于不同基金、不同客户独立建账，独立核算；公司通过复核制度、凭证制度、合理的估值方法和估值程序等会计措施真实、完整、及时地记载每一笔业务并正确进行会计核算和业务核算。同时还建立会计档案保管制度，确保档案真实完整。

#### (6) 信息披露

公司建立了完善的信息披露制度，保证公开披露的信息真实、准确、完整。公司设立了信息披露负责人，并建立了相应的程序进行信息的收集、组织、审核和发布工作，以此加强对信息的审查核对，使所公布的信息符合法律法规的规定，同时加强对信息披露的检查和评价，对存在的问题及时提出改进办法。

#### (7) 监察稽核

公司设立督察长，经董事会聘任，报中国证监会核准。根据公司监察稽核工作的需要和

董事会授权，督察长可以列席公司相关会议，调阅公司相关档案，就内部控制制度的执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能。督察长定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况，董事会对督察长的报告进行审议。

公司设立监察部开展监察稽核工作，并保证监察部的独立性和权威性。公司明确了监察部及内部各岗位的具体职责，严格制订了专业任职条件、操作程序和组织纪律。

监察部强化内部检查制度，通过定期或不定期检查内部控制制度的执行情况，促使公司各项经营管理活动的规范运行。

公司董事会和管理层充分重视和支持监察稽核工作，对违反法律、法规和公司内部控制制度的，追究有关部门和人员的责任。

#### 5. 基金管理人关于内部控制制度声明书

- (1) 本公司承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确；
- (2) 本公司承诺根据市场变化和公司业务发展不断完善内部控制制度。

## 四、基金托管人

### （一）基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期：1983年10月31日

注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

法定代表人：肖钢

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

托管及投资者服务部总经理：李爱华

托管部门信息披露联系人：唐州徽

电话：（010）66594855

传真：（010）66594942

### （二）基金托管部门及主要人员情况

中国银行于1998年设立基金托管部，为进一步树立以投资者为中心的服务理念，中国银行于2005年3月23日正式将基金托管部更名为托管及投资者服务部，现有员工120余人。另外，中国银行在重点分行已开展托管业务。

目前，中国银行拥有证券投资基金、一对多专户、一对一专户、社保基金、保险资产、QFII资产、QDII资产、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、信托资产、年金资产、理财产品、海外人民币基金、私募基金等门类齐全的托管产品体系。在国内，中国银行率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，为各类客户提供个性化的托管服务。2011年末，中国银行各类托管资产规模突破两万亿元，居同业前列。

### （三）证券投资基金托管情况

截至2012年6月末，中国银行已托管长盛创新先锋混合、长盛同盛封闭、长盛同智优势混合（LOF）、大成2020生命周期混合、大成蓝筹稳健混合、大成优选封闭、大成景宏封



闭、工银大盘蓝筹股票、工银核心价值股票、国泰沪深 300 指数、国泰金鹿保本混合、国泰金鹏蓝筹混合、国泰区位优势股票、国投瑞银稳定增利债券、海富通股票、海富通货币、海富通精选贰号混合、海富通收益增长混合、海富通中证 100 指数 (LOF)、华宝兴业大盘精选股票、华宝兴业动力组合股票、华宝兴业先进成长股票、华夏策略混合、华夏大盘精选混合、华夏回报二号混合、华夏回报混合、华夏行业股票 (LOF)、嘉实超短债债券、嘉实成长收益混合、嘉实服务增值行业混合、嘉实沪深 300 指数 (LOF)、嘉实货币、嘉实稳健混合、嘉实研究精选股票、嘉实增长混合、嘉实债券、嘉实主题混合、嘉实回报混合、嘉实价值优势股票型、金鹰成份优选股票、金鹰行业优势股票、银河成长股票、易方达平稳增长混合、易方达策略成长混合、易方达策略成长二号混合、易方达积极成长混合、易方达货币、易方达稳健收益债券、易方达深证 100ETF、易方达中小盘股票、易方达深证 100ETF 联接、万家 180 指数、万家稳健增利债券、银华优势企业混合、银华优质增长股票、银华领先策略股票、景顺长城动力平衡混合、景顺长城优选股票、景顺长城货币、景顺长城鼎益股票 (LOF)、泰信天天收益货币、泰信优质生活股票、泰信蓝筹精选股票、泰信债券增强收益、招商先锋混合、泰达宏利精选股票、泰达宏利集利债券、泰达宏利中证财富大盘指数、华泰柏瑞盛世中国股票、华泰柏瑞积极成长混合、华泰柏瑞价值增长股票、华泰柏瑞货币、华泰柏瑞量化现行股票型、南方高增长股票 (LOF)、国富潜力组合股票、国富强化收益债券、国富成长动力股票、宝盈核心优势混合、招商行业领先股票、东方核心动力股票、华安行业轮动股票型、摩根士丹利华鑫强收益债券型、诺德中小盘股票型、民生加银稳健成长股票型、博时宏观回报债券型、易方达岁丰添利债券型、富兰克林国海中小盘股票型、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金联接、上证中小盘交易型开放式指数、华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接、长城中小盘成长股票型、易方达医疗保健行业股票型、景顺长城稳定收益债券型、上证 180 金融交易型开放式指数、国泰上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金联接、诺德优选 30 股票型、泰达宏利聚利分级债券型、国联安优选行业股票型、长盛同鑫保本混合型、金鹰中证技术领先指数增强型、泰信中证 200 指数、大成内需增长股票型、银华永祥保本混合型、招商深圳电子信息传媒产业 (TMT) 50 交易型开放式指数、招商深证 TMT50 交易型开放式指数证券投资基金联接、嘉实深证基本面 120 交易型开放式指数证券投资基金联接、深证基本面 120 交易型开放式指数、上证 180 成长交易型开放式指数、华宝兴业上证 180 成长交易型开放式指数证券投资基金联接、易方达资源行业股票型、华安深证 300 指数、嘉实信用债券型、平安大华行业先锋股票型、华泰柏瑞信用增利债券型、泰信中小盘精选股票型、海富通国策导



向股票型、中邮上证 380 指数增强型、泰达宏利中证 500 指数分级、长盛同禧信用增利债券型、银华中证内地资源主题指数分级、平安大华深证 300 指数增强型、嘉实安心货币市场、上投摩根健康品质生活股票型、工银瑞信睿智中证 500 指数分级、招商优势企业灵活配置混合型、国泰中小板 300 成长交易型开放式指数、国泰中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金联接、景顺长城优信增利债券型、诺德周期策略股票型、长盛电子信息产业股票型、诺安中证创业成长指数分级、信诚双盈分级债券型、嘉实沪深 300 交易型开放式指数、民生加银信用双利债券型、工银瑞信基本面量化策略股票型、信诚周期轮动股票型、富兰克林国海研究精选股票型、诺安汇鑫保本混合型、平安大华策略先锋混合型、华宝兴业中证短融 50 指数债券型、180 等权重交易型开放式指数、华安双月鑫短期理财债券型、大成景恒保本混合型、景顺长城上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金联接、上投摩根分红添利债券型、嘉实优化红利股票型、嘉实海外中国股票 (QDII)、银华全球优选 (QDII-FOF)、长盛环球景气行业大盘精选股票型 (QDII)、华泰柏瑞亚洲领导企业股票型 (QDII)、信诚金砖四国积极配置 (QDII)、海富通大中华精选股票型 (QDII)、招商标普金砖四国指数 (LOF-QDII)、华宝兴业成熟市场动量优选 (QDII)、大成标普 500 等权重指数 (QDII)、长信标普 100 等权重指数 (QDII)、博时抗通胀增强回报 (QDII)、华安大中华升级股票型 (QDII)、信诚全球商品主题 (QDII)、上投摩根全球天然资源股票型、工银瑞信中国机会全球配置股票型 (QDII)、易方达标普全球高端消费品指数增强型、建信全球资源股票型等 164 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，基金托管规模位居同业前列。

#### (四) 托管业务的内部控制制度

中国银行开办各类基金托管业务均获得相应的授权，并在辖内实行业务授权管理和从业人员核准资格管理。中国银行自 1998 年开办托管业务以来严格按照相关法律法规的规定以及监管部门的监管要求，以控制和防范基金托管业务风险为主线，制定并逐步完善了包括托管业务授权管理制度、业务操作规程、员工职业道德规范、保密守则等在内的各项业务管理制度，将风险控制落实到每个工作环节；在敏感部位建立了安全保密区和隔离墙，安装了录音监听系统，以保证基金信息的安全；建立了有效核对和监控制度、应急制度和稽查制度，保证托管基金资产与银行自有资产以及各类托管资产的相互独立和资产的安全；制定了内部信息管理制度，严格遵循基金信息披露规定和要求，及时准确地披露相关信息。

最近一年内, 中国银行的基金托管业务部门及其高级管理人员无重大违法违规行为, 未受到中国证监会、中国银监会及其他有关机关的处罚。

## (五) 托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》的相关规定, 基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定, 或者违反基金合同约定的, 应当拒绝执行, 立即通知基金管理人, 并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定, 或者违反基金合同约定的, 应当立即通知基金管理人, 并及时向国务院证券监督管理机构报告。

## 五、相关服务机构

### (一) 基金份额发售机构

1. 直销机构：易方达基金管理有限公司

注册地址：广东省珠海市香洲区情侣路 428 号九洲港大厦 4001 室

办公地址：广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43F

法定代表人：叶俊英

电话：020-85102506

传真：400 881 8099

联系人：温海萍

网址：www.efunds.com.cn

直销机构网点信息：

(1) 易方达基金管理有限公司广州直销中心

办公地址：广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40F

电话：020-85102506

传真：400 881 8099

联系人：温海萍

(2) 易方达基金管理有限公司北京直销中心

办公地址：北京市西城区金融街 20 号 B 座 8 层

电话：010-63213377

传真：400 881 8099

联系人：魏巍

(3) 易方达基金管理有限公司上海直销中心

办公地址：上海市世纪大道 88 号金贸大厦 2706-2708 室

电话：021-50476668

传真：400 881 8099

联系人：王璟

(4) 易方达基金管理有限公司网上交易系统

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

## 2. 场内代销机构

具有基金代销资格的深圳证券交易所会员单位。

## 3. 场外代销机构（以下排序不分先后）

### (1) 中国银行

住所：北京市复兴门内大街 1 号

办公地址：北京市复兴门内大街 1 号

法定代表人：肖钢

联系人：侯燕鹏

客户服务电话：95566

传真：010-66594465

网址：[www.boc.cn](http://www.boc.cn)

### (2) 中国工商银行

注册地址：北京西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：姜建清

联系人：王均山

客户服务电话：95588

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

### (3) 中国建设银行

注册地址：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：王洪章

联系人：王嘉朔

客户服务电话：95533

网址：[www.ccb.com](http://www.ccb.com)

### (4) 中国农业银行

注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：蒋超良

联系人：刘一宁

联系电话：010-85108227

客户服务电话：95599

开放式基金业务传真：010-85109219

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

(5) 交通银行

住所：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：胡怀邦

联系人：陈铭铭

联系电话：021-58781234

客户服务电话：95559

传真：021-58408483

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

(6) 北京银行

注册地址：北京市西城区金融大街甲 17 号首层

办公地址：北京市西城区金融大街丙 17 号

法定代表人：闫冰竹

联系人：谢小华

客户服务电话：95526

传真：010-66226045

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

(7) 东莞银行

注册地址：东莞市运河东一路 193 号

办公地址：东莞市运河东一路 193 号

法定代表人：廖玉林

联系人：叶德森

联系电话：0769-22119061

客户服务电话：0769-96228

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

(8) 广州银行

注册地址：广州市广州大道北 195 号

办公地址：广州市广州大道北 195 号

法定代表人：姚建军

客户服务电话：广州：96699；全国：4008996699

网址：www.gzcb.com.cn

(9) 江苏银行

注册地址：南京市洪武北路 55 号

法定代表人：黄志伟

联系人：田春慧、法晓宁

联系电话：025-58587018、025-58587036

客户服务电话：96098、40086-96098

传真：025-58587038

网址：www.jsbchina.cn

(10) 民生银行

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：董文标

联系人：董云巍

联系电话：010-58560666

客户服务电话：95568

传真：010-57092611

网址：www.cmbc.com.cn

(11) 平安银行

注册地址：广东省深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦

办公地址：广东省深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦

法定代表人：肖遂宁

联系人：周晓霞

联系电话：0755-22166212

客户服务电话：95511-3

开放式基金业务传真：0755-25879453

网址：www.bank.pingan.com

(12) 浦发银行

注册地址：上海市浦东新区浦东南路 500 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：吉晓辉

联系人：高天、于慧

联系电话：021-61618888

客户服务电话：95528

传真：021-63604199

网址：www.spdb.com.cn

(13) 中国光大银行

注册地址：北京市西城区复兴门外大街 6 号光大大厦

办公地址：北京市西城区太平桥大街 25 号金融街 F3 大厦(中国光大中心)

