

工银瑞信四季收益债券型证券投资基金更新的招募说  
明书  
(2022 年第 2 号)

基金管理人：工银瑞信基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

## 重要提示

工银瑞信四季收益债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会 2011 年 1 月 4 日《关于核准工银瑞信四季收益债券型证券投资基金募集的批复》（证监许可〔2011〕7 号文）核准公开募集。本基金基金合同于 2011 年 2 月 10 日起生效，自该日起基金管理人正式开始管理本基金。

工银瑞信基金管理有限公司（以下称“本基金管理人”或“管理人”）保证招募说明书的内容真实、准确、完整。招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

投资有风险，投资者认购（或申购）基金份额时应认真阅读本招募说明书和基金产品资料概要，全面认识本基金产品的风险收益特征，应充分考虑投资者自身的风险承受能力，并对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资者基金投资的“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导致的投资风险，由投资者自行承担。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险、本基金的特定风险等等。本基金为债券型基金，属于低风险基金产品，其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金，高于货币市场基金。在债券型基金产品中，本基金主要投资于公司债、企业债、短期融资券、商业银行金融债与次级债、企业资产支持证券、可转换债券（含分离交易的可转换债券）等企业机构发行的债券，其长期平均风险程度和预期收益率高于普通债券型基金。本基金初始募集净值 1 元。在市场波动因素影响下，本基金净值可能低于初始面值，本基金投资者有可能出现亏损。

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

本基金合同生效后三年内（含三年）为首个封闭期，封闭期间投资者不能申购赎回本基金份额，但可在本基金上市交易后通过证券交易所转让基金份额。在距封闭期届满日 30 个

工作日前，基金管理人将以现场或通讯方式召开基金份额持有人大会，投票决定是否同意本基金继续封闭三年。如果封闭期届满前基金份额持有人大会依据有关法律法规和本基金合同第十章的相关规定成功召开并决定进入下一个三年封闭期，经中国证监会核准，则本基金继续封闭三年，即在上个封闭期届满后的次日随即开始下一个三年封闭期。在本基金保持封闭运作方式期间，需在每个封闭期届满前按照前述程序召开基金份额持有人大会并决定基金运作方式。如果封闭期届满前基金份额持有人大会未能依据有关法律法规和本基金合同第十章的相关规定成功召开或基金份额持有人大会上本基金继续封闭的决议未获得通过，则本基金在上个封闭期届满后的次日转为上市开放式基金（LOF），投资者可进行基金份额的申购与赎回，一旦本基金转为上市开放式基金（LOF）后，本基金将以上市开放式基金的模式持续运作，无需每隔三年召开一次基金份额持有人大会决定基金运作方式。

本基金基金份额持有人大会表决投票时间自 2013 年 12 月 9 日起，至 2014 年 1 月 20 日 17:00 止。公司于 2014 年 1 月 23 日发布《工银瑞信基金管理有限公司关于工银瑞信四季收益债券型证券投资基金基金份额持有人大会出席统计结果及基金运作方式变更的公告》，本基金于封闭期届满后的次日起（即 2014 年 2 月 10 日）转为上市开放式基金（LOF），投资人可进行基金份额的申购与赎回。

本基金的投资范围包括存托凭证，若投资可能面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与创新企业、境外发行人、中国存托凭证发行机制以及交易机制等相关的风险。

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

本基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人所管理的其它基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。

本基金本次更新招募说明书，是根据《基金合同》、《托管协议》的修订，更新了释义、相关服务机构、基金份额的上市交易、基金份额的申购与赎回、基金资产估值、基金的费用与税收、基金的收益与分配、基金份额的注册登记、非交易过户、转托管、冻结与解冻、基金的信息披露、基金合同的变更、终止与基金财产的清算、基金合同的内容摘要、基金托管协议的内容摘要等章节，并更新了基金管理人主要人员情况，上述内容更新截止日为 2022 年 10 月 23 日。除非另有说明，本招募说明书所载其他内容截止日为 2022 年 2 月 28 日，有

关财务数据和净值表现数据截止日为有关财务数据和净值表现数据截止日为 2021 年 12 月 31 日（财务数据未经审计）。

## 目录

重要提示.....	1
一、绪言.....	5
二、释义.....	5
三、基金管理人.....	10
四、基金托管人.....	21
五、相关服务机构.....	23
六、基金的募集.....	58
七、基金合同的生效.....	59
八、基金份额的上市交易.....	59
九、基金份额的申购与赎回.....	60
十、基金运作方式的变更及相关事项.....	70
十一、基金的投资.....	71
十二、基金的业绩.....	84
十三、基金的财产.....	85
十四、基金资产估值.....	86
十五、基金的收益与分配.....	91
十六、基金的费用与税收.....	93
十七、基金份额的注册登记、非交易过户、转托管、冻结与解冻.....	94
十八、基金的会计与审计.....	97
十九、基金的信息披露.....	97
二十、侧袋机制.....	102
二十一、风险揭示.....	104
二十二、基金合同的变更、终止与基金财产的清算.....	108
二十三、基金合同的内容摘要.....	111
二十四、基金托管协议的内容摘要.....	111
二十五、对基金份额持有人的服务.....	111
二十六、其他应披露事项.....	115
二十七、招募说明书的存放及查阅方式.....	116
二十八、备查文件.....	116
附件一.....	116
附件二.....	131

