

东方红益丰纯债债券型证券投资基金  
招募说明书（更新）  
（2021年第1号）

基金管理人：上海东方证券资产管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

二〇二一年六月四日

## 【重要提示】

东方红益丰纯债债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）的募集申请经中国证监会2020年3月13日证监许可【2020】437号文准予注册。本基金的基金合同于2020年7月21日正式生效。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。

本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值和市场前景做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资有风险，投资人认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书、基金产品资料概要及基金合同等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，自行承担投资风险。投资者在获得基金投资收益的同时，亦承担基金投资中出现的各类风险，可能包括：证券市场整体环境引发的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、大量赎回、巨额赎回或暴跌导致的流动性风险、基金管理人在投资经营过程中产生的操作风险、本基金特有的风险等。基金管理人提醒投资者基金投资的“卖者尽责、买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

本基金是一只债券型基金，其预期风险与预期收益高于货币市场

基金，低于混合型基金和股票型基金。

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

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证投资于本基金一定盈利，也不保证最低收益。

本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等基金管理人无法予以控制的情形导致被动达到或超过50%的除外。法律法规另有规定的，从其规定。

本招募说明书所载内容截止至2021年5月20日，基金投资组合报告截止至2021年3月31日（财务数据未经审计）。

## 目 录

|                            |     |
|----------------------------|-----|
| 一、绪言.....                  | 4   |
| 二、释义.....                  | 5   |
| 三、基金管理人.....               | 10  |
| 四、基金托管人.....               | 20  |
| 五、相关服务机构.....              | 30  |
| 六、基金的募集.....               | 34  |
| 七、基金合同的生效.....             | 35  |
| 八、基金份额的申购与赎回.....          | 36  |
| 九、基金的投资.....               | 47  |
| 十、基金的业绩.....               | 57  |
| 十一、基金的财产.....              | 59  |
| 十二、基金资产估值.....             | 60  |
| 十三、基金的收益与分配.....           | 67  |
| 十四、基金的费用与税收.....           | 69  |
| 十五、基金的会计与审计.....           | 73  |
| 十六、基金的信息披露.....            | 74  |
| 十七、风险揭示.....               | 81  |
| 十八、基金合同的变更、终止与基金财产的清算..... | 89  |
| 十九、基金合同内容摘要.....           | 91  |
| 二十、托管协议的内容摘要.....          | 107 |
| 二十一、对基金份额持有人的服务.....       | 121 |
| 二十二、其他应披露事项.....           | 123 |
| 二十三、招募说明书的存放及查阅方式.....     | 125 |
| 二十四、备查文件.....              | 126 |

## 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》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）和其他有关法律法规的规定，以及《东方红益丰纯债债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

本招募说明书阐述了本基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资者投资决策有关的全部必要事项，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

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

本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本招募说明书由上海东方证券资产管理有限公司解释。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，或对本招募说明书做出任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写，并经中国证监会注册。基金合同是规定基金合同当事人之间权利义务关系的基本法律文件。招募说明书主要向投资者披露与本基金相关事项的信息，是投资者据以选择及决定是否投资于本基金的要约邀请文件。基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

## 二、释义

本招募说明书中除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

- 1、基金或本基金：指东方红益丰纯债债券型证券投资基金
- 2、基金管理人：指上海东方证券资产管理有限公司
- 3、基金托管人：指上海浦东发展银行股份有限公司
- 4、合同、基金合同、《基金合同》：指《东方红益丰纯债债券型证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效的修订和补充
- 5、托管协议：指基金管理人与基金托管人签订的《东方红益丰纯债债券型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
- 6、招募说明书、《招募说明书》：指《东方红益丰纯债债券型证券投资基金招募说明书》及其更新
- 7、基金产品资料概要：指《东方红益丰纯债债券型证券投资基金基金产品资料概要》及其更新
- 8、基金份额发售公告：指《东方红益丰纯债债券型证券投资基金基金份额发售公告》
- 9、法律法规：指中国现时有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等
- 10、《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，经 2012 年 12 月 28 日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自 2013 年 6 月 1 日起实施，并经 2015 年 4 月 24 日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修正的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 11、《销售办法》：指中国证监会 2013 年 3 月 15 日颁布、同年 6 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 12、《信息披露办法》：指中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

13、《运作办法》：指中国证监会 2014 年 7 月 7 日颁布、同年 8 月 8 日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

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

15、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

16、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行保险监督管理委员会

17、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

18、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

19、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

20、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的可投资于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

21、人民币合格境外机构投资者：指按照《人民币合格境外机构投资者境内证券投资试点办法》及相关法律法规规定，运用来自境外的人民币资金进行境内证券投资的境外法人

22、投资人、投资者：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

23、基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人

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

25、销售机构、代销机构：指基金管理人以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务

协议，办理基金销售业务的机构

26、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

27、基金登记机构、登记机构：指上海东方证券资产管理有限公司或其委托的符合条件的办理基金登记业务的机构，本基金的登记机构为中国证券登记结算有限责任公司

28、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

29、基金交易账户：指各销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构办理基金认购、申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务所引起的基金份额的变动及结余情况的账户

30、基金合同生效日：指基金募集达到法律规定及《基金合同》约定的条件，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

31、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

32、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

33、基金存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

34、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

35、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

36、T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日(不包含 T 日)

37、开放日：指销售机构为投资者办理本基金份额申购、赎回等业务的工作日

38、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

39、《业务规则》：指《中国证券登记结算有限责任公司开放式证券投资基金及证券公司集合资产管理计划份额登记及资金结算业务指南》以及其他适用于

## 证券投资基金的业务规则

40、认购：指在基金募集期内，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

41、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

42、赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为

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

44、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

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

46、巨额赎回：指本基金单个开放日，基金净赎回申请（赎回申请总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一工作日基金总份额的 10% 时的情形

47、元：指人民币元

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

49、基金资产总值：指基金所拥有的各类证券及票据价值、银行存款本息、基金应收申购款以及其他资产的价值总和

50、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

51、基金份额净值：指估值日基金资产净值除以估值日基金份额总数的数值

52、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

53、指定媒介：指中国证监会指定的用以进行信息披露的全国性报刊及指定互联网网站（包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露

网站)等媒介

54、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

55、货币市场工具：指现金；期限在一年以内（含一年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单；剩余期限在三百九十七天以内（含三百九十七天）的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券；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

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

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

58、不可抗力：指基金合同当事人不能预见、不能避免并不能克服，且在基金合同由基金托管人、基金管理人签署之日后发生的，使基金合同当事人无法全部履行或无法部分履行基金合同的任何事件，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律法规变化、突发停电或其他突发事件、证券、期货交易所非正常暂停或停止交易

## 三、基金管理人

### （一）基金管理人概况

本基金基金管理人为上海东方证券资产管理有限公司，基本信息如下：

名称：上海东方证券资产管理有限公司

住所：上海市黄浦区中山南路109号7层-11层

办公地址：上海市黄浦区外马路108号供销大厦7层-11层

法定代表人：宋雪枫

设立日期：2010年7月28日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监许可[2010]518号

开展公开募集证券投资基金管理业务批准文号：证监许可[2013]1131号

组织形式：有限责任公司

注册资本：3亿元人民币

存续期限：持续经营

联系电话：（021）53952888

联系人：彭轶君

股东情况：东方证券股份有限公司持有公司100%的股权。

公司前身是东方证券股份有限公司客户资产管理业务总部，2010年7月28日经中国证券监督管理委员会《关于核准东方证券股份有限公司设立证券资产管理子公司的批复》（证监许可[2010]518号）批准，由东方证券股份有限公司出资3亿元，在原东方证券股份有限公司客户资产管理业务总部的基础上正式成立，是国内首家获批设立的券商系资产管理公司。

### （二）主要人员情况

#### 1、基金管理人董事会成员

宋雪枫先生，董事长，中共党员，管理学博士。曾任申能股份有限公司投资部办事员，财务部办事员、主管、副经理、经理，总经理助理，总会计师，副总经理，监事长；上海外高桥第二发电有限责任公司财务总监、监事长；上海浦东发展银行股份有限公司监事；申能集团财务有限公司监事长；上海嘉禾航运有限公司董事长；中天合创能源有限责任公司监事长；申能（集团）有限公司总经理

助理；上海诚毅投资管理有限公司总经理、董事长；东方证券股份有限公司监事会主席；上海申能诚毅股权投资有限公司董事长。现任申能（集团）有限公司党委委员、副总经理，上海申能能源发展有限公司董事长，东方证券股份有限公司党委书记、执行董事，上海东方证券资产管理有限公司董事长。

任莉女士，总经理、公开募集基金管理业务负责人、财务负责人，社会学硕士、工商管理硕士。拥有十多年海内外市场营销经验，曾任东方证券股份有限公司资产管理业务总部副总经理，上海东方证券资产管理有限公司总经理助理、副总经理、联席总经理、董事会秘书。现任上海东方证券资产管理有限公司董事、总经理、公开募集基金管理业务负责人、财务负责人。

杨斌先生，董事，中共党员，经济学硕士。曾任中国人民银行上海分行非银行金融机构管理处科员，上海证管办稽查处、稽查局案件审理处副主任科员、主任科员，上海证监局稽查一处、机构二处主任科员、机构一处副处长、期货监管处处长、法制处处长，东方证券股份有限公司稽核总部总经理。现任东方证券股份有限公司副总裁兼首席风险官兼合规总监、合规法务管理总部总经理，上海东证期货有限公司董事、东方金融控股（香港）有限公司董事、东方证券承销保荐有限公司董事、长城基金管理有限公司监事。

杨洁琼女士，董事，中共党员，法学学士。曾任东方证券股份有限公司人力资源管理总部高级主管、总经理助理、副总经理、副总经理（主持工作）。现任东方证券股份有限公司人力资源管理总部总经理，上海东方证券资产管理有限公司董事，上海东证期货有限公司党委副书记。

尤文杰先生，董事，中共党员，经济学学士。曾任立信会计师事务所（特殊普通合伙）项目经理、高级经理、合伙人，东方证券股份有限公司计划财务管理总部副总经理、副总经理（主持工作）。现任东方证券股份有限公司计划财务管理总部总经理，上海东证期货有限公司董事、东方证券承销保荐有限公司董事、东方金融控股（香港）有限公司董事、上海东方证券资产管理有限公司董事。

## 2、基金管理人监事

朱静女士，监事，中共党员，经济学硕士。曾任西安矿山机械厂职员，上海财通国际投资管理有限公司证券管理部经理、副总经理，东方证券股份有限公司经纪业务总部职员、业务规划董事、运行资深主管、总经理助理，营运管理总部

总经理助理、副总经理，董事会办公室副主任。现任东方证券股份有限公司战略发展总部总经理兼东方金融控股（香港）有限公司总经理，上海东证期货有限公司董事，东方金融控股（香港）有限公司董事，东证国际金融集团有限公司董事，诚泰融资租赁（上海）有限公司监事会主席，长城基金管理有限公司董事，上海东方证券资产管理有限公司监事。

### 3、经营管理层人员

任莉女士，总经理（简历请参见上述关于董事的介绍）。

张锋先生，副总经理，硕士研究生。曾任上海财政证券公司研究员，兴业证券股份有限公司研究员，上海融昌资产管理有限公司研究员，信诚基金管理有限公司股票投资副总监、基金经理，上海东方证券资产管理有限公司基金投资部总监、私募权益投资部总经理、公募集合权益投资部总经理、执行董事、董事总经理。现任上海东方证券资产管理有限公司副总经理、首席投资官、投资决策委员会主席，兼任公募权益投资部总经理，基金经理兼任投资经理。

周代希先生，副总经理，中共党员，硕士研究生。曾任深圳证券交易所会员管理部经理、金融创新实验室高级经理、固定收益与衍生品工作小组执行经理，兼任深圳仲裁委员会仲裁员。现任上海东方证券资产管理有限公司副总经理。

刘峰先生，副总经理，中共党员，本科学士。曾任华福证券有限责任公司职员、兴业银行股份有限公司资产托管部职员、委托处副处长、委托处处长、总经理助理、副总经理。现任上海东方证券资产管理有限公司副总经理。

汤琳女士，副总经理，本科学士。曾任东方证券股份有限公司资产管理业务总部市场营销经理，上海东方证券资产管理有限公司综合管理部副总监、董事总经理。现任上海东方证券资产管理有限公司董事会秘书、副总经理，兼任综合管理部总经理。

### 4、合规总监、首席风险官

李云亮先生，合规总监兼首席风险官，中共党员，博士研究生。曾任重庆理工大学计算机学院大学讲师，重庆证监局机构监管处副调研员，西南证券股份有限公司证券资管部总经理，金鹰基金管理有限公司副总经理，深圳前海金鹰资产管理有限公司董事长，金鹰基金管理有限公司督察长。现任上海东方证券资产管理有限公司合规总监、公开募集基金管理业务合规负责人、兼任首席风险官、合