法定代表人：唐双宁

联系人：朱红

联系电话：010-63636153

客户服务电话：95595

传真：010-63639709

网址：www.cebbank.com

(14) 广发证券

注册地址：广州天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼（4301-4316 房）

办公地址：广东省广州天河区天河北路大都会广场 5、18、19、36、38、41、42、43 楼

法定代表人：孙树明

联系人：黄岚

客户服务电话：95575

开放式基金业务传真：020-87555305

网址：www.gf.com.cn

(15) 渤海证券

注册地址：天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

办公地址：天津市南开区宾水西道 8 号

法定代表人：杜庆平

联系人：王兆权

联系电话：022-28451861

客户服务电话：400-651-5988

传真：022-28451892

网址：www.bhzq.com

(16) 财富里昂证券

注册地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 9 楼

法定代表人：罗浩

电话：021-38784818

传真：021-68775878

联系人：倪丹

客户服务电话：68777877

网址：www.cf-clsa.com

(17) 财通证券

注册地址：杭州市杭大路 15 号嘉华国际商务中心

办公地址：杭州市杭大路 15 号嘉华国际商务中心

法定代表人：沈继宁

联系人：徐轶青

联系电话：0571-87822359

客户服务电话：96336（浙江）、400-869-6336（全国）

网址：www.ctsec.com

(18) 长城证券

注册地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

法定代表人：黄耀华

联系人：刘阳

联系电话：0755-83516289

客户服务电话：0755-33680000、400-6666-888

传真：0755-83515567

网址：www.cgws.com

(19) 长江证券



注册地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

办公地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：胡运钊

联系人：李良

联系电话：027-65799999

客户服务电话：95579、4008-888-999

传真：027-85481900

网址：www.95579.com

(20) 东海证券

注册地址：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18、19 楼

办公地址：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18、19 楼

法定代表人：朱科敏

联系人：梁旭

联系电话：0519-88157761

客户服务电话：400-888-8588

传真：0519-88157761

网址：www.longone.com.cn

(21) 广州证券

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

办公地址：广州市天河区珠江新城珠江西路 5 号广州国际金融中心 19、20 楼

法定代表人：刘东

联系人：林洁茹

联系电话：020-88836999

客户服务电话：020-961303

传真：020-88836654

网址：www.gzs.com.cn

(22) 国金证券

注册地址：成都市青羊区东城根上街 95 号

办公地址：成都市青羊区东城根上街 95 号

法定代表人：冉云

联系人：金喆

联系电话：028-86690126

客户服务电话：4006 600109

传真：028-86690126

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

(23) 国盛证券

注册地址：江西省南昌市北京西路 88 号（江信国际金融大厦）

办公地址：江西省南昌市北京西路 88 号（江信国际金融大厦）

法定代表人：曾小普

联系人：陈明

联系电话：0791-86281305

客户服务电话：4008222111

传真：0197-86265337

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

(24) 海通证券

注册地址：上海市淮海中路 98 号

办公地址：上海市广东路 689 号

法定代表人：王开国

联系人：金芸、李笑鸣

联系电话：021-23219000

客户服务电话：95553、400-8888-001

传真：021-23219100

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

(25) 宏源证券

注册地址：新疆乌鲁木齐市文艺路 233 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 19 号

法定代表人：冯戎

联系人：李巍

联系电话：010-88085858

客户服务电话：4008-000-562

传真：010-88085195

网址：www.hysec.com

(26) 华安证券

注册地址：安徽省合肥市长江中路 357 号

办公地址：安徽省合肥市南二环 959 号财智中心 B1 座

法定代表人：李工

联系人：甘霖

联系电话：0551-5161666

客户服务电话：96518、400-80-96518

开放式基金业务传真：0551-5161672

网址：www.hazq.com

(27) 华龙证券

注册地址：甘肃省兰州市静宁路 308 号

办公地址：兰州市城关区东岗西路 638 号财富大厦

法定代表人：李晓安

联系人：李昕田

联系电话：0931-4890619

客户服务电话：400-689-8888、0931-4890619

传真：0931-4890628

网址：www.hlzqgs.com

(28) 华泰证券

注册地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

办公地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦、深圳深南大道 4011 号港中旅大厦 24 楼

法定代表人：吴万善

联系人：庞晓芸

开放式基金咨询电话：95597

开放式基金业务传真：025-51863323（南京）；0755-82492962（深圳）

网址：www.htsc.com.cn

(29) 华融证券

注册地址：北京市西城区金融大街 8 号

办公地址：北京市西城区金融大街 8 号 A 座三层、五层

法定代表人：宋德清

联系人：陶颖

联系电话：010-58568040

客户服务电话：010-58568118

传真：010-58568062

网址：www.hrsec.com.cn

(30) 江海证券

注册地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

办公地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

法定代表人：孙名扬

联系人：张宇宏

联系电话：0451-82336863

传真：0451-82287211

客户服务电话：400-666-2288

网址：www.jhzq.com.cn

(31) 金元证券

注册地址：海南省海口市南宝路 36 号证券大厦 4 层

办公地址：深圳市深南大道 4001 号时代金融中心 17 层

法定代表人：陆涛

联系人：马贤清

联系电话：0755-83025022

客户服务电话：400-8888-228

传真：0755-83025625

网址：www.jyzq.cn

(32) 平安证券

注册地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼

办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼

法定代表人：杨宇翔

联系人：郑舒丽

客户服务电话：400-881-6168

开放式基金业务传真：0755-82400862

网址：www.pingan.com

(33) 齐鲁证券

注册地址：山东省济南市经七路 86 号

法定代表人：李玮

联系人：吴阳

联系电话：0531-68889155

客户服务电话：95538

传真：0531-68889752

网址：www.qlzq.com.cn

(34) 瑞银证券

注册地址：北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 12 层、15 层

办公地址：北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 12 层、15 层

法定代表人：刘弘

联系人：牟冲

联系电话：010-58328112

客户服务电话：400-887-8827

传真：010-59228748

网址：www.ubssecurities.com

(35) 山西证券

办公地址：太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

注册地址：太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

法定代表人：侯巍

联系人：郭熠

联系电话：0351-8686659

客户服务电话：95573 或 400-666-1618

传真：0351-8686619

网址：www.i618.com.cn

(36) 申银万国证券

注册地址：上海市常熟路 171 号

办公地址：上海市常熟路 171 号

法定代表人：储晓明

联系人：曹晔

联系电话：021-54033888

客户服务电话：95523、4008895523

传真：021-54038844

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

(37) 万联证券

注册地址：广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 F 栋 18、19 层

办公地址：广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 F 栋 18、19 层

法定代表人：张建军

联系人：罗创斌

联系电话：020-37865070

客户服务电话：400-8888-133

开放式基金业务传真：020-22373718-1013

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

(38) 西部证券

注册地址：西安市东大街 232 号陕西信托大厦 16-17 层

办公地址：西安市东大街 232 号陕西信托大厦 16-17 层

法定代表人：刘建武

联系人：冯萍

联系电话：029-87416787

客户服务电话：029-95582

传真：029-87417012

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

(39) 厦门证券

注册地址：厦门市莲前西路 2 号莲富大厦十七楼

办公地址：厦门市莲前西路 2 号莲富大厦十七楼

法定代表人：傅毅辉

联系人：卢金文

联系电话：0592-5161642

客户服务电话：0592-5163588

传真：0592-5161140

网址：www.xmzq.cn

(40) 湘财证券

注册地址：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号标志商务中心 A 栋 11 层

办公地址：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号标志商务中心 A 栋 11 层

法定代表人：林俊波

联系人：钟康莺

联系电话：021-68634518

开放式基金咨询电话：400-888-1551

开放式基金业务传真：021-68865680

网址：www.xcsc.com

(41) 信达证券

注册地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人：高冠江

联系人：唐静

联系电话：010-63081000

客户服务电话：400-800-8899

传真：010-63080978

网址：www.cindasc.com

(42) 招商证券

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

法定代表人：宫少林

联系人：林生迎

联系电话：0755-82943666

客户服务电话：95565、400-8888-111

传真：0755-82943636

网址：www.newone.com.cn

(43) 中航证券

注册地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼

办公地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼

法定代表人：杜航

联系人：戴蕾

联系电话：0791-86768681

客户服务电话：400-8866-567

传真：0791-86770178

网址：www.avicsec.com

(44) 中山证券

注册地址：深圳市福田区益田路 6009 号新世界中心 29 层

法定代表人：吴永良

联系人：李珍

客户服务电话：4001022011

网址：www.zszq.com.cn

(45) 浙商证券

注册地址：浙江省杭州市杭大路 1 号黄龙世纪广场 A 座

办公地址：浙江省杭州市杭大路 1 号黄龙世纪广场 A 座 6/7

法定代表人：吴承根

联系人：李凌芳

联系电话：021-64718888-1801

客户服务电话：0571967777

传真：021-64713759

网址：www.stocke.com.cn

(46) 中投证券

注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18-21 层及第 04 层 01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23 单元



办公地址：深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 04、18 层至 21 层

法定代表人：龙增来

联系人：刘毅

联系电话：0755-82023442

客户服务电话：400-600-8008

传真：0755-82026539

网址：www.china-invs.cn

(47) 中信证券（浙江）

注册地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 588 号恒鑫大厦主楼 19、20 层

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 588 号恒鑫大厦主楼 19、20 层

法定代表人：沈强

联系人：周妍

联系电话：0571-86078823

客户服务电话：96598

传真：0571-85783771

网址：www.bigsun.com.cn

(48) 中信万通证券

注册地址：青岛市崂山区苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15 层（1507-1510 室）

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层

法定代表人：杨宝林

联系人：吴忠超

联系电话：0532-85022326

客户服务电话：0532-96577

传真：0532-85022605

网址：www.zxwt.com.cn

## (二) 基金登记结算机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京西城区太平桥大街 17 号

办公地址：北京西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：金颖

电话：(010) 59378839

传真：(010) 59378907

联系人：朱立元

### (三) 律师事务所和经办律师

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：韩炯

联系电话：(021) 31358666

传真：(021) 31358600

联系人：黎明

经办律师：吕红、黎明

### (四) 会计师事务所和经办注册会计师

会计师事务所：普华永道中天会计师事务所有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

法定代表人：杨绍信

联系电话：(021) 23238888

传真：(021) 23238800

联系人：沈兆杰

经办注册会计师：薛竞、庄贤

## 六、基金的募集

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同的相关规定、并经中国证券监督管理委员会《关于核准易方达岁丰添利债券型证券投资基金募集的批复》（证监许可[2010]1358号）核准募集。

本基金为契约型、债券型基金。本基金合同生效后三年内（含三年）为封闭期，封闭期间投资者不能申购、赎回本基金份额，但可在本基金上市交易后通过证券交易所转让基金份额。封闭期结束后，本基金转为上市开放式基金（LOF）。

本基金的存续期间为不定期。

本基金募集期间每份基金份额的初始面值为人民币 1.00 元。

本基金募集期自 2010 年 11 月 1 日至 2010 年 11 月 3 日。募集对象为符合法律法规规定的个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和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者。

本基金募集期共募集 2,679,114,943.70 份基金份额，有效认购户数为 2,914 户。

## 七、基金合同的生效

### （一）基金合同的生效

本基金基金合同于 2010 年 11 月 9 日正式生效。自基金合同生效日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

### （二）基金存续期内的基金份额持有人数量和资金额

本合同存续期内，基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5,000 万元的，基金管理人应当及时报告中国证监会；连续 20 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会说明原因和报送解决方案。

法律法规或监管部门另有规定的，按其规定办理。

## 八、基金份额的上市交易

### （一）基金的上市

如基金具备下列条件，基金管理人可依据《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》，向深圳证券交易所申请上市交易。

1. 经中国证监会核准发售且基金合同生效；
2. 基金合同期限五年以上；
3. 基金份额持有人不少于 1000 人；
4. 基金管理人和基金托管人的资格经中国证监会核准；
5. 深圳证券交易所要求的其他条件。

### （二）上市交易的时间和地点

本基金合同生效后，于 2010 年 12 月 3 日开始在深圳证券交易所上市交易。

基金上市后，登记在证券登记结算系统中的基金份额可直接在深圳证券交易所上市交

易; 登记在注册登记系统中的基金份额通过办理跨系统转托管业务将基金份额转至证券登记结算系统后, 方可上市交易。

### (三) 上市交易的规则

本基金在深圳证券交易所的上市交易需遵照《深圳证券交易所交易规则》、《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》等有关规定, 包括但不限于:

