

# 南方稳利1年定期开放债券型 证券投资基金招募说明书

基金管理人：南方基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

## 目录

一、 绪言.....	3
二、 释义.....	4
三、 基金管理人.....	8
四、 基金托管人.....	17
五、 相关服务机构.....	22
六、 基金的募集.....	24
七、 基金合同的生效.....	28
八、 基金份额的申购和赎回.....	29
九、 基金的投资.....	38
十、 基金的财产.....	43
十一、 基金资产估值.....	44
十二、 基金的收益与分配.....	48
十三、 基金的费用与税收.....	50
十四、 基金的会计与审计.....	52
十五、 基金的信息披露.....	53
十六、 风险揭示.....	58
十七、 基金合同的变更、终止和基金财产的清算.....	61
十八、 基金合同的内容摘要.....	63
十九、 基金托管协议的内容摘要.....	84
二十、 基金份额持有人服务.....	99
二十一、 其他应披露事项.....	102
二十二、 招募说明书存放及其查阅方式.....	103
二十三、 备查文件.....	104

## 重要提示

本基金经中国证监会 2013 年 3 月 18 日证监许可[2013]253 号文核准募集。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，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做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资者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，本基金投资中小企业私募债的风险，本基金的特定风险等，详见招募说明书“风险揭示”章节。其中，本基金投资中小企业私募债券，中小企业私募债是根据相关法律法规由非上市中小企业采用非公开方式发行的债券。由于不能公开交易，一般情况下，交易不活跃，潜在较大流动性风险。当发债主体信用质量恶化时，受市场流动性所限，本基金可能无法卖出所持有的中小企业私募债，由此可能给基金净值带来更大的负面影响和损失。

投资有风险，投资者认购（或申购）基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本基金为定期开放基金。本基金封闭期内不办理申购赎回业务。本基金的每个自由开放期为 5 至 20 个工作日，基金份额持有人在自由开放期可自由申购、赎回基金份额。但本基金的受限开放期仅为 1 个工作日，且在受限开放期，本基金仅有限度地确认赎回申请。因而，基金份额持有人可能面临不能全部赎回基金份额而产生的流动性风险。

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资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

## 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》）以及《南方稳利1年定期开放债券型证券投资基金基金合同》编写。

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

本招募说明书根据本基金的基金合同编写，并经中国证监会核准。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

《招募说明书》中除非文意另有所指，下列词语具有如下含义：

- 1、基金或本基金：指南方稳利1年定期开放债券型证券投资基金
- 2、基金管理人：指南方基金管理有限公司
- 3、基金托管人：指中国农业银行股份有限公司
- 4、基金合同或本基金合同：指《南方稳利1年定期开放债券型证券投资基金基金合同》及对本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《南方稳利1年定期开放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：指《南方稳利1年定期开放债券型证券投资基金招募说明书》及其定期的更新
- 7、基金份额发售公告：指《南方稳利1年定期开放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日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，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》及颁布机关对其不时做出的修订
- 10、《销售办法》：指中国证监会2011年6月9日颁布、同年10月1日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 11、《信息披露办法》：指中国证监会2004年6月8日颁布、同年7月1日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 12、《运作办法》：指中国证监会2004年6月29日颁布、同年7月1日实施并在2012年6月19日发布修订后的《证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 13、中国证监会：指中国证券监督管理委员会
- 14、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会
- 15、基金合同当事人：指受基金合同约束，根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人
- 16、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人
- 17、机构投资者：指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织

18、合格境外机构投资者：指符合《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

19、人民币合格境外机构投资者：指按照《基金管理公司、证券公司人民币合格境外机构投资者境内证券投资试点办法》（包括其不时修订）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

20、投资人：指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和人民币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、非交易过户、转托管等业务

23、销售机构：指南方基金管理有限公司（直销机构）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（代销机构）

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。基金的登记机构为南方基金管理有限公司或接受南方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买卖基金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）

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《南方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本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、元：指人民币元

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

45、基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和

46、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

47、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

48、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

49、指定媒体：指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站及其他媒体

50、不可抗力：指本合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件。

51、运作周期：本基金以1年为一个运作周期，每个运作周期为自基金合同生效日（含）或每个自由开放期结束之日的次日（含）起至1年后的对日的期间

52、开放期：本基金的开放期包括自由开放期和受限开放期

53、自由开放期：在每个运作周期结束后进入自由开放期。本基金的每个自由开放期为5至20个工作日。自由开放期的具体期间由基金管理人在上一个运作周期结束前公告说明。在自由开放期内，本基金采取开放运作模式，投资人可办理基金份额申购、赎回或其他业务

54、受限开放期：在首个运作周期中，本基金的受限开放期为基金合同生效日起每三个月的对日。在第二个及以后的运作周期中，本基金的受限开放期为该运作周期首日起每三个月的对日。本基金的每个受限开放期为1个工作日

55、封闭期：指本基金在每个运作周期内，除受限开放期以外的期间。在每个封闭期内本基金采取封闭运作模式，期间基金份额总额保持不变，本基金不接受基金份额的申购和赎

回

56、对日：指某一特定日期在后续日历天数中的对应日期，如该对应日期为非工作日，则顺延至下一工作日，若该日历天数中不存在对应日期的，则顺延至下一工作日。

57、信用类固定收益金融工具：包括但不限于金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府机构债、地方政府债、资产支持证券、可分离交易可转债中的债券部分、中小企业私募债券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）

58、货币市场工具：现金；一年以内(含一年)的银行定期存款、大额存单；剩余期限在三百九十七天以内(含三百九十七天)的债券；期限在一年以内(含一年)的债券回购；期限在一年以内(含一年)的中央银行票据；中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的金融工具



## 三、基金管理人

### 一、基金管理人概况

名称：南方基金管理有限公司

住所及办公地址：深圳市福田区福华一路六号免税商务大厦塔楼 31、32、33 层整层

成立时间：1998 年 3 月 6 日

法定代表人：吴万善

注册资本：1.5 亿元人民币

电话：(0755) 82763888

传真：(0755) 82763889

联系人：鲍文革

南方基金管理有限公司是经中国证监会证监基字[1998]4 号文批准，由南方证券有限公司、厦门国际信托投资公司、广西信托投资公司共同发起设立。2000 年，经中国证监会证监基金字[2000]78 号文批准进行了增资扩股，注册资本达到 1 亿元人民币。2005 年，经中国证监会证监基金字[2005]201 号文批准进行增资扩股，注册资本达 1.5 亿元人民币。目前股权结构：华泰证券股份有限公司 45%、深圳市投资控股有限公司 30%、厦门国际信托有限公司 15%及兴业证券股份有限公司 10%。

### 二、主要人员情况

#### 1、董事会成员

吴万善先生，董事，中共党员，工商管理硕士，高级经济师。历任中国人民银行江苏省分行金融管理处科员、中国人民银行南京市分行江宁支行科员；华泰证券证券发行部副经理、总经理助理；江苏省证券登记处总经理；华泰证券副总经理、总裁，现任华泰证券股份有限公司董事长兼党委副书记、南方基金管理有限公司董事长、代总裁。

高良玉先生，董事，中共党员，经济学硕士，经济师。历任南京农业大学审计处干部、中国人民银行金融管理司主任科员、中国证监会发行部副处长。1998 年加入南方基金担任副总经理、总裁，现任南方基金管理有限公司副董事长、南方东英资产管理有限公司（香港）董事会主席。

张涛先生，董事，中共党员，博士研究生。历任华泰证券总裁办公室总裁秘书、投资银行一部业务经理、福州办事处副主任、上海总部投资银行业务部副总经理、深圳总部副总经理、深圳彩田路营业部总经理、董事会秘书、总裁助理兼董事会办公室主任；现任华泰证券

股份有限公司副总裁、党委委员。

姜健先生，董事，中共党员，硕士研究生。历任南京农业大学教师；华泰证券人事处职员、人事处培训教育科科长、投资银行部股票事务部副经理、投资银行一部副总经理、投资银行一部高级经理、投资银行总部副总经理兼发行部总经理、资产管理总部总经理、投资银行业务总监兼投资银行业务南京总部总经理、总裁助理兼上海总部总经理、公司机构客户服务部总经理。现任华泰证券股份有限公司副总裁、董事会秘书、党委委员。

李真先生，董事，中共党员，材料工程、企业管理双学士，高级工程师。历任机械工业部科技司材料工艺处、科研管理处副主任科员、总工程师秘书、科技与质量监督司行业技术处副处长；深圳亚洲金刚石有限公司副总经理（干部交流）；深圳市投资管理公司董事局秘书处副主任、综合部副部长、部长、总裁助理兼工业一部部长、办公室主任；深圳市通产实业有限公司党委书记、董事长；深圳会展中心管理有限责任公司党委书记、总经理、董事长；现任深圳市投资控股有限公司董事、总经理、党委副书记。

余钢先生，董事，中共党员。毕业于湘潭大学英语专业，高级经济师。历任广州军区技术局四处见习学员；广州军区技术局组织处助理翻译、中尉；广州军区情报部副连参谋、正连参谋、副营参谋；深圳市投资管理公司人事部、董办、办公室业务经理；深圳市国资委企业领导人员管理处主任科员；深圳市国资委办公室副主任、党委秘书；深圳市国资委企业领导人员管理处副处长；深圳市地铁有限公司人力资源部部长、党支部书记；深圳市地铁集团有限公司党委委员人力资源部部长、党支部书记（2009-2010年4月兼深圳通公司董事、深圳大学轨道交通学院理事会理事）；2009.09—2009.11 深圳市市委中青班培训学习；现任深圳市投资控股有限公司党委副书记、纪委书记、董事。

洪文瑾女士，董事，中共党员，硕士研究生。历任厦门经济特区建设发展公司财务部，厦门建发集团有限公司财务部副经理、厦门建发信托投资公司副总经理、总经理，厦门国际信托投资有限公司总经理，现任厦门国际信托有限公司董事长。

庄园芳女士，董事，工商管理硕士，经济师。历任兴业证券交易业务部总经理助理、负责人，证券投资部副总经理、总经理，投资总监；现任兴业证券股份有限公司副总裁。

张磊先生，独立董事，工商管理硕士（MBA）及国际关系硕士，注册金融分析师(CFA)，获得美国 NASD Series 7 & 65 证书。曾工作于耶鲁大学投资基金办公室（Yale Endowment）及美国新生市场投资基金(Emerging Markets Management, LLC)，主要从事基金管理及投资研究。历任纽约证券交易所国际董事及中国首席代表；现任 HCM 投资管理有限公司高级合伙人，United World College of Southeast Asia Foundation 校董、耶鲁大学校务委员会成员、国际顾问委员会成员，纽约金融分析师协会会员。

周春生先生，独立董事，博士。历任美国联邦储备委员会经济学家、美国加州大学及香港大学商学院教授、中国证监会规划发展委员会委员（副局长级）、中国留美金融学会理事、美国经济学会、美国金融研究会会员，Annals of Economics and Finance 编委，北京大学光

华管理学院院长助理、EMBA 中心主任、高层管理者培训与发展中心主任、财务金融学教授，香港大学荣誉教授，深圳证券交易所第一、二、三届上市委员会委员；现为长江商学院金融教授、EMBA 和高层培训项目学术主任，国家杰出青年基金获得者。

王全洲先生，独立董事，中共党员，大学学历，1997 年中国人民大学会计专业研究生班毕业，注册会计师、资产评估师、注册税务师；历任北京市财政局会计处副处长，北京会计公司总经理（正处级）；现任北京兴华会计师事务所董事长、主任会计师。

丛培国先生，独立董事，法学硕士。历任北京大学法律系经济法教研室助教、经济法讲师、经济法教研室副主任，美国加州大学洛杉矶校区（UCLA）客座教授、北京大学副教授；现任北京君佑律师事务所合伙人、事务所主任。

米志明先生，独立董事，本科，高级经济师、注册会计师。历任江苏省姜堰税务局副局长，扬州市税务局副局长，扬州市财政局局长、党组书记，扬州市人民政府副秘书长，建设银行扬州市分行行长、党组书记，财政部深圳专员办专员、巡视员。

## 2、监事会成员

骆新都女士，职工监事，经济学硕士，经济师。历任民政部外事处处长、南方证券有限公司副总裁、南方基金管理有限公司董事长、顾问；现任南方基金管理有限公司监事会主席。

舒本娥女士，监事，本科。历任熊猫电子集团公司财务处财务处长，华泰证券计划资金部副总经理（主持工作）、稽查监察部副总经理、总经理；现任华泰证券股份有限公司财务总监兼计划财务部总经理。

周景民先生，监事，工学硕士、工商管理硕士（MBA），经济师。历任深圳三九企业集团三九贸易公司职员，深圳大鹏证券有限公司投资银行部项目经理、加拿大西蒙弗雷泽大学工商管理学院 MBA 学生兼助教，广东美的集团战略发展部高级经理，招商局集团中国南山开发（集团）公司研究发展部高级项目经理，深圳市投资控股有限公司投资部副经理、经理；现任深圳市投资控股有限公司投资部高级主管。