稽核部总经理及风险管理部总经理。

5、公开募集基金管理业务合规负责人（督察长）

李云亮先生，公开募集基金管理业务合规负责人（简历请参见上述关于合规总监、首席风险官的介绍）。

6、本基金基金经理

徐觅先生，上海东方证券资产管理有限公司公募固定收益投资部总经理助理、基金经理，2016年12月至今任东方红益鑫纯债债券型证券投资基金基金经理、2017年8月至今任东方红汇利债券型证券投资基金基金经理、2017年8月至今任东方红汇阳债券型证券投资基金基金经理、2017年9月至今任东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理、2017年9月至2020年5月任东方红货币市场基金基金经理、2018年3月至今任东方红目标优选三年定期开放混合型证券投资基金基金经理、2018年5月至今任东方红配置精选混合型证券投资基金基金经理、2018年10月至今任东方红核心优选一年定期开放混合型证券投资基金基金经理、2020年1月至今任东方红安鑫甄选一年持有期混合型证券投资基金基金经理、2020年7月至今任东方红益丰纯债债券型证券投资基金基金经理。复旦大学工商管理硕士。曾任长信基金管理有限责任公司基金事务部基金会计、交易管理部债券交易员，广发基金管理有限公司固定收益部债券交易员，富国基金管理有限公司固定收益部基金经理助理，上海东方证券资产管理有限公司私募固定收益投资部投资经理。

7、投资决策委员会成员

投资决策委员会成员构成如下：主任委员张锋先生、委员胡伟先生、胡雅丽女士、邓炯鹏先生、谭鹏万先生、侯振新先生。

8、上述人员之间不存在近亲属关系。

**（三）基金管理人的职责**

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

2、办理基金备案手续；

3、自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、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、除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

7、依法接受基金托管人的监督；

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

9、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

10、编制季度报告、中期报告和年度报告；

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

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

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

14、按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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

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

17、确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的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；但因第三方责任导致基金财产或基金份额持有人利益受到损失，而基金管理人首先承担了责任的情况下，基金管理人有权向第三方追偿；

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

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

25、执行生效的基金份额持有人大会的决议；

26、建立并保存基金份额持有人名册；

27、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

#### **（四）基金管理人关于遵守法律法规的承诺**

1、基金管理人承诺严格遵守《中华人民共和国证券法》、《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》等法律法规的相关规定，并建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止违法违规行为的发生；

2、基金管理人承诺严格遵守《基金法》、《运作办法》，建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止以下《基金法》、《运作办法》禁止的行为发生：

- （1）将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
- （2）不公平地对待管理的不同基金财产；
- （3）利用基金财产或者职务之便为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；
- （4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；

(5) 侵占、挪用基金财产；

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

(7) 玩忽职守，不按照规定履行职责；

(8) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。

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

(1) 越权或违规经营；

(2) 违反基金合同或托管协议；

(3) 故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益；

(4) 在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；

(5) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；

(6) 玩忽职守、滥用职权，不按照规定履行职责；

(7) 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，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

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

(9) 贬损同行，以提高自己；

(10) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；

(11) 以不正当手段谋求业务发展；

(12) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；

(13) 其他法律、行政法规和中国证监会规定禁止的行为。

#### **(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，基金财产不得用于下列投资或者活动：

1、承销证券；

2、违反规定向他人贷款或者提供担保；

3、从事承担无限责任的投资；

4、买卖其他基金份额，但是法律法规或中国证监会另有规定的除外；

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

如法律、行政法规或监管部门取消或调整上述禁止性规定，本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制或以调整后的规定为准。

#### **（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，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
- 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、内部控制的原则**

（1）健全性原则。内部控制应当包括基金管理人的各项业务、各个部门或机构和各级人员，并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个环节。

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

（3）独立性原则。基金管理人各机构、部门和岗位职责应当保持相对独立，基金管理人基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离。

##### **2、内部控制的组织架构**

基金管理人根据有关法律法规和章程的规定，建立了规范的治理机构和议事规则，明确了决策、执行、监督等方面的职责权限，形成了科学有效的职责分工和制衡机制。董事会、监事、经营管理层能够根据公司章程以及有关议事规则运行并行使职权。

基金管理人设董事会，对股东负责。董事会有5名董事组成，设董事长1人。董事会下设合规与风险管理委员会。基金管理人已制定董事会议事规则，规定了董事会会议的召开及表决程序和职责等。

基金管理人设监事一名。公司监事依照法律及章程的规定负责检查财务和合规管理；对董事、总经理及其他高级管理人员执行职务时违反法律、法规或者章程的行为进行监督；督促落实风险管理体系的建立和实施及相关事项的整改；并就涉及基金管理人风险的重大事项向股东汇报。

经营管理层负责组织实施董事会决议，主持基金管理人的经营管理工作，负责经营管理中风险管理工作的日常运行。负责董事会授权范围内重大经营项目和创新业务的风险评估和决策。基金管理人已制定《上海东方证券资产管理有限公司总经理工作会议议事规则》，对公司总经理办公会议的种类及程序做出了明确规定。经营管理层下设投资决策委员会、产品委员会、风险控制委员会、信息技术战略发展和治理委员会，并分别制定了相应的议事规则，对各项重大业务及投资进行决策与风险控制。

### 3、内部控制制度

内部控制制度指规范内部控制的一系列规章制度和业务规则，是内部控制的重要组成部分。内部控制制度制订的基本依据为法律法规、中国证监会及其他主管部门有关文件的规定。内部控制制度分为四个层次：

(1) 《公司章程》——指经股东批准的《公司章程》，是基金管理人制定各项基本管理制度和具体管理规章的指导性文件；

(2) 内部控制大纲——是对《公司章程》规定的内部控制原则的细化和展开，是各项基本管理制度的纲要和总揽；

(3) 公司基本管理制度——是基金管理人在经营管理宏观方面进行内部控制的制度依据。基本管理制度须经董事会审议并批准后实施。基本管理制度包括但不限于风险管理制度、投资管理制度、基金会计核算办法、信息披露办法、监察稽核制度、信息技术管理制度、业绩评估考核制度和危机处理制度等；

(4) 部门规章制度以及业务流程——部门规章制度以及业务流程是在公司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。它不仅是基金管理人的业务、管理、监督的需要，同时也是避免工作中主管随意性的有效手段。部门制度及具体管理规章根据总经理办公会的决定进行拟订、修改，经总经理办公会批准后实施的。制定的依据包括法律法规、证监会规定和《公司章程》及公司基本管理制度。

4、基金管理人关于内部控制的声明

(1) 本基金管理人承诺以上内部控制的披露真实、准确。

(2) 本基金管理人承诺将根据市场环境的变化及公司的发展不断完善内部控制制度。

(3) 本基金管理人承诺将积极配合外部风险监督工作。

## 四、基金托管人

### （一）基金托管人基本情况

#### 1、基金托管人概况

本基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司，基本信息如下：

名称：上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“上海浦东发展银行”）

注册地址：上海市中山东一路12号

办公地址：上海市中山东一路12号

法定代表人：郑杨

成立时间：1992年10月19日

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

组织形式： 股份有限公司

注册资本： 293.52亿元人民币

存续期间： 持续经营

基金托管资格批文及文号： 中国证监会证监基金字[2003]105号

联系人： 胡波

联系电话： （021）61618888

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

上海浦东发展银行总行于2003年设立基金托管部，2005年更名为资产托管

部，2013年更名为资产托管与养老金业务部，2016年进行组织架构优化调整，并更名为资产托管部，目前下设证券托管处、客户资产托管处、内控管理处、业务保障处、总行资产托管运营中心（含合肥分中心）五个职能处室。

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

## 2、主要人员情况

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

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

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

## 3、基金托管业务经营情况

截止 2021 年 3 月 31 日，上海浦东发展银行证券投资基金托管规模为 11233.54 亿元，比去年末增加 6.47%。托管证券投资基金共二百九十八支，分别为国泰金龙行业精选基金、国泰金龙债券基金、天治财富增长基金、广发小盘成长基金、汇添富货币基金、长信金利趋势基金、嘉实优质企业基金、国联安货币基金、长信利众债券基金（LOF）、博时安丰 18 个月基金（LOF）、易方达裕丰回报基金、鹏华丰泰定期开放基金、汇添富双利增强债券基金、华富恒财定开债券基金、汇添富和聚宝货币基金、工银目标收益一年定开债券基金、北信瑞丰宜投宝货币基金、中海医药健康产业基金、华富国泰民安灵活配置混合基金、安信动态策略灵活配置基金、东方红稳健精选基金、国联安鑫享混合基金、长安鑫利优选混合基金、工银瑞信生态环境基金、天弘新价值混合基金、嘉实机构快线货币基金、鹏华 REITs 封闭式基金、华富健康文娱基金、金鹰改革红利基金、易方达裕祥回报债券基金、中银瑞利灵活配置混合基金、华夏新活力混合基金、鑫元汇利债券型基金、南方转型驱动灵活配置基金、银华远景债券基金、富安达长盈灵活配置混合型基金、中信建投睿溢混合型证券投资基金、工银瑞信恒享纯债基金、长信利发债券基金、博时景发纯债基金、鑫元得利债券型基金、东方红战略沪港深混合基金、博时富发纯债基金、博时利发纯债基金、银河君信混合基金、兴业启元一年定开债券基金、工银瑞信瑞盈 18 个月定开债券基金、中信建投稳裕定开债券基金、招商招怡纯债债券基金、中加丰享纯债债券基金、银河君耀灵活配置混合基金、广发汇瑞 3 个月定期开放债券发起式证券投资基金、汇安嘉汇纯债债券基金、南方宣利定开债券基金、招商兴福灵活配置混合基金、博时鑫润灵活配置混合基金、兴业裕华债券基金、易方达瑞通灵活配置混合基金、招商招祥纯债债券基金、易方达瑞程混合基金、中欧骏泰货币基金、招商招华纯债债券基金、汇安丰融灵活配置混合基金、汇安嘉源纯债债券基金、国泰普益混合基金、汇添富鑫瑞债券基金、鑫元合丰纯债债券基金、博时鑫惠混合基金、国泰润利纯债基金、华富天益货币基金、汇安丰华混合基金、汇安沪深 300 指数增强型证券投资基金、汇安丰恒混合基金、景顺长城中证 500 指数基金、鹏华丰康债券基金、兴业安润货币基金、兴业瑞丰 6 个月定开债券基金、兴业裕丰债券基金、易方达瑞弘混合基金、长安鑫富领先混合基金、万家现金增利货币基金、上银慧增利货币市场基金、易方达瑞富灵活配置证券投资基金、博时富腾纯债债券型证券投资

基金、安信工业 4.0 主题沪港深精选混合基金、万家天添宝货币基金、中欧瑾泰债券型证券投资基金、中银证券安弘债券基金、鑫元鑫趋势灵活配置混合基金、泰康年年红纯债一年定期开放债券基金、广发高端制造股票型发起式基金、永赢永益债券基金、南方安福混合基金、中银证券聚瑞混合基金、太平改革红利精选灵活配置混合基金、富荣富乾债券型证券投资基金、国联安安稳灵活配置混合型证券投资基金、前海开源弘泽债券型发起式证券投资基金、前海开源弘丰债券型发起式证券投资基金、中海沪港深多策略灵活配置混合型基金、中银证券祥瑞混合型证券投资基金、前海开源盛鑫灵活配置混合型基金、鑫元行业轮动灵活配置混合型基金、兴业 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、富国颐利纯债债券型证券投资基金、华安安浦债券型证券投资基金、南方泽元债券型证券投资基金、鹏扬淳利定期开放债券型证券投资基金、万家鑫悦纯债债券型基金、新疆前海联合泳祺纯债债券型证券投资基金、永赢盈益债券型证券投资基金、中加颐合纯债债券型证券投资基金、中信保诚稳达债券型证券投资基金、中银中债 3-5 年期农发行债券指数证券投资基金、东方红核心优选一年定期开放混合型证券投资基金、平安惠锦纯债债券型证券投资基金、华夏鼎通债券型证券投资基金、鑫元全利债券型发起式证券投资基金、中融恒裕纯债债券型证券投资基金、嘉实致盈债券型证券投资基金、永赢消费主题灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信瑞福纯债债券型证券投资基金、东兴品牌精选灵活配置混合型证券投资基金、广发中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、融通通捷债券型证券投资基金、华富恒盛纯债债券型证券投资基金、建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金、汇安嘉鑫纯债债券型证券投资基金、国寿安保安丰纯债债券型证券投资基金、博时中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、银河家盈纯债债券型证券投资基金、博时富永纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、南方畅利定期开放债券型发起式证券投资基金、中加瑞利纯债债券型证券投资基金、华富中证 5 年恒定久期国开债指数型证券投资基金、永赢合益债券型证券投资基金、嘉实中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、广发港股通优质增长混合型证券投资基金、长安泓沅中短债债券型证券投资基金、中海信息产业精选混合型证券投资基金、民生加银恒裕债券型证券投资基金、国寿安保尊益信用纯债债券型证券投资基金、平安惠泰纯债债券型证券投资基金、中信建投景