1. 本基金上市首日的开盘参考价为前一交易日基金份额净值;
2. 本基金实行价格涨跌幅限制, 涨跌幅比例限制为 10%, 自上市首日起实行;
3. 本基金买入申报数量为 100 份或其整数倍;
4. 本基金申报价格最小变动单位为 0.001 元人民币;
5. 本基金适用大宗交易的有关规则。

### (四) 上市交易的费用

本基金上市交易的费用按照深圳证券交易所有关规定办理。

### (五) 上市交易的行情揭示

本基金在深圳证券交易所挂牌交易, 交易行情通过行情发布系统揭示。行情发布系统同时揭示基金前一交易日的基金份额净值。

### (六) 上市交易的停复牌

本基金的停复牌按照相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所的有关规定执行。

### (七) 暂停上市的情形和处理方式

本基金上市后, 发生下列情况之一时, 应暂停上市交易:

1. 不再具备本条“(一) 基金的上市”中规定的上市条件;
2. 违反国家有关法律、法规, 中国证监会决定暂停其上市;

3. 严重违反《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》；
4. 深圳证券交易所认为应当暂停上市的其他情形。

发生上述暂停上市情形时，基金管理人在接到深圳证券交易所通知后，应立即在至少一种指定媒体上刊登暂停上市公告。

## （八）恢复上市的公告

暂停上市情形消除后，基金管理人可向深圳证券交易所提出恢复上市申请，经深圳证券交易所核准后，可恢复本基金上市，并在至少一种中国证监会指定媒体上刊登恢复上市公告。

## （九）终止上市的情形和处理方式

发生下列情况之一时，本基金应终止上市交易：

1. 自暂停上市之日起半年内未能消除暂停上市原因的；
2. 基金份额持有人大会决定提前终止上市；
3. 基金合同约定的终止上市的其他情形；
4. 深圳证券交易所认为应当终止上市的其他情形。

发生上述终止上市情形时，由证券交易所终止其上市交易，基金管理人报经中国证监会备案后终止本基金的上市，并在至少一种指定媒体上刊登终止上市公告。

相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所对基金上市交易的规则等规定内容进行调整的，本基金的基金合同和更新的招募说明书相应予以修改，且此修改无须召开基金份额持有人大会。

## 九、基金份额的申购、赎回和转换

### （一）申购与赎回的期间

在本基金封闭期内，投资者不能申购、赎回基金份额，但可在本基金上市交易后通过证券交易所转让基金份额。

本基金按照有关法律法规的规定和本基金合同的约定转为上市开放式基金（LOF）后，投资者可进行基金份额的申购、赎回。

### （二）申购与赎回的场所

投资人可以使用基金账户，通过基金管理人、场外代销机构办理申购和赎回业务。投资人也可使用深圳证券账户，通过深圳证券交易所交易系统办理申购和赎回业务。

投资人可通过下述场所按照规定的方式进行申购或赎回：

1. 基金管理人的直销中心及网上交易系统；
2. 办理本基金申购、赎回及相关业务的场内代销机构，即取得基金代销业务资格的深圳证券交易所会员单位；
3. 办理本基金申购、赎回及相关业务的场外代销机构，具体场外代销机构相关信息可见“五、相关服务机构”的“（一）基金份额发售机构”部分。

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。基金管理人可根据情况变更代销机构，并予以公告。

### （三）申购与赎回办理的开放日及时间

#### 1. 开放日及开放时间

本基金开放期内，投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，开放日为上海证券交易所、深圳证券交易所的交易日，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本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

若出现新的证券交易市场或交易所交易时间更改或实际情况需要，基金管理人可对申

购、赎回时间进行调整，但此项调整应按照《信息披露办法》或其他相关规定在实施日前在至少一家指定媒体公告。

## 2. 申购、赎回开始日及业务办理时间

申购赎回业务在本基金转为上市开放式基金（LOF）后开始办理，在确定申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应按照《信息披露办法》或其他相关规定在开始办理申购赎回前在至少一家指定媒体及基金管理人互联网网站（以下简称“网站”）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。本基金开放申购、赎回或转换后，投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请的，其基金份额申购、赎回价格为下一开放日基金份额申购、赎回的价格。

## （四）申购与赎回的原则

1. “未知价”原则，即基金的申购与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. 基金采用金额申购和份额赎回的方式，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3. 场外基金份额持有人在赎回基金份额时，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；

4. 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；

5. 投资人通过深圳证券交易所交易系统办理本基金的场内申购、赎回时，需遵守深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则。若相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对申购、赎回业务等规则有新的规定，按新规定执行；

6. 基金管理人可根据基金运作的实际情况并不影响基金份额持有人实质利益的前提下调整上述原则。基金管理人必须在新规则开始实施前按照《信息披露办法》的有关规定在至少一家指定媒体及基金管理人网站公告并报中国证监会备案。

## （五）申购与赎回的程序

### 1. 申购与赎回申请的提出

基金投资者须按销售机构规定的手续，在开放日的业务办理时间内提出申购或赎回的申



请。

投资者申购本基金，须按销售机构规定的方式全额交付申购款项。

投资者提交赎回申请时，其在销售机构（网点）必须有足够的基金份额余额。

## 2. 申购与赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理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，本基金登记结算机构在 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）及时到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。

基金销售机构申购、赎回申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到该申请。申购、赎回的确认以登记结算机构或基金管理公司的确认结果为准。

## 3. 申购与赎回申请的款项支付

申购采用全额交款方式，若资金在规定时间内未全额到账则申购不成功，投资者已缴付的申购款项本金将退回投资者账户。

投资者赎回申请成功后，赎回款项在自受理基金投资者有效赎回申请之日起不超过 7 个工作日内划往投资者银行账户。在发生巨额赎回时，赎回款项的支付办法按本基金合同和有关法律法规规定处理。

# （六）申购与赎回的数额限制

## 1. 申购金额的限制

场外申购时，投资者通过直销中心首次申购的单笔最低金额为 50,000 元人民币（含申购费），通过代销网点或本公司网上交易系统首次申购的单笔最低金额为 1,000 元人民币（含申购费）；追加申购单笔最低金额均为 1,000 元人民币（含申购费）。各销售机构对申购金额及交易级差有其他规定的，根据其规定办理。

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

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

场内申购时，每笔申购金额最低为 1,000 元，同时申购金额必须是整数金额。

## 2. 赎回份额的限制

投资者单笔赎回申请不得低于 100 份基金份额。

基金管理人可根据市场情况，合理调整对申购金额和赎回份额的数量限制，基金管理人进行前述调整必须按照《信息披露办法》或其他相关规定提前在至少一种指定媒体上公告。

## （七）基金的申购费和赎回费

### 1. 申购费用

投资者在申购本基金份额时需交纳申购费，本基金的申购费用由基金申购人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、登记结算等各项费用。具体费率如下：

申购金额 M（元）（含申购费）	申购费率
M < 100 万	0.8%
100 万 ≤ M < 500 万	0.4%
500 万 ≤ M < 1000 万	0.2%
M ≥ 1000 万	1000 元/笔

在申购费按金额分档的情况下，如果投资者多次申购，申购费适用单笔申购金额所对应的费率。

### 2. 赎回费用

赎回费用由基金赎回人承担，赎回费用的 25% 归基金财产，其余用于支付登记结算费和其他必要的手续费。

本基金的场内赎回适用固定的赎回费率，为 0.1%。

本基金的场外赎回费率按持有时间递减，具体费率如下：

持有时间（天）	赎回费率
0-364	0.1%
365-729	0.05%
730 及以上	0%

3. 基金管理人可以在法律法规和本基金合同规定范围内调整申购费率和赎回费率。费率如发生变更，基金管理人应按照《信息披露办法》或其他相关规定在调整实施前在至少一种指定媒体上公告。

## （八）申购和赎回的数额和价格

### 1. 申购和赎回数额、余额的处理方式

（1）申购份额余额的处理方式：申购的有效份额为按实际确认的净申购金额除以当日的基金份额净值，场外申购涉及金额、份额的计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。场内申购涉及金额的计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产；场内申购涉及份额的计算结果采用截位法保留到整数位，整数位后小数部分的份额对应的资金返还至投资者资金账户。

（2）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以当日基金份额净值为基准并扣除相应的费用，赎回金额计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

### 2. 申购份额的计算

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

（注：对于 1000 万（含）以上适用固定金额申购费的申购，净申购金额 = 申购金额 - 固定申购费金额）

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

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

例三：某投资人投资 4 万元申购本基金，申购费率为 0.8%，假设申购当日基金份额净值为 1.040 元，则其可得到的申购份额为：

$$\text{净申购金额} = 40,000 / (1 + 0.8\%) = 39,682.54 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 40,000 - 39,682.54 = 317.46 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 39,682.54 / 1.040 = 38,156.29 \text{ 份}$$

如果投资人是场内申购，申购份额为 38,156 份，其余 0.29 份对应金额返回给投资人。

具体计算公式为：

$$\text{实际净申购金额} = 38,156 \times 1.040 = 39,682.24 \text{ 元}$$

$$\text{退款金额} = 40,000 - 39,682.24 - 317.46 = 0.30 \text{ 元}$$

### 3. 赎回金额的计算

赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值为基准计算的赎回价格，赎回金额单位为元，计算结果保留到小数点后两位，第三位四舍五入。赎回金额的计算

算方法如下：

赎回费用=赎回份额×T 日基金份额净值×赎回费率

赎回金额=赎回份额×T 日基金份额净值-赎回费用

例四：某投资人赎回 1 万份基金份额，对应的赎回费率为 0.1%，假设赎回当日基金份额净值是 1.016 元，则其可得到的赎回金额为：

赎回费用 =  $10,000 \times 1.016 \times 0.1\% = 10.16$  元

赎回金额 =  $10,000 \times 1.016 - 10.16 = 10,149.84$  元

即：投资人赎回本基金 1 万份基金份额，假设赎回当日基金份额净值是 1.016 元，则其可得到的赎回金额为 10,149.84 元。

#### 4. 基金份额净值的计算公式

基金份额净值=基金资产净值总额/发行在外的基金份额总数

本基金 T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

## （九）申购与赎回的登记结算

### 1. 场外申购和赎回的登记结算

投资者申购基金成功后，正常情况下，登记结算机构在 T+1 日为投资者登记权益并办理登记结算手续，正常情况下，投资者自 T+2 日（含该日）后有权赎回该部分基金份额。

投资者赎回基金成功后，正常情况下，登记结算机构在 T+1 日为投资者办理扣除权益的登记结算手续。

登记结算机构可以在法律法规允许的范围内，对上述登记结算办理时间进行调整，但不得实质影响投资者的合法权益，基金管理人最迟于开始实施前 2 个工作日在至少一家指定媒体及基金管理人网站公告。

### 2. 场内申购和赎回的登记结算

本基金场内申购和赎回的登记结算业务，按照深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关规定办理。

## （十）巨额赎回的认定及处理方式

### 1. 巨额赎回的认定

单个开放日中，本基金的基金份额净赎回申请（赎回申请总份额扣除申购总份额后的余额）与净转出申请（转出申请总份额扣除转入申请总份额后的余额）之和超过上一日基金总份额的 10%，为巨额赎回。

### 2. 巨额赎回的处理方式

出现巨额赎回时，基金管理人可以根据当时基金资产组合状况和深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定，选择下述处理方式：

（1）接受全额赎回：当基金管理人认为有能力兑付投资者的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

（2）部分延期赎回：当基金管理人认为兑付投资者的赎回申请有困难，或认为兑付投资者的赎回申请进行的资产变现可能使基金财产净值发生较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一日基金总份额 10%的前提下，对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个基金份额持有人申请赎回份额占当日申请赎回总份额的比例，确定该基金份额持有人当日受理的赎回份额；未受理部分除投资者在提交赎回申请时选择将当日未获受理部分予以撤销者外，延迟至下一开放日办理，赎回价格为下一开放日的价格。转入下一开放日的赎回申请不享有赎回优先权，以此类推，直到全部赎回为止。

深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司另有规定的，从其规定。

（3）当发生巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或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，同时在至少一种指定媒体予以上公告。

（4）暂停接受和延缓支付：本基金连续 2 个开放日以上发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但延缓期限不得超过 20 个工作日，并应当在至少一种指定媒体上公告。