苏荣坚先生，监事，学士学位，高级经济师。历任三明市财政局、财委，厦门信达股份有限公司财务部、厦门国际信托投资公司财务部业务主办、副经理，自营业务部经理；现任厦门国际信托有限公司财务总监兼财务部总经理。

郑城美先生，监事，中共党员，经济学硕士。历任兴业证券华林营业部客户经理、研究中心市场分析师、经纪业务部市场分析师、办公室文秘部经理、南平滨江路营业部副总经理（主持工作）、计划财务部副总经理、财务部总经理、兴业证券财务总监；现任兴业证券副总裁。

苏民先生，职工监事，博士研究生，工程师。历任安徽国投深圳证券营业部电脑工程师，华夏证券深圳分公司电脑部经理助理，南方基金管理有限公司运作保障部副总监、市场服务部总监、电子商务部总监；现任南方基金管理有限公司风险管理部总监。

### 3、公司高级管理人员

吴万善先生，董事，中共党员，工商管理硕士，高级经济师。历任中国人民银行江苏省分行金融管理处科员、中国人民银行南京市分行江宁支行科员；华泰证券证券发行部副经理、总经理助理；江苏省证券登记处总经理；华泰证券副总经理、总裁，现任华泰证券股份有限公司董事长兼党委副书记、南方基金管理有限公司董事长、代总裁。

俞文宏先生，副总裁，中共党员，工商管理硕士，经济师，历任江苏省投资公司业务经理、江苏国际招商公司部门经理、江苏省国际信托投资公司投资银行部总经理、江苏国信高科技创业投资有限公司董事长兼总经理。2003 年加入南方基金，现任南方基金管理有限公司副总裁、党委委员。

郑文祥先生，副总裁，工商管理硕士。曾任职于湖北省荆州市农业银行、南方证券公司、国泰君安证券公司。2000 年加入南方基金，历任国债投资经理、专户理财部副总监、南方避险增值基金基金经理、总经理助理兼养老金业务部总监，现任南方基金管理有限公司副总裁。

朱运东先生，副总裁，中共党员，经济学学士。曾任职于财政部地方预算司及办公厅、中国经济开发信托投资公司，2002 年加入南方基金，历任北京分公司总经理、产品开发部总监、总裁助理、首席市场执行官，现任南方基金管理有限公司副总裁、党委委员。

秦长奎先生，副总裁，中共党员，工商管理硕士。历任南京汽车制造厂经营计划处科员，华泰证券有限责任公司营业部总经理、总裁助理兼基金部总经理、投资银行总部副总经理兼债券部总经理。2005 年加入南方基金，曾任督察长兼监察稽核部总监，现任南方基金管理有限公司副总裁、纪委书记、南方东英资产管理有限公司（香港）董事。

杨小松先生，督察长，中共党员，经济学硕士，注册会计师。历任德勤国际会计师行会计专业翻译，光大银行证券部职员，证监会主任科员、副处长、处长（期间曾派往美国 NASDAQ 工作），局长助理、副局长、副主任。2012 年加入南方基金，现任南方基金管理有限公司督察长、党委委员、党委副书记。

### 4、基金经理

李璇，清华大学金融学学士、硕士，注册金融分析师（CFA），具有基金从业资格。2007 年加入南方基金管理有限公司固定收益部，担任信用债高级分析师。2010 年 9 月至 2012 年 6 月，担任南方宝元基金经理；2010 年 9 月至今，担任南方多利基金经理；2012 年 5 月至今，担任南方金利基金经理；2012 年 12 月至今，担任南方安心基金经理。

### 5、投资决策委员会成员

董事长、代总裁吴万善先生，副总裁郑文祥先生，固定收益部总监李海鹏先生。

### 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、依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发

售、申购、赎回和登记事宜；

2、办理基金备案手续；

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

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

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

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

7、依法接受基金托管人的监督；

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

9、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

10、编制季度、半年度和年度基金报告；

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

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

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

14、按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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

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

17、确保需要向基金投资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条件下得到有关资料的复印件；

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

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

20、因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

21、监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

22、当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；

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

24、基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人；

25、执行生效的基金份额持有人大会的决议；

26、建立并保存基金份额持有人名册；

27、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

#### 四、基金管理人关于遵守法律法规的承诺

1、基金管理人承诺不从事违反《证券法》的行为，并承诺建立健全的内部控制制度，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以下违反《基金法》的行为，并承诺建立健全的内部风险控制制度，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) 依照法律、行政法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他行为。

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

(1) 越权或违规经营；

(2) 违反基金合同或托管协议；

(3) 故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益；

(4) 在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；

(5) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；

(6) 玩忽职守、滥用职权；

(7) 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) 除按基金管理人制度进行基金运作投资外，直接或间接进行其他股票投资；

(9) 协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易；

(10) 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；

(11) 贬损同行，以提高自己；

(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) 以不正当手段谋求业务发展；

(14) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；

(15) 其他法律、行政法规禁止的行为。

## 五、基金管理人关于禁止性行为的承诺

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

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、行政法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

## 六、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、不能利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者谋取利益；

3、不泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；

4、不得以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

## 七、基金管理人的内部控制制度

1、内部控制制度概述

为了保证公司规范运作，有效地防范和化解管理风险、经营风险以及操作风险，确保基金财务和公司财务以及其他信息真实、准确、完整，从而最大程度地保护基金份额持有人的

利益，本基金管理人建立了科学合理、控制严密、运行高效的内部控制制度。

内部控制制度是指公司为实现内部控制目标而建立的一系列组织机制、管理方法、操作程序与控制措施的总称。内部控制制度由内部控制大纲、基本管理制度、部门业务规章等组成。

公司内部控制大纲是对公司章程规定的内控原则的细化和展开，是对各项基本管理制度的总揽和指导，内部控制大纲明确了内控目标、内控原则、控制环境、内控措施等内容。

基本管理制度包括内部会计控制制度、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、资料档案管理制度、业绩评估考核制度和紧急应变制度等。

部门业务规章是在基本管理制度的基础上，对各部门的主要职责、岗位设置、岗位职责、操作守则等的具体说明。

## 2、内部控制原则

健全性原则。内部控制机制必须覆盖公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员，并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个运作环节。

有效性原则。通过科学的内控手段和方法，建立合理的内控程序，维护内控制度的有效执行。

独立性原则。公司各机构、部门和岗位在职能上应当保持相对独立，公司基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离。

相互制约原则。公司内部部门和岗位的设置必须权责分明、相互制衡，并通过切实可行的措施来实行。

成本效益原则。公司应充分发挥各机构、各部门及各级员工的工作积极性，运用科学化的方法尽量降低经营运作成本，提高经济效益，以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

## 3、主要内部控制制度

### (1) 内部会计控制制度

公司依据《中华人民共和国会计法》、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》、《企业财务通则》等国家有关法律、法规制订了基金会计制度、公司财务会计制度、会计工作操作流程和会计岗位职责，并针对各个风险控制点建立严密的会计系统控制。

内部会计控制制度包括凭证制度、复核制度、账务处理程序、基金估值制度和程序、基金财务清算制度和程序、成本控制制度、财务收支审批制度和费用报销管理办法、财产登记保管和实物资产盘点制度、会计档案保管和财务交接制度等。

### (2) 风险管理控制制度

风险控制制度由风险控制委员会组织各部门制定，风险控制制度由风险控制的目标和原则、风险控制的机构设置、风险控制的程序、风险类型的界定、风险控制的主要措施、风险控制的具体制度、风险控制制度的监督与评价等部分组成。



风险控制的具体制度主要包括投资风险管理制度、交易风险管理制度、财务风险控制制度以及岗位分离制度、防火墙制度、岗位职责、反馈制度、保密制度、员工行为准则等程序性风险管理制度。

### （3）监察稽核制度

公司设立督察长，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。督察长由总经理提名，董事会聘任，并经全体独立董事同意。

督察长负责组织指导公司监察稽核工作。除应当回避的情况外，督察长享有充分的知情权和独立的调查权。督察长根据履行职责的需要，有权参加或者列席公司董事会以及公司业务、投资决策、风险管理等相关会议，有权调阅公司相关文件、档案。督察长应当定期或者不定期向全体董事报送工作报告，并在董事会及董事会下设的相关专门委员会定期会议上报告基金及公司运作的合法合规情况及公司内部风险控制情况。

公司设立监察稽核部门，具体执行监察稽核工作。公司配备了充足合格的监察稽核人员，明确规定了监察稽核部门及内部各岗位的职责和工作流程。

监察稽核制度包括内部稽核管理办法、内部稽核工作准则等。通过这些制度的建立，检查公司各业务部门和人员遵守有关法律、法规和规章的情况；检查公司各业务部门和人员执行公司内部控制制度、各项管理制度和业务规章的情况。

## 四、基金托管人

### 一、基金托管人基本情况

名称：中国农业银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座九层

法定代表人：蒋超良

成立时间：2009 年 1 月 15 日

批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复【2009】13 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：32,479,411.7 万元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]23 号

联系电话：010-63201510

传真：010-63201816

联系人：李芳菲

发展概况：

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分，总行设在北京。经国务院批准，中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于 2009 年 1 月 15 日依法成立。中国农业银行网点遍布中国城乡，成为国内网点最多、业务辐射范围最广，服务领域最广，服务对象最多，业务功能齐全的大型国有商业银行之一。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行，中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念，坚持审慎稳健经营、可持续发展，立足县域和城市两大市场，实施差异化竞争策略，着力打造‘伴你成长’服务品牌，依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品，致力为广大客户提供优质的金融服务，与广大客户共创价值、共同成长。中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行，经验丰富，服务优质，业绩突出，2004 年被英国《全球托管人》评为中国“最佳托管银行”。2007 年中国农业银行通过了美国 SAS70 内部控制审计，并获得无保留意见的 SAS70 审计报告，表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设，品牌声誉进一步提升，在 2010 年首届“‘金牌理财’TOP10 颁奖盛典”中成绩突出，获“最佳托管银行”奖。2010 年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的“最佳资产托管奖”。

中国农业银行证券投资基金托管部于 1998 年 5 月经中国证监会和中国人民银行批准成立，2004 年 9 月更名为托管业务部，内设养老金管理中心、技术保障处、营运中心、委托资产托管处、保险资产托管处、证券投资基金托管处、境外资产托管处、综合管理处、风险

管理处，拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

## 二、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工 140 余名，其中高级会计师、高级经济师、高级工程师、律师等专家 10 余名，服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强，高级管理层均有 20 年以上金融从业经验和高级技术职称，精通国内外证券市场的运作。

## 三、基金托管业务经营情况

截至 2013 年 5 月 28 日，中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共 160 只，包括富国天源平衡混合型证券投资基金、华夏平稳增长混合型证券投资基金、大成积极成长股票型证券投资基金、大成景阳领先股票型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金、长盛同德主题增长股票型证券投资基金、裕阳证券投资基金、汉盛证券投资基金、裕隆证券投资基金、景福证券投资基金、鸿阳证券投资基金、丰和价值证券投资基金、久嘉证券投资基金、长盛成长价值证券投资基金、宝盈鸿利收益证券投资基金、大成价值增长证券投资基金、大成债券投资基金、银河稳健证券投资基金、银河收益证券投资基金、长盛中信全债指数增强型债券投资基金、长信利息收益开放式证券投资基金、长盛动态精选证券投资基金、景顺长城内需增长开放式证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、长信银利精选开放式证券投资基金、富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金、鹏华货币市场证券投资基金、中海分红增利混合型证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、新华优选分红混合型证券投资基金、交银施罗德精选股票证券投资基金、泰达宏利货币市场基金、交银施罗德货币市场证券投资基金、景顺长城资源垄断股票型证券投资基金、大成沪深 300 指数证券投资基金、信诚四季红混合型证券投资基金、富国天时货币市场基金、富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金、益民货币市场基金、长城安心回报混合型证券投资基金、中邮核心优选股票型证券投资基金、景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金、交银施罗德成长股票证券投资基金、长盛中证 100 指数证券投资基金、泰达宏利首选企业股票型证券投资基金、东吴价值成长双动力股票型证券投资基金、鹏华动力增长混合型证券投资基金、宝盈策略增长股票型证券投资基金、国泰金牛创新成长股票型证券投资基金、益民创新优势混合型证券投资基金、中邮核心成长股票型证券投资基金、华夏复兴股票型证券投资基金、富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金、长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金、富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金、申万巴黎竞争优势股票型证券投资基金、新华优选成长股票型证券投资基金、金元惠理成长动力灵活配置混合型证券投资基金、天治稳健双盈债券型证券投资基金、中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金、金元惠理丰利债券型证券投资基金、交银施罗德先锋股票证券投资基金、东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金、建信收益增