和中短债债券型证券投资基金、工银瑞信添慧债券型证券投资基金、华富安鑫债券型证券投资基金、汇添富中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金、南方旭元债券型发起式证券投资基金、大成中债 3-5 年国开行债券指数基金、永赢众利债券型证券投资基金、华夏中债 3-5 年政策性金融债指数证券投资基金、中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金、新疆前海联合科技先锋混合型证券投资基金、银华尊尚稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、博时颐泽平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、农银养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、汇添富汇鑫浮动净值货币市场基金、泰康安欣纯债债券型证券投资基金、恒生前海港股通精选混合型证券投资基金、鹏华丰鑫债券型证券投资基金、中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金、汇添富保鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富安兴 39 个月定期开放债券型证券投资基金、中融睿享 86 个月定期开放债券型基金、南方梦元短债债券型证券投资基金、鹏扬淳开债券型证券投资基金、华宝宝惠纯债 39 个月定期开放债券型证券投资基金、建信 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金、农银汇理金益债券型证券投资基金、博时稳欣 39 个月定期开放债券型证券投资基金、同泰慧择混合型证券投资基金、招商中证红利交易型开放式指数证券投资基金、嘉实致禄 3 个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、永赢久利债券型证券投资基金、嘉实安元 39 个月定期开放纯债债券型证券投资基金、交银施罗德裕泰两年定期开放债券型证券投资基金、长城嘉鑫两年定期开放债券型证券投资基金、建信荣禧一年定期开放债券型证券投资基金、鹏扬浦利中短债债券型证券投资基金、平安惠合纯债债券型证券投资基金、工银瑞信深证 100 交易型开放式指数证券投资基金、鹏华 0-5 年利率债债券型发起式证券投资基金、景顺长城弘利 39 个月定期开放债券型证券投资基金、工银瑞信泰颐三年定期开放债券型证券投资基金、华安鑫浦 87 个月定期开放债券型证券投资基金、汇安嘉盛纯债债券型证券投资基金、东方红安鑫甄选一年持有期混合型证券投资基金、西藏东财中证通信技术主题指数型发起式证券投资基金、财通裕惠 63 个月定期开放债券型证券投资基金、南方尊利一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰中证全指家用电器交易型开放式指数证券投资基金、鹏华尊裕一年定期开放债券型发起式证券投资基金、鹏扬淳悦一年定期开放债券

型发起式证券投资基金、兴业鼎泰一年定期开放债券型发起式证券投资基金、安信丰泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金、国泰中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金、广发恒隆一年持有期混合型证券投资基金、安信中证信用主体 50 债券指数证券投资基金、国泰中证全指家用电器交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、海富通富泽混合型证券投资基金、华富中债-0-5 年中高等级信用债收益平衡指数证券投资基金、汇添富稳健增益一年持有期混合型证券投资基金、南方誉慧一年持有期混合型证券投资基金、农银汇理永乐 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）、鹏扬景恒六个月持有期混合型证券投资基金、平安合兴 1 年定期开放债券型发起式证券投资基金、融通中债 1-3 年国开行债券指数基金、太平中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、天弘永裕稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、中欧真益稳健一年持有期混合型证券投资基金、南华中证杭州湾区交易型开放式指数证券投资基金联接基金、金信核心竞争力灵活配置混合型证券投资基金、华泰紫金中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金、博时价值臻选两年持有期灵活配置混合型证券投资基金、东方红益丰纯债债券型证券投资基金、东方红鑫泰 66 个月定期开放债券型证券投资基金、东方红鼎元 3 个月定期开放混合型发起式证券投资基金、富国上海金交易型开放式证券投资基金、富国上海金交易型开放式证券投资基金联接基金、工银瑞信深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、广发汇浦三年定期开放债券型证券投资基金、国联安增泰一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、海富通惠增多策略一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、华安中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金、华宝中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、景顺长城安鑫回报一年持有期混合型证券投资基金、景顺长城电子信息产业股票型证券投资基金、景顺长城中债 3-5 年政策性金融债指数证券投资基金、民生加银瑞鑫一年定期开放债券型发起式证券投资基金、鹏华锦润 86 个月定期开放债券型证券投资基金、鹏华创新未来 18 个月封闭运作混合型证券投资基金、鹏扬淳安 66 个月定期开放债券型证券投资基金、融通通恒 63 个月定期开放债券型证券投资基金、上银聚远盈 42 个月定期开放债券型证券投资基金、新疆前海联合淳丰纯债 87 个月定期开放债券型证券投资基金、兴业稳泰 66 个月定期开放债券型证券

投资基金、兴业睿进混合型证券投资基金、易方达悦享一年持有期混合型基金、易方达创新未来 18 个月封闭运作混合型基金、银华汇益一年持有期混合型基金、永赢瑞宁 87 个月定期开放债券型证券投资基金、长信浦瑞 87 个月定期开放债券型证券投资基金、招商添盛 78 个月定期开放债券型证券投资基金、中信建投稳丰 63 个月定期开放债券型证券投资基金、中信保诚景裕中短债债券型证券投资基金、泰达宏利中证申万绩优策略指数增强型证券投资基金、泰达宏利乐盈 66 个月定期开放债券型证券投资基金、创金合信泰博 66 个月定期开放债券型证券投资基金、淳厚安裕 87 个月定期开放债券型证券投资基金、西部利得尊泰 86 个月定期开放债券型证券投资基金、西部利得聚禾灵活配置混合型基金、德邦锐泽 86 个月定期开放债券型证券投资基金、德邦惠利混合型证券投资基金、光大保德信尊合 87 个月定期开放债券型证券投资基金、蜂巢添禧 87 个月定期开放债券型证券投资基金、国金惠丰 39 个月定期开放债券型证券投资基金、九泰科新优享灵活配置混合型证券投资基金、华泰保兴久盈 63 个月定期开放债券型证券投资基金、博时恒旭一年持有期混合型基金、大成卓享一年持有期混合型基金、东方红明鉴优选两年定期开放混合型基金、广发研究精选股票型证券投资基金、恒生前海恒颐五年定期开放债券型基金、华夏创新未来 18 个月封闭运作混合型基金、汇添富创新未来 18 个月封闭运作混合型基金、汇添富高质量成长精选 2 年持有期混合型基金、嘉实浦惠 6 个月持有期混合型基金、农银养老目标日期 2045 五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、天弘睿新三个月定期开放混合型基金、鑫元乾利债券型证券投资基金、兴业研究精选混合型基金、中加瑞合纯债债券型证券投资基金、中欧创新未来 18 个月封闭运作混合型基金、中欧价值成长混合型基金、创金合信医药消费股票型证券投资基金、新华安享惠融 88 个月定期开放债券型证券投资基金、申万菱信安泰广利 63 个月定期开放债券型证券投资基金、汇丰晋信惠安 63 个月定期开放债券型证券投资基金、中邮纯债丰利债券型证券投资基金、兴银汇泽 87 个月定期开放债券型证券投资基金、东方红启航三年持有期混合型基金、东方红启瑞三年持有期混合型基金、博时创新经济混合型基金、富国融泰三个月定期开放混合型发起式证券投资基金、国泰中证动漫游戏交易型开放式指数证

券投资基金、汇添富健康生活一年持有期混合型证券投资基金、嘉实浦盈一年持有期混合型证券投资基金、景顺长城新能源产业股票型证券投资基金、农银汇理安瑞一年持有期混合型 FOF 基金、鹏华安裕 5 个月持有期混合型证券投资基金基金、银华稳健增长一年持有期混合型证券投资基金、招商添逸 1 年定期开放债券型发起式证券投资基金、中银顺泽回报一年持有期混合型证券投资基金、创金合信竞争优势混合型证券投资基金、兴全汇吉一年持有期混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证物联网主题交易型开放式指数证券投资基金等。

## （二）基金托管人的内部控制制度

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

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

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

具体内控措施包括：培育员工树立内控优先、制度先行、全员化风险控制的风险管理理念，营造浓厚的内控文化氛围，使风险意识贯穿到组织架构、业务岗位、人员的各个环节。制定权责清晰的业务授权管理制度、明确岗位职责和各项操作规程、员工职业道德规范、业务数据备份和保密等在内的各项业务管理制度；建立严格完善的资产隔离和资产保管制度，托管资产与托管人资产及不同托管资产之间实行独立运作、分别核算；对各类突发事件或故障，建立完备有效的应急预案，定期组织灾备演练，建立重大事项报告制度；在基金运作办公区域建立健

全安全监控系统，利用录音、录像等技术手段实现风险控制；定期对业务情况进行自查、内部稽核等措施进行监控，通过专项/全面审计等措施实施业务监控，排查风险隐患。

### 三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

#### 1、监督依据

托管人严格按照有关政策法规、以及基金合同、托管协议等进行监督。监督依据具体包括：

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

#### 2、监督内容

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

#### 3、监督方法

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

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

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

#### 4、监督结果的处理方式

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

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

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

## 五、相关服务机构

### （一）基金份额销售机构

#### 1、直销机构

##### （1）直销中心

名称：上海东方证券资产管理有限公司

住所：上海市黄浦区中山南路109号7层-11层

办公地址：上海市黄浦区外马路108号供销大厦8层

法定代表人：宋雪枫

联系电话：（021）33315895

传真：（021）63326381

联系人：于莉

公司网址：www.dfham.com

##### （2）网上交易系统

网上交易系统包括基金管理人公司网站（www.dfham.com）、东方红资产管理APP、基金管理人微信服务号和基金管理人指定且授权的电子交易平台，个人投资者可登录基金管理人网站（www.dfham.com）、东方红资产管理APP、基金管理人微信服务号和基金管理人指定且授权的电子交易平台，在与基金管理人达成网上交易的相关协议、接受基金管理人有关服务条款、了解有关基金网上交易的具体业务规则后，通过基金管理人网上交易系统办理开户、认购、申购、赎回等业务。

#### 2、代销机构

##### （1）东方证券股份有限公司

注册地址：上海市中山南路119号东方证券大厦

办公地址：上海市中山南路318号2号楼13层、21层—23层、25层—29层、32层、36层、39层、40层

法定代表人：金文忠

客服电话：（021）95503

公司网站: [www.dfzq.com.cn](http://www.dfzq.com.cn)

(2) 上海东证期货有限公司

注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区浦电路500号上海期货大厦14层

办公地址: 上海市黄浦区中山南路318号35层

法定代表人: 卢大印

客服电话: 400-885-9999

公司网站: [www.dzqh.com.cn](http://www.dzqh.com.cn)

(3) 上海天天基金销售有限公司

注册地址: 上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层

公司地址: 上海市徐汇区宛平南路88号东方财富大厦

法定代表人: 其实

客服电话: 95021

公司网站: <http://fund.eastmoney.com>

(4) 珠海盈米基金销售有限公司

注册地址: 珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491

办公地址: 广州市海珠区阅江中路688号保利国际广场北塔33层

法定代表人: 肖雯

客服电话: 020-89629066

公司网站: [www.yingmi.cn](http://www.yingmi.cn)

(5) 北京展恒基金销售股份有限公司

注册地址: 北京市朝阳区安苑路11号西楼6层604、607

办公地址: 北京朝阳区北四环中路27号院5号楼A座6层11室

法定代表人: 闫振杰

客服电话: 4008188000

公司网站: [www.myfund.com](http://www.myfund.com)

(6) 上海好买基金销售有限公司

注册地址: 上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号

办公地址: 上海市浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903-906室

法定代表人: 杨文斌

客服电话：4007009665

公司网站：www.ehowbuy.com

(7) 北京蛋卷基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区创远路34号院6号楼15层

办公地址：北京市朝阳区创远路34号院6号楼17层

法定代表人：钟斐斐

客服电话：4001599288

公司网站：www.danjuanapp.com

(8) 深圳众禄基金销售股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区笋岗街道梨园路8号HALO广场一期4层12-13室

办公地址：深圳市罗湖区笋岗街道梨园路8号HALO广场一期4层12-13室

法定代表人：薛峰

客服电话：4006788887

公司网站：www.zlfund.cn

(9) 京东肯特瑞基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区西三旗建材城中路12号17号平房157

办公地址：北京市亦庄经济开发区科创十一街18号院京东集团总部

法定代表人：李骏

客服电话：95118

公司网站：http://kenterui.jd.com

(10) 中国人寿保险股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街16号

法定代表人：王滨

客服电话：95519

公司网站：www.chinalife.com.cn

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并披露基金销售机构名录。

**(二) 登记机构**

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街17号

办公地址：北京市西城区太平桥大街17号

法定代表人：于文强

电话：010-50938600

传真：010-50938907

联系人：赵亦清

### **（三）出具法律意见书的律师事务所**

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心19层

办公地址：上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心19层

负责人：韩炯

电话：（021）31358666

传真：（021）31358600

联系人：陈颖华

经办律师：黎明、陈颖华

### **（四）审计基金财产的会计师事务所**

名称：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

注册地址：中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路1318号星展银行大厦507  
单元01室

办公地址：上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场二座普华永道中心11楼

执行事务合伙人：李丹

经办注册会计师：陈熹、叶尔甸

电话：021-23238888

传真：021-23238800

联系人：乐美昊

## 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》及其他有关规定募集，募集申请经中国证监会2020年3月13日证监许可【2020】437号文准予注册。

### （一）基金类型

债券型证券投资基金。

### （二）基金的运作方式

契约型开放式。

### （三）基金存续期限

不定期。

### （四）基金份额类别设置

在不违反法律法规、基金合同的约定以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，经与基金托管人就清算交收、核算估值、系统支持等方面协商一致，在履行适当程序后基金管理人可增加、减少或调整基金份额类别设置、对基金份额分类办法及规则进行调整并在调整实施之日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告，不需要召开基金份额持有人大会。

### （五）基金募集情况

募集期为2020年6月29日至2020年7月15日。经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）验资，按照每份基金份额面值人民币1.00元计算，募集期共募集601,453,413.59份基金份额（含利息转份额），有效认购户数为358户。

## 七、基金合同的生效

### （一）基金合同生效

根据有关规定，本基金满足《基金合同》生效条件，《基金合同》于2020年7月21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产规模

《基金合同》生效后，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续60个工作日出现前述情形的，基金管理人应当在10个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并在6个月内召开基金份额持有人大会进行表决。