## （十一）拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理

### 1. 在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资者的申购申请：

（1）因不可抗力导致基金管理人无法受理投资者的申购申请；

- (2) 证券交易场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；
- (3) 发生本基金合同规定的暂停基金财产估值情况；
- (4) 基金财产规模过大，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的利益的情形；
- (5) 基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔或数笔申购；
- (6) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

基金管理人决定拒绝或暂停接受某些投资者的申购申请时，申购款项将退回投资者账户。基金管理人决定暂停接受申购申请时，应当依法公告，上述（5）除外。在暂停申购的情形消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理并依法公告。

2. 在以下情况下，基金管理人可以暂停接受投资者的赎回申请：

- (1) 因不可抗力导致基金管理人无法支付赎回款项；
- (2) 证券交易场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；
- (3) 基金连续发生巨额赎回，根据本基金合同规定，可以暂停接受赎回申请的情况；
- (4) 发生本基金合同规定的暂停基金财产估值的情况；
- (5) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一的，基金管理人应当在当日向中国证监会备案，并及时公告。已接受的赎回申请，基金管理人应当足额支付；如暂时不能足额支付，应当按单个赎回申请人已被接受的赎回申请量占已接受的赎回申请总量的比例分配给赎回申请人，其余部分在后续工作日予以支付。

在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并及时公告。

3. 暂停基金的申购、赎回，基金管理人应按规定公告并报中国证监会备案。

4. 暂停申购或赎回期间结束，基金重新开放时，基金管理人应依法公告并报中国证监会备案。

(1) 如果发生暂停的时间为一天，基金管理人将于重新开放日，在至少一种指定媒体，刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并公告最近一个工作日的基金份额净值。

(2) 如果发生暂停的时间超过一天但少于两周，暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应按照《信息披露办法》或其他相关规定提前在至少一种指定媒体刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近一个工作日的基金份额净值。

(3) 如果发生暂停的时间超过两周，暂停期间，基金管理人应每两周至少重复刊登暂

停公告一次；当连续暂停时间超过两个月时，可对重复刊登暂停公告的频率进行调整。暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应按照《信息披露办法》或其他相关规定提前在至少一种指定媒体刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近一个工作日的基金份额净值。

## （十二）基金转换

在本基金开放期，基金管理人可以根据相关法律法规以及本基金合同的规定，在条件成熟的情况下提供本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换服务。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本基金合同的规定制定并公告。

## （十三）基金的定期定额投资计划

在本基金开放期以及在各项条件成熟的情况下，本基金可为基金投资者提供定期定额投资计划服务，具体实施方法以更新后的招募说明书和基金管理人届时公告为准。



## 十、基金的转托管、非交易过户、冻结与质押

### （一）转托管

#### 1. 系统内转托管

（1）系统内转托管是指持有人将其持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（席位）之间进行转托管的行为。

（2）份额登记在证券登记结算系统的基金份额持有人在变更办理上市交易的会员单位时，可办理已持有基金份额的系统内转托管。

#### 2. 跨系统转托管

跨系统转托管是指持有人将其持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统之间进行转托管的行为。

本基金跨系统转托管的具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司的相关规定办理。

（二）基金的非交易过户是指基金登记结算机构受理继承、捐赠和司法强制执行而产生的非交易过户以及登记结算机构认可、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结算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结算机构的规定办理，并按基金登记结算机构规定的标准收费。

（三）基金登记结算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，以及登记结算机构认可、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按照我国法律法规、监管规章及国家有权机关的要求，以及登记结算机构业务规定来决定是否冻结。

（四）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。



## 十一、基金的投资

### （一）投资目标

本基金通过主要投资债券品种,力争为基金持有人提供持续稳定的高于业绩比较基准的收益,实现基金资产的长期增值。

### （二）投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国债、央行票据、金融债、企业债、短期融资券、公司债、可转换债券(含分离型可转换债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益品种、股票、权证等权益类品种以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产,但可以参与一级市场新股申购或增发新股,并可持有因可转债转股所形成的股票、因所持股票所派发的权证以及因投资可分离债券而产生的权证等。

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

本基金各类资产的投资比例范围为:固定收益类资产的比例不低于基金资产的 80%,其中,信用债券的投资比例不低于固定收益类资产的 40%,权益类资产的比例不高于基金资产的 20%。开放期内,现金以及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

本基金所指的信用债券为企业债、短期融资券、公司债、金融债、可转换债券(含分离型可转换债券)、资产支持证券等除国债和央行票据之外的、非由国家信用担保的固定收益证券品种。

### （三）投资理念

以宏观经济研究指导债券配置,利用严格的信用评估和信用利差分析等技术手段,在风险可控的前提下,争取稳健回报,通过新股申购等方式,提高基金收益。

## （四）投资策略

### 1. 资产配置策略

本基金基于对以下因素的判断，进行基金资产在非信用类固定收益品种（国债、央行票据等）、信用类固定收益品种和新股（含增发）申购之间的配置：1）基于对利率走势、利率期限结构等因素的分析，预测固定收益品种的投资收益和风险；2）对宏观经济、行业前景以及公司财务进行严谨的分析，考察其对固定收益市场信用利差的影响；3）基于对新股发行频率、中签率、上市后的平均涨幅等的分析，预测新股申购的收益率以及风险。

### 2. 固定收益品种投资策略

#### （1）固定收益品种的配置策略

##### a) 平均久期配置

本基金通过对宏观经济变量（包括国内生产总值、工业增长、货币信贷、固定资产投资、消费、外贸差额、财政收支、价格指数和汇率等）和宏观经济政策（包括货币政策、财政政策、产业政策、外贸和汇率政策等）进行分析，预测未来的利率趋势，判断债券市场对上述变量和政策的反应，并据此积极调整债券组合的平均久期，提高债券组合的总投资收益。

##### b) 期限结构配置

本基金对债券市场收益率期限结构进行分析，运用统计和数量分析技术，预测收益率期限结构的变化方式，选择确定期限结构配置策略，配置各期限固定收益品种的比例，以达到预期投资收益最大化的目的。

##### c) 类属配置

本基金对不同类型固定收益品种的信用风险、税赋水平、市场流动性、市场风险等因素进行分析，研究同期限的国债、金融债、企业债、交易所和银行间市场投资品种的利差和变化趋势，制定债券类属配置策略，以获取不同债券类属之间利差变化所带来的投资收益。

#### （2）单个债券的选择

在进行债券组合平均久期、期限结构和类属配置的基础上，本基金对影响个别债券定价的主要因素，包括流动性、市场供求、信用风险、票息及付息频率、税赋、含权等因素进行分析，选择具有良好投资价值的债券品种进行投资。

#### （3）信用债券的投资策略

本基金对信用债券采取自上而下的投资策略。通过对宏观经济和企业财务状况进行分析，对债券的信用风险进行度量及定价，利用市场对信用利差定价的相对失衡，对溢价率较

高的品种进行投资。

- a) 根据宏观经济环境及各行业的发展状况，决定各行业的配置比例；
- b) 研究债券发行人的产业发展趋势、行业政策、公司背景、盈利状况、竞争地位、治理结构、特殊事件风险等基本面信息，分析企业的长期运作风险；
- c) 运用财务评分模型对债券发行人的资产流动性、盈利能力、偿债能力、现金流水平等方面进行综合评分，度量发行人财务风险；
- d) 利用历史数据、市场价格以及资产质量等信息，估算债券发行人的违约率及违约损失率；
- e) 综合发行人各方面分析结果，确定信用利差的合理水平，利用市场的相对失衡，选择溢价偏高的品种进行投资。

#### (4) 信用风险管理

本基金从以下三个方面来进行信用风险管理：1) 进行独立的发行主体信用分析，不断在实践中完善分析方法和积累分析经验数据；2) 严格遵守信用类债券的备选库制度，根据不同的信用风险等级，按照不同的投资管理流程和权限管理制度，对入库债券进行定期信用跟踪分析；3) 采取分散化投资策略和集中度限制，严格控制组合整体的违约风险水平。

#### (5) 资产支持证券投资

本基金将分析资产支持证券的资产特征，估计违约率和提前偿付比率，并利用收益率曲线和期权定价模型，对资产支持证券进行估值。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。本基金投资资产支持证券的比例不高于基金资产净值的 20%。

### 3. 可转换债券的投资策略

可转换债券的价值主要取决于其股权价值、债券价值和转换期权价值，本基金管理人将对可转换债券的价值进行评估，选择具有较高投资价值的可转换债券进行投资。

本管理人将对发行公司的基本面进行分析，包括所处行业的景气度、公司成长性、市场竞争力等，并参考同类公司的估值水平，判断可转换债券的股权投资价值；基于对利率水平、票息率及派息频率、信用风险等因素的分析，判断其债券投资价值；采用期权定价模型，估算可转换债券的转换期权价值。综合以上因素，对可转换债券进行定价分析，制定可转换债券的投资策略。

此外，本基金还将根据新发可转债的预计中签率、模型定价结果，积极参与可转债新券的申购

#### 4. 权益类资产的投资策略

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

本基金对新股发行公司的行业景气度、财务稳健性、公司竞争力、利润成长性等因素进行分析，参考同类公司的估值水平，进行股票的价值评估，从而判断一、二级市场价差的大小，并根据资金成本、新股的中签率及上市后股价涨幅的统计、股票锁定期期间投资风险的判断，制定新股申购策略。在新发股票获准上市后，本基金管理人将根据对股票内在投资价值的判断，结合市场环境的分析，选择适当的时机卖出。对于分离交易的可转换公司债券，在认权证上市后，本基金将根据权证估值模型的分析结果，在权证价值被高估时，选择适当的时机卖出。

### （五）业绩比较基准

本基金业绩比较基准：三年期银行定期存款收益率+1.2%

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，基金管理人可以根据本基金的投资范围和投资策略，确定变更基金的业绩比较基准。业绩比较基准的变更需经基金管理人与基金托管人协商一致。基金管理人最迟应于新的业绩比较基准实施前 2 日在至少一种指定媒体上进行公告并报中国证监会备案。

### （六）风险收益特征

本基金为债券型基金，理论上其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金、股票型基金，高于货币市场基金。

### （七）投资决策

#### 1. 决策依据

- （1）国家有关法律、法规和本基金合同的有关规定。
- （2）宏观经济发展态势、微观经济运行环境和证券市场走势。

#### 2. 决策程序

- 1) 研究员提交宏观经济、债券市场、行业分析、新股申购、公司研究及信用分析报告；

2) 基金经理根据研究报告以及对宏观经济、债券市场投资机会、新股申购收益率、股票市场预期收益水平的判断, 制定资产配置计划, 按照公司制度提交审议并实施;

3) 基金经理制定具体的固定收益品种、新股(含增发)的投资方案, 构造投资组合;

4) 集中交易室依据基金经理的指令, 执行交易;

5) 监察部对基金的日常投资和交易是否遵守法律法规、基金合同进行独立监督检查;

6) 投资风险管理部定期出具基金绩效评估和风险管理报告, 供基金经理调整投资组合时参考;

6) 基金经理定期检讨投资组合的运作成效, 并进行相应的组合调整。

## (八) 投资禁止行为与限制

### 1. 禁止用本基金财产从事以下行为

(1) 承销证券;

(2) 向他人贷款或者提供担保;

(3) 从事承担无限责任的投资;

(4) 买卖其他基金份额, 但是国务院另有规定的除外;

(5) 向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券;

(6) 买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券;

(7) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;

(8) 依照法律、行政法规有关法律法规规定, 由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

### 2. 基金投资组合比例限制

(1) 持有一家上市公司的股票, 其市值不超过基金资产净值的 10%;

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

(3) 基金财产参与股票发行申购, 本基金所申报的金额不超过基金总资产, 本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;

(4) 进入全国银行间同业市场的债券回购融入的资金余额不得超过基金资产净值的

40%；债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

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

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

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

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

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

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

(11) 本基金只投资于投资级别的信用债券，基金持有信用债券期间，如果其信用等级下降至投资级别以下，应在评级报告发布之日起 30 个交易日内予以全部卖出。其中，本基金所指投资级别是指具有由国内评级机构出具的 BBB 级及以上级（若为短期融资券，则为 A-3 级及以上级）信用评级的信用债券；

(12) 本基金不得违反基金合同中有关投资范围、投资策略、投资比例的规定；

(13) 法律法规或监管部门规定的其它限制。

3. 若将来法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更，致使本款前述约定的投资禁止行为和投资组合比例限制被修改或取消，基金管理人在依法履行相应程序后，本基金可相应调整禁止行为和投资限制规定。