强债券型证券投资基金、银华内需精选股票型证券投资基金(LOF)、大成行业轮动股票型证券投资基金、交银施罗德上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金、上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金、富兰克林国海沪深 300 指数增强型证券投资基金、南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)、景顺长城能源基建股票型证券投资基金、中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信中小盘成长股票型证券投资基金、东吴货币市场证券投资基金、博时创业成长股票型证券投资基金、招商信用添利债券型证券投资基金、易方达消费行业股票型证券投资基金、富国汇利分级债券型证券投资基金、大成景丰分级债券型证券投资基金、兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金(LOF)、工银瑞信深证红利交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信深证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金、富国可转换债券证券投资基金、大成深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、泰达宏利领先中小盘股票型证券投资基金、交银施罗德信用添利债券证券投资基金、东吴中证新兴产业指数证券投资基金、工银瑞信四季收益债券型证券投资基金、招商安瑞进取债券型证券投资基金、汇添富社会责任股票型证券投资基金、工银瑞信消费服务行业股票型证券投资基金、易方达黄金主题证券投资基金(LOF)、中邮中小盘灵活配置混合型证券投资基金、浙商聚潮产业成长股票型证券投资基金、嘉实领先成长股票型证券投资基金、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、南方保本混合型证券投资基金、交银施罗德先进制造股票证券投资基金、上投摩根新兴动力股票型证券投资基金、富兰克林国海策略回报灵活配置混合型证券投资基金、金元惠理保本混合型证券投资基金、招商安达保本混合型证券投资基金、交银施罗德深证 300 价值交易型开放式指数证券投资基金、南方中国中小盘股票指数证券投资基金(LOF)、交银施罗德深证 300 价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金、富国中证 500 指数增强型证券投资基金(LOF)、长信内需成长股票型证券投资基金、大成中证内地消费主题指数证券投资基金、中海消费主题精选股票型证券投资基金、长盛同瑞中证 200 指数分级证券投资基金、景顺长城核心竞争力股票型证券投资基金、汇添富信用债债券型证券投资基金、光大保德信行业轮动股票型证券投资基金、富兰克林国海亚洲(除日本)机会股票型证券投资基金、汇添富逆向投资股票型证券投资基金、大成新锐产业股票型证券投资基金、申万菱信中小板指数分级证券投资基金、广发消费品精选股票型证券投资基金、鹏华金刚保本混合型证券投资基金、汇添富理财 14 天债券型证券投资基金、嘉实全球房地产证券投资基金、金元惠理新经济主题股票型证券投资基金、东吴保本混合型证券投资基金、建新社会责任股票型证券投资基金、嘉实理财宝 7 天债券型证券投资基金、富兰克林国海恒久信用债券型证券投资基金、大成月添利理财债券型证券投资基金、安信目标收益债券型证券投资基金、富国 7 天理财宝债券型证券投资基金、交银施罗德理财 21 天债券型证券投资基金、易方达中债新综合指数发起式证券投资基金(LOF)、工银瑞信信用纯债债券型证券投资基金、大成现金增利货币

市场基金、景顺长城支柱产业股票型证券投资基金、易方达月月利理财债券型证券投资基金、摩根士丹利华鑫量化配置股票型证券投资基金、东方央视财经 50 指数增强型证券投资基金、交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金、鹏华理财 21 天债券型证券投资基金、国泰民安增利债券型发起式证券投资基金、万家 14 天理财债券型证券投资基金、华安纯债债券型发起式证券投资基金、金元惠理惠利保本混合型证券投资基金、南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、招商双债增强分级债券型证券投资基金、景顺长城品质投资股票型证券投资基金、中海可转换债券债券型证券投资基金、融通标普中国可转债指数增强型证券投资基金、大成现金宝场内实时申赎货币市场基金、交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金、国泰中国企业境外高收益债券型证券投资基金、富兰克林国海焦点驱动灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城沪深 300 等权重交易型开放式指数证券投资基金、广发聚源定期开放债券型证券投资基金、大成景安短融债券型证券投资基金、嘉实研究阿尔法股票型证券投资基金。

#### **四、基金托管人的内部控制制度**

##### **1、内部控制目标**

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定,守法经营、规范运作、严格监察,确保业务的稳健运行,保证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。

##### **2、内部控制组织结构**

风险管理委员会总体负责中国农业银行的风险管理与内部控制工作,对托管业务风险管理和内部控制工作进行监督和评价。托管业务部专门设置了风险管理处,配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作,独立行使监督稽核职权。

##### **3、内部控制制度及措施**

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;业务人员具备从业资格;业务管理实行严格的复核、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。

#### **五、托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序**

基金托管人通过参数设置将《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议规定的投资比例和禁止投资品种输入监控系统,每日登录监控系统监督基金管理人的投资运作,并通过基金资金账户、基金管理人的投资指令等监督基金管理人的其他行为。

当基金出现异常交易行为时，基金托管人应当针对不同情况进行以下方式的处理：

- 1、电话提示。对媒体和舆论反映集中的问题，电话提示基金管理人；
- 2、书面警示。对本基金投资比例接近超标、资金头寸不足等问题，以书面方式对基金管理人进行提示；
- 3、书面报告。对投资比例超标、清算资金透支以及其他涉嫌违规交易等行为，书面提示有关基金管理人并报中国证监会。

## 五、相关服务机构

### 一、销售机构

#### 1、直销机构：

南方基金管理有限公司

住所及办公地址：深圳市福田区福华一路六号免税商务大厦塔楼 31、32、33 层整层

法定代表人：吴万善

电话：(0755) 82763905、82763906

传真：(0755) 82763900

联系人：张锐珊

#### 2、代销机构：

(1) 中国农业银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：蒋超良

客户服务电话：95599

(2) 其他基金代销机构情况详见基金管理人发布的相关公告。

### 二、登记机构

名称：南方基金管理有限公司

住所及办公地址：深圳市福田区福华一路六号免税商务大厦塔楼 31、32、33 层整层

法定代表人：吴万善

电话：(0755) 82763849

传真：(0755) 82763868

联系人：古和鹏

### 三、律师事务所

名称：广东华瀚律师事务所

注册地址：深圳市罗湖区笋岗东路 1002 号宝安广场 A 座 16 楼 G.H 室

负责人：李兆良

电话：(0755) 82687860

传真：(0755) 82687861

经办律师：杨忠、戴瑞冬

#### 四、会计师事务所

名称：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：金毅

经办会计师：薛竞、金毅



## 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》、基金合同及其他有关规定，并经中国证监会 2013 年 3 月 18 日证监许可[2013]253 号文批准募集。

本基金为契约型开放式基金。基金存续期限为不定期。

### 一、募集期

自基金份额发售之日起不超过 3 个月，具体发售时间见基金份额发售公告。

### 二、发售对象

符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和人民币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。

### 三、募集目标

本基金可设置首次募集规模上限，具体募集上限及规模控制的方案详见基金份额发售公告或其他公告。若本基金设置首次募集规模上限，基金合同生效后不受此募集规模的限制。

### 四、发售方式和销售渠道

本基金通过各销售机构的基金销售网点向投资者公开发售，各销售机构的具体名单见基金份额发售公告。

本基金认购的申请方式为书面申请或管理人公布的其他方式。

本基金基金份额发售面值为人民币 1.00 元，按面值发售。

本基金认购采取全额缴款认购的方式。若资金未全额到账则认购无效，基金管理人将认购无效的款项退回。

基金投资者在募集期内可多次认购，认购一经确认不得撤销。

当日（T 日）在规定时间内提交的申请，投资者通常可在 T+2 日到网点查询交易情况，在募集截止日后 3 个工作日内可以到网点打印交易确认书。

### 五、认购费用

1、对于认购本基金的特定投资群体，本基金认购费率最高不高于 0.06%，且随认购金额的增加而递减，如下表所示：

购买金额 (M)	认购费率
M < 100 万	0.06%
100 万 ≤ M < 500 万	0.04%
500 万 ≤ M < 1000 万	0.02%
M ≥ 1000 万	每笔 100 元

特定投资群体指依法设立的基本养老保险基金、依法制定的企业年金计划筹集的资金及其投资运营收益形成的企业补充养老保险基金（包括全国社会保障基金、经监管部门批准可以投资基金的地方社会保险基金、企业年金单一计划以及集合计划）。特定投资群体需在认购前向基金管理人登记备案，并经基金管理人确认。如将来出现经监管部门批准可以投资基金的其他社会保险基金、企业年金或其他养老金类型，基金管理人可在招募说明书更新时或发布临时公告将其纳入特定投资群体范围，并按规定向中国证监会备案。

2、除上述特定投资群体外，认购本基金的所有投资者，本基金认购费率最高不高于 0.6%，且随认购金额的增加而递减，如下表所示：

购买金额 (M)	认购费率
M < 100 万	0.6%
100 万 ≤ M < 500 万	0.4%
500 万 ≤ M < 1000 万	0.2%
M ≥ 1000 万	每笔 1,000 元

投资者重复认购，须按每次认购所对应的费率档次分别计费。

基金认购费用不列入基金财产，主要用于基金的市场推广、销售、登记等募集期间发生的各项费用。

## 六、认购期利息的处理方式

《基金合同》生效前，投资者的认购款项只能存入专门账户，不得动用。认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有，其中利息转份额以基金登记机构的记录为准。

## 七、基金认购份额的计算

1、本基金采用“金额认购、份额确认”的方式。基金的认购金额包括认购费用和净认购金额。认购份额的计算公式为：

$$\text{净认购金额} = \text{认购金额} / (1 + \text{认购费率})$$

$$\text{认购费用} = \text{认购金额} - \text{净认购金额}$$

$$\text{认购份额} = (\text{净认购金额} + \text{认购利息}) / \text{基金份额面值}$$

例：某非特定群体的普通投资者投资 10 万元认购本基金份额，该笔认购产生利息 50 元，对应认购费率为 0.6%，则其可得到的认购份额为：

净认购金额 =  $100,000 / (1 + 0.6\%) = 99,403.58$  元

认购费用 =  $100,000 - 99,403.58 = 596.42$  元

认购份额 =  $(99,403.58 + 50) / 1.00 = 99,453.58$  份

例：某特定投资者投资 10 万元认购本基金份额，该笔认购产生利息 50 元，对应认购费率为 0.06%，则其可得到的认购份额为：

净认购金额 =  $100,000 / (1 + 0.06\%) = 99,940.04$  元

认购费用 =  $100,000 - 99,940.04 = 59.96$  元

认购份额 =  $(99,940.04 + 50) / 1.00 = 99,990.04$  份

2、认购份额的计算中，涉及基金份额的计算结果均保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分舍弃，舍弃部分归入基金财产；涉及金额的计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有，其中利息转份额以基金登记机构的记录为准。利息折算的份额保留到小数点后两位，小数点后两位以后部分舍去，余额计入基金财产。

## 八、基金认购金额的限制

本基金首次认购和追加认购最低金额均为人民币 1,000 元，具体认购金额以各基金代销机构的公告为准。本基金直销机构最低认购金额由基金管理人制定和调整。

## 九、基金份额的认购和持有限额

基金管理人不对每个账户的认购和持有基金份额进行限制。

## 十、基金运作方式

契约型开放式

本基金以定期开放的方式运作，即本基金以运作周期和自由开放期相结合的方式运作。

本基金以 1 年为一个运作周期，每个运作周期为自基金合同生效日（含）或每个自由开放期结束之日的次日（含）起至 1 年后的对日的期间。

在每个运作周期结束后进入自由开放期。本基金的每个自由开放期为 5 至 20 个工作日。自由开放期的具体期间由管理人在上一个运作周期结束前公告说明。在自由开放期内，本基金采取开放运作模式，投资人可办理基金份额申购、赎回或其他业务。

在首个运作周期中，本基金的受限开放期为基金合同生效日起每三个月的对日。在第二个及以后的运作周期中，本基金的受限开放期为该运作周期首日起每三个月的对日。本基金

的每个受限开放期为 1 个工作日。

在每个受限开放期，本基金将开放赎回，但对赎回数量进行控制，确保赎回数量占该受限开放期前一日基金份额总数的 10% 以内（含 10%）。当赎回数量占比超过该受限开放期前一日基金份额总数的 10%，则对赎回申请的确认按照前一日基金份额总数的 10% 占该日实际赎回申请的比例进行部分确认。

在每个受限开放期，本基金一般不接受申购申请。基金管理人可根据本基金的运作状况或市场情况开放本基金的申购业务，并可对申购设定上限或设定比例确认规则等，具体的申购规则由基金管理人在开始办理申购前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上予以公告，并报中国证监会备案。

在每个运作周期内，除受限开放期以外，均为封闭期。在封闭期内，本基金不接受基金份额的申购和赎回。

如封闭期或运作周期结束之日后第一个工作日因不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放申购与赎回业务的，开放期自不可抗力或其他情形的影响因素消除之日起的下一个工作日开始。开放期内因发生不可抗力或其他情形而发生基金暂停申购与赎回业务的，开放期将按因不可抗力或其他情形而暂停申购与赎回的期间相应延长。

本基金的每个运作周期以封闭期和受限开放期相交替的方式运作，每个运作周期内包括 4 个封闭期和 3 个受限开放期。

例如，假设本基金基金合同于 2013 年 6 月 18 日生效，则本基金的第一个运作周期为 2013 年 6 月 18 日至 2014 年 6 月 18 日，其中受限开放期分别为 2013 年 9 月 18 日、2013 年 12 月 18 日、2014 年 3 月 18 日。在以上每个受限开放期，投资者可提出基金份额的赎回申请，本基金将对当日的赎回数量进行控制，确保赎回数量占该受限开放期前一日基金份额总数的 10% 以内（含 10%）。上述日期如为节假日，则顺延至下一工作日。