法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

## 八、基金份额的申购与赎回

### （一）申购和赎回场所

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。具体的销售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，并在基金管理人网站公示。基金投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。

### （二）申购和赎回的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

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

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

#### 2、申购、赎回开始日及业务办理时间

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

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

在确定申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告申购与赎回的开始时间。本基金于2020年10月19日起开放日常申购、赎回等业务。

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

### （三）申购与赎回的原则

#### 1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额

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，即按照基金份额持有人份额登记日期的先后次序进行顺序赎回，以确定所适用的赎回费率；

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

基金管理人可在法律法规允许且对基金份额持有人无实质性不利影响的前提下，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按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

#### （四）申购与赎回的程序

##### 1、申购和赎回的申请方式

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

##### 2、申购和赎回的款项支付

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

基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；基金份额登记机构确认赎回时，赎回生效。投资者赎回申请生效后，基金管理人将在T+7日(包括该日)内支付赎回款项。遇证券、期货交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其它非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程时，赎回款项顺延至下一个工作日划出。在发生巨额赎回或基金合同载明的其他暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。

##### 3、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T日)，在正常情况下，本基金登记机构在T+1日内对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请，投资人应在T+2日后(包括该日)及时到销售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，否则，如因

申请未得到基金登记机构的确认而造成的损失，由投资者自行承担。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该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申购、赎回申请。申购、赎回的确认以基金登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资人应及时查询。

### **（五）申购和赎回的数额限制**

#### **1、申购金额的限制**

通过基金管理人直销中心、网上交易系统、各代销机构办理基金申购业务的，基金份额的申购最低金额为单笔10元人民币（含申购费）。实际操作中，对最低申购限额及交易级差以各销售机构的具体规定为准。投资者当期分配的基金收益转购基金份额时，不受最低申购金额的限制。基金管理人可根据市场情况，调整本基金首次申购的最低金额。

投资者可多次申购，对单个投资者的累计持有份额不设上限限制，但单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的50%（在基金运作过程中因基金份额赎回等基金管理人无法予以控制的情形导致被动达到或超过50%的除外）。法律法规另有规定的，从其规定。

2、基金份额持有人在销售机构赎回时，每次对本基金的赎回申请不得低于1份。本基金基金份额持有人每个交易账户的最低份额余额为1份。基金份额持有人因赎回、转换、跨系统转托管等原因导致其单个基金交易账户内剩余的基金份额低于1份时，登记系统可对该剩余的基金份额自动进行强制赎回处理。

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

4、基金管理人可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，基金管理人应依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

### **（六）基金的申购费和赎回费**

## 1、申购费率

本基金对通过基金管理人直销中心申购本基金的养老金客户与除此之外的其他投资者实施差别的申购费率。

养老金客户指基本养老基金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金，包括全国社会保障基金、可以投资基金的地方社会保障基金、企业年金单一计划以及集合计划、企业年金理事会委托的特定客户资产管理计划、企业年金养老金产品、个人税收递延型商业养老保险等产品、养老目标基金以及职业年金计划等。如将来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，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养老金客户范围。非养老金客户指除养老金客户外的其他投资者。

通过基金管理人直销中心申购本基金的养老金客户的申购费率如下：

| 申购金额（M）         | 费率        |
|-----------------|-----------|
| M<100 万元        | 0.20%     |
| 100 万元≤M<500 万元 | 0.16%     |
| M≥500 万元        | 每笔 1000 元 |

其他投资者申购本基金的申购费率如下：

| 申购金额（M）         | 费率        |
|-----------------|-----------|
| M<100 万元        | 0.50%     |
| 100 万元≤M<500 万元 | 0.40%     |
| M≥500 万元        | 每笔 1000 元 |

本基金的申购费用由基金投资人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用。投资者在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。

## 2、赎回费率

本基金赎回费率按基金份额持有时间递减。投资者在一天之内如果有多笔赎回，适用费率按单笔分别计算。具体如下：

| 份额持续持有时间（L） | 适用赎回费率 |
|-------------|--------|
| L<7 日       | 1.5%   |
| 7 日≤L<30 日  | 0.5%   |

|               |   |
|---------------|---|
| $L \geq 30$ 日 | 0 |
|---------------|---|

赎回费用由基金赎回人承担，赎回费用全部归基金财产。

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介上公告。

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且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下根据市场情况制定基金促销计划，针对投资人定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，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申购费率和赎回费率。

### （七）申购和赎回的数额和价格

#### 1、基金份额的申购份额计算：

基金的申购金额包括申购费用和净申购金额，其中：

申购费用适用比例费率时，申购份额的计算方法如下：

净申购金额=申购金额/（1+申购费率）

申购费用=申购金额-净申购金额

申购份额=净申购金额/申购当日基金份额净值

申购费用为固定金额时，申购份额的计算方法如下：

申购费用=固定金额

净申购金额=申购金额-申购费用

申购份额=净申购金额/申购当日基金份额净值

例一：某投资人（非养老金客户）投资40,000元申购本基金，申购费率为0.50%，假设申购当日基金份额净值为1.0400元，则其可得到的申购份额为：

净申购金额=40,000/（1+0.50%）=39,801.00元

申购费用=40,000-39,801.00=199.00元

申购份额=39,801.00/1.0400=38,270.19份

即：投资者（非养老金客户）投资40,000元申购本基金，假定申购当日基金份额净值为1.0400元，可得到38,270.19份基金份额。

#### 2、赎回金额的计算

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

赎回总金额=赎回份额×T日基金份额净值

赎回费用=赎回总金额×基金赎回费率

净赎回金额=赎回总金额-赎回费用

例二：某投资人赎回10,000份本基金份额，假设赎回当日基金份额净值是1.0160元，假设持有时间对应的赎回费率为0.5%，则其可得到的净赎回金额为：

赎回总金额=10,000×1.0160=10,160.00元

赎回费用 =10,160.00×0.5%=50.80元

净赎回金额 =10,160.00-50.80=10,109.20元

即：投资人赎回本基金10,000份基金份额，假设赎回当日基金份额净值是1.0160元，假设持有时间对应的赎回费率为0.5%，则其可得到的净赎回金额为10,109.20元。

3、本基金份额净值的计算，保留到小数点后4位，小数点后第5位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产享有或承担。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，经履行适当程序，可以适当延迟计算或公告。

4、申购份额的余额的处理方式：

申购的有效份额为净申购金额除以当日的基金份额净值，有效份额单位为份，申购份额按四舍五入方法，保留到小数点后2位，由此产生的收益或损失由基金财产享有或承担。

5、赎回金额的余额的处理方式：

赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后2位，由此产生的收益或损失由基金财产享有或承担。

6、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性，摆动定价机制的具体处理原则与操作规范遵循法律法规以及监管部门、自律组织的规定，具体见基金管理人届时的相关公告。

#### （八）申购和赎回的登记

投资者T日申购基金成功后，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）后有权赎回该部分基金份额。

投资者T日赎回基金成功后,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。

基金管理人可以在法律法规允许的范围内,依法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,并应在调整实施日前依照《信息披露办法》的有关规定,在指定媒介公告。

### (九) 拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时,基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请:

- 1、因不可抗力导致基金无法正常运作。
- 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时,基金管理人可暂停或拒绝接受投资人的申购申请。
- 3、证券、期货交易所交易时间非正常停市,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
- 4、接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。
- 5、基金资产规模过大,使基金管理人无法找到合适的投资品种,或其他可能对基金业绩产生负面影响,或发生其他损害现有基金份额持有人利益的情形。
- 6、当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时,经与基金托管人协商确认后,基金管理人应当暂停接受基金申购申请。
- 7、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%,或者变相规避50%集中度的情形时,基金管理人有权对该等申购申请进行部分确认或拒绝接受该等申购申请。
- 8、基金管理人、基金托管人、基金销售机构或登记机构因技术故障或异常情况导致基金销售系统或基金登记系统或基金会计系统无法正常运行。
- 9、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致超过基金管理人设定的基金总规模、单日净申购比例上限、单一投资人单日申购金额上限,基金管理人有权对该等申购申请进行部分确认或拒绝接受该等申购申请。
- 10、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述1、2、3、5、6、8、10项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人申购申请时,基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申

购公告。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的，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。

#### （十）暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

- 1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。
- 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。
- 3、证券、期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
- 4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。
- 5、发生继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时，基金管理人可暂停接受基金份额持有人的赎回申请。
- 6、当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请。
- 7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，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，未支付部分可延缓支付。若出现上述第4项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理，并依照有关规定在指定媒介上公告。

#### （十一）巨额赎回的情形及处理方式

##### 1、巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一工作日基金总份额的10%时，即认为是发生了巨额赎回。

## 2、巨额赎回的处理方式

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

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

(2) 部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一工作日基金总份额的10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

(3) 发生巨额赎回，且单个基金份额持有人赎回申请超过上一工作日基金总份额30%的情形下，对单个基金份额持有人超过上一工作日基金总份额30%以上的赎回申请，基金管理人可以延期办理赎回。对单个基金份额持有人30%以内（含30%）的赎回申请按普通基金份额持有人（即其他赎回申请未超过上一工作日基金总份额30%以上的基金份额持有人）赎回程序（包括巨额赎回）办理，对该单个基金份额持有人超过30%的赎回申请进行延期办理。对于未能赎回部分，该基金份额持有人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回，如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。

(4) 暂停赎回：连续2个开放日以上(含本数)发生巨额赎回，如基金管理人

认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过20个工作日，并应当在指定媒介上进行公告。

### 3、巨额赎回的公告

当发生上述巨额赎回并采取相关措施时，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，并在两日内在指定媒介上刊登公告。

## （十二）暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

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

2、基金管理人应于恢复开放申购或赎回日前，在指定媒介上刊登基金恢复开放申购或赎回公告，并公布最近1个工作日基金份额净值。

## （十三）基金转换

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

## （十四）基金的非交易过户

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

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

## （十五）基金的转托管

基金份额持有人可办理已持有基金份额在不同销售机构之间的转托管，基金

销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。

#### **（十六）定期定额投资计划**

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

#### **（十七）基金份额的冻结与解冻**

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的其他情况下的冻结与解冻。

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

#### **（十八）基金份额的转让**

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

## 九、基金的投资

### (一) 投资目标

本基金在严格控制投资风险的基础上,追求稳定的当期收益和基金资产的稳健增值。

### (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、地方政府债、政府支持机构债、金融债、企业债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、公司债、资产支持证券、证券公司发行的短期公司债券、分离交易可转债的纯债部分、债券逆回购、同业存单、银行存款、货币市场工具等固定收益类资产、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会相关规定。

本基金不得买入股票,也不参与新股申购和新股增发。可转债仅投资可分离交易可转债的纯债部分。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人履行适当程序后,可以将其纳入投资范围,其投资比例遵循届时有效法律法规或相关规定。

基金的投资组合比例为:本基金投资于债券的比例不低于基金资产的80%;每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%,前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

### (三) 投资策略

#### 1、资产配置策略

本基金为纯债券型基金,本基金不得买入股票,也不参与新股申购和新股增发,可转债仅投资可分离交易可转债的纯债部分。

本基金将采用自上而下的方法,在充分研究基本宏观经济形势以及微观市场主体的基础上,对市场基本利率、债券类产品收益率、货币类产品收益率等大类产品收益率水平变化进行评估,并结合各类别资产的波动性以及流动性状况分

析，针对不同行业、不同投资品种选择投资策略，以此做出最佳的资产配置及风险控制。

## 2、利率类投资策略

本基金对国内外经济运行趋势进行分析和预测，利用量化方法深入分析和预测国债、央行票据等利率投资品种的收益和风险，把握产品组合的平均久期，选择合适的期限结构的配置策略，具体策略如下：

### （1）久期调整策略

基于对宏观经济运行情况的深入研究，预期市场利率的变化趋势，并结合基金未来现金流情况，确定债券组合平均剩余期限。如果预测未来市场利率上升，则可通过缩短组合平均剩余期限的办法规避利率风险；反之，如果预测未来市场利率下降，则通过延长组合平均剩余期限，获得超额回报。

### （2）收益率曲线策略

通过预测收益率曲线的形状和变化趋势，对债券组合进行久期配置，主要包括子弹策略、两极策略和梯式策略。其中子弹策略可使投资组合中债券久期集中于收益率曲线的一点，适用于收益率曲线较陡时；两极策略可使投资组合中债券的久期集中在收益率曲线的两端，适用于收益率曲线两头下降较中间下降更多的蝶式变动；梯式策略可使投资组合中债券的久期均匀分布，适用于收益率曲线水平移动的情况。

### （3）骑乘策略

通过跟踪收益率曲线，分析收益率曲线各期限段的利差情况，买入收益率曲线最陡峭处所对应的期限债券，随着债券剩余期限的缩短，到期收益率将迅速下降，进而获得较高的资本利得收益。

## 3、信用投资策略

相对央票、国债等利率产品，信用债券的信用利差是获取较高投资收益的来源，而信用利差主要受两个方面的影响：市场信用利差曲线的走势与信用债本身的信用变化。因而分别采用以下策略：

### （1）基于信用利差曲线变化的投资策略

一是分析经济周期和相关市场变化对信用利差曲线的影响，二是分析信用债市场容量、信用债、流动性等变化趋势对信用利差曲线的影响。

## （2）基于信用债本身信用变化的投资策略

发行人信用发生变化后，将采用变化后债券信用级别所对应的信用利差曲线对公司债、企业债定价。影响信用债信用风险的因素主要包括行业风险、公司风险、现金流风险、资产负债风险和其他风险等五个方面。通过内部评级系统分析信用债的相对信用水平、违约风险及理论信用利差，发掘相对价值被低估的信用债券，以确定债券组合的类属配置和个券配置。