## （九）投资组合比例调整

基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的，基金管理人应当在十个交易日内进行调整。法



律法规或监管机构另有规定时，从其规定。

## （十）基金的融资、融券

本基金可以按照国家的有关法律法规规定进行融资、融券。

## （十一）基金管理人代表基金行使所投资证券产生权利的处理原则及方法

1. 不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；
2. 有利于基金资产的安全与增值；
3. 基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金投资者的利益；
4. 基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利，保护基金投资者的利益。

## （十二）基金投资组合报告（未经审计）

本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。

本基金的托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同的规定，已于 2012 年 11 月 26 日复核了本报告的内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告有关数据的期间为 2012 年 7 月 1 日至 2012 年 9 月 30 日。

### 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	80,939,196.93	1.95
	其中：股票	80,939,196.93	1.95
2	固定收益投资	3,932,660,809.07	94.96
	其中：债券	3,932,660,809.07	94.96

	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	40,278,514.04	0.97
6	其他各项资产	87,576,122.65	2.11
7	合计	4,141,454,642.69	100.00

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	33,082,996.93	1.22
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	5,345,000.00	0.20
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	27,737,996.93	1.02
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和	-	-



	供应业		
E	建筑业	31,536,800.00	1.17
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	16,319,400.00	0.60
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	80,939,196.93	2.99

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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002663	普邦园林	1,264,000	31,536,800.00	1.17
2	002662	京威股份	1,908,060	16,409,316.00	0.61
3	300335	迪森股份	1,180,000	16,319,400.00	0.60
4	002667	鞍重股份	535,129	11,328,680.93	0.42
5	002674	兴业科技	500,000	5,345,000.00	0.20

注：本基金本报告期末仅持有以上股票。

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	99,020,000.00	3.66

2	央行票据	-	-
3	金融债券	187,904,000.00	6.94
	其中：政策性金融债	187,904,000.00	6.94
4	企业债券	2,795,071,684.80	103.28
5	企业短期融资券	69,860,000.00	2.58
6	中期票据	242,489,000.00	8.96
7	可转债	538,316,124.27	19.89
8	其他	-	-
9	合计	3,932,660,809.07	145.31

5. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	113003	重工转债	1,985,950	204,294,676.50	7.55
2	112055	11徐工01	2,000,000	203,796,000.00	7.53
3	1280128	12渝地产债	1,100,000	112,475,000.00	4.16
4	122106	11唐新01	1,033,760	105,753,648.00	3.91
5	122108	11新天01	1,000,000	102,000,000.00	3.77

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

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名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8. 投资组合报告附注

(1) 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编

制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

(2) 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) 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	423,247.25
2	应收证券清算款	10,000,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	77,152,875.40
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	87,576,122.65

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110013	国投转债	86,353,323.20	3.19
2	110018	国电转债	86,113,479.20	3.18
3	110017	中海转债	80,526,958.60	2.98
4	125089	深机转债	34,571,255.54	1.28
5	110016	川投转债	25,156,422.80	0.93
6	125731	美丰转债	19,536,932.43	0.72
7	110015	石化转债	1,763,076.00	0.07

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

## 十二、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，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金合同生效日为2010年11月9日，基金合同生效以来（截至2012年6月30日）的投资业绩及与同期基准的比较如下表所示：

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)
基金合同生效至2010年12月31日	1.00%	0.11%	0.74%	0.01%	0.26%	0.10%
2011年1月1日至2011年12月31日	1.19%	0.14%	5.97%	0.02%	-4.78%	0.12%
2012年1月1日至2012年6月30日	8.08%	0.18%	3.06%	0.02%	5.02%	0.16%
基金合同生效至2012年6月30日	10.46%	0.15%	9.77%	0.02%	0.69%	0.13%

## 十三、基金的财产

### (一) 基金资产总值

本基金的基金资产总值包括基金所持有的各类有价证券、银行存款本息、基金的应收款项和其他投资所形成的价值总和。

### (二) 基金资产净值

本基金的基金资产净值是指基金财产总值减去负债后的价值。

### （三）基金财产的账户

本基金根据相关法律法规、规范性文件开立基金资金账户以及证券账户，与基金管理人和基金托管人自有的财产账户以及其他基金财产账户独立。

### （四）基金财产的保管及处分

1. 本基金财产独立于基金管理人及基金托管人的固有财产，并由基金托管人保管。
2. 基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益，归基金财产。
3. 基金管理人、基金托管人、基金登记结算机构和基金代销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。
4. 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范围。
5. 基金财产的债权不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债务相抵销；不同基金财产的债权债务，不得相互抵销。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

## 十四、基金资产的估值

### （一）估值目的

基金估值的目的是为了准确、真实地反映基金相关金融资产和金融负债的公允价值。开放式基金份额申购、赎回价格应按基金估值后确定的基金份额净值计算。

### （二）估值日

本基金的估值日为每个工作日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非营业日。

### （三）估值对象

基金所持有的金融资产和金融负债。

### （四）估值方法

本基金按以下方式进行估值：

#### 1. 证券交易所上市的有价证券的估值

（1）交易所上市的股票、权证，以其估值日在证券交易所挂牌的收盘价估值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的收盘价估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值。

（2）交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值。

(3) 交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按有交易的最近交易日所采用的净价估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日所采用的净价，确定公允价值。

(4) 交易所以大宗交易方式交易的资产支持证券，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。

(5) 交易所上市不存在活跃市场的其他有价证券，采用估值技术确定公允价值。

2. 处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

(1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值价格估值；

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

(3) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值价格估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3. 因持有股票而享有的配股权，以及停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值。

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

5. 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

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

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

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

## （五）估值程序

基金日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行。基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以书面形式报给基金托管人，基金托管人按《基金合同》规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

## （六）暂停估值的情形

1. 基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
2. 因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金财产价值时；
3. 中国证监会认定的其他情形。

## （七）基金份额净值的确认

用于基金信息披露的基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人进行复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金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份额净值予以公布。

基金份额净值的计算精确到 0.001 元，小数点后第四位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

## （八）估值错误的处理

1. 当基金财产的估值导致基金份额净值小数点后三位（含第三位）内发生差错时，视为基金份额净值估值错误。

2. 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财产估值的准确性、及时性。当基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当计价错误达到或超过基金份额净值的 0.25% 时，基金管理人应当报中国证监会备案；当计价错误达到或超过基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应当公告，并同时报中国证监会备案。

3. 前述内容如法律法规或监管机构另有规定的，按其规定处理。



## （九）特殊情形的处理

1. 基金管理人按本条第（四）款有关估值方法规定的第 6 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. 由于不可抗力原因，或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金财产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。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由此造成的影响。

## 十五、基金运作方式的变更及相关事项

### (一)基金运作方式的变更

契约型，本基金合同生效后三年内（含三年）为封闭期，封闭期间投资者不能申购、赎回本基金份额，但可在本基金上市交易后通过证券交易所转让基金份额。封闭期结束后，本基金转为上市开放式基金（LOF）。本基金在封闭期结束后转为上市开放式基金（LOF）不需要召开基金份额持有人大会。

本基金在封闭期内，在符合一定条件的前提下，可以转换运作方式，提前成为上市开放式基金（LOF）。

### (二)在封闭期内转换运作方式

#### 1. 在封闭期内基金转换运作方式的条件

基金合同生效满 12 个月后，若基金折价率连续 50 个交易日超过 10%，则基金管理人将在 30 个工作日内进行召集基金份额持有人大会的公告，审议有关基金转为开放式运作的事项。

其中，T 日基金折价率 =  $1 - T$  当日基金份额收盘价 / T 日基金份额净值。

#### 2. 在封闭期内基金转换运作方式失败

在封闭期内，若审议基金转换运作方式的基金份额持有人大会不满足基金合同和法律法规规定的召开条件而未能召开，基金将保持封闭运作方式。

若基金转换运作方式未获得基金份额持有人大会批准，基金管理人将按照有关规定将基金份额持有人大会表决结果报中国证监会核准并公告。

如在上述情况下，基金份额持有人大会未能召开，或转换基金运作方式的提案未获得基金份额持有人大会通过，但第 1 条约定的情形再次出现的，基金管理人应根据第 1 条另行召集基金份额持有人大会，审议有关转换基金运作方式为上市开放式基金（LOF）的事项。

### (三)转换运作方式对基金份额的交易的影响

转换运作方式后，基金在深圳证券交易所上市交易的相关事宜并不因基金转换运作方式而发生调整。

## 十六、基金的收益分配

### （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资产负债表中基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

### （三）收益分配原则

1. 封闭期内，基金收益分配采用现金方式；开放期内，基金收益分配方式分为现金分红与红利再投资，投资人可选择获取现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资，若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金红利；登记在证券登记结算系统基金份额持有人深圳证券账户下的基金份额只能采取现金红利方式，不能选择红利再投资；

2. 每一基金份额享有同等分配权；

3. 封闭期内，在符合有关基金收益分配条件的前提下，本基金收益每年至少分配 1 次，最多分配 12 次，并且本基金每年度收益分配比例不得低于基金该年度已实现收益的 90%，但若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配。封闭期内，基金合同生效满 6 个月后，若基金在每月最后一个交易日收盘后每 10 份基金份额可分配利润金额高于 0.05 元（含），则基金须进行收益分配，每份基金份额每次分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 80%；

4. 开放期内，本基金收益每年最多分配 12 次，每份基金份额每次分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 60%；

5. 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；

6. 本基金收益分配的发放日距离收益分配基准日的时间不超过 15 个工作日。
7. 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

#### （四）收益分配方案

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

#### （五）收益分配方案的确定、公告与实施

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

法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### （六）收益分配中发生的费用

收益分配时所发生的银行汇划或其他手续费用由投资者自行承担。开放期内，当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行汇划或其他手续费用时，登记结算机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额。红利再投资的计算方法等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定。

## 十七、 基金的费用与税收

### (一) 基金费用的种类

1. 基金管理人的管理费；
2. 基金托管人的托管费；
3. 因基金的证券交易或结算而产生的费用；
4. 基金合同生效以后的信息披露费用；
5. 基金份额持有人大会费用；
6. 基金合同生效以后的会计师费和律师费；
7. 基金的资金汇划费用；
8. 基金上市初费与上市月费；
9. 按照国家有关法律法规规定或行业惯例可以列入的其他费用。

### (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

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的 0.7%年费率计提。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 0.7%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.7\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人于次月首日起 5 个工作日内向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

#### 2. 基金托管人的基金托管费

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的 0.2%年费率计提。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.2%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

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。由基金管理人于次月首日起 5 个工作日内向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

3. 本条第（一）款第 3 至第 9 项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入当期基金费用。

### （三）不列入基金费用的项目

本条第（一）款约定以外的其他费用，以及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，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

### （四）基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。

### （五）税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

## 十八、基金的会计与审计

### （一）基金会计政策

1. 基金的会计年度为公历每年 1 月 1 日至 12 月 31 日。
2. 基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位。
3. 会计核算制度按国家有关的会计核算制度执行。
4. 本基金独立建账、独立核算。
5. 本基金会计责任人为基金管理人。
6. 基金管理人应保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关法律法规规定编制基金会计报表，基金托管人定期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）基金审计

1. 基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相独立的、具有从事证券业务资格的会计师事务所及其注册会计师等对基金年度财务报表及其他规定事项进行审计；
2. 基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须报中国证监会备案。基金管理人应在更换会计师事务所后 2 日内公告。
3. 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；

## 十九、基金的信息披露

### （一）信息披露的形式

本基金的信息披露严格按照《基金法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容和格式准则》、《证券投资基金信息披露编报规则》、基金合同及其它有关规定进行。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

至少一种指定媒体和基金管理人、基金托管人的互联网网站等媒介披露，并保证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。

## （二）信息披露的种类、披露时间和披露形式

### 1. 基金招募说明书、基金合同、基金托管协议

基金募集申请经中国证监会核准后，基金管理人应当在基金份额发售的3日前，将招募说明书、基金合同摘要登载在指定报刊和网站上；基金管理人、基金托管人应当将基金合同、基金托管协议登载在各自公司网站上。

基金合同生效后，基金管理人应当在每6个月结束之日起45日内，更新招募说明书并登载在网站上，将更新后的招募说明书摘要登载在指定报刊上。

### 2. 基金份额发售公告

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

### 3. 基金合同生效公告

基金管理人应当在基金合同生效的次日在指定媒体和网站上登载基金合同生效公告。

### 4. 基金上市交易公告书

基金份额获准在证券交易所上市交易的，基金管理人应当在基金上市日前至少3个工作日，将基金上市交易公告书登载在指定报刊和网站上。

### 5. 基金资产净值、基金份额净值公告

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

基金上市交易后，基金管理人应当在每个交易日的次日，通过网站、基金份额销售网点以及其他媒介，披露交易日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前述最后一个市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定报刊和网站上。