本基金的首个运作周期结束后即进入首个自由开放期，为 2014 年 6 月 19 日起的 5 至 20 个工作日。若基金首次自由开放期确定为 20 个工作日，则自 2014 年 6 月 19 日至 2014 年 7 月 16 日的 20 个工作日为本基金的首个自由开放期，在此期间投资者可以办理本基金的申购、赎回业务。

自 2014 年 7 月 17 日起进入本基金下一自由开放期，以此类推。

## 七、基金合同的生效

### 一、基金备案的条件

本基金自基金份额发售之日起 3 个月内，在基金募集份额总额不少于 2 亿份，基金募集金额不少于 2 亿元人民币且基金认购人数不少于 200 人的条件下，基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售，并在 10 日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告之日起 10 日内，向中国证监会办理基金备案手续。

基金募集达到基金备案条件的，自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起，《基金合同》生效；否则《基金合同》不生效。基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对《基金合同》生效事宜予以公告。基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。

### 二、基金合同不能生效时募集资金的处理方式

如果募集期限届满，未满足募集生效条件，基金管理人应当承担下列责任：

- 1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；
- 2、在基金募集期限届满后 30 日内退还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期存款利息。
- 3、如基金募集失败，基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和销售机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。

### 三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

《基金合同》生效后，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并报送解决方案。

本基金自基金合同生效之日起，有下列情形之一的，基金管理人与基金托管人协商一致后，可以终止本基金合同，不需要召开持有人大会。

- 1、基金合同生效后，每个自由开放期届满时，基金份额持有人数量不满 200 人的；
- 2、基金合同生效后，每个自由开放期届满时，基金资产净值低于 5000 万元的；
- 3、基金合同生效后，每个自由开放期届满时，基金前 10 大份额持有人持有基金份额总数超过基金总份额 90% 的。

法律法规另有规定时，从其规定。

## 八、基金份额的申购和赎回

### 一、申购与赎回的期间

封闭期内，投资者不能申购、赎回基金份额。开放期内，投资人可进行基金份额的申购、赎回。本基金的开放期包括自由开放期和受限开放期。

本基金以1年为一个运作周期，每个运作周期为自基金合同生效日（含）或每个自由开放期结束之日的次日（含）起至1年后的对日的期间。

**自由开放期：**在每个运作周期结束后进入自由开放期。本基金的每个自由开放期为5至20个工作日。自由开放期的具体期间由基金管理人在上一个运作周期结束前公告说明。在自由开放期内，本基金采取开放运作模式，投资人可办理基金份额申购、赎回或其他业务。

**受限开放期：**在首个运作周期中，本基金的受限开放期为基金合同生效日起每三个月的对日。在第二个及以后的运作周期中，本基金的受限开放期为该运作周期首日起每三个月的对日。本基金的每个受限开放期为1个工作日。

**封闭期：**指本基金在每个运作周期内，除受限开放期以外的期间。在每个封闭期内本基金采取封闭运作模式，期间基金份额总额保持不变，本基金不接受基金份额的申购和赎回。

### 二、申购与赎回场所

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。具体的销售网点将由基金管理人在招募说明书或其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并予以公告。基金投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。

### 三、申购与赎回的开放日及时间

#### 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，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。投资者应当在开放期的开放日办理申购和赎回申请。

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体上公告。

#### 2、申购、赎回开始日及业务办理时间

除法律法规或基金合同另有约定外，自每个封闭期或运作周期结束之日后第一个工作日

(含)起,本基金进入开放期,开始办理申购和赎回业务。每个受限开放期为上一封闭期结束后的第1个工作日,每个自由开放期为上一个运作周期结束后的5至20个工作日,自由开放期的具体期间由基金管理人在上一运作周期结束前公告说明。如封闭期或运作周期结束之日后第一个工作日因不可抗力或其他情形致使本基金无法按时开放申购与赎回业务的,开放期自不可抗力或其他情形的影响因素消除之日起的下一个工作日开始。开放期内因发生不可抗力或其他情形而致使本基金暂停申购与赎回的,开放期将因不可抗力或其他情形而暂停申购与赎回的期间相应延长。自由开放期内本基金采取开放运作模式,投资人可办理基金份额申购、赎回或其他业务。

基金管理人应在每次开放期前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告开放期的开始与结束时间。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购或者赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的,其基金份额申购、赎回价格为下一开放日基金份额申购、赎回的价格。但是,在自由开放期内最后一个开放日和受限开放期,投资者在基金合同约定时间之后提出申购、赎回申请的,视为无效申请。封闭期内,本基金不办理申购与赎回业务(红利再投资除外)。

#### 四、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、在每个受限开放期,本基金将开放赎回,但对赎回数量进行控制,确保赎回数量占该受限开放期前一日基金份额总数的10%以内(含10%)。当赎回数量占比超过该受限开放期前一日基金份额总数的10%,则对赎回申请的确认按照前一日基金份额总数的10%占该日实际赎回申请的比例进行部分确认。

在每个受限开放期,本基金一般不接受申购申请。基金管理人可根据本基金的运作状况或市场情况开放本基金的申购业务,并可对申购设定上限或设定比例确认规则等,具体的申购规则由基金管理人在开始办理申购前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上予以公告,并报中国证监会备案。

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

#### 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。

投资人在提交申购申请时须按销售机构规定的方式备足申购资金，投资人在提交赎回申请时须持有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回申请无效。

### 2、申购和赎回的款项支付

投资人申购基金份额时，必须在规定的时间内全额交付申购款项，投资人按合同的约定交付款项，申购申请即为有效。

投资人赎回申请成功后，基金管理人将在 T+7 日(包括该日)内支付赎回款项。在本基金自由开放期内，若单个开放日内的基金份额净赎回申请超过前一开放日的基金总份额的 20%，款项的支付办法参照本基金合同有关条款处理。

基金管理人可以在法律法规允许的范围内，对上述业务办理时间进行调整，并提前公告。

### 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，投资人可在 T+2 日后(包括该日)到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功，则申购款项退还给投资人。

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请。申购、赎回申请的确认以登记机构或基金管理人的确认结果为准。

## 六、申购和赎回的数量限制

1、本基金申购和追加申购的最低金额均为 1,000 元，单笔最低赎回份额不限制，基金份额持有人可将其全部或部分基金份额赎回。各代销机构对最低限额有其他规定的，以各代销机构的约定为准。本基金直销机构最低申购金额及最低赎回份额由基金管理人制定和调整。

2、本基金不对投资者每个交易账户的最低基金份额余额进行限制；

3、本基金不对单个投资者累计持有的基金份额上限进行限制；

4、基金管理人可根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整上述对申购的金额和赎回的份额的数量限制，基金管理人必须在调整生效前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体公告并报中国证监会备案。

## 七、申购和赎回的价格、费用及其用途

1、本基金在申购时收取申购费用。

本基金对特定投资群体与除此之外的其他投资者实施差别的申购费率。



对于申购本基金的特定投资群体，本基金申购费率最高不高于 0.06%，且随申购金额的增加而递减，如下表所示：

购买金额 (M)	申购费率
M < 100 万	0.06%
100 万 ≤ M < 500 万	0.04%
500 万 ≤ M < 1000 万	0.02%
M ≥ 1000 万	每笔 100 元

特定投资群体指依法设立的基本养老保险基金、依法制定的企业年金计划筹集的资金及其投资运营收益形成的企业补充养老保险基金（包括全国社会保障基金、经监管部门批准可以投资基金的地方社会保险基金、企业年金单一计划以及集合计划）。特定投资群体需在申购前向基金管理人登记备案，并经基金管理人确认。如将来出现经监管部门批准可以投资基金的其他社会保险基金、企业年金或其他养老金类型，基金管理人可在招募说明书更新时或发布临时公告将其纳入特定投资群体范围，并按规定向中国证监会备案。

除上述特定投资群体外，申购本基金的所有投资者，本基金申购费率最高不高于 0.6%，且随申购金额的增加而递减，如下表所示：

购买金额 (M)	申购费率
M < 100 万	0.6%
100 万 ≤ M < 500 万	0.4%
500 万 ≤ M < 1000 万	0.2%
M ≥ 1000 万	每笔 1,000 元

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、注册登记等各项费用。

2、本基金的赎回费率如下表：

本基金在受限开放期内的赎回费率为 2%，自由开放期内不收取赎回费，如下表所示：

赎回时点	赎回费率
受限开放期	2%
自由开放期	0

本基金赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。本基金的赎回费用全部归入基金财产。

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

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的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对以特定交易方式（如网上交易、电话交易等）进行基金交易的投资人定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，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申购费率。

## 八、申购份额与赎回金额的计算

1、基金申购份额的计算方法如下：

本基金的申购金额包括申购费用和净申购金额。申购份额的计算公式为：

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

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

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

例：某投资者（非特定投资群体）在自由开放期投资 10 万元申购本基金，对应申购费率为 0.6%，假设申购当日基金份额净值为 1.016 元，则其可得到的申购份额为：

$$\text{净申购金额} = 100,000 / (1 + 0.6\%) = 99,403.58 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 100,000 - 99,403.58 = 596.42 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 99,403.58 / 1.016 = 97,838.16 \text{ 份}$$

2、基金赎回金额的计算

在本基金的赎回金额的计算公式为：

$$\text{赎回费用} = \text{赎回份额} \times \text{赎回当日基金份额净值} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{赎回金额} = \text{赎回份额} \times \text{赎回当日基金份额净值} - \text{赎回费用}$$

例：某投资者于自由开放期赎回本基金 10 万份，对应的赎回费率为 0%，假设赎回当日基金份额净值是 1.017 元，则其可得到的赎回金额为：

$$\text{赎回金额} = 100,000 \times 1.017 = 101,700.00 \text{ 元}$$

例：某投资者于受限开放期赎回本基金 10 万份，对应的赎回费率为 2%，假设赎回当日基金份额净值是 1.017 元，则其可得到的赎回金额为：

$$\text{赎回费用} = 100,000 \times 1.017 \times 2\% = 2,034 \text{ 元}$$

$$\text{赎回金额} = 100,000 \times 1.017 - 2,034 = 99,666 \text{ 元}$$

3、基金份额净值的计算

本基金份额净值的计算，保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 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。

4、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申购金额在扣除相应的费用后，以当日基金份额净值为基准计算。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。申购涉及份额的计算结果按舍去尾数的方法，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。

#### 5、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来计算并扣除相应的费用，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。

### 九、申购和赎回的登记

投资者申购基金成功后，基金登记机构在 T+1 日为投资者登记权益并办理登记手续，投资者自 T+2 日（含该日）后于本基金开放日内有权赎回该部分基金份额。

投资者赎回基金成功后，基金登记机构在 T+1 日为投资者办理扣除权益的登记手续。

登记机构可以在法律法规允许的范围内，对上述登记办理时间进行调整，但不得实质影响投资者的合法权益，并最迟于实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体公告。

### 十、拒绝或暂停申购的情形

在开放期内发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

- 1、因不可抗力导致基金无法正常运转。
- 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接收投资人的申购申请。
- 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或者无法办理申购业务。
- 4、基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。
- 5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人利益的情形。
- 6、因基金收益分配、基金投资组合内某个或某些证券即将上市等原因，使基金管理人认为短期内继续接受申购可能会影响或损害已有基金份额持有人利益的。
- 7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第 1、2、3、5、6、7 项暂停申购情形时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒体上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。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，且开放期间按暂停申购的期间相应延长。

### 十一、暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形

(一) 在开放期内发生下列情形时, 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时, 基金管理人可暂停接收投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。
- 3、证券交易所交易时间非正常停市, 导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
- 4、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形时, 基金管理人可调整本基金开放期的具体时间, 并及时向中国证监会备案, 已确认的赎回申请, 基金管理人应足额支付; 如暂时不能足额支付, 应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人, 未支付部分可延期支付。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, 且开放期间按暂停赎回的期间相应延长。

(二) 若本基金在自由开放期内的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 20%, 基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回、延缓支付或终止基金合同。

(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) 延缓支付: 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, 基金管理人应当接受并确认当日所有的赎回申请, 当日按比例办理的赎回份额不得低于基金总份额的 20%, 其余赎回申请可以延缓支付赎回款项, 但不得超过 20 个工作日, 并应当在指定媒体上进行公告。

(3) 终止基金合同: 如基金管理人无法在 20 个工作日内支付上述未支付部分的赎回款项, 或基金管理人认为在变现过程中由于交易成本等因素明显损害其他基金份额持有人利益的情形, 可不经基金份额持有人大会决议, 由基金管理人和基金托管人协商一致, 并报中国证监会备案后, 《基金合同》终止, 对于已确认未支付赎回款的交易与基金其他客户一并进行剩余财产的分配。

当发生上述暂停赎回或延缓支付时, 基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个交易日内通知基金份额持有人, 说明有关处理方法, 同时在指定媒体上刊登公告。