## 4、互换策略

不同券种在利息、违约风险、久期、流动性、税收和衍生条款等方面存在差别，基金管理人可以根据对债券的相对价值判断，选择合适的交易时机，同时买入卖出，赚取收益级差。

主要包括：价值置换，即判断未来利差曲线走势，在期限相近下买入利差较高的债券；新老券置换，即在相同收益率下买入近期发行的债券；流动性置换，即在相同收益率下买入流动性更好的债券；信用的置换，即在相同外部信用级别和收益率下，买入内部信用评级更高的债券；市场间利差互换，即在公司信用债和国家信用债之间，如果预期信用利差扩大，则用国家信用债替换公司信用债；反之，则用公司信用债替换国家信用债。

## 5、资产支持证券投资策略

随着备案制的推出，资产支持证券市场的供给会越来越丰富，但当前国内资产支持证券市场仍以信贷资产证券化产品为主，仍处于初级阶段。因而对于资产支持证券的投资关键在于对基础资产质量及未来现金流的分析，评估个券价值和投资风险，把握市场交易机会，选择相对价值较高的资产支持证券进行选择并分散投资，以降低流动性风险，获得稳定收益。

## 6、国债期货投资策略

本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为目的，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

## 7、证券公司短期公司债券投资策略

本基金证券公司短期公司债券的投资策略主要从分析证券行业整体情况、证券公司基本面情况入手，包括整个证券行业的发展现状，发展趋势，具体证券公

司的经营情况、资产负债情况、现金流情况，从而分析证券公司短期公司债券的违约风险及合理的利差水平，对证券公司短期公司债券进行独立、客观的价值评估。

#### （四）投资限制

##### 1、投资组合限制

本基金的投资组合将遵循以下限制：

（1）本基金投资债券的比例不低于基金资产的80%；

（2）本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

（3）本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的10%；

（4）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的10%，完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金品种可以不受此条款规定的比例限制；

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

（6）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的20%；

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

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

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

（10）本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的15%；

（11）本基金在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的30%；

(12) 本基金参与国债期货时, 本基金所持有的债券(不含到期日在一年以内的政府债券) 市值和买入、卖出国债期货合约价值, 合计(轧差计算) 应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定;

(13) 本基金在任何交易日内交易(不包括平仓) 的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的30%;

(14) 本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的140%;

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

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

(17) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除(2)、(9)、(15)、(16)条外, 因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的, 基金管理人应当在10个交易日内进行调整, 但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的, 从其规定。

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

法律法规或监管部门取消或调整上述限制, 如适用于本基金, 基金管理人在履行适当程序后, 则本基金投资不再受相关限制或按照调整后的规定执行, 基金管理人及时根据《信息披露办法》规定在指定媒介公告。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益, 基金财产不得用于下列投资或者活动:

- (1) 承销证券;
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保;
- (3) 从事承担无限责任的投资;

- (4) 买卖其他基金份额，但法律法规或中国证监会另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- (6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

如法律、行政法规或监管部门取消或调整上述禁止性规定，本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制或以调整后的规定为准。

### 3、关联交易原则

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

### (五) 业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：中债综合指数收益率\*80%+同期中国人民银行公布的一年期银行定期存款税后收益率\*20%。

中债综合指数由中央国债登记结算有限责任公司编制，其样本范围涵盖银行间市场和交易所市场，成份债券包括国家债券、企业债券、央行票据等所有主要债券种类，具有广泛的市场代表性，能够反应中国债券市场的总体走势。

本基金为纯债基金，投资于债券的比例不低于基金资产的80%，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，采用80%作为业绩比较基准中债券投资所代表的权重，20%作为同期中国人民银行公布的一年期银行定期存款税后收益率的权重，可以较好的体现本基金的投资目标和风险收益特征。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金业绩基准时，本基金可以变更业绩比较基准，但应与基金托管人协商一致，在履行适当程序后报中国证监会备案，并在中国证监会指定的媒介上及时公告，无需召开基金份额持有人大会。

## （六）风险收益特征

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

## （七）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、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；

2、有利于基金资产的安全与增值；

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

## （八）基金投资组合报告

以下投资组合报告数据截至2021年3月31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              | —              | —            |
|    | 其中：股票             | —              | —            |
| 2  | 基金投资              | —              | —            |
| 3  | 固定收益投资            | 368,504,800.00 | 98.59        |
|    | 其中：债券             | 368,504,800.00 | 98.59        |
|    | 资产支持证券            | —              | —            |
| 4  | 贵金属投资             | —              | —            |
| 5  | 金融衍生品投资           | —              | —            |
| 6  | 买入返售金融资产          | —              | —            |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | —              | —            |
| 7  | 银行存款和结算备付金合计      | 3,553,771.11   | 0.95         |
| 8  | 其他资产              | 1,706,223.06   | 0.46         |
| 9  | 合计                | 373,764,794.17 | 100.00       |

### 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

#### （1）报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金不参与股票投资。

#### （2）报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金不参与股票投资。

### 3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资

细

本基金不参与股票投资。

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      | 168,864,800.00 | 45.20        |
| 2  | 央行票据      | —              | —            |
| 3  | 金融债券      | 199,640,000.00 | 53.44        |
|    | 其中：政策性金融债 | 199,640,000.00 | 53.44        |
| 4  | 企业债券      | —              | —            |
| 5  | 企业短期融资券   | —              | —            |
| 6  | 中期票据      | —              | —            |
| 7  | 可转债（可交换债） | —              | —            |
| 8  | 同业存单      | —              | —            |
| 9  | 其他        | —              | —            |
| 10 | 合计        | 368,504,800.00 | 98.65        |

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明

细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称     | 数量（张）     | 公允价值（元）        | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 210201 | 21 国开 01 | 2,000,000 | 199,640,000.00 | 53.44        |
| 2  | 019649 | 21 国债 01 | 1,690,000 | 168,864,800.00 | 45.20        |

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

（1）本期国债期货投资政策

本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为目的，

结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

(2) 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末进行国债期货投资。

(3) 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末进行国债期货投资。

10、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是否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

本基金持有 21 国开 01（代码：210201YH）的发行主体国家开发银行因为违规的政府购买服务项目提供融资、项目资本金管理不到位，棚改贷款项目存在资本金违规抽回情况等 24 项违法违规行，于 2020 年 12 月 25 日被中国银保监会处罚款 4880 万元；因违规开展外汇交易、违反银行交易记录管理规定，于 2020 年 11 月 10 日被国家外汇管理局北京外汇管理部分别处以 60 万元罚款。

本基金对上述证券的投资决策程序符合基金合同及公司制度的相关规定，本基金管理人会对上述证券继续保持跟踪研究。

本基金持有的前十名证券中其余证券的发行主体本期未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) 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金不参与股票投资。

(3) 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）        |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | 44,474.19    |
| 2  | 应收证券清算款 | —            |
| 3  | 应收股利    | —            |
| 4  | 应收利息    | 1,661,748.87 |
| 5  | 应收申购款   | —            |
| 6  | 其他应收款   | —            |
| 7  | 待摊费用    | —            |
| 8  | 其他      | —            |
| 9  | 合计      | 1,706,223.06 |

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金不参与股票投资。

(6) 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## 十、基金的业绩

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

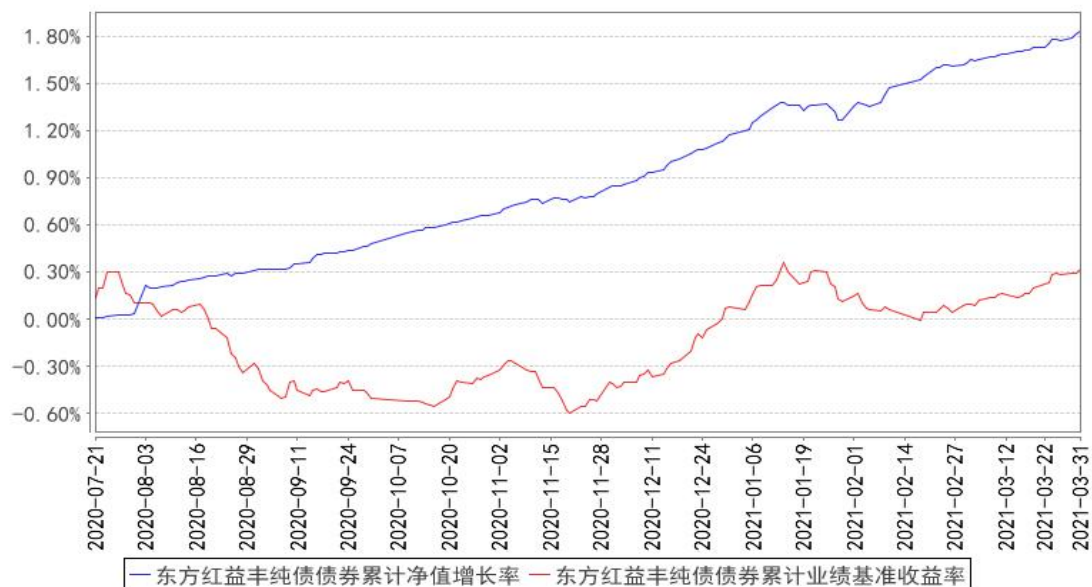
以下基金业绩数据截至2021年3月31日。

1、东方红益丰纯债债券型证券投资基金基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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    |
|------------------------|--------|-----------|------------|---------------|-------|--------|
| 2020年7月21日至2020年12月31日 | 1.17%  | 0.02%     | 0.08%      | 0.04%         | 1.09% | -0.02% |
| 2020年7月21日至2021年3月31日  | 1.83%  | 0.02%     | 0.32%      | 0.04%         | 1.51% | -0.02% |

2、自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

东方红益丰纯债债券累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：（1）基金合同于2020年7月21日生效，自合同生效日起至本报告期末不满一年。

（2）本基金建仓期6个月，即从2020年7月21日起至2021年1月20日，建仓期

结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

## 十一、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、期货结算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。

## 十二、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、国债期货、资产支持证券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产和负债。

### （三）估值原则

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

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

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

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

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

#### （四）估值方法

以下估值方法中所指的固定收益品种，是指在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所及中国证监会认可的其他交易场所上市交易或挂牌转让的国债、中央银行债、政策性银行债、短期融资券、中期票据、企业债、公司债、商业银行金融债、可转换债券、证券公司短期债、资产支持证券、同业存单等债券品种。

##### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

（1）交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；交易所上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价进行估值；

（2）交易所上市实行全价交易的债券（可转债除外），选取第三方估值机构提供的估值全价减去估值全价中所含的债券（税后）应收利息得到的净价进行估值；

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

（4）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、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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、对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种，回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。对银行间市场未上市，且第三方估值机构

未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异，未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。

4、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

5、对于只在上交所固定收益平台或者深交所综合协议平台交易的债券，按估值技术估值，估值技术无法确定时，按成本估值。国家有最新规定的，按其规定进行估值。

6、国债期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

#### 7、存款的估值方法

持有的银行定期存款或通知存款以本金列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入。

#### 8、汇率

本基金外币资产价值计算中，涉及外币对人民币汇率的，应当以基金估值日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价为准。

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

10、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性，并需履行相关信息披露义务。

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

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

根据《基金法》，基金管理人计算基金资产净值，基金托管人复核、审查基金管理人计算的基金资产净值。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净值信息的计算结果对外予以公布。

### （五）估值程序

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

基金管理人于每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

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

### （六）估值错误的处理

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

基金合同的当事人应按照以下约定处理：

#### 1、估值错误类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或登记机构、或销售机构、或投资人自身的原因造成估值错误，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的当事人（“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。

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。

(5) 估值错误责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人原因造成基金资产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人原因造成基金资产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。除基金管理人和托管人之外的第三方造成基金资产的损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错责任方追偿。

(6) 如果出现估值错误的当事人未按规定对受损方进行赔偿，并且依据法律、行政法规、《基金合同》或其他规定，基金管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任，则基金管理人有权向出现过错的当事人进行追索，并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失。

(7) 按法律法规规定的其他原则处理估值错误。

### 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的交易数据的，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并报中国证监会备案。

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

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

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

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

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

(4) 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。如果行业另有通行做法，基金管理人和基金托管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处理。

### **(七) 暂停估值的情形**

- 1、基金投资所涉及的证券、期货交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；
- 3、当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停估值；
- 4、法律法规规定、中国证监会或《基金合同》认定的其他情形。

### **(八) 基金净值的确认**

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

### **(九) 特殊情形的处理**

- 1、基金管理人、基金托管人按估值方法的第9项进行估值时，所造成的误差不得作为基金资产估值错误处理；
- 2、由于证券、期货交易所及其登记结算公司等第三方机构发送的数据错误，或由于其他不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

## 十三、基金的收益与分配

### （一）基金利润的构成

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

### （二）基金可供分配利润

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

### （三）基金收益分配原则

本基金收益分配应遵循下列原则：

- 1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准；
- 2、本基金的每份基金份额享有同等分配权；
- 3、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按除权日的基金份额净值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；
- 4、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；
- 5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

### （四）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截至基金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日内在指定媒介公告。