### 6. 定期报告

基金定期报告由基金管理人按照法律法规和中国证监会颁布的有关证券投资基金信息披露内容与格式的相关文件的规定单独编制，由基金托管人按照法律法规的规定对相关内容



进行复核。基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告及更新的招募说明书。

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

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

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

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

法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定。

## 7. 临时报告与公告

基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在两日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日报中国证监会或基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

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事件，包括：

- (1) 基金份额持有人大会的召开；
- (2) 终止基金合同；
- (3) 转换基金运作方式；
- (4) 更换基金管理人、基金托管人；
- (5) 基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- (6) 基金管理人股东及其出资比例发生变更；
- (7) 基金募集期延长；
- (8) 基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动；
- (9) 基金管理人的董事在一年内变更超过 50%；
- (10) 基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过 30%；
- (11) 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼；
- (12) 基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查；

(13) 基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚，基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚；

(14) 重大关联交易事项；

(15) 基金收益分配事项；

(16) 管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；

(17) 基金份额净值计价错误达基金份额净值 0.5%；

(18) 基金改聘会计师事务所；

(19) 基金变更、增加、减少基金代销机构；

(20) 基金更换基金登记结算机构；

(21) 基金开始办理申购、赎回；

(22) 基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；

(23) 基金发生巨额赎回并延期支付；

(24) 基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；

(25) 基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；

(26) 基金暂停上市、恢复上市或终止上市；

(27) 基金份额持有人大会的决议

(28) 中国证监会规定的其他事项。

#### 8. 公开澄清

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

### （三）信息披露文件的存放与查阅

招募说明书公布后，应当分别置备于基金管理人、基金托管人和基金代销机构的住所，投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件。

基金定期报告公布后，应当分别置备于基金管理人和基金托管人的住所，投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件。

## 二十、风险揭示

### （一）市场风险

本基金主要投资于证券市场，而证券市场价格因受到经济因素、政治因素、投资者心理和交易制度等各种因素的影响而产生波动，从而导致基金收益水平发生变化，产生风险。主要的风险因素包括：

#### 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. 利率风险

利率风险主要是指因金融市场利率的波动而导致证券市场价格和收益率变动的风险。利率直接影响着债券的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。本基金主要投资方向包括债券、票据和银行存款，其收益水平直接受到利率变化的影响。

#### 3. 再投资风险

债券、票据偿付本息后以及回购到期后可能由于市场利率的下降面临资金再投资的收益率低于原来利率，由此本基金面临再投资风险。

#### 4. 信用风险

债券发行人不能按期还本付息或回购交易中交易对手在回购到期履行交割责任时不能偿还全部或部分证券或价款，都可能使本基金面临信用风险。

#### 5. 新股风险

如果新股发行数量减少或新股申购收益率降低，本基金将面临收益率降低的风险。尤其当新股上市价格跌破发行价格时，新股申购将可能出现亏损。

#### 6. 经营风险

公司的经营活动受多种因素影响。如管理能力、行业竞争、市场前景、技术更新、新产品研究开发等都会导致公司盈利发生变化。如果基金所投资的上市公司经营不善，其债券价格可能下跌；同时，其偿债能力也会受到影响。

## （二）管理风险

1. 在基金管理运作过程中，基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的占有以及对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平；

2. 基金管理人和基金托管人管理手段和管理技术等因素的变化也会影响基金收益水平。

## （三）流动性风险

流动性风险指因市场交易量不足，导致证券不能迅速、低成本地转变为现金的风险。大部分债券品种的流动性较好，也存在部分可转债、企业债、资产证券化等品种流动性相对较差的情况。在特殊市场情况下(加息或是市场资金紧张的情况下)，会普遍存在债券品种交投不活跃、成交量不足的情形，此时如果基金赎回量较大，可能导致基金收益出现较大波动。

基金管理人为提高新股中签率，可能采取回购的方法，会降低基金资产的流动性。新股申购到股票上市存在一定时间间隔，如果遭遇大量赎回，可能导致基金现金支付出现困难。

## （四）特有风险

1. 本基金对信用债券的投资比例不低于固定收益类资产的 40%。其中信用债券为企业债、短期融资券、公司债、金融债、可转换债券（含分离型可转换债券）、资产支持证券等除国债和央行票据之外的、非由国家信用担保的固定收益证券品种。这些债券发生违约的可能性高于由国家信用担保的固定收益品种，比如国债。本基金相对于普通的债券型基金而言面临着相对更高的信用风险。

2. 本基金合同生效后三年之内为封闭期，封闭期间投资者不能申购、赎回基金份额，但可在基金上市交易后通过证券交易所转让基金份额。在本基金封闭期间，若出现基金折价现象，本基金二级市场的转让价格可能低于基金份额净值。

## （五）其他风险

1. 因技术因素而产生的风险，如电脑系统不可靠产生的风险；

2. 因战争、自然灾害等不可抗力导致的基金管理人、基金托管人、基金代销机构等机构无法正常工作，从而影响基金运作的风险；

3. 因金融市场危机、代理商违约、基金托管人违约等超出基金管理人自身控制能力的因素出现，可能导致基金或者基金份额持有人利益受损的风险。

## 二十一、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。

2. 变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案，并自中国证监会核准或出具无异议意见之日起生效。

3. 但如因相应的法律法规发生变动并属于本基金合同必须遵照进行修改的情形，或者基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化或对基金份额持有人利益无实质性不利影响的，可不经基金份额持有人大会决议，而经基金管理人和基金托管人同意修改后公布，并报中国证监会备案。

4. 基金合同生效后的存续期内，出现以下情形之一的，基金管理人应召集基金份额持有人大会，并由基金份额持有人大会就是否终止基金合同，或基金与其他基金合并进行表决：

（1）基金份额持有人数量连续 60 个工作日达不到 200 人；

（2）基金资产净值连续 60 个工作日低于 3000 万元；

（3）本基金前十大基金份额持有人所持份额数在本基金全部份额数中所占比例连续 60 个工作日达到 90%以上。

### （二）基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同应当终止：

1. 基金份额持有人大会决定终止；

2. 因重大违法、违规行为，被中国证监会责令终止的；

3. 基金管理人、基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金管理人、基金托管人承接的；

4. 法律法规和基金合同规定的其他情形。

基金合同终止后，基金管理人和基金托管人有权依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关法律法规的规定，行使请求给付报酬、从基金财产中获得补

偿的权利。

### （三）基金财产的清算

1. 基金合同终止，基金管理人应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。

#### 2. 基金财产清算组

（1）自基金合同终止事由之日起 30 个工作日内由基金管理人组织成立基金财产清算组，在基金财产清算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托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

（2）基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

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

#### 3. 清算程序

- （1）基金合同终止情形发生后，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- （2）基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；
- （3）基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；
- （4）对基金财产进行评估和变现；
- （5）制作清算报告；
- （6）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；
- （7）将清算报告报中国证监会备案并公告；
- （8）对基金财产进行分配。

#### 4. 清算费用

清算费用是指基金财产清算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组优先从基金财产中支付。

#### 5. 基金剩余财产的分配

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）、（2）、（3）项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

对于由基金交纳、中国证券登记结算有限责任公司收取的最低结算备付金和交易席位保证金，在中国证券登记结算有限责任公司对其进行调整交收日才能收回。

#### 6. 基金财产清算的公告

基金财产清算组做出的清算报告经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并公告。

7. 基金财产清算账册及文件由基金托管人保存 15 年以上。



## 二十二、基金合同的内容摘要

### (一) 基金管理人的权利和义务

#### 1. 基金管理人的权利

- (1) 依法募集基金，办理基金备案手续；
- (2) 依照法律法规和基金合同独立管理运用基金财产；
- (3) 根据法律法规和基金合同的规定，制订、修改并公布有关基金认购、申购、赎回、转托管、基金转换、非交易过户、冻结、收益分配等方面的业务规则；
- (4) 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；
- (5) 根据法律法规和基金合同的规定销售基金份额；
- (6) 在本合同的有效期限内，在不违反公平、合理原则以及不妨碍基金托管人遵守相关法律法规及其行业监管要求的基础上，基金管理人有权对基金托管人履行本合同的情况进行必要的监督。如认为基金托管人违反了法律法规或基金合同规定对基金财产、其他基金合同当事人的利益造成重大损失的，应及时呈报中国证监会和中国银监会，以及采取其他必要措施以保护本基金及相关基金合同当事人的利益；
- (7) 根据基金合同的规定选择适当的基金代销机构并有权依照代销协议和有关法律法规对基金代销机构行为进行必要的监督和检查；
- (8) 自行担任基金登记结算机构或选择、更换基金登记结算代理机构，办理基金登记结算业务，并按照基金合同规定对基金登记结算代理机构进行必要的监督和检查；
- (9) 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回的申请；
- (10) 在法律法规允许的前提下，为基金份额持有人的利益依法为基金进行融资、融券；
- (11) 依据法律法规和基金合同的规定，制订基金收益分配方案；
- (12) 按照法律法规，代表基金对被投资企业行使股东权利，代表基金行使因投资于其他证券所产生的权利；
- (13) 在基金托管人职责终止时，提名新的基金托管人；
- (14) 依据法律法规和基金合同的规定，召集基金份额持有人大会；
- (15) 以基金管理人的名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律

行为；

(16) 选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构并确定有关费率；

(17) 法律法规、基金合同规定的其他权利。

## 2. 基金管理人的义务

(1) 依法募集基金，办理或者委托经国务院证券监督管理机构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、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；

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

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

(6) 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；

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

(8) 进行基金会计核算并编制基金的财务会计报告；

(9) 依法接受基金托管人的监督；

(10) 编制季度、半年度和年度基金报告；

(11) 采取适当合理的措施使计算开放式基金份额认购、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；

(12) 计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；

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

(14) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、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以保密，不得向他人泄露；

(15) 按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

(16) 保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表、代表基金签订的重大合同及其他相关资料；

(17) 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；

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

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

(20)因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人的合法权益,应承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;

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

(22)法律法规、基金合同及中国证监会规定的其它义务。

## (二) 基金托管人的权利和义务

### 1. 基金托管人的权利

(1) 依据法律法规和基金合同的规定安全保管基金财产;

(2) 依照基金合同的约定获得基金托管费;

(3) 监督基金管理人对本基金的投资运作;

(4) 在基金管理人职责终止时,提名新的基金管理人;

(5) 依据法律法规和基金合同的规定召集基金份额持有人大会;

(6) 法律法规、基金合同规定的其它权利。

### 2. 基金托管人的义务

(1) 安全保管基金财产;

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

(3) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户;

(4) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外,不得以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) 对所托管的不同基金财产分别设置账户,确保基金财产的完整和独立;

(6) 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;

(7) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其它相关资料;

- (8) 按照基金合同的约定, 根据基金管理人的指令, 及时办理清算、交割事宜;
- (9) 保守基金商业秘密。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外, 在基金信息公开披露前应予以保密, 不得向他人泄露;
- (10) 根据法律法规及本合同的约定, 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项;
- (11) 对基金财务会计报告、半年度和年度基金报告的相关内容出具意见, 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;
- (12) 建立并保存基金份额持有人名册;
- (13) 复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额申购、赎回价格;
- (14) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对;
- (15) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项;
- (16) 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会;
- (17) 按照规定监督基金管理人的投资运作;
- (18) 因违反基金合同导致基金财产损失, 应承担赔偿责任, 其责任不因其退任而免除;
- (19) 基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时, 应为基金向基金管理人追偿;
- (20) 法律法规、基金合同及中国证监会规定的其他义务。

### (三) 基金份额持有人的权利和义务

#### 1. 基金份额持有人权利

- (1) 分享基金财产收益;
- (2) 参与分配清算后的剩余基金财产;
- (3) 依法申请赎回其持有的基金份额;
- (4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会;
- (5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会, 对基金份额持有人大会审议事项行使表决权;
- (6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料;
- (7) 监督基金管理人的投资运作;
- (8) 对基金管理人、基金托管人、基金份额销售机构损害其合法权益的行为依法提起

诉讼；

- (9) 法律法规、基金合同规定的其他权利。

## 2. 基金份额持有人义务

- (1) 遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；
- (2) 缴纳基金认购、申购款项及基金合同规定的费用；
- (3) 在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；
- (4) 不从事任何有损基金、其他基金份额持有人及其他基金合同当事人合法利益的活动；

动；

- (5) 执行基金份额持有人大会的决议；

(6) 返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人、基金托管人及基金管理人的代理人处获得的不当得利；