## 十二、其他暂停申购和赎回的情形

发生《基金合同》或《招募说明书》中未予载明的事项，但基金管理人无正当理由认为需要暂停基金申购、赎回申请的，应当报经中国证监会批准。基金管理人应当立即在指定媒体刊登暂停公告。

### 十三、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

1、发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人当日应及时向中国证监会备案，并在规定期限内指定媒体上刊登暂停公告。

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

### 十四、基金的转换

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本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。

### 十六、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。

### 十七、基金的转托管

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

### 十八、基金的冻结和解冻

基金登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻，以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。

## 十九、其他业务

在相关法律法规允许的条件下，基金登记机构可依据其业务规则，受理基金份额质押等业务，并收取一定的手续费用。

## 九、基金的投资

### 一、投资目标

本基金在严格控制风险和追求基金资产长期稳定的基础上,力求获得高于业绩比较基准的投资收益。

### 二、投资范围

本基金主要投资于具有良好流动性的固定收益类金融工具,包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府机构债、地方政府债、资产支持证券、中小企业私募债券、可分离交易可转债中的债券部分、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但需符合中国证监会的相关规定。

本基金对固定收益类金融工具的投资比例合计不低于基金资产的80%,其中对信用类固定收益金融工具的投资比例合计不低于基金固定收益类金融工具的80%。在每个受限开放期的开始前10个工作日和结束后10个工作日,自由开放期的开始前3个月和结束后3个月,以及受限开放期和自由开放期内不受上述投资组合比例的限制。在自由开放期,本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,在运作周期内(包含受限开放期和封闭期),本基金不受上述5%的限制。本基金不直接从二级市场买入股票、权证、可转债等,也不参与一级市场的新股、可转债申购或增发新股。

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

### 三、投资策略

本基金以中长期利率趋势分析为基础,结合经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析,实施积极的债券投资组合管理,以获取较高的债券组合投资收益。

#### (1) 信用债投资策略

本基金将重点投资信用类债券,以提高组合收益能力。信用债券相对央票、国债等利率产品的信用利差是本基金获取较高投资收益的来源,本基金将在南方基金内部信用评级的基础上和内部信用风险控制的框架下,积极投资信用债券,获取信用利差带来的高投资收益。

债券的信用利差主要受两个方面的影响,一是市场信用利差曲线的走势;二是债券本身的信用变化。本基金依靠对宏观经济走势、行业信用状况、信用债券市场流动性风险、信用债券供需情况等的分析,判断市场信用利差曲线整体及分行业走势,确定各期限、各类属信

用债券的投资比例。依靠内部评级系统分析各信用债券的相对信用水平、违约风险及理论信用利差，选择信用利差被高估、未来信用利差可能下降的信用债券进行投资，减持信用利差被低估、未来信用利差可能上升的信用债券。

#### (2) 收益率曲线策略

收益率曲线形状变化代表长、中、短期债券收益率差异变化，相同久期债券组合在收益率曲线发生变化时差异较大。通过对同一类属下的收益率曲线形态和期限结构变动进行分析，首先可以确定债券组合的目标久期配置区域并确定采取子弹型策略、哑铃型策略或梯形策略；其次，通过不同期限间债券当前利差与历史利差的比较，可以进行增陡、减斜和凸度变化的交易。

#### (3) 杠杆放大策略

杠杆放大操作即以组合现有债券为基础，利用买断式回购、质押式回购等方式融入低成本资金，并购买剩余年限相对较长并具有较高收益的债券，以期获取超额收益的操作方式。

#### (4) 资产支持证券投资策略

当前国内资产支持证券市场以信贷资产证券化产品为主（包括以银行贷款资产、住房抵押贷款等作为基础资产），仍处于创新试点阶段。产品投资关键在于对基础资产质量及未来现金流的分析，本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下，采用基本面分析和数量化模型相结合，对个券进行风险分析和价值评估后进行投资。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。

#### (5) 中小企业私募债投资策略

由于中小企业私募债券采取非公开方式发行和交易，并限制投资者数量上限，整体流动性相对较差。同时，受到发债主体资产规模较小、经营波动性较高、信用基本面稳定性较差的影响，整体的信用风险相对较高。中小企业私募债券的这两个特点要求在具体的投资过程中，应采取更为谨慎的投资策略。本基金认为，投资该类债券的核心要点是分析和跟踪发债主体的信用基本面，并综合考虑信用基本面、债券收益率和流动性等要素，确定最终的投资决策。

今后，随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等，基金还将积极寻求其他投资机会，如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金将在履行适当程序后，将其纳入投资范围以丰富组合投资策略。

## 四、投资决策依据和决策程序

### 1、决策依据

(1) 国家有关法律、法规和本基金契约的有关规定。依法决策是本基金进行投资的前提；

(2) 宏观经济发展态势、微观经济运行环境和证券市场走势。这是本基金投资决策的



基础；

(3) 投资对象收益和风险的配比关系。在充分权衡投资对象的收益和风险的前提下做出投资决策，是本基金维护投资者利益的重要保障。

## 2、决策程序

(1) 决定主要投资原则：投资决策委员会决定基金的主要投资原则，并对基金投资组合的资产配置比例等提出指导性意见。

(2) 提出投资建议：固定收益部研究员以外部研究报告以及其他信息来源作为参考，对利率市场、信用市场进行研究，提出债券市场运行趋势的分析观点，在重点关注的投资产品范围内根据自己的研究选出有投资价值的各类债券向基金经理做出投资建议。研究员根据基金经理提出的要求对各类投资品种进行研究并提出投资建议。

(3) 制定投资决策：基金经理在遵守投资决策委员会制定的投资原则前提下，根据研究员提供的投资建议以及自己的分析判断，做出具体的投资决策。

(4) 进行风险评估：风险控制委员会定期召开会议，对基金投资组合进行风险评估，并提出风险控制意见。

(5) 评估和调整决策程序：基金管理人有权根据环境的变化和实际的需要调整决策的程序。

## 五、投资限制

### (一) 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) 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) 向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- (6) 买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、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) 依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

### (二) 投资组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

(1) 本基金对固定收益类金融工具的投资比例合计不低于基金资产的 80%，其中对信用类固定收益金融工具的投资比例合计不低于基金固定收益类金融工具的 80%。在每个受限开放期的开始前 10 个工作日和结束后 10 个工作日，自由开放期的开始前 3 个月和结束后 3 个月，以及受限开放期和自由开放期内不受上述投资组合比例的限制；

(2) 在自由开放期，本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，在运作周期内（包含受限开放期和封闭期），本基金不受上述 5% 的限制；

(3) 本基金不直接从二级市场买入股票、权证、可转债等，也不参与一级市场的新股、可转债申购或增发新股；

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

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

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

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

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

(10) 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%；

(11) 本基金持有单只中小企业私募债券，其市值不得超过该基金资产净值的 10%；

(12) 本基金投资中小企业私募债券的剩余期限，不得超过自投资之日起至本次运作周期结束之日的长度；

(13) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价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。

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。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消上述限制，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。

## 六、业绩比较基准

一年期定期存款税后收益率 $\times$ 140%

对于本基金的第一个运作周期，上述“一年期定期存款税后收益率”指基金合同生效当日中国人民银行公布并执行的一年期金融机构人民币存款基准税后利率。对于第二个及之后的运作周期，“一年期定期存款税后收益率”指第二个及之后的运作周期的第一个工作日中国人民银行公布并执行的一年期金融机构人民币存款基准税后利率。

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时，本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

## 七、风险收益特征

本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金。

## 八、基金管理人代表基金行使债权人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债权人权利，保护基金份额持有人的利益。

## 九、基金的融资融券

本基金可以根据届时有效的有关法律法规和政策的规定进行融资融券。

## 十、基金的财产

### 一、基金资产总值

基金资产总值是指购买的各类证券及票据价值、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和。

### 二、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### 三、基金财产的账户

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

### 四、基金财产的保管和处分

本基金财产独立于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的财产，并由基金托管人保管。基金管理人、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。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

## 十一、 基金资产估值

### 一、 估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券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、银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

### 三、 估值方法

#### 1、 证券交易所上市的有价证券的估值

(1) 交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

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

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

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

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

4、 中小企业私募债采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

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。

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

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

#### 四、估值程序

1、基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到0.001元，小数点后第4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基金份额净值，并按规定公告。

2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或本基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

#### 五、估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后3位以内(含第3位)发生估值错误时，视为基金份额净值错误。

本基金合同的当事人应按照以下约定处理：

##### 1、估值错误类型

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

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

##### 2、估值错误处理原则

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

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

(3) 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、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

## 七、基金净值的确认

---

用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算,基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的基金资产净值和基金份额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。



## 十二、 基金的收益与分配

### 一、基金利润的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额，基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

### 二、基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

### 三、基金收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次。若本基金每个封闭期结束日（不含）之前的第 15 个工作日当日收市后每 10 份基金份额可分配利润金额高于 0.1 元（含），则本基金在 15 个工作日之内进行收益分配。每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 50%。若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

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

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

### 四、收益分配方案

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

### 五、收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，在 2 个工作日内在指定媒体公告并报中国证监会备案。

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

## 六、基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足于支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额。红利再投资的计算方法，依照登记机构相关业务规则执行。

## 十三、 基金的费用与税收

### 一、基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、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 0.7%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.7\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，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、公休假等，支付日期顺延。

#### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，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、公休日等，支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类中第 3—8 项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

### 三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

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

#### **四、费用调整**

基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。降低基金管理费率和基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须依照《信息披露办法》的有关规定于新的费率实施前在指定媒体上刊登公告。

#### **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。

## 十四、 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；
- 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从业资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意。
- 3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所需在2个工作日内在指定媒体公告并报中国证监会备案。

## 十五、 基金的信息披露

一、本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《基金合同》及其他有关规定。

### 二、信息披露义务人

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

本基金信息披露义务人按照法律法规和中国证监会的规定披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的媒体和基金管理人、基金托管人的互联网网站（以下简称“网站”）等媒介披露，并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

三、本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

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

四、本基金公开披露的信息应采用中文文本。如同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证两种文本的内容一致。两种文本发生歧义的，以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

### 五、公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

#### （一）基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议

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

2、基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。《基金合同》生效后，基金管理人在每6个月结束之日起45日内，更新招募说明书并登载在网站上，将更新后的招募说明书摘要登载在指定媒体上；基金管理人在公告的15日前向主要办公场所所在地的中国证监会派出机构报送更新的招募说明书，并就有关更新内容提供书面说明。

本基金在招募说明书（更新）等文件中披露中小企业私募债券的投资情况。

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

基金募集申请经中国证监会核准后，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》摘要登载在指定媒体上；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体上。

#### （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体上登载《基金合同》生效公告。

#### （四）基金资产净值、基金份额净值

《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在每个工作日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露工作日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定媒体上。

#### （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份额发售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、基金半年度报告和基金季度报告

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媒体上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。

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

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

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

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

本基金在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露中小企业私募债券的投资情况。

### （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在 2 个工作日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地的中国证监会派出机构备案。

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

- 1、基金份额持有人大会的召开；
- 2、终止《基金合同》；
- 3、转换基金运作方式；
- 4、更换基金管理人、基金托管人；
- 5、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- 6、基金管理人股东及其出资比例发生变更；
- 7、基金募集期延长；
- 8、基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动；
- 9、基金管理人的董事在一年内变更超过百分之五十；
- 10、基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过百分之三十；
- 11、涉及基金管理人、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百分之零点五；
- 18、基金改聘会计师事务所；
- 19、变更基金销售机构；
- 20、更换基金登记机构；
- 21、本基金开始办理申购、赎回；
- 22、本基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；
- 23、本基金发生延缓支付；
- 24、本基金发生暂停接受申购、赎回申请；
- 25、本基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；
- 26、本基金投资中小企业私募债券后两个交易日内，在中国证监会指定媒体披露所投资中小企业私募债券的名称、数量、期限、收益率等信息；
- 27、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。

#### （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，应当依法报国务院证券监督管理机构核准或者备案，并予以公告。

#### （十）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，指定专人负责管理信息披露事务。

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

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告和定期更新的招募说明书等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人出具书面文件或者盖章确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定媒体中选择披露信息的报刊。

基金管理人、基金托管人除依法在指定媒体上披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒体披露信息，但是其他公共媒体不得早于指定媒体披露信息，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 15 年。

#### 七、信息披露文件的存放与查阅

招募说明书公布后，应当分别置备于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的住所，供公众查阅、复制。

基金定期报告公布后，应当分别置备于基金管理人和基金托管人的住所，以供公众查阅、复制。

## 十六、 风险揭示

本基金投资于债券市场，基金净值会因为债券市场波动等因素产生波动。基金投资中出现的风险分为如下三类，一是本基金特有的风险；二是国内债券市场风险，包括政策风险、利率风险等；三是开放式基金共有的风险，包括流动性风险、管理风险等。