### （六）基金收益分配中发生的费用

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。



## 十四、基金的费用与税收

### （一）与基金运作有关的费用

#### 1、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、仲裁费和诉讼费；
- （5）基金份额持有人大会费用；
- （6）基金的证券、期货交易费用；
- （7）基金的银行汇划费用；
- （8）证券、期货账户开户费和账户维护费；
- （9）按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

#### 2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

##### （1）基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.30%的年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式，于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，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0.05%的年费率计提。托管费的计

算方法如下：

$$H=E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

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，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式，于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述基金费用的种类中第3—9项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

## （二）与基金销售有关的费用

### 1、申购费率

本基金对通过基金管理人直销中心申购本基金的养老金客户与除此之外的其他投资者实施差别的申购费率。

养老金客户指基本养老基金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金，包括全国社会保障基金、可以投资基金的地方社会保障基金、企业年金单一计划以及集合计划、企业年金理事会委托的特定客户资产管理计划、企业年金养老金产品、个人税收递延型商业养老保险等产品、养老目标基金以及职业年金计划等。如将来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，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养老金客户范围。非养老金客户指除养老金客户外的其他投资者。

通过基金管理人直销中心申购本基金的养老金客户的申购费率如下：

| 申购金额（M）         | 费率        |
|-----------------|-----------|
| M<100 万元        | 0.20%     |
| 100 万元≤M<500 万元 | 0.16%     |
| M≥500 万元        | 每笔 1000 元 |

其他投资者申购本基金的申购费率如下：

| 申购金额（M）  | 费率    |
|----------|-------|
| M<100 万元 | 0.50% |

|                        |           |
|------------------------|-----------|
| 100 万元 $\leq$ M<500 万元 | 0.40%     |
| M $\geq$ 500 万元        | 每笔 1000 元 |

本基金的申购费用由基金投资人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用。投资者在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。

## 2、赎回费率

本基金赎回费率按基金份额持有时间递减。投资者在一天之内如果有多笔赎回，适用费率按单笔分别计算。具体如下：

| 份额持续持有时间（L）       | 适用赎回费率 |
|-------------------|--------|
| L<7 日             | 1.5%   |
| 7 日 $\leq$ L<30 日 | 0.5%   |
| L $\geq$ 30 日     | 0      |

赎回费用由基金赎回人承担，赎回费用全部归基金财产。

4、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介上公告。

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且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下根据市场情况制定基金促销计划，针对投资人定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，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申购费率和赎回费率。

## （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，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用；

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协商一致后，可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率。

调高基金管理费率、基金托管费率，须召开基金份额持有人大会审议；调低基金管理费率、基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人调整管理费、托管费，需于调整实施前书面告知基金托管人。

基金管理人必须于新的费率实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

#### **（五）基金税收**

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

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

## 十五、基金的会计与审计

### （一）基金会计政策

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

### （二）基金的年度审计

- 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的具有证券、期货相关业务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日内在指定媒介公告。

## 十六、基金的信息披露

（一）本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《流动性风险管理规定》、《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、法人和非法人组织。

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

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

### （三）本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

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

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

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

### （五）公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

# 1、基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议、基金产品资料概要

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

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

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

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

基金募集申请经中国证监会准予注册后，基金管理人在基金份额发售的3日前，将基金份额发售公告、基金招募说明书提示性公告、《基金合同》提示性公告登载在指定报刊上，将基金份额发售公告、基金招募说明书、基金产品资料概要、《基金合同》和基金托管协议登载在指定网站上，并将基金产品资料概要登载在基金销售机构网站或营业网点；基金托管人应当同时将《基金合同》、基金托管协议登载在指定网站上。

# 2、基金份额发售公告

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

# 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介上登载《基金合同》生效公告。

#### 4、基金开始申购、赎回公告

在确定申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应依照《信息披露办法》的有关规定于申购开始日、赎回开始日前在指定媒介上公告。

#### 5、基金净值信息

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

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

基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在指定网站披露半年度和年度最后一日的基金份额净值和基金份额累计净值。

#### 6、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，并保证基金投资者能够在基金销售机构网站或营业网点查阅或者复制前述信息资料。

#### 7、基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告（合称“基金定期报告”）

基金管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载于指定网站上，并将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计。

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

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

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

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

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

## 8、临时报告与公告

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在2日内编制临时报告书，并登载在指定报刊和指定网站上。

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

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

(12) 基金管理人及其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人及其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；

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

(14) 基金收益分配事项；

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

(16) 基金份额净值估值错误达基金份额净值0.5%；

(17) 本基金开始办理申购、赎回；

(18) 本基金发生巨额赎回并延期办理；

(19) 本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；

(20) 本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；

(21) 调整基金份额类别设置；

(22) 发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；

(23) 基金管理人采用摆动定价机制；

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

## 9、澄清公告

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

## 10、基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

## 11、基金投资国债期货的信息披露

基金管理人应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书

（更新）等文件中披露国债期货交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示国债期货交易对本基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标。

#### 12、基金投资资产支持证券的信息披露

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

#### 13、证券公司发行的短期公司债券的信息披露

基金管理人应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露证券公司发行的短期公司债券的投资情况。

#### 14、中国证监会规定的其他信息。

### （六）信息披露事务管理

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

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

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

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

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

为基金信息披露义务人公开披露的基金信息出具审计报告、法律意见书的专

业机构，应当制作工作底稿，并将相关档案至少保存到《基金合同》终止后10年。

**（七）信息披露文件的存放与查阅**

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

**（八）当出现下述情况时，可暂停或延迟披露基金相关信息：**

- 1、不可抗力；
- 2、发生暂停估值的情形；
- 3、法律法规、基金合同或中国证监会规定的情况。

## 十七、风险揭示

证券投资基金（以下简称“基金”）是一种长期投资工具，其主要功能是分散投资，降低投资单一证券所带来的个别风险。基金不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具，投资者购买基金，既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益，也可能承担基金投资所带来的损失。

本基金是一只债券型基金，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于股票型基金和混合型基金。

投资人应当认真阅读本基金《基金合同》、《招募说明书》、基金产品资料概要等信息披露文件，了解本基金的风险收益特征，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断本基金是否和投资人的风险承受能力相适应，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。

基金管理人提醒投资人在作出投资决策后，须了解并自行承担以下风险：

### （一）东方红益丰纯债债券型证券投资基金的主要风险

本基金面临包括但不限于以下风险：

#### 1、市场风险

市场风险是指投资品种的价格因受经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素影响而引起的波动，导致收益水平变化，产生风险。市场风险主要包括：

##### （1）政策风险

货币政策、财政政策、产业政策和证券市场监管政策等国家政策的变化对证券市场产生一定的影响，可能导致证券价格波动，从而影响收益。

##### （2）经济周期风险

证券市场受宏观经济运行的影响，而经济运行具有周期性的特点，而周期性的经济运行表现将对证券市场的收益水平产生影响，从而对本基金的收益产生影响。

##### （3）利率风险

利率风险是指由于利率变动而导致的证券价格和证券利息的损益。利率波动会直接影响企业的融资成本和利润水平，导致证券市场的价格和收益率的变动，

使基金收益水平随之发生变化，从而产生风险。

#### （4）公司经营风险

公司的经营状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务因素等都会导致公司盈利发生变化，从而导致基金投资收益变化。

#### （5）衍生品风险

金融衍生产品具有杠杆效应且价格波动剧烈，会放大收益或损失，在某些情况下甚至会导致投资亏损高于初始投资金额。

#### （6）购买力风险

投资者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，从而使投资者的实际收益下降。

### 2、管理风险

在基金运作过程中，基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的获取和对经济形势、金融市场价格走势的判断，如基金管理人判断有误、获取信息不全、或对投资工具使用不当等影响基金的收益水平，从而产生风险。

### 3、本基金的主要流动性风险及管理方法

#### （1）基金申购、赎回安排

本基金的申购、赎回安排详见本招募说明书“八、基金份额的申购与赎回”章节。

#### （2）拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

本基金拟投资的市场包括银行间和交易所的债券市场等，从投资品种来看，本基金的大部分投资标的都是在证券交易所上市的有价证券，或是在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，这些标的往往存在公开交易市场、具有活跃的交易特性、估值政策清晰，因此，从投资标的的挑选上，流动性有一定的保障。

#### （3）巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

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

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

正常赎回程序执行。

2) 部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一工作日基金总份额的10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

3) 发生巨额赎回，且单个基金份额持有人赎回申请超过上一工作日基金总份额30%的情形下，对单个基金份额持有人超过上一工作日基金总份额30%以上的赎回申请，基金管理人可以延期办理赎回。对单个基金份额持有人30%以内（含30%）的赎回申请按普通基金份额持有人（即其他赎回申请未超过上一工作日基金总份额30%以上的基金份额持有人）赎回程序（包括巨额赎回）办理，对该单个基金份额持有人超过30%的赎回申请进行延期办理。对于未能赎回部分，该基金份额持有人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回，如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。

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

(4) 实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响  
基金管理人经与基金托管人协商一致，在确保投资者得到公平对待的前提

下，可依照法律法规及基金合同的约定，综合运用各类流动性风险管理工具，包括但不限于：

#### 1) 延期办理巨额赎回申请

投资者请参见基金合同“第六部分 基金份额的申购与赎回”中“九、巨额赎回的情形及处理方式”，详细了解本基金延期办理巨额赎回申请的情形及程序。

在此情形下，本基金可能无法及时满足基金份额持有人的所有赎回申请，延期办理巨额赎回部分对应的赎回款项有可能晚于预期时间到达基金份额持有人。

#### 2) 暂停接受赎回申请

投资者请参见基金合同“第六部分 基金份额的申购与赎回”中“八、暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形”，详细了解本基金暂停接受赎回申请的情形及程序。

在此情形下，基金份额持有人的部分或全部赎回申请可能被拒绝，本基金恢复接受赎回申请时的基金份额净值可能与基金份额持有人最初提交赎回申请时的基金份额净值不同。

#### 3) 延缓支付赎回款项

投资者请参见基金合同“第六部分 基金份额的申购与赎回”中“八、暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形”，详细了解本基金延缓支付赎回款项的情形及程序。

在此情形下，基金份额持有人在申请赎回后可能存在不能及时获得全部赎回款项的风险。

#### 4) 收取短期赎回费

本基金对持续持有期少于7日的投资者收取不低于1.5%的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产。赎回费在基金份额持有人赎回基金份额时收取。

在此情形下，基金份额持有人可能会被收取更多的赎回费。

#### 5) 暂停基金估值

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

在此情形下，由于没有可供参考的基金份额净值，基金份额持有人的申购申请及赎回申请可能会被延期办理。

#### 6) 摆动定价

当本基金发生大额申购或赎回情形时，本基金管理人可以采用摆动定价机制，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，以确保基金估值的公平性。

在此情形下，当日参与申购和赎回交易的基金份额持有人可能存在承担申购或者赎回产生的交易及其他成本的风险。

#### 7) 中国证监会认定的其他措施。

### 4、信用风险

基金在交易过程中发生交收违约，或者基金所投资债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，或由于债券发行人信用质量恶化导致债券价格下降，造成基金资产损失的风险。

### 5、技术风险

在基金的日常交易中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致基金投资者的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理人、基金托管人、证券交易所、证券登记结算机构等。

### 6、操作风险

基金管理人、基金托管人、证券、期货交易所、证券、期货登记结算机构等在业务操作过程中，因操作失误或违反操作规程而引起的风险。

### 7、本基金参与债券回购的风险

债券回购为提升整体基金组合收益提供了可能，但也存在一定的风险。债券回购的主要风险包括信用风险、投资风险及波动性加大的风险，其中，信用风险指回购交易中交易对手在回购到期时，不能偿还全部或部分证券或价款，造成基金净值损失的风险；投资风险是指在进行回购操作时，回购利率大于债券投资收益而导致的风险以及由于回购操作导致投资总量放大，致使整个组合风险放大的风险；而波动性加大的风险是指在进行回购操作时，在对基金组合收益进行放大的同时，也对基金组合的波动性（标准差）进行了放大，即基金组合的风险将会加大。回购比例越高，风险暴露程度也就越高，对基金净值造成损失的可能性也

就越大。

#### 8、参与国债期货的风险

(1) 杠杆性风险。国债期货交易采用保证金交易方式，潜在损失可能成倍放大，具有杠杆性风险。

(2) 到期日风险。国债期货合约到期时，如本基金仍持有未平仓合约，交易所将按照交割结算价将本基金持有的合约进行现金交割，本基金存在无法继续持有到期合约的可能，具有到期日风险。国债期货合约采取实物交割方式，如本基金未能在规定期限内如数交付可交割国债或者未能在规定期限内如数缴纳交割贷款，将构成交割违约，交易所将收取相应的惩罚性违约金。

(3) 强制平仓风险。如本基金参与交割不符合交易所或者期货公司相关业务规定，期货公司有权不接受本基金的交割申请或对本基金的未平仓合约强行平仓，由此产生的费用和结果将由基金承担。

(4) 使用国债期货对冲市场风险的过程中，基金财产可能因为国债期货合约与合约标的价格波动不一致而面临期现基差风险。在需要将国债期货合约展期时，合约平仓时的价格与下一个新合约开仓时的价格之差也存在不确定性，面临跨期基差风险。

#### 9、参与资产支持证券的投资风险

(1) 与基础资产相关的风险有信用风险、现金流预测风险和原始权益人的风险等。

1) 信用风险是指被购买的基础资产的信用风险将全部从原始权益人处最终转移至资产支持证券持有人，如果借款人的履约意愿下降或履约能力恶化，将可能给资产支持证券持有人带来投资损失。