- (7) 遵守基金管理人、销售机构和登记结算机构的相关交易及业务规则；

- (8) 法律法规及基金合同规定的其他义务。

## (四) 基金份额持有人大会

1. 本基金的基金份额持有人大会，由本基金的基金份额持有人或其合法的代理人共同组成。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

2. 当出现或需要决定下列事由之一时，应召开基金份额持有人大会：

- (1) 终止基金合同；
- (2) 封闭期内基金的扩募；
- (3) 转换基金运作方式，依据本基金合同的约定直接转换运作方式的除外；
- (4) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；

- (5) 更换基金管理人、基金托管人；

- (6) 变更基金类别；

- (7) 变更基金投资目标、范围或策略；

- (8) 变更基金份额持有人大会程序；

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

(10) 本基金与其他基金合并；

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

(12) 法律法规、中国证监会或本基金合同规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

3. 出现以下情形之一的，可由基金管理人和基金托管人协商后修改本基金合同，不需召开基金份额持有人大会：

(1) 调低基金管理费率、基金托管费率；

(2) 在法律法规和基金合同规定的范围内变更本基金的申购费率、调低赎回费率或收费方式；

(3) 因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改；

(4) 对基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生重大变化；

(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；

(6) 除法律法规或基金合同规定应当召开基金份额持有人大会以外的其他情形。

4. 基金合同生效后的存续期内，出现以下情形之一的，基金管理人应召集基金份额持有人大会，并由基金份额持有人大会就是否终止基金合同，或基金与其他基金合并进行表决：

(1) 基金份额持有人数量连续 60 个工作日达不到 200 人；

(2) 基金资产净值连续 60 个工作日低于 3000 万元；

(3) 本基金前十大基金份额持有人所持份额数在本基金全部份额数中所占比例连续 60 个工作日达到 90% 以上。

5. 召集人及召集方式：

(1) 除法律法规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，基金托管人认为有必要召开的，应当自行召集。

(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，应当自行召集。

(4) 代表基金份额 10%（本条中“以上”均包括本数，下同）以上的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应



当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。

基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%以上的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。

基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开。

(5) 代表基金份额 10% 以上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，而基金管理人、基金托管人都不召集的，代表基金份额 10%以上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。

(6) 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。

(7) 基金份额持有人大会的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

## 6. 会议通知

(1) 召开基金份额持有人大会，召集人应当至少提前 30 天在至少一种指定媒体上公告。基金份额持有人大会不得就未经公告的事项进行表决。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

- a. 会议召开的时间、地点、方式；
- b. 会议拟审议的主要事项、议事程序和表决方式；
- c. 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；
- d. 代理投票授权委托书的内容要求（包括但不限于代理人身份、代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；
- e. 会务常设联系人姓名、电话；

(2) 如采用通讯表决方式，会议通知还应载明具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见的寄交和收取方式、投票表决的截止日以及表决票的送达地址等内容。

(3) 如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人作为监督人到指定地点对书面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作为监督人到指定地点对书面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作为监督人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对书面表决意见的计票进行监督的,不影响计票和表决效力。

## 7. 开会方式

基金份额持有人大会可通过现场开会或通讯开会方式召开。

(1) 现场开会。现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委派其代理人出席,现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席,基金管理人或托管人拒不派代表出席的,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:

a. 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和代理投票授权委托书等文件符合法律法规、本基金合同和会议通知的规定,并与登记结算机构记录相符;

b. 经核对,汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示,全部有效凭证所对应的基金份额占权益登记日基金总份额的 50%以上。

(2) 通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式在表决截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:

a. 召集人按本基金合同规定公布会议通知后,在两个工作日内连续公布相关提示性公告;

b. 召集人按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见;

c. 本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的 50%以上;

d. 直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的其他代表,同时提交的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和代理投票授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定,并与登记结算机构记录相符;

e. 会议通知公布前已报中国证监会备案。

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

## 8. 议事内容与程序

### (1) 议事内容及提案权

a. 议事内容为本基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容以及召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项;



b. 基金管理人、基金托管人、代表基金份额 10%以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案；

c. 对于基金管理人、基金托管人或基金份额持有人提交的提案，大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

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

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

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

e. 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

### a. 现场开会

在现场开会的方式下，基金份额持有人大会的主持人为召集人授权出席大会的代表。首先由大会主持人按照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，经合法执业的律师见证后形成大会决议。

### b. 通讯开会

在通讯方式开会的情况下，首先由召集人在会议通知中公布提案，在所通知的表决截止日期后第二个工作日由大会聘请的公证机关及监督人的监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。如监督人经通知但拒绝到场监督，不影响在公证机关监督下形成的决议的有效性。

## 9. 表决

(1) 基金份额持有人所持每份基金份额享有平等的表决权。

(2) 基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

### a. 特别决议

对于特别决议应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二(含)以上通过。更换基金管理人或者基金托管人、转换基金运作方式或终止基金合同应当以特别决议通过方为有效。

b. 一般决议

对于一般决议应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的 50% (含) 以上通过。

(3) 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,符合法律法规、基金合同和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决;表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决,但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

(4) 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。

10. 计票

(1) 现场开会

a. 如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集,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推举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人;如大会由基金份额持有人自行召集,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推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拒不出席大会的,不影响计票的效力。

b. 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。

c. 如果大会主持人对于提交的表决结果有怀疑,可以对所投票数进行重新清点;如果出席大会的基金份额持有人或其代理人对大会主持人宣布的表决结果有异议,有权在宣布表决结果后立即要求重新清点,大会主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次;重新清点后,大会持有人应当当场公布重新清点结果。

(2) 通讯方式开会

在通讯方式开会的条件下,计票方式为:

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

11、生效与公告

(1) 基金份额持有人大会按照《基金法》等有关法律法规规定表决通过的事项，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

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

(3) 基金份额持有人大会决议应当自中国证监会核准或出具无异议意见后 2 日内，由基金份额持有人大会召集人在至少一种指定媒体上公告。

(4) 如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机关、公证员姓名等一同公告。

12、法律法规或监管机关对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

## (五) 基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### 1. 基金合同的变更

(1) 变更基金合同涉及法律法规规定或本合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。

(2) 变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案，并自中国证监会核准或出具无异议意见之日起生效。

(3) 但如因相应的法律法规发生变动并属于本基金合同必须遵照进行修改的情形，或者基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系变化或对基金份额持有人利益无实质性不利影响的，可不经基金份额持有人大会决议，而经基金管理人和基金托管人同意修改后公布，并报中国证监会备案。

(4) 基金合同生效后的存续期内，出现以下情形之一的，基金管理人应召集基金份额持有人大会，并由基金份额持有人大会就是否终止基金合同，或基金与其他基金合并进行表决：

- 1) 基金份额持有人数量连续 60 个工作日达不到 200 人；
- 2) 基金资产净值连续 60 个工作日低于 3000 万元；
- 3) 本基金前十大基金份额持有人所持份额数在本基金全部份额数中所占比例连续 60 个工作日达到 90%以上。

### 2. 基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同应当终止：

- (1) 基金份额持有人大会决定终止；
- (2) 因重大违法、违规行为，被中国证监会责令终止的；
- (3) 基金管理人、基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金管理人、基金托管人承接的；
- (4) 法律法规和基金合同规定的其他情形。

基金合同终止后，基金管理人和基金托管人有权依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关法律法规的规定，行使请求给付报酬、从基金财产中获得补偿的权利。

### 3. 基金财产的清算

(1) 基金合同终止，基金管理人应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。

#### (2) 基金财产清算组

1) 自基金合同终止事由之日起 30 个工作日内由基金管理人组织成立基金财产清算组，在基金财产清算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托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

2) 基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

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

#### (3) 清算程序

- 1) 基金合同终止情形发生后，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- 2) 基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；
- 3) 基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；
- 4) 对基金财产进行评估和变现；
- 5) 制作清算报告；
- 6) 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；
- 7) 将清算报告报中国证监会备案并公告；
- 8) 对基金财产进行分配。

#### (4) 清算费用

清算费用是指基金财产清算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组优先从基金财产中支付。

#### (5) 基金剩余财产的分配

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)、2)、3) 项规定清偿前,不分配给基金份额持有人。

对于由基金交纳、中国证券登记结算有限责任公司收取的最低结算备付金和交易席位保证金,在中国证券登记结算有限责任公司对其进行调整交收日才能收回。

#### (6) 基金财产清算的公告

基金财产清算组做出的清算报告经会计师事务所审计,律师事务所出具法律意见书后,报中国证监会备案并公告。

(7) 基金财产清算账册及文件由基金托管人保存 15 年以上。

### (六) 争议的处理

1. 本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

2. 本基金合同的当事人之间因本基金合同产生的或与本基金合同有关的争议可通过友好协商解决,但若自一方书面提出协商解决争议之日起 60 日内争议未能以协商方式解决的,则任何一方有权将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会,按照其时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的,对仲裁各方当事人均具有约束力。

3. 除争议所涉内容之外,本基金合同的其他部分应当由本基金合同当事人继续履行。

### (七) 基金合同的效力

1. 本基金合同是基金合同当事人之间的法律文件,应由基金管理人和基金托管人的法定代表人或其授权签字人签字并加盖公章。基金合同于投资者缴纳认购的基金份额的款项时成立,自基金募集结束报中国证监会备案并获中国证监会书面确认后生效。

2. 本基金合同的有效期限自其生效之日起至本基金财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止。

3. 本基金合同自生效之日起对包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人在内的基金合同各方当事人具有同等的法律约束力。

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

5. 基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

基金合同存放在基金管理人和基金托管人住所，投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件，基金合同条款及内容应以基金合同正本为准。

## 二十三、基金托管协议的内容摘要

### （一）托管协议当事人

#### 1. 基金管理人（或简称“管理人”）

名称：易方达基金管理有限公司

住所：广东省珠海市香洲区情侣路 428 号九洲港大厦 4001 室

法定代表人：叶俊英

成立时间：2001 年 4 月 17 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：证监基金字[2001]4 号

组织形式： 有限责任公司

注册资本： 壹亿贰千万元人民币

经营范围： 基金募集、基金销售；资产管理；经中国证监会批准的其他业务

存续期间： 持续经营

#### 2. 基金托管人（或简称“托管人”）

名称： 中国银行股份有限公司

住所： 北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：肖钢

成立时间： 1983 年 10 月 31 日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号

组织形式： 股份有限公司

注册资本： 人民币贰仟伍佰叁拾捌亿叁仟玖佰壹拾陆万贰仟零玖元

经营范围： 吸收人民币存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；从事同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱服务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代客外汇买卖；外汇信用卡的发行和代理国外信用卡的发行



及付款；资信调查、咨询、见证业务；组织或参加银团贷款；国际贵金属买卖；海外分支机构经营与当地法律许可的一切银行业务；在港澳地区的分行依据当地法令可发行或参与代理发行当地货币；经中国人民银行批准的其他业务。

存续期间： 持续经营

## （二）基金托管人对基金管理人的业务监督、核查

1. 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督。主要包括以下方面：

(1) 对基金的投资范围、投资对象进行监督：

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国债、央行票据、金融债、企业债、短期融资券、公司债、可转换债券（含分离型可转换债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益品种、股票、权证等权益类品种以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产，但可以参与一级市场新股申购或增发新股，并可持有因可转债转股所形成的股票、因所持股票所派发的权证以及因投资可分离债券而产生的权证等。

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

本基金各类资产的投资比例范围为：固定收益类资产的比例不低于基金资产的 80%，其中，信用债券的投资比例不低于固定收益类资产的 40%，权益类资产的比例不高于基金资产的 20%。开放期内，现金以及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

本基金所指的信用债券为企业债、短期融资券、公司债、金融债、可转换债券（含分离型可转换债券）、资产支持证券等除国债和央行票据之外的、非由国家信用担保的固定收益证券品种。

(2) 对基金投融资比例进行监督：

1) 本基金为债券基金，固定收益类资产的比例不低于基金资产的 80%，权益类资产的比例不高于基金资产的 20%，其中，信用债券的投资比例不低于固定收益类资产的 40%；

2) 持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%；

3) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过基金总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；



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

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

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

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

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

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

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

11) 本基金只投资于投资级别的信用债券, 基金持有信用债券期间, 如果其信用等级下降至投资级别以下, 应在评级报告发布之日起 30 个工作日内予以全部卖出。其中, 本基金所指投资级别是指具有由国内评级机构出具的 BBB 级及以上级(若为短期融资券, 则为 A-3 级及以上级)信用评级的信用债券;

12) 法律法规或监管部门规定的其它限制。

(3) 对基金投资禁止行为进行监督。为对基金禁止从事的关联交易进行监督, 基金管理人和基金托管人应相互提供与本机构有控股关系的股东或与本机构有其他重大利害关系的公司名单;