### 一、本基金的特定风险

1、本基金的开放期包括自由开放期和受限开放期，投资者需在自由开放期提出申购赎回申请，在受限开放期提出赎回申请，在非开放期间将无法进行申购或赎回。

2、投资者在本基金的自由开放期内可自由申购或赎回基金份额，但在受限开放期内本基金仅确认不超过该受限开放期前一日基金份额总数的 10%（含 10%）的赎回申请。当赎回申请超过该比例时，本基金将对赎回申请进行比例确认，从而造成投资者可能面临因不能全额赎回基金而出现流动性风险。

3、开放期如果出现较大数额的净赎回申请，则使基金资产变现困难，基金可能面临一定的流动性风险，存在着基金份额净值波动的风险。

4、在本基金每次自由开放期届满，若出现基金份额持有人数量不满 200 人，或基金资产净值低于 5000 万元，或基金前 10 大份额持有人持有基金份额总数超过基金总份额 90% 的情况，基金管理人宣布基金合同终止并履行清算程序，存在着基金无法继续存续的风险。

5、在本基金自由开放期内，若单个开放日内的基金份额净赎回申请超过前一开放日的基金总份额的 20%，如果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，基金管理人应当接受并确认当日所有的赎回申请，当日按比例办理的赎回份额不得低于基金总份额的 20%，其余赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日。因此，投资人将面临其赎回款项被延缓支付的风险。

6、在本基金自由开放期内，若单个开放日内的基金份额净赎回申请超过前一开放日的基金总份额的 20%，如基金管理人无法在 20 个工作日内支付上述未支付部分的赎回款项，或基金管理人认为在变现过程中由于交易成本等因素明显损害其他基金份额持有人利益的情形，可不经基金份额持有人大会决议，由基金管理人和基金托管人协商一致，并报中国证监会备案后，《基金合同》终止，对于已确认未支付赎回款的交易与基金其他客户一并进行剩余财产的分配。因此，投资人面临合同终止的风险。

7、本基金主要投资于信用类的固定收益类品种，因此，本基金除承担由于市场利率波动造成的利率风险外还要承担如企业债、公司债等信用品种的发债主体信用恶化造成的信用风险。

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

企业采用非公开方式发行的债券。

由于不能公开交易，一般情况下，交易不活跃，潜在较大流动性风险。外部评级机构一般不对这类债券进行外部评级，可能也会降低市场对该类债券的认可度，从而影响该类债券的市场流动性。同时由于债券发行主体的资产规模较小、经营的波动性较大，且各类材料不公开发布，也大大提高了分析并跟踪发债主体信用基本面的难度。

当发债主体信用质量恶化时，受市场流动性所限，本基金可能无法卖出所持有的中小企业私募债，由此可能给基金净值带来更大的负面影响和损失。

9、本基金对特定投资群体设定了优惠费率。特定投资群体需在认购/申购前向基金管理人登记备案，并经基金管理人确认，否则不适用优惠认/申购费率。

## 二、债券市场风险

债券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响，导致基金收益水平变化，产生风险，主要包括：

1、政策风险。因国家宏观经济形势、货币政策和财政政策等发生变化，导致债券价格波动而产生风险。

2、利率风险。利率波动直接影响着债券的价格和收益率，从而影响基金的净值表现。利率波动可能导致债券基金跌破面值。在利率波动时，债券基金的净值波动一般会高于货币市场基金。

3、信用风险。主要是指债务人的违约风险，若债务人经营不善，资不抵债，债权人可能会损失掉大部分的投资，这主要体现在企业债中。

4、购买力风险。基金的利润将主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀的影响而导致购买力下降，从而使基金的实际收益下降。

5、债券收益率曲线变动风险。债券收益率曲线变动风险是指与收益率曲线非平行移动有关的风险，单一的久期指标并不能充分反映这一风险的存在。

6、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（即前面所提到的利率风险）互为消长。具体为当利率下降时，基金从投资的固定收益证券所得的利息收入进行再投资时，将获得较少的收益率。

7、债券回购风险。较高的债券正回购比例可能增加组合的流动性风险和利率风险。

8、经济周期风险。证券市场是国民经济的晴雨表，而经济运作具有周期性的特点。宏观经济运行状况将对证券市场的收益水平产生影响，从而产生风险。

## 三、开放式基金共有的风险

1、管理风险。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和对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平，造成

管理风险。

2、流动性风险。本基金的流动性需求主要集中在开放期，管理人有权接受投资者的赎回，基金管理人可采取各种有效管理措施，满足流动性的需求。但如果出现较大数额的赎回申请，则使基金资产变现困难，基金面临流动性风险。

### 3、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) 因业务快速发展而在制度建设、人员配备、内控制度建立等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) 不可抗力可能导致基金资产的损失，影响基金收益水平，从而带来风险；
- (7) 其他意外导致的风险。

## 十七、 基金合同的变更、终止和基金财产的清算

### 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。对于可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准生效后方可执行，自决议生效后两日内在指定媒体公告。

### 二、《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，经中国证监会核准后《基金合同》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、基金合同生效后，每个开放期届满时，若基金份额持有人数量不满 200 人，或基金资产净值低于 5000 万元，或基金前 10 大份额持有人持有基金份额总数超过基金总份额 90%，基金管理人与基金托管人协商一致后决定终止；

4、在本基金自由开放期内，若单个开放日内的基金份额净赎回申请超过前一开放日的基金总份额的 20%，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回、延缓支付或终止基金合同。如基金管理人无法在 20 个工作日内支付全部已确认的赎回款项，或基金管理人认为在变现过程中由于交易成本等因素明显损害其他基金份额持有人利益的情形，由基金管理人和基金托管人协商一致后决定终止；

5、《基金合同》约定的其他情形；

6、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### 三、基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

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

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

#### 4、基金财产清算程序：

- (1) 《基金合同》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) 对基金财产进行分配；

5、基金财产清算的期限为 6 个月。

#### 四、清算费用

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

#### 五、基金财产清算剩余资产的分配

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

#### 六、基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

#### 七、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 十八、 基金合同的内容摘要

### 一、基金合同当事人的权利、义务

#### （一）基金份额持有人的权利与义务

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

- （1）分享基金财产收益；
- （2）参与分配清算后的剩余基金财产；
- （3）依法申请赎回其持有的基金份额；
- （4）按照规定要求召开基金份额持有人大会；
- （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、基金销售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》；
- （2）了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自行承担投资风险；
- （3）关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；
- （4）缴纳基金认购、申购、赎回款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；
- （5）在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；
- （6）不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；
- （7）执行生效的基金份额持有人大会的决定；
- （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）基金管理人的权利与义务

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

- （1）依法募集基金；



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

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

(4) 销售基金份额;

(5) 召集基金份额持有人大会;

(6) 依据《基金合同》及有关法律的规定监督基金托管人, 如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律的规定, 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》及有关法律的规定决定基金收益的分配方案;

(11) 在《基金合同》约定的范围内, 拒绝或暂停受理申购与赎回申请;

(12) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利, 为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利;

(13) 在法律法规允许的前提下, 为基金的利益依法为基金进行融资、融券;

(14) 以基金管理人的名义, 代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为;

(15) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构;

(16) 在符合有关法律、法规的前提下, 制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换和非交易过户的业务规则, 在法律法规和本基金合同规定的范围内决定和调整基金的除调高管理费率 and 托管费率之外的相关费率结构和收费方式;

(17) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

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

(2) 办理基金备案手续;

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

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

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

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

(7) 依法接受基金托管人的监督；

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

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(10) 编制季度、半年度和年度基金报告；

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

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

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

(14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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

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

(17) 确保需要向基金投资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、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，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

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

(8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、赎回价格；

(9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

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

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

(12) 建立并保存基金份额持有人名册；

(13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

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

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

(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。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

### (一) 召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

(1) 终止《基金合同》；

(2) 更换基金管理人；

- (3) 更换基金托管人;
  - (4) 转换基金运作方式;
  - (5) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准, 但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外;
  - (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(法律法规和中国证监会另有规定的除外);
  - (9) 变更基金份额持有人大会程序;
  - (10) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会;
  - (11) 单独或合计持有本基金总份额 10%以上(含 10%) 基金份额的基金份额持有人(以基金管理人收到提议当日的基金份额计算, 下同)就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会;
  - (12) 对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项;
  - (13) 法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。
- 2、以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改, 不需召开基金份额持有人大会:
- (1) 调低基金管理费、基金托管费;
  - (2) 法律法规要求增加的基金费用的收取;
  - (3) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率;
  - (4) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改;
  - (5) 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生变化;
  - (6) 基金管理人、销售机构、登记机构在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则;
  - (7) 基金合同生效后, 每个开放期届满时, 若基金份额持有人数量不满 200 人, 或基金资产净值低于 5000 万元, 或基金前 10 大份额持有人持有基金份额总数超过基金总份额 90%, 基金管理人与基金托管人协商一致后决定终止;
  - (8) 在本基金自由开放期内, 若单个开放日内的基金份额净赎回申请超过前一开放日的基金总份额的 20%, 基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回、延缓支付或终止基金合同。如基金管理人无法在 20 个工作日内支付全部已确认的赎回款项, 或基金管理人认为在变现过程中由于交易成本等因素明显损害其他基金份额持有人利益的情形, 由基金管理人和基金托管人协商一致后决定终止;
  - (9) 法律法规和《基金合同》规定的范围内, 增设本基金的基金份额类别;
  - (10) 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以外的其他情

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。

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

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

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

## （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，在指定媒体公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

- （1）会议召开的时间、地点和会议形式；
- （2）会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；
- （3）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
- （4）授权委托证明的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；
- （5）会务常设联系人姓名及联系电话；

(6) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续;

(7) 召集人需要通知的其他事项。

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。

3、如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。

#### (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或通讯开会方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

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

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

(2) 经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的 50%（含 50%）。

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式在表决截至日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

(2) 召集人按基金合同约定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取书面表决意见的，不影响表决效力；

(3) 本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有

的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的 50%（含 50%）；

（4）上述第（3）项中直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并与基金登记机构记录相符；

（5）会议通知公布前报中国证监会备案。

## （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 50%以上（含 50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

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

#### （2）通讯开会

在通讯开会的情况下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后 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 50% 以上（含 50%）通过方为有效；除下列第 2 项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的 2/3 以上（含 2/3）通过方可做出。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

#### （七）计票

##### 1、现场开会

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

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

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

（4）计票过程应由公证机关予以公证，基金管理人或基金托管人拒不出席大会的，不影响计票的效力。

##### 2、通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对书面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 日内报中国证监会核准或者备案。

基金份额持有人大会的决议自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 个工作日内在指定媒体上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

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

（九）本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规的部分，如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

## 三、基金收益分配原则、执行方式

### （一）基金利润的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额，基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

### （二）基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

### （三）基金收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次。若本基金每个封闭期结束日（不含）之前的第 15 个工作日当日收市后每 10 份基金份额可分配利润金额高于 0.1 元（含），则本基金在 15 个工作日之内进行收益分配。每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 50%。若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

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

- 4、每一基金份额享有同等分配权；
- 5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### （四）收益分配方案

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

#### （五）收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，在2个工作日内在指定媒体公告并报中国证监会备案。

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

#### （六）基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额。红利再投资的计算方法，依照登记机构相关业务规则执行。

### 四、基金费用与税收

#### （一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、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0.7%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.7\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，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、公休假等，支付日期顺延。

## 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.2% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，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、公休日等，支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类中第 3—8 项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

### （三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

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

### （四）费用调整

基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。降低基金管理费率和基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须依照《信息披露办法》的有关规定于新的费率实施前在指定媒体上刊登公告。

### （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。

## 五、基金财产的投资范围和投资限制

## （一）投资范围

本基金主要投资于具有良好流动性的固定收益类金融工具，包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府机构债、地方政府债、资产支持证券、中小企业私募债券、可分离交易可转债中的债券部分、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。

本基金对固定收益类金融工具的投资比例合计不低于基金资产的 80%，其中对信用类固定收益金融工具的投资比例合计不低于基金固定收益类金融工具的 80%。在每个受限开放期的开始前 10 个工作日和结束后 10 个工作日，自由开放期的开始前 3 个月和结束后 3 个月，以及受限开放期和自由开放期内不受上述投资组合比例的限制。在自由开放期，本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，在运作周期内（包含受限开放期和封闭期），本基金不受上述 5% 的限制。本基金不直接从二级市场买入股票、权证、可转债等，也不参与一级市场的新股、可转债申购或增发新股。

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。

## （二）投资限制

### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金对固定收益类金融工具的投资比例合计不低于基金资产的 80%，其中对信用类固定收益金融工具的投资比例合计不低于基金固定收益类金融工具的 80%。在每个受限开放期的开始前 10 个工作日和结束后 10 个工作日，自由开放期的开始前 3 个月和结束后 3 个月，以及受限开放期和自由开放期内不受上述投资组合比例的限制；

（2）在自由开放期，本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，在运作周期内（包含受限开放期和封闭期），本基金不受上述 5% 的限制；

（3）本基金不直接从二级市场买入股票、权证、可转债等，也不参与一级市场的新股、可转债申购或增发新股；

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

（6）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

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

证券规模的 10%；

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

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

(10) 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%；

(11) 本基金持有单只中小企业私募债券，其市值不得超过该基金资产净值的 10%；

(12) 本基金投资中小企业私募债券的剩余期限，不得超过自投资之日起至本次运作周期结束之日的时时间长度；

(13) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价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。