2) 现金流预测风险是指，对基础资产未来现金流的预测可能会出现一定程度的偏差，优先级资产支持证券持有人可能面临现金流预测偏差导致的资产支持证券投资风险。

3) 原始权益人的风险，如果原始权益人转让的标的资产项下的债权存在权利瑕疵或转让资产行为不真实，将会导致资产支持证券持有人产生损失。

(2) 与资产支持证券相关的风险有市场利率风险、流动性风险、评级风险、提前偿付及延期偿付风险等。

1) 市场利率将随宏观经济环境的变化而波动, 利率波动可能会影响优先级收益。当市场利率上升时, 资产支持证券的相对收益水平就会降低。

2) 流动性风险指资产支持证券持有人可能面临无法在合理的时间内以公允价格出售资产支持证券而遭受损失的风险。

3) 评级机构对资产支持证券的评级不是购买、出售或持有资产支持证券的建议, 而仅是对资产支持证券预期收益和/或本金偿付的可能性作出的判断, 不能保证资产支持证券的评级将一直保持在该等级, 评级机构可能会根据未来具体情况撤销资产支持证券的评级或降低资产支持证券的评级。评级机构撤销或降低资产支持证券的评级可能对资产支持证券的价值带来负面影响。

4) 提前偿付及延期偿付风险指, 资产支持证券持有人可能在各档资产支持证券预期到期日之前或之后获得本金及收益偿付, 导致实际投资期限短于或长于资产支持证券预期期限。

#### 10、本基金特有投资策略带来的风险

本基金为债券型基金, 债券的投资比例不低于基金资产的80%, 该类债券的特定风险即为本基金及投资者主要面对的特定投资风险。债券的投资收益会受到宏观经济、政府产业政策、货币政策、市场需求变化、行业波动等因素的影响, 同时若债券发行主体信用状况恶化、发债主体或债券信用评级下降, 可能导致发债主体不能按时或全额支付本金和利息, 或者债券价格下降, 从而给基金资产带来损失。

#### 11、参与证券公司短期公司债券的投资风险

本基金投资证券公司短期公司债券, 由于证券公司短期公司债券为非公开发行和交易, 且限制投资者数量上限, 潜在流动性风险相对较大。若发行主体信用质量恶化或投资者大量赎回需要变现资产时, 受流动性所限, 本基金可能无法卖出所持有的证券公司短期公司债券, 从而可能给基金净值带来损失。

12、本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险

本基金法律文件投资章节有关风险收益特征的表述是基于投资范围、投资比例、证券市场普遍规律等做出的概述性描述, 代表了一般市场情况下本基金的长期风险收益特征。销售机构(包括基金管理人直销机构和其他销售机构)根据相关

法律法规对本基金进行风险评价，不同的销售机构采用的评价方法也不同，因此销售机构的风险等级评价与基金法律文件中风险收益特征的表述可能存在不同，投资人在购买本基金时需按照销售机构的要求完成风险承受能力与产品风险之间的匹配检验。

### 13、其他风险

（1）战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致基金资产的损失，从而带来风险。

（2）基金管理人因停业、解散、撤销、破产，或者被中国证监会撤销相关业务许可等原因不能履行职责，可能导致基金资产的损失，从而带来风险。

### （二）声明

1、本基金未经任何一级政府、机构及部门担保。投资者自愿投资于本基金，须自行承担投资风险。

2、本基金通过代销机构代理销售，但是，基金并不是代销机构的存款或负债，也没有经代销机构担保或者背书，代销机构并不能保证其收益或本金安全。

## 十八、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### （一）《基金合同》的变更

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

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，基金管理人应在决议生效后2日内在指定媒介公告。

### （二）《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：

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

### （三）基金财产的清算

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

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

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

4、基金财产清算程序：

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

(3) 对基金财产进行估值和变现；

(4) 制作清算报告；

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

(6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；

(7) 对基金剩余财产进行分配。

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

#### **(四) 清算费用**

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

#### **(五) 基金财产清算剩余资产的分配**

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

#### **(六) 基金财产清算的公告**

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算小组进行公告，基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

#### **(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。

## 十九、基金合同内容摘要

### （一）基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

#### 1、基金份额持有人的权利与义务

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

每份基金份额具有同等的合法权益。

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

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

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

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

5) 在其持有的基金份额范围内, 承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任;

6) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动;

7) 执行生效的基金份额持有人大会的决议;

8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利;

9) 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。

## 2、基金管理人的权利与义务

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

1) 依法募集资金;

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

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

4) 销售基金份额;

5) 按照规定召集基金份额持有人大会;

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

7) 在基金托管人更换时, 提名新的基金托管人;

8) 选择、委托、更换基金销售机构, 对基金销售机构的相关行为进行监督和处理;

9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用;

10) 依据《基金合同》及有关法律、法规规定决定基金收益的分配方案;

11) 在《基金合同》约定的范围内, 拒绝或暂停受理申购与赎回申请;

12) 依照法律法规为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利;

13) 在法律法规允许的前提下, 为基金的利益依法为基金进行融资;

14) 以基金管理人的名义, 代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实

施其他法律行为；

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

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

17) 法律法规、中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

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

2) 办理基金备案手续；

3) 自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、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) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

7) 依法接受基金托管人的监督；

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

9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

10) 编制季度报告、中期报告和年度报告；

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

12) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、

《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；

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

14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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

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

17) 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的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；但因第三方责任导致基金财产或基金份额持有人利益受到损失，而基金管理人首先承担了责任的情况下，基金管理人有权向第三方追偿；

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

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

- 25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- 26) 建立并保存基金份额持有人名册；
- 27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

### 3、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收入；

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，为基金开设资金账户、证券账户和期货结算账户等投资所需账户、为基金办理证券交易资金清算；

5) 以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司和银行间市场清算所股份有限公司开设银行间债券托管账户；

6) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

7) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

8) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

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

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

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

5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证;

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

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

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

9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项;

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

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

12) 建立并保存基金份额持有人名册;

13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对;

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

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

16) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作;

17) 参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;

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

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

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

21) 执行生效的基金份额持有人大会的决议;

22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## (二) 基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成,基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

本基金份额持有人大会不设日常机构。

### 1、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) 调整基金管理人、基金托管人的报酬标准,但法律法规和中国证监会要求调整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) 对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项;
- 13) 法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持

有人大会的事项。

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

- 1) 法律法规要求增加的基金费用的收取;
- 2) 调整本基金的申购费率、调低赎回费率、变更收费方式;
- 3) 增加新的基金份额类别或调整基金份额分类规则;
- 4) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改;
- 5) 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生重大变化;
- 6) 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情形。

## 2、会议召集人及召集方式

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

(2) 基金管理人未按规定召集或不能召集时,由基金托管人召集。

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

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

日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

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

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

### 3、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

- 1) 会议召开的时间、地点、方式和会议形式；
- 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）、授权方式、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及投票方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、表决意见提交的截止时间和收取方式。

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

### 4、基金份额持有人出席会议的方式

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

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

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

2) 经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，

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

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

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

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

3) 本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的，基金份额持有

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

4) 上述第3)项中直接出具表决意见的基金份额持有人或受托代表他人出具表决意见的代理人，同时提交或经验证的持有基金份额的凭证、受托出具表决意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托书需符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并与基金登记机构记录相符。

(3) 在法律法规和监管机关允许的情况下，本基金的基金份额持有人可采用网络、电话、短信等其他非书面方式授权其代理人出席基金份额持有人大会；在会议召开方式上，本基金亦可采用网络、电话、短信等其他非现场方式或者以非现场方式与现场方式结合的方式召开基金份额持有人大会，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。

## 5、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。

## 6、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三分之二以上（含三分之二）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》、本基金与其他基金合并以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

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

## 7、计票

### (1) 现场开会

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

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

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

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

### (2) 通讯开会

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

## 8、生效与公告

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

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 日内在指定媒介上公告。如果采用

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

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

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

### （三）基金合同的变更、终止与基金财产的清算

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

（2）关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，基金管理人应在决议生效后 2 日内在指定媒介公告。

#### 2、《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：

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

#### 3、基金财产的清算

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

（2）基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金

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

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

(4) 基金财产清算程序：

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

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

#### 4、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。

#### 5、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。

#### 6、基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告，基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

#### 7、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

#### **（四）争议解决方式**

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，应提交上海国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为上海市，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，除非仲裁裁决另有决定，仲裁费由败诉方承担。

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

《基金合同》受中国法律（为本基金合同之目的，在此不包括香港、澳门特别行政区和台湾地区法律）管辖。

#### **（五）基金合同存放地和投资者取得合同的方式**

《基金合同》可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅。

## 二十、托管协议的内容摘要

### （一）基金托管协议当事人

1、基金管理人：上海东方证券资产管理有限公司

住所：上海市黄浦区中山南路 318 号 31 层

法定代表人：潘鑫军

成立时间：2010 年 7 月 28 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监许可字[2010]518 号

注册资本：3 亿元人民币

组织形式：有限责任公司

存续期间：持续经营

电话：（021）63325888

2、基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：郑杨

成立日期：1992 年 10 月 19 日

基金托管业务资格批准机关：中国证监会

基金托管业务资格文号：证监基金字[2003]105 号

组织形式：股份有限公司（上市）

注册资本：人民币 293.52 亿元

经营期限：持续经营

### （二）基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

1、基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权

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

本基金将投资于以下金融工具：

本基金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、地方政府债、政府支持机构债、金融债、企业债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、公司债、资产支持证券、证券公司发行的短期公司债券、分离交易可转

债的纯债部分、债券逆回购、同业存单、银行存款、货币市场工具等固定收益类资产、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。

本基金不得买入股票，也不参与新股申购和新股增发。可转债仅投资可分离交易可转债的纯债部分。

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，其投资比例遵循届时有效法律法规或相关规定。

《基金合同》已明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种，以便基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合《基金合同》关于证券选择标准的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。

本基金不得投资于相关法律、法规、部门规章及《基金合同》禁止投资的投资工具。

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

1) 按法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金的投资资产配置比例为：

本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

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

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

a) 本基金投资债券的比例不低于基金资产的 80%；

b) 本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

c) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；

d) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%，完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金品种可以不受此条款规定的比例限制；

e) 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%；

f) 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%；

g) 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%；

h) 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%；

i) 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；

j) 本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的 15%；

k) 本基金在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%；

l) 本基金参与国债期货时，本基金所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定；

m) 本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 30%；

n) 本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

o) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的 15%。因证券市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符

合该比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

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

q) 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。

法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则在履行适当程序后，本基金投资不再受相关限制或按调整后的规定执行，基金管理人及时根据《信息披露办法》规定在指定媒介公告。

除 b)、i)、o)、p) 条外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

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

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

根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金禁止从事下列行为：

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

如法律、行政法规或监管部门取消或调整上述禁止性规定，本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制或以调整后的规定为准。

(4) 基金托管人依据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定对于基金

关联投资限制进行监督。

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

如法律、法规或《基金合同》有关于基金从事关联交易的规定，基金管理人和基金托管人事先相互提供与本机构有控股关系的股东、与本机构有其他重大利害关系的公司名单及有关关联方发行的证券清单，加盖公章并书面提交。名单变更后基金管理人应及时发送基金托管人，经基金托管人确认后，新的关联交易名单开始生效。基金托管人仅按基金管理人提供的基金关联方名单为限，进行监督。如果基金托管人在运作中严格遵循了监督流程，基金管理人仍违规进行关联交易，并造成基金资产损失的，由基金管理人承担责任。

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

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

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

基金管理人应当加强对基金投资银行存款风险的评估与研究，严格测算与控制投资银行存款的风险敞口。对于基金投资的银行存款，由于存款银行发生信用风险事件而造成损失时，由基金管理人负责向相关责任人进行追偿。如果基金托管人在运作过程中遵循有关法律法规的规定和《基金合同》的约定监督流程，则对于由于存款银行信用风险引起的损失，不承担赔偿责任。

(7) 基金托管人对基金投资中期票据的监督责任仅限于依据本协议相关规定对投资比例和投资限制进行事后监督；除此外，无其它监督责任。如发现异常

情况，应及时以书面形式通知基金管理人。基金管理人应积极配合和协助基金托管人进行监督和核查。基金因投资中期票据导致的信用风险、流动性风险，基金托管人不承担任何责任。如因基金管理人原因导致基金出现损失且基金托管人不存在过错的，基金托管人不承担任何责任。

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监督和核查。

3、基金托管人发现基金管理人的投资运作及其他运作违反《基金法》、《基金合同》、基金托管协议等有关规定时，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应在下一个工作日及时核对，并以书面形式向基金托管人发出回函，进行解释或举证。

在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

基金管理人应积极配合和协助基金托管人依照法律法规、《基金合同》和本托管协议对基金业务的监督和核查，对基金托管人发出的书面提示，必须在规定时间内答复基金托管人并改正，或就基金托管人的疑义进行解释或举证，对基金托管人按照法律法规、《基金合同》和本托管协议的要求需向中国证监会报送基金监督报告的，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

若基金托管人发现基金管理人发出但未执行的投资指令或依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反《基金合同》约定的，应当立即通知基金管理人，并报告中国证监会。基金管理人的上述违规失信行为给基金财产或基金份额持有人造成的损失，由基金管理人承担。