(4) 基金管理人向基金托管人提供其银行间债券市场交易的交易对手库, 交易对手库由银行间交易会员中财务状况较好、实力雄厚、信用等级高的交易对手组成。基金管理人可以根据实际情况的变化, 及时对交易对手库予以更新和调整, 并通知基金托管人。基金管理人参与银行间债券市场交易的交易对手应符合交易对手库的范围。基金托管人对基金管理人参与银行间债券市场交易的交易对手是否符合交易对手库进行监督;

(5) 基金托管人对银行间市场交易的交易方式的控制按如下约定进行监督。

基金管理人应按照审慎的风险控制原则, 对银行间交易对手的资信状况进行评估, 控制交易对手的资信风险, 确定与各类交易对手所适用的交易结算方式, 在具体的交易中, 应尽力争取对基金有利的交易方式。由于交易对手资信风险引起的损失, 基金托管人不承担赔偿责任

任。

(6) 基金如投资银行存款，基金管理人应根据法律法规的规定及基金合同的约定，事先确定符合条件的所有存款银行的名单，并及时提供给基金托管人，基金托管人据以对基金投资银行存款的交易对手是否符合上述名单进行监督；

(7) 对法律法规规定及《基金合同》约定的基金投资的其他方面进行监督。

2. 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复核。

3. 基金托管人在上述第 1、2 款的监督和核查中发现基金管理人违反法律法规的规定、《基金合同》及本协议的约定，应及时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确认并以书面形式对基金托管人发出回函并改正。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应及时向中国证监会报告。

4. 基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律法规、《基金合同》及本协议的规定，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并按照规定及时向中国证监会报告。基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律法规和其他有关规定，或者违反《基金合同》、本协议约定的，应当立即通知基金管理人，并按照规定及时向中国证监会报告。

5. 基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查，包括但不限于：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。

### （三）基金管理人对于基金托管人的业务核查

1. 在本协议的有效期限内，在不违反公平、合理原则以及不妨碍基金托管人遵守相关法律法规及其行业监管要求的基础上，基金管理人有权对基金托管人履行本协议的情况进行必要的核查，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、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

2. 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、无正当理由未执行或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法律法规、《基金合同》及本协议有关规定时，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正，基金托管人收

到通知后应及时核对并以书面形式对基金管理人发出回函。在限期内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应依照法律法规的规定报告中国证监会。

3. 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。

## （四）基金财产的保管

### 1. 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，未经基金管理人的合法合规指令或法律法规、《基金合同》及本协议另有规定，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，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。

### 2. 基金合同生效前募集资金的验资和入账

(1) 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》等有关规定的，由基金管理人在法定期限内聘请具有从事相关业务资格的会计师事务所对基金进行验资，并出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的 2 名以上（含 2 名）中国注册会计师签字方为有效。

(2) 基金管理人应将属于本基金财产的全部资金划入在基金托管人处为本基金开立的基金银行账户中，并确保划入的资金与验资确认金额相一致。

### 3. 基金的银行账户的开设和管理

(1) 基金托管人应负责本基金的银行账户的开设和管理。

(2) 基金托管人以本基金的名义开设本基金的银行账户。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。本基金的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益、收取申购款，均需通过本基金的银行账户进行。

(3) 本基金银行账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立其他任何银行账户；亦不得使用本基金的银行账户进行本基金业务以外的活动。

(4) 基金银行账户的管理应符合法律法规的有关规定。

#### 4. 基金进行定期存款投资的账户开设和管理

基金托管人根据基金管理人的指令以基金名义在基金托管人认可的存款银行的指定营业网点开立存款账户，并负责该账户的日常管理以及银行预留印鉴的保管和使用。基金管理人应派专人协助办理开户事宜。在上述账户开立和账户相关信息变更过程中，基金管理人应提前向基金托管人提供开户或账户变更所需的相关资料，并对基金托管人给予积极配合和协助。

#### 5. 基金证券账户和证券交易资金账户的开设和管理

(1) 基金托管人应当代表本基金，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。

(2) 本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或转让本基金的证券账户，亦不得使用本基金的证券账户进行本基金业务以外的活动。

(3) 基金托管人以自身法人名义在中国证券登记结算有限公司上海分公司/深圳分公司公司开立结算备付金账户，用于办理基金托管人所托管的包括本基金在内的全部基金在证券交易所进行证券投资所涉及的资金结算业务。结算备付金的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

(4) 在本托管协议生效日之后，本基金被允许从事其他投资品种的投资业务的，涉及相关账户的开设、使用的，若无相关规定，则基金托管人应当比照并遵守上述关于账户开设、使用的规定。

#### 6. 债券托管专户的开设和管理

基金合同生效后，基金管理人负责以基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表基金进行交易；基金托管人负责以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司开设银行间债券市场债券托管账户，并代表基金进行银行间债券市场债券和资金的清算。在上述手续办理完毕之后，由基金托管人负责向中国人民银行报备。

#### 7. 基金财产投资的有关有价凭证的保管

基金财产投资的实物证券、银行定期存款存单等有价凭证由基金托管人负责妥善保管。基金托管人对其以外机构实际有效控制的有价凭证不承担责任。

#### 8. 与基金财产有关的重大合同及有关凭证的保管

基金托管人按照法律法规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及

有关凭证。基金管理人代表基金签署有关重大合同后应在收到合同正本后 30 日内将一份正本的原件提交给基金托管人。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。重大合同由基金管理人与基金托管人按规定各自保管至少 15 年。

## （五）基金资产净值计算与复核

1. 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计算日该基金份额总数后的价值。

2. 基金管理人应每个工作日对基金财产估值。估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算业务指引》及其他法律法规的规定。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结束后计算出当日的该基金份额净值，并在盖章后以传真方式发送给基金托管人。基金托管人应在收到上述传真后对净值计算结果进行复核，并在盖章后以传真方式将复核结果传送给基金管理人，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

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

4. 基金管理人、基金托管人发现基金估值违反《基金合同》订明的估值方法、程序以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，双方应及时进行协商和纠正。

5. 当基金资产的估值导致基金份额净值小数点后三位内发生差错时，视为基金份额净值估值错误。当基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当计价错误达到基金份额净值的 0.25% 时，基金管理人应当报中国证监会备案；当计价错误达到基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应当公告，并报中国证监会备案。如法律法规或监管机关对前述内容另有规定的，按其规定处理。

6. 由于基金管理人对外公布的任何基金净值数据错误，导致该基金财产或基金份额持有人的实际损失，基金管理人应对此承担责任。若基金托管人计算的净值数据正确，则基金托管人对该损失不承担责任；若基金托管人计算的净值数据也不正确，则基金托管人也应承担部分未正确履行复核义务的责任。如果上述错误造成了基金财产或基金份额持有人的不当得利，且基金管理人及基金托管人已各自承担了赔偿责任，则基金管理人应负责向不当得利



之主体主张返还不当得利。如果返还金额不足以弥补基金管理人和基金托管人已承担的赔偿金额，则双方按照各自赔偿金额的比例对返还金额进行分配。

7. 由于证券交易所或中国证券登记结算有限责任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可以免除赔偿责任。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由此造成的影响。

8. 如果基金托管人的复核结果与基金管理人的计算结果存在差异，且双方经协商未能达成一致，基金管理人可以按照其对基金份额净值的计算结果对外予以公布，基金托管人可以将相关情况报中国证监会备案。

## （六）基金份额持有人名册的保管

### 1. 基金份额持有人名册的内容

基金份额持有人名册的内容包括但不限于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包括以下几类：

- (1) 基金募集期结束时的基金份额持有人名册；
- (2) 基金权益登记日的基金份额持有人名册；
- (3) 基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册；
- (4) 每半年度最后一个交易日的基金份额持有人名册。

### 2. 基金份额持有人名册的提供

对于每半年度最后一个交易日的基金份额持有人名册，基金管理人应在每半年度结束后5个工作日内定期向基金托管人提供。对于基金募集期结束时的基金份额持有人名册、基金权益登记日的基金份额持有人名册以及基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册，基金管理人应在相关的名册生成后5个工作日内向基金托管人提供。

### 3. 基金份额持有人名册的保管

基金托管人应妥善保管基金份额持有人名册。如基金托管人无法妥善保存持有人名册，基金管理人应及时向中国证监会报告，并代为履行保管基金份额持有人名册的职责。基金托管人应对基金管理人由此产生的保管费给予补偿。

## （七）适用法律与争议解决方式

1. 本协议适用中华人民共和国法律并从其解释。

2. 基金管理人与基金托管人之间因本协议产生的或与本协议有关的争议可通过友好协商解决。但若自一方书面提出协商解决争议之日起 60 日内争议未能以协商方式解决的，则任何一方有权将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会，并按其时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。

3. 除争议所涉的内容之外，本协议的当事人仍应履行本协议的其他规定。

## （八）托管协议的变更与终止

### 1. 托管协议的变更

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行变更。变更后的新协议，其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突。变更后的新协议应当报中国证监会核准或备案。

### 2. 托管协议的终止

发生以下情况，本托管协议应当终止：

- （1）《基金合同》终止；
- （2）本基金更换基金托管人；
- （3）本基金更换基金管理人；
- （4）发生《基金法》、《运作办法》或其他法律法规规定的终止事项。

## 二十四、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）场外的基金份额持有人投资交易确认服务

基金登记结算机构保留基金份额持有人名册上列明的场外的基金份额持有人的基金交易记录。

基金管理人直销网点应根据在基金管理人直销网点进行交易的投资者的要求提供成交确认单。基金代销机构应根据在代销网点进行交易的投资者的要求提供成交确认单。

### （二）场外的基金份额持有人交易记录查询服务

场外的基金份额持有人可通过基金管理人的客户服务中心查询历史交易记录。

### （三）场外的基金份额持有人的对账单服务形式：

1. 场外基金份额持有人可登录本公司网站（<http://www.efunds.com.cn>）查阅对账单。
2. 场外基金份额持有人也可向本公司定制纸质、电子或短信形式的定期或不定期对账单。

具体查阅和定制账单的方法可参见本公司网站或拨打客服热线咨询。

### （四）资讯服务

#### 1. 客户服务中心电话

投资者如果想了解基金产品、服务等信息，可拨打如下电话：4008818088（免长途话费）。

#### 2. 互联网站及电子信箱

网址：<http://www.efunds.com.cn>

电子信箱：[service@efunds.com.cn](mailto:service@efunds.com.cn)



## 二十五、其他应披露事项

公告事项	披露日期
易方达基金管理有限公司关于增加瑞银证券为易方达岁丰添利债券型证券投资基金场外代销机构的公告	2012-5-29
易方达岁丰添利债券型证券投资基金分红公告	2012-6-11
易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加中信万通证券为代销机构及在中信万通证券推出定期定额申购业务的公告	2012-6-11
易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购广州迪森热能技术股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	2012-7-4
易方达基金管理有限公司关于提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	2012-7-6
易方达基金管理有限公司关于高级管理人员变更公告	2012-7-7
易方达岁丰添利债券型证券投资基金分红公告	2012-7-9
易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加国盛证券为代销机构、在国盛证券推出定期定额申购业务及参加国盛证券网上交易申购费率优惠活动的公告	2012-7-23
易方达岁丰添利债券型证券投资基金分红公告	2012-8-8
易方达基金管理有限公司关于增加国金证券为旗下部分开放式基金代销机构的公告	2012-8-27
易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加浙商证券为代销机构、在浙商证券推出定期定额申购业务及参加浙商证券非现场委托方式申购与定期定额申购费率优惠活动的公告	2012-9-4
易方达基金管理有限公司对市场上出现冒用本公司名义进行非法证券活动的特别提示	2012-9-7
易方达岁丰添利债券型证券投资基金分红公告	2012-9-11
易方达基金管理有限公司关于提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	2012-10-10

易方达岁丰添利债券型证券投资基金分红公告	2012-11-7
----------------------	-----------

注：以上公告披露在中国证券报、上海证券报、证券时报上。

## 二十六、招募说明书的存放及查阅方式

本招募说明书存放在基金管理人、基金托管人及基金代销机构处，投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与公告的内容完全一致。

## 二十七、备查文件

1. 中国证监会核准易方达岁丰添利债券型证券投资基金募集的文件；
2. 《易方达岁丰添利债券型证券投资基金基金合同》；
3. 《易方达岁丰添利债券型证券投资基金托管协议》；
4. 法律意见书；
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照；
6. 基金托管人业务资格批件、营业执照。

存放地点：基金管理人、基金托管人处

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。

易方达基金管理有限公司

2012年12月17日