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。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消上述限制，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。

## 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) 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) 向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；

(6) 买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、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) 依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

## 六、基金资产估值

### （一）估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券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、银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

### （三）估值方法

#### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

（1）交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

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

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

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

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

4、中小企业私募债采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

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。

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

双方协商解决。

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

#### （四）估值程序

1、基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到 0.001 元，小数点后第 4 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基金份额净值，并按规定公告。

2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或本基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

#### （五）估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后 3 位以内(含第 3 位)发生估值错误时，视为基金份额净值错误。

本基金合同的当事人应按照以下约定处理：

##### 1、估值错误类型

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

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

##### 2、估值错误处理原则

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

（2）估值错误的责任方对有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对



估值错误的有关直接当事人负责，不对第三方负责。

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

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

### 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

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

### 4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

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

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

(3) 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、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

### (七) 基金净值的确认

用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的基金资产净值和基金份额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。

## 七、基金合同变更、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。对于可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准生效后方可执行，自决议生效后两日内在指定媒体公告。

### （二）《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，经中国证监会核准后《基金合同》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、基金合同生效后，每个开放期届满时，若基金份额持有人数量不满 200 人，或基金资产净值低于 5000 万元，或基金前 10 大份额持有人持有基金份额总数超过基金总份额 90%，基金管理人与基金托管人协商一致后决定终止；

4、在本基金自由开放期内，若单个开放日内的基金份额净赎回申请超过前一开放日的基金总份额的 20%，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回、延缓支付或终止基金合同。如基金管理人无法在 20 个工作日内支付全部已确认的赎回款项，或基金管理人认为在变现过程中由于交易成本等因素明显损害其他基金份额持有人利益的情形，由基金管理人和基金托管人协商一致后决定终止；

5、《基金合同》约定的其他情形；

6、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### （三）基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

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

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

#### 4、基金财产清算程序：

- (1) 《基金合同》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) 对基金财产进行分配；

#### 5、基金财产清算的期限为 6 个月。

##### (四) 清算费用

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

##### (五) 基金财产清算剩余资产的分配

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

##### (六) 基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

##### (七) 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 八、争议的处理和适用的法律

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交仲裁或向人民法院起诉。任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。

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》受中国法律管辖。

### **九、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、代销机构的办公场所和营业场所查阅；投资者也可按工本费购买《基金合同》复制件或复印件，但内容应以《基金合同》正本为准。

## 十九、 基金托管协议的内容摘要

### 一、基金托管协议当事人

#### (一) 基金管理人

名称：南方基金管理有限公司

注册地址：深圳市福田区中心区福华一路六号免税商务大厦塔楼 31、32、33 层整层

办公地址：深圳市福田区中心区福华一路六号免税商务大厦塔楼 31、32、33 层整层

邮政编码：518048

法定代表人：吴万善

成立日期：1998 年 3 月 6 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字[1998]4 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：人民币 1.5 亿元

存续期间：持续经营

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、中国证监会许可的其他业务。

#### (二) 基金托管人

名称：中国农业银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座九层

邮政编码：100031

法定代表人：蒋超良

成立时间：2009 年 1 月 15 日

基金托管资格批准文号：中国证监会证监基字[1998]23 号

注册资本：32,479,411.7 万元人民币

存续期间：持续经营

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；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、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；结汇、售汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项；提供保管箱服务；代理资金清算；各类汇兑业务；代理政策性银行、外国政府和国际金融机构贷款业务；贷款承诺；组织或参加银团贷款；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇借款；发行、代理发行、买卖或代理买卖股票以外的外币有价证券；外币票据承兑和贴现；自营、代客外汇买卖；外币兑换；外汇担保；资信调查、咨询、见证业务；

企业、个人财务顾问服务；证券公司客户交易结算资金存管业务；证券投资基金托管业务；企业年金托管业务；产业投资基金托管业务；合格境外机构投资者境内证券投资托管业务；代理开放式基金业务；电话银行、手机银行、网上银行业务；金融衍生产品交易业务；经国务院银行业监督管理机构等监管部门批准的其他业务；保险兼业代理业务。

## 二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

（一）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种池和交易对手库，以便基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。

本基金主要投资于具有良好流动性的固定收益类金融工具，包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府机构债、地方政府债、资产支持证券、中小企业私募债券、可分离交易可转债中的债券部分、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。

本基金对固定收益类金融工具的投资比例合计不低于基金资产的 80%，其中对信用类固定收益金融工具的投资比例合计不低于基金固定收益类金融工具的 80%。在每个受限开放期的开始前 10 个工作日和结束后 10 个工作日，自由开放期的开始前 3 个月和结束后 3 个月，以及受限开放期和自由开放期内不受上述投资组合比例的限制。在自由开放期，本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，在运作周期内（包含受限开放期和封闭期），本基金不受上述 5% 的限制。本基金不直接从二级市场买入股票、权证、可转债等，也不参与一级市场的新股、可转债申购或增发新股。

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。

（二）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资、融券比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督：

（1）本基金对固定收益类金融工具的投资比例合计不低于基金资产的 80%，其中对信用类固定收益金融工具的投资比例合计不低于基金固定收益类金融工具的 80%。在每个受限开放期的开始前 10 个工作日和结束后 10 个工作日，自由开放期的开始前 3 个月和结束后 3 个月，以及受限开放期和自由开放期内不受上述投资组合比例的限制；

(2) 在自由开放期, 本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%, 在运作周期内 (包含受限开放期和封闭期), 本基金不受上述 5% 的限制;

(3) 本基金不直接从二级市场买入股票、权证、可转债等, 也不参与一级市场的新股、可转债申购或增发新股;

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

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

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

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

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

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

(10) 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%;

(11) 本基金持有单只中小企业私募债券, 其市值不得超过该基金资产净值的 10%;

(12) 本基金投资中小企业私募债券的剩余期限, 不得超过自投资之日起至本次运作周期结束之日的时长度;

(13) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价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。

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。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消上述限制, 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。

(三) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定, 对本协议第十五条第九项基金投资禁止行为进行监督。基金托管人通过事后监督方式对基金管理人基金投资禁止行为和关联交易进行监督。根据法律法规有关基金禁止从事关联交易的规定, 基金管理人和基金托管人相互提供与本机构有控股关系的股东、与本机构有其他重大利害关系的公司名单及有关关联方交易证券名单。基金管理人和基金托管人有责任确保关联交易名单的真实性、准

确性、完整性，并负责及时将更新后的名单发送给对方。

若基金托管人发现基金管理人与关联交易名单中列示的关联方进行法律法规禁止基金从事的关联交易时，基金托管人应及时提醒并协助基金管理人采取必要措施阻止该关联交易的发生，如基金托管人采取必要措施后仍无法阻止关联交易发生时，基金托管人有权向中国证监会报告。对于基金管理人已成交的关联交易，如基金托管人事前已严格遵循了监督流程仍无法阻止该关联交易的发生，而只能按相关法律法规和交易所规则进行事后结算，则基金托管人不承担由此造成的损失，并应向中国证监会报告。

（四）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供经慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手名单，并约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金托管人监督基金管理人是否按事前提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易。基金管理人可以每半年对银行间债券市场交易对手名单进行更新，如基金管理人根据市场情况需要临时调整银行间债券市场交易对手名单，应向基金托管人说明理由，在与交易对手发生交易前3个工作日内与基金托管人协商解决。基金管理人收到基金托管人书面确认后，被确认调整的名单开始生效，新名单生效前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。基金管理人负责对交易对手的资信控制，按银行间债券市场的交易规则进行交易，基金托管人则根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督，但不承担交易对手不履行合同造成的损失。如基金托管人事后发现基金管理人没有按照事先约定的交易对手或交易方式进行交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人，基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任。

（五）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、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。

如果基金管理人未经基金托管人的审核擅自将不实的业绩表现数据印制在宣传推介材料上，则基金托管人对此不承担任何责任，并将在发现后立即报告中国证监会。

（六）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资流通受限证券进行监督。

1、基金投资流通受限证券，应遵守《关于规范基金投资非公开发行证券行为的紧急通知》、《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。

2、流通受限证券，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重



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

3、在首次投资流通受限证券之前，基金管理人应当制定相关投资决策流程、风险控制制度、流动性风险控制预案等规章制度。基金管理人应当根据基金流动性的需要合理安排流通受限证券的投资比例，并在风险控制制度中明确具体比例，避免基金出现流动性风险。上述规章制度须经基金管理人董事会批准。上述规章制度经董事会通过之后，基金管理人应当将上述规章制度以及董事会批准上述规章制度的决议提交给基金托管人。

4. 在投资流通受限证券之前，基金管理人应至少提前一个交易日向基金托管人提供有关流通受限证券的相关信息，具体应当包括但不限于如下文件（如有）：

拟发行数量、定价依据、监管机构的批准证明文件复印件、基金管理人与承销商签订的销售协议复印件、缴款通知书、基金拟认购的数量、价格、总成本、划款账号、划款金额、划款时间文件等。基金管理人应保证上述信息的真实、完整。

5. 基金托管人在监督基金管理人投资流通受限证券的过程中，如认为因市场出现剧烈变化导致基金管理人的具体投资行为可能对基金财产造成较大风险，基金托管人有权要求基金管理人对该风险的消除或防范措施进行补充和整改，并做出书面说明。否则，基金托管人经事先书面告知基金管理人，有权拒绝执行其有关指令。因拒绝执行该指令造成基金财产损失的，基金托管人不承担任何责任，并有权报告中国证监会。

6. 基金管理人应保证基金投资的受限证券登记存管在本基金名下，并确保基金托管人能够正常查询。因基金管理人原因产生的受限证券登记存管问题，造成基金财产的损失或基金托管人无法安全保管基金财产的责任与损失，由基金管理人承担。

7. 如果基金管理人未按照本协议的约定向基金托管人报送相关数据或者报送了虚假的数据，导致基金托管人不能履行托管人职责的，基金管理人应依法承担相应法律后果。除基金托管人未能依据基金合同及本协议履行职责外，因投资流通受限证券产生的损失，基金托管人按照本协议履行监督职责后不承担上述损失。

（七）基金托管人发现基金管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作中违反法律法规和基金合同的规定，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函，就基金托管人的疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当立即通知基金管理人，并报告中国证监会。

(八)基金管理人负有义务配合和协助基金托管人依照法律法规、基金合同和本托管协议对基金业务执行核查。对基金托管人发出的书面提示,基金管理人应在规定时间内答复并改正,或就基金托管人的疑义进行解释或举证;对基金托管人按照法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项,基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

(九)基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为,应及时报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正,并将纠正结果报告中国证监会。基金管理人无正当理由,拒绝、阻挠对方根据本协议规定行使监督权,或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督,情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的,基金托管人应报告中国证监会。

### 三、基金管理人对基金托管人的业务核查

(一)基金管理人应对基金托管人履行托管职责情况进行核查,核查事项包括基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、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。

(二)基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、基金合同、本协议及其他有关规定时,应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正。基金托管人收到通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金管理人发出回函,说明违规原因及纠正期限,并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内,基金管理人有权随时对通知事项进行复查,督促基金托管人改正。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。

(三)基金管理人发现基金托管人有重大违规行为,应及时报告中国证监会,同时通知基金托管人限期纠正,并将纠正结果报告中国证监会。基金托管人无正当理由,拒绝、阻挠对方根据本协议规定行使监督权,或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督,情节严重或经基金管理人提出警告仍不改正的,基金管理人应报告中国证监会。

### 四、基金财产的保管

### （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。未经基金管理人依据合法程序作出的合法合规指令，基金托管人不得自行运用、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、基金托管人根据基金管理人的指令，按照基金合同和本协议的约定保管基金财产，如有特殊情况双方可另行协商解决。
- 6、对于因为基金投资产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金账户的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金财产造成损失的，基金托管人对此不承担任何责任。
- 7、除依据法律法规和基金合同的规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

### （二）基金募集期间及募集资金的验资

- 1、基金募集期间的资金应存于基金管理人在具有托管资格的商业银行开设的基金认购专户。该账户由基金管理人开立并管理。
- 2、基金募集期满或基金停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，基金管理人应将属于基金财产的全部资金划入基金托管人开立的基金托管资金账户，同时在规定时间内，聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的 2 名或 2 名以上中国注册会计师签字方为有效。
- 3、若基金募集期限届满，未能达到基金合同生效的条件，由基金管理人按规定办理退款等事宜，基金托管人应提供充分协助。

### （三）基金资金账户的开立和管理

- 1、基金托管人应负责本基金的资金账户的开设和管理。
- 2、基金托管人可以本基金的名义在其营业机构开设本基金的资金账户，并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。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，均需通过本基金的资金账户进行。
- 3、基金托管资金账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立任何其他银行账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。
- 4、基金托管资金账户的开立和管理应符合相关法律法规的有关规定。

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

#### （四）基金证券账户的开立和管理

1、基金托管人在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司为基金开立基金托管人与基金联名的证券账户。