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

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

基金管理人无正当理由,拒绝、阻挠基金托管人根据本协议规定行使监督权,或采取拖延、欺诈等手段妨碍基金托管人进行有效监督,情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的,基金托管人应报告中国证监会。

### **(三) 基金管理人对基金托管人的业务核查**

基金管理人对基金托管人履行托管职责情况进行核查,核查事项包括但不限于基金托管人是否安全保管基金财产、是否分别开设基金财产的资金账户、证券账户和期货结算账户及投资所需其他账户、是否复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、是否根据基金管理人指令办理清算交收、进行相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、无故未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、《基金合同》、本托管协议及其他有关规定时,基金管理人应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正,基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式向基金管理人发出回函。在限期内,基金管理人有权随时对通知事项进行复查,督促基金托管人改正。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的,基金管理人应报告中国证监会。基金管理人发现基金托管人有重大违规行为,应立即报告中国证监会和银行业监督管理机构,同时通知基金托管人限期纠正。基金托管人因此给基金、基金管理人造成损失的,应负责赔偿。

基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为,包括但不限于:提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性,在规定时间内答复基金管理人并改正。

基金托管人无正当理由,拒绝、阻挠基金管理人根据本协议规定行使监督权,或采取拖延、欺诈等手段妨碍基金管理人进行有效监督,情节严重或经基金管理人提出警告仍不改正的,基金管理人应报告中国证监会。

### **(四) 基金财产的保管**

#### **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) 基金托管人应按本协议规定安全保管托管财产。未经基金管理人的指令,不得自行运用、处分、分配基金的任何财产(基金托管人主动扣收的汇划费

除外)。基金托管人不对处于自身实际控制之外的账户及财产承担责任。

(3) 基金托管人按照规定为托管的基金财产开设资金账户、证券账户和期货结算账户及投资所需其他账户。

(4) 基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户,与基金托管人的其他业务和其他基金的托管业务实行严格的分账管理,确保基金财产的完整与独立。

(5) 对于因基金认(申)购、基金投资过程中产生的应收财产,应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人,到账日基金财产没有到达基金托管人处的,基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金造成损失的,基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失,基金托管人对基金管理人的追偿行为应予以必要的协助与配合,但对基金财产的损失不承担责任。

## 2、募集资金的验证

募集期内销售机构按销售与服务代理协议的约定,将认购资金划入基金管理人开设的募集账户。基金募集期满,募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后,由基金管理人聘请具有从事证券、期货业务资格的会计师事务所进行验资,出具验资报告,出具的验资报告应由参加验资的2名以上(含2名)中国注册会计师签字方为有效。基金管理人应将募集的属于本基金财产的全部资金划入基金托管人为基金开立的资产托管专户中。基金托管人收到有效认购资金当日以书面形式确认资金到账情况,并及时将资金到账凭证传真给基金管理人,双方进行账务处理。

若基金募集期限届满,未能达到《基金合同》备案的条件,由基金管理人按规定办理退款事宜。

## 3、基金资产托管专户的开立和管理

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

本基金的一切货币收支活动,均需通过基金托管人或基金的资产托管专户进

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

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

#### 4、基金证券账户与证券交易资金账户的开设和管理

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

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

基金证券账户的开立和原始开户材料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。基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司开立结算备付金账户，基金托管人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、证券结算保证金等的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定和基金托管人为履行结算参与人的义务所制定的业务规则执行。

#### 5、银行间市场债券托管和资金结算专户的开立和管理及市场准入备案

《基金合同》生效后，在符合监管机构要求的情况下，基金管理人负责以基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表基金进行交易；基金托管人根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司、银行间市场清算所股份有限公司的有关规定，以本基金的名义分别在中央国债登记结算有限责任公司、银行间市场清算所股份有限公司开立债券托管账户和资金结算账户，并代表基金进行银行间市场债券交易的结算。基金托管人协助基金管理人完成银行间债券市场准入备案。

#### 6、其他账户的开设和管理

(1) 因业务发展而需要开立的其它账户，可以根据《基金合同》或有关法

法律法规的规定，经基金管理人和基金托管人协商一致后，由基金托管人负责为基金开立。新账户按有关规则使用并管理。

(2) 法律、法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

#### 7、基金投资银行存款账户的开立和管理

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

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

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

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

为防范特殊情况下的流动性风险，定期存款协议中应当约定提前支取条款。

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

#### 8、基金财产投资的有关实物证券、银行定期存款存单等有价凭证的保管

基金财产投资的有关实物证券、银行定期存款存单由基金托管人存放于基金托管人的保管库；其中实物证券也可存入中央国债登记结算有限责任公司、中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司、银行间市场清算所股份有限公司或票据营业中心的代保管库。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。属于基金托管人实际有效控制下的实物证券在基金托管人保管期间的损坏、灭失，由此产生的责任应由基金托管人承担。基金托管人对基金托管人以外机构实际有效控制或保管的实物证券、银行定期存款存单对应的财产不承担保管责任。

#### 9、与基金财产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同的原件分别应由基金托管人、基金管理人保管。除本协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与

基金有关的重大合同时在保证基金一方持有两份以上的正本,以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人在合同签署后 5 个工作日内通过专人送达、挂号邮寄等安全方式将合同原件送达基金托管人处。合同原件应存放于基金管理人和基金托管人各自文件保管部门 15 年以上。对于无法取得二份以上的正本的,基金管理人应向基金托管人提供加盖公章的合同传真件,基金托管人以收到的传真件进行操作。若基金管理人发现提供的合同传真件与基金管理人留存的原件不一致的,基金管理人应及时提供正确的传真件,并承担相应损失。基金托管人有权要求查阅原件。

### **(五) 基金资产净值计算与复核**

#### **1、基金资产净值的计算、复核的时间和程序**

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

根据有关法律法规,基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任,因此,就与本基金有关的会计问题,如经相关各方在平等基础上充分讨论后,仍无法达成一致意见的,按照基金管理人对基金净值信息的计算结果对外予以公布。每个工作日,基金管理人应对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或基金合同的规定暂停估值时除外。估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算业务指引》及其他法律、法规的规定。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金份额净值和基金资产净值并以双方认可的方式发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核后以双方认可的方式发送给基金管理人,由基金管理人约定对外公布。

### **(六) 基金份额持有人名册的保管**

基金份额持有人名册的内容必须包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。基金份额持有人名册由基金的基金登记机构根据基金管理人的指令编制和保管,基金管理人应按照目前相关规则保管基金份额持有人名册。保管方式可以

采用电子或文档的形式。保管期限为 15 年，法律法规或监管部门另有规定的除外。

在基金托管人编制中期报告和年度报告前，基金管理人应将每年 6 月 30 日、12 月 31 日的基金持有人名册送交基金托管人，文件方式可以采用电子或文档的形式并且保证其的真实、准确、完整。基金托管人应妥善保管，不得将持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途。

### （七）争议解决方式

1、本协议适用中华人民共和国法律（为本协议之目的，在此不包括香港、澳门特别行政区和台湾地区法律），并从其解释。

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

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

### （八）托管协议的变更、终止与基金财产的清算

#### 1、托管协议的变更与终止

##### （1）托管协议的变更程序

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

##### （2）基金托管协议终止的情形

发生以下情况，本托管协议终止：

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

## 2、基金财产的清算

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

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

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

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

(5) 基金财产清算程序：

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

(6) 清算费用

清算费用是指基金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剩余财产中支付。

(7) 基金财产按下列顺序清偿：

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

基金财产未按前款 1)－3) 项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

## 3、基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告，基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

#### 4、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 二十一、对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务。基金管理人将根据基金份额持有人的需要和市场的变化，增加或变更服务项目。主要服务内容如下：

### （一）基金份额持有人交易资料的寄送服务

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

基金管理人在每季度结束后向定制纸质对账单且在季度内有交易或季度末最后一个交易日仍持有基金份额的投资者寄送季度对账单。

由于投资者提供的邮寄地址、手机号码、电子邮箱不详、错误、未及时变更或邮局投递差错、通讯故障、延误等原因有可能造成对账单无法按时或准确送达。因上述原因无法正常收取对账单的投资者，敬请及时通过本公司网站，或拨打本公司客服热线查询、核对、变更预留联系方式。

### （二）免费信息定制服务

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

### （三）客户呼叫中心电话服务

客户呼叫中心自动语音系统提供 7×24 小时基金净值信息、账户交易情况、基金产品与服务等信息查询。

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

### （四）客户投诉受理服务

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

### （五）基金管理人客户服务联络方式

客户呼叫热线：4009200808，工作时间内可转人工坐席。

传真：（021）63326981

公司网址：www.dfham.com

电子信箱：service@dfham.com

（六）如本招募说明书存在任何您/贵机构无法理解的内容，请通过上述方式联系本公司。请确保投资前，您/贵机构已经全面理解了本招募说明书。

## 二十二、其他应披露事项

本基金信息披露的规定媒介为中国证券报、公司官网（网址：[www.dfham.com](http://www.dfham.com)）、中国证监会基金电子披露网站（网址：<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）。以下为本基金2020年7月21日至2021年5月20日的信息披露文件：

| 序号 | 信息披露日       | 公告名称                                             |
|----|-------------|--------------------------------------------------|
| 1  | 2020年7月22日  | 东方红益丰纯债债券型证券投资基金基金合同生效公告                         |
| 2  | 2020年8月7日   | 关于东方红货币市场基金D类份额赎回转购（含定期定额赎回转购）业务适用范围调整的公告        |
| 3  | 2020年8月12日  | 上海东方证券资产管理有限公司关于提醒直销平台投资者及时完善、更新身份资料信息的公告        |
| 4  | 2020年8月25日  | 东方红益丰纯债债券型证券投资基金基金产品资料概要更新                       |
| 5  | 2020年10月9日  | 东方红益丰纯债债券型证券投资基金基金开放日常申购（赎回、转换、定期定额投资）业务公告       |
| 6  | 2020年10月15日 | 关于东方红益丰纯债债券型证券投资基金在直销平台开通定期定额投资、转换业务并开展费率优惠活动的公告 |
| 7  | 2020年10月21日 | 东方红益丰纯债债券型证券投资基金暂停接受个人投资者申购（含定期定额投资）业务的公告        |
| 8  | 2020年10月22日 | 东方红益丰纯债债券型证券投资基金暂停接受个人投资者转换转入（含定期定额转换转入）业务的公告    |
| 9  | 2020年10月27日 | 上海东方证券资产管理有限公司关于高级管理人员变更的公告                      |
| 10 | 2020年10月28日 | 东方红益丰纯债债券型证券投资基金2020年第3季度报告                      |
| 11 | 2020年11月21日 | 上海东方证券资产管理有限公司关于新增基金高级管理人员的公告                    |
| 12 | 2020年11月27日 | 上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金在直销平台开展费率优惠活动的公告           |
| 13 | 2020年12月24日 | 关于上海东方证券资产管理有限公司直销中心办公地址变更的公告                    |
| 14 | 2020年12月31日 | 上海东方证券资产管理有限公司关于董事与高级管理人员变更的公告                   |
| 15 | 2020年12月31日 | 上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金在直销平台开通基金转换业务并开展费率优惠活动的公告  |
| 16 | 2021年1月8日   | 上海东方证券资产管理有限公司关于住所变更的公告                          |

| 序号 | 信息披露日      | 公告名称                                                  |
|----|------------|-------------------------------------------------------|
|    |            | 告                                                     |
| 17 | 2021年1月11日 | 上海东方证券资产管理有限公司关于旗下基金在直销平台开展费率优惠活动的公告                  |
| 18 | 2021年1月22日 | 东方红益丰纯债债券型证券投资基金2020年第4季度报告                           |
| 19 | 2021年2月22日 | 上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加中国人寿保险股份有限公司为代理销售机构并开通定投业务的公告 |
| 20 | 2021年3月2日  | 上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金在直销平台开通转换业务并开展费率优惠活动的公告         |
| 21 | 2021年3月13日 | 上海东方证券资产管理有限公司关于高级管理人员变更的公告                           |
| 22 | 2021年3月15日 | 东方红益丰纯债债券型证券投资基金暂停大额申购（含转换转入、定期定额投资）业务的公告             |
| 23 | 2021年3月17日 | 东方红益丰纯债债券型证券投资基金分红公告                                  |
| 24 | 2021年3月31日 | 东方红益丰纯债债券型证券投资基金2020年年度报告                             |
| 25 | 2021年4月22日 | 东方红益丰纯债债券型证券投资基金2021年第一季度报告                           |

## 二十三、招募说明书的存放及查阅方式

本基金招募说明书存放在基金管理人、基金托管人和基金销售机构的住所，投资者可在办公时间查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复印件或复印件。

基金管理人和基金托管人应保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

## 二十四、备查文件

- (一) 中国证监会准予东方红益丰纯债债券型证券投资基金募集注册的文件
- (二) 《东方红益丰纯债债券型证券投资基金基金合同》
- (三) 《东方红益丰纯债债券型证券投资基金托管协议》
- (四) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (五) 基金托管人业务资格批件、营业执照
- (六) 关于申请募集注册东方红益丰纯债债券型证券投资基金之法律意见书
- (七) 登记协议
- (八) 中国证监会要求的其他文件

基金托管人业务资格批件和营业执照存放在基金托管人处；基金合同、托管协议及其他备查文件存放在基金管理人处。投资者可在营业时间免费到存放地点查阅。

上海东方证券资产管理有限公司

二〇二一年六月四日