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

3、基金托管人以自身法人名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户，并代表所托管的基金完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级法人清算工作，基金管理人应予以积极协助。结算备付金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、基金证券账户的开立和证券账户卡的保管由基金托管人负责，账户资产的管理和运用由基金管理人负责。

5、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，涉及相关账户的开设、使用的，按有关规定开设、使用并管理；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。

#### （五）债券托管专户的开设和管理

基金合同生效后，基金托管人根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司的有关规定，以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司开立债券托管与结算账户，并代表基金进行银行间市场债券的结算。基金管理人和基金托管人同时代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议。

#### （六）其他账户的开立和管理

1、因业务发展需要而开立的其他账户，可以根据法律法规和基金合同的规定，在基金管理人和基金托管人商议后由基金托管人负责开立。新账户按有关规则使用并管理。

2、法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

#### （七）基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的有关实物证券、银行定期存款存单等有价凭证由基金托管人负责妥善保管，保管凭证由基金托管人持有。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。托管人对托管人以外机构实际有效控制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由基金管理人、基金托管人保管。除协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时，应保证基金一方持有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。重大合同的保管期限为基金合同终止后 15 年。

### 五、基金资产净值计算和会计核算

#### （一）基金资产净值的计算及复核程序

##### 1、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的净资产值。

基金份额净值是指基金资产净值除以基金份额总数后得到的基金份额的资产净值。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，由此产生的误差计入基金财产。国家另有规定的，从其规定。

每工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

##### 2、复核程序

基金管理人每工作日对基金资产进行估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人依据基金合同和相关法律法规的规定对外公布。

#### （二）基金资产估值方法和特殊情形的处理

##### 1、估值对象

基金所拥有的债券、银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

##### 2、估值方法

###### （1）证券交易所上市的有价证券的估值

1) 交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

2) 交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最

近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

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

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

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

(4) 中小企业私募债采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(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。

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。以约定的方法、程序和相关法律法规的规定进行估值，以维护基金份额持有人的利益。

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

### 3、特殊情形的处理

基金管理人、基金托管人按(6)项进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

#### (三) 基金份额净值错误的处理方式

(1) 当基金份额净值小数点后3位以内(含第3位)发生差错时，视为基金份额净值错误；基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；错误偏差达到或超过基金资产净值的0.25%时，基金管理人应当及时通知基金托管人并报中国证监会；错误偏差达到基金份额净值的0.50%时，基金管理人应当公告、通报基金托管人并报中国证监会备案；当发生净值计算错误时，由基金管

理人负责处理，由此给基金份额持有人和基金造成损失的，应由基金管理人先行赔付，基金管理人按差错情形，有权向其他当事人追偿。

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

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

②若基金管理人计算的基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告，而且基金托管人未对计算过程提出疑义或要求基金管理人书面说明，基金份额净值出错且造成基金份额持有人损失的，应根据法律法规的规定对基金份额持有人或基金支付赔偿金，就实际向基金份额持有人或基金支付的赔偿金额，其中基金管理人承担 50%，基金托管人承担 50%。

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

④由于基金管理人提供的信息错误（包括但不限于基金申购或赎回金额等），基金托管人在履行正常复核程序后仍不能发现该错误，进而导致基金份额净值计算错误而引起的基金份额持有人和基金财产的损失，由基金管理人负责赔付。

(3) 由于证券交易所、登记结算公司发送的数据错误，有关会计制度变化或由于其他不可抗力原因，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而造成的基金份额净值计算错误，基金管理人、基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

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

(5) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。如果行业有通行做法，双方当事人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商。

#### (四) 暂停估值与公告基金份额净值的情形

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

### （五）基金会计制度

按国家有关部门规定的会计制度执行。

### （六）基金账册的建立

基金管理人进行基金会计核算并编制基金财务会计报告。基金管理人独立地设置、记录和保管本基金的全套账册。若基金管理人和基金托管人对会计处理方法存在分歧，应以基金管理人的处理方法为准。若当日核对不符，暂时无法查找到错账的原因而影响到基金资产净值的计算和公告的，以基金管理人的账册为准。

### （七）基金财务报表与报告的编制和复核

#### 1、财务报表的编制

基金管理人应当及时编制并对外提供真实、完整的基金财务会计报告。月度报表的编制，基金管理人应于每月终了后 5 个工作日内完成；招募说明书在基金合同生效后每 6 个月更新并公告一次，于该等期间届满后 45 日内公告。季度报告应在每个季度结束之日起 15 个工作日内编制完毕并予以公告；半年度报告在会计年度半年终了后 60 日内编制完毕并予以公告；年度报告在会计年度结束后 90 日内编制完毕并予以公告。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。

#### 2、报表复核

基金管理人在月度报表完成当日，将报表盖章后提供给基金托管人复核；基金托管人在收到后应在 3 日内进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在季度报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后 7 个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在半年度报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后 30 日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在年度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人应在收到后 45 日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人和基金托管人之间的上述文件往来均以加密传真的方式或双方商定的其他方式进行。

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



(八) 基金管理人应每季向基金托管人提供基金业绩比较基准的基础数据和编制结果。

## 六、基金份额持有人名册的登记与保管

本基金的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、基金权益登记日、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至少应包括持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册由登记机构编制,由基金管理人审核并提交基金托管人保管。基金托管人有权要求基金管理人提供任意一个交易日或全部交易日的基金份额持有人名册,基金管理人应及时提供,不得拖延或拒绝提供。

基金管理人应及时向基金托管人提交基金份额持有人名册。每年 6 月 30 日和 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。

基金管理人和基金托管人应妥善保管基金份额持有人名册,保存期限为 15 年。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

因本协议产生或与之相关的争议,双方当事人应通过协商、调解解决,协商、调解不能解决的,任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会,仲裁地点为北京市,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。仲裁裁决是终局的,对当事人均有约束力。

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

本协议适用中华人民共和国法律并从其解释。

## 八、托管协议的变更、终止与基金财产的清算

### (一) 托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致,可以对协议进行修改。修改后的新协议,其内容不得与基金合同的规定有任何冲突。基金托管协议的变更报中国证监会核准或备案后生效。

## （二）基金托管协议终止的情形

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

## （三）基金财产的清算

### 1、基金财产清算小组

(1)基金合同终止后，成立基金清算小组，基金清算小组在中国证监会的监督下进行基金清算。

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

(3)在基金财产清算过程中，基金管理人和基金托管人应各自履行职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和本托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

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

### 2、基金财产清算程序

- (1)基金合同终止时，由基金清算小组统一接管基金财产；
- (2)对基金财产进行清理和确认；
- (3)对基金财产进行估价和变现；
- (4)编制清算报告；
- (5)聘请会计师事务所对清算报告进行审计；
- (6)聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- (7)将基金清算结果报告中国证监会；
- (8)公布基金清算报告；
- (9)对基金剩余财产进行分配。

### 3、清算费用

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

### 4、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。

#### 5、基金财产清算的公告

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 个工作日内由基金清算小组公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算结果经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，由基金财产清算小组报中国证监会备案并公告。

#### 6、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 二十、 基金份额持有人服务

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，有权增加和修改相关服务项目。

### 一、基金份额持有人交易资料的寄送及发送服务

#### 1、交易确认单

每次交易结束后，投资者可在 T+2 个工作日后通过销售机构的网点查询或打印交易确认单。

#### 2、纸质对账单

每季度结束后 15 个工作日内，基金管理人向本季度有交易且有定制的投资者寄送对账单，资料（含姓名及地址等）不详的除外。投资者可通过基金管理人网站（[www.nffund.com](http://www.nffund.com)）、客服热线（400-889-8899 转人工）、[客服邮箱（service@nffund.com](mailto:service@nffund.com) 或 [service@southernfund.com](mailto:service@southernfund.com)）及在线客服等途径申请/取消对账单服务。

#### 3、电子对账单

基金管理人提供月度、季度、年度电子邮件对账单及月度、季度手机短信对账单服务，基金管理人将以电子邮件或手机短信形式向定制的投资者定期发送。投资者可通过基金管理人网站（[www.nffund.com](http://www.nffund.com)）、客服热线（400-889-8899 转人工）、[客服邮箱（service@nffund.com](mailto:service@nffund.com) 或 [service@southernfund.com](mailto:service@southernfund.com)）及在线客服等途径申请/取消对账单服务。

### 二、网上在线服务

（一）通过基金管理人网站（[www.nffund.com](http://www.nffund.com)），投资者可获得如下服务：

#### 1、查询服务

投资者通过基金账户号、身份证号等开户证件号码和查询密码登录基金管理人网站“账户查询”栏目，可享有基金交易查询、账户查询和基金信息查询服务。

#### 2、信息资讯服务

投资者可以利用基金管理人网站获取本基金和基金管理人的各类信息，包括基金的法律文件、基金公告、业绩报告和基金管理人最新动态等各类最新资料。

#### 3、网上交易服务

投资者可通过基金管理人网站“网上交易”系统办理本基金的开户、认购/申购、赎回及信息查询等业务。有关基金网上交易的具体业务规则请参见基金管理人网站相关公告。

#### 4、自助答疑服务

投资者可通过基金管理人网站“自助答疑”栏目，选定咨询问题的类型如账户类、交易

类、网上查询/交易、服务类、产品介绍、金融知识等并输入要咨询问题的关键词，便可自助进行相关问题的搜索及解答。

#### 5、网上人工服务

投资者可登录基金管理人网站通过“在线客服”获得投资顾问、业务咨询、信息查询、服务投诉及建议、信息定制、资料修改等专项服务。

#### 6、专用客户端下载

投资者可通过基金管理人网站下载专用客户端，如PC版、iPhone版、iPad版和Android版等，通过专用客户端获得基金净值查询、账户查询、理财资讯及相关客户服务。基金管理人网上直销客户还可通过专用客户端进行基金交易。

(二) 投资者通过手机上网，访问<https://wap.southernfund.com>可获得基金管理人最新的理财资讯，办理各项基金查询和基金交易业务。手机WAP交易具体规则请参见基金管理人网站相关公告。

### 三、信息定制服务

投资者可以通过基金管理人网站([www.nffund.com](http://www.nffund.com))、客户服务中心提交信息定制申请，基金管理人通过电子邮件或手机短信定期发送所定制的信息。可定制的内容如下：

- 1、电子邮件：基金份额净值、电子邮件对账单、基金周刊等。
- 2、手机短信：基金份额净值、手机短信对账单、理财专刊（彩信）等。

### 四、账户资料变更服务

为便于投资者及时得到基金管理人提供的各项服务，请投资者及时更新联系信息。投资者可通过以下5种方式进行联系信息（包括联系地址、手机号码、固定电话、电子邮箱等）的变更：

- 1、登录基金管理人网站“账户查询”或“网上交易”（仅限基金管理人网上直销投资者）系统自助修改联系信息。
- 2、致电基金管理人客户服务中心400-889-8899转人工修改。
- 3、发送邮件至基金管理人客服邮箱[service@nffund.com](mailto:service@nffund.com)或[service@southernfund.com](mailto:service@southernfund.com)提交修改申请。
- 4、通过基金管理人网站“在线客服”在线提交修改申请。
- 5、通过销售机构提交账户资料变更业务申请。

### 五、客户服务中心电话服务

投资者拨打基金管理人客服热线400-889-8899（国内免长途话费）可享有如下服务：

- 1、自助语音服务：提供7×24小时基金净值信息、账户交易情况、基金产品等自助查询

服务。

2、人工服务：提供每周七天，每日不少于8小时的人工服务（法定节假日除外）。投资者可以通过该热线获得投资顾问、业务咨询、信息查询、服务投诉及建议、信息定制、资料修改等专项服务。

3、电话交易服务：基金管理人网上直销投资者可通过基金管理人的电话交易系统办理开放式基金的认购、申购、交易撤单、交易密码修改、信息查询和投资者该直销账户下开放式基金的赎回、转换及分红方式变更等业务。有关基金电话交易的具体业务规则请参见基金管理人网站相关公告。

## **六、客户投诉及建议受理服务**

投资者可以通过基金管理人客户服务中心人工热线、在线客服、书信、电子邮件、短信、传真及各销售机构网点柜台等不同的渠道对基金管理人和销售网点所提供的服务进行投诉或提出建议。

## 二十一、 其他应披露事项

本基金暂无其他应披露事项。《基金合同》如有未尽事宜，由《基金合同》当事人各方按有关法律法规协商解决。

## 二十二、 招募说明书存放及其查阅方式

本招募说明书存放在本基金管理人、基金托管人、基金销售机构的办公场所，投资者可在办公时间免费查阅；也可按工本费购买本招募说明书复制件或复印件，但应以招募说明书正本为准。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。



## 二十三、 备查文件

- 1、中国证监会核准本基金成立的文件；
- 2、《南方稳利 1 年定期开放债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《南方稳利 1 年定期开放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；
- 7、《南方基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
- 8、中国证监会要求的其他文件。

（本页仅供南方稳利 1 年定期开放债券型证券投资基金招募说明书使用）

签订地：            市

签订日：            年    月    日