## 一、绪言

《工银瑞信四季收益债券型证券投资基金（LOF）更新招募说明书》（以下简称“本招募说明书”或“招募说明书”）依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《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》”）等相关法律法规和《工银瑞信四季收益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工银瑞信四季收益债券型证券投资基金（LOF）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，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本招募说明书由工银瑞信基金管理有限公司解释。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，或对本招募说明书作任何解释或者说明。

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

## 二、释义

1、基金或本基金：指工银瑞信四季收益债券型证券投资基金及转型后的工银瑞信四季收益债券型证券投资基金（LOF）

2、基金管理人或本基金管理人：指工银瑞信基金管理有限公司

3、基金托管人或本基金托管人：指中国农业银行股份有限公司

4、基金合同或本基金合同：指《工银瑞信四季收益债券型证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充

5、托管协议或本托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《工银瑞信四季收益债券型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充

6、招募说明书：指《工银瑞信四季收益债券型证券投资基金招募说明书》及基金转型

后的《工银瑞信四季收益债券型证券投资基金（LOF）招募说明书》，及其更新

7、基金份额发售公告：指《工银瑞信四季收益债券型证券投资基金份额发售公告》

8、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、司法解释、部门规章、地方性法规、地方政府规章及其他对基金合同当事人有约束力的规范性文件及对该等法律法规不时作出的修订

9、《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，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 日起实施的，并经 2015 年 4 月 24 日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修改的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订

10、《销售办法》：指中国证监会 2013 年 3 月 15 日颁布、同年 6 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

11、《信息披露办法》：指中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

12、《运作办法》：指中国证监会 2014 年 7 月 7 日颁布、同年 8 月 8 日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及对其不时作出的修订

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

14、《上市规则》：指《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》

15、中国：指中华人民共和国，就本基金合同而言，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区

16、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

17、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行保险监督管理委员会

18、基金合同当事人：指受基金合同约束，根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人

19、个人投资者：指年满 18 周岁，合法持有现时有效的中华人民共和国居民身份证等有效身份证件的中国公民，以及依据有关法律法规规定或中国证监会批准可以投资证券投资基金的其他自然人

20、机构投资者：指符合法律法规规定可以投资证券投资基金的在中华人民共和国注册登记并存续或经政府有关部门批准设立的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织机构

21、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》及其他相关法律法规的可投资于中国境内证券的中国境外的机构投资者

- 22、基金投资者：指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者的合称
- 23、基金份额持有人：指依招募说明书和基金合同合法取得基金份额的基金投资者
- 24、基金销售业务：指基金的认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务
- 25、销售机构：指直销机构和代销机构
- 26、直销机构：指工银瑞信基金管理有限公司（包括直销中心和网上交易系统）
- 27、代销机构：指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金代销业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议，代为办理基金销售业务的机构，以及可通过深圳证券交易所交易系统办理基金销售业务的会员单位
- 28、基金销售网点：指直销机构的直销中心及代销机构的代销网点
- 29、注册登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括基金投资者基金账户的建立和管理、基金份额注册登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等
- 30、注册登记机构：指办理注册登记业务的机构。基金的注册登记机构为工银瑞信基金管理有限公司或接受工银瑞信基金管理有限公司委托代为办理注册登记业务的机构
- 31、会员单位：指经相关证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的交易所会员单位
- 32、证券账户：指注册登记机构给投资者开立的用于记录投资者持有证券的账户，包括人民币普通股票账户和证券投资基金账户，记录在该账户下的基金份额登记在注册登记机构的证券登记结算系统
- 33、开放式基金账户或基金账户：指注册登记机构为基金投资者开立的、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，其中场外 A 类基金份额记录在中国证券登记结算有限责任公司开立的开放式基金账户并登记在中国证券登记结算有限责任公司的登记结算系统，场内 A 类份额记录在基金份额持有人深圳证券账户并登记在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记结算系统，C 类基金份额仅可通过场外方式申购，记录在工银瑞信基金管理有限公司开立的基金账户并登记在工银瑞信管理有限公司的注册登记系统
- 34、基金交易账户：指销售机构为基金投资者开立的、记录基金投资者通过该销售机构买卖基金份额的变动及结余情况的账户
- 35、基金合同生效日：指基金募集期结束后达到法律法规规定及基金合同约定的备案条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并收到其书面确认的日期
- 36、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，按照基金合同规定



的程序终止基金合同的日期

37、基金募集期限：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

38、封闭期：指根据本合同中关于基金运作方式的约定，对本基金采取封闭式运作的期间，在该期间内基金份额保持不变，基金份额持有人不得申请申购、赎回本基金

39、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

40、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

41、日：指公历日

42、月：指公历月

43、T日：指销售机构在规定时间受理基金投资者有效申请工作日

44、T+n日：指自T日起第n个工作日(不包含T日)，n指自然数

45、开放日：指为基金投资者办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

46、交易时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

47、《业务规则》：指《中国证券登记结算有限责任公司上市开放式基金登记结算业务实施细则》、《深圳证券交易所上市开放式基金业务规则》、《深圳证券交易所开放式基金申购赎回业务实施细则》和《工银瑞信基金管理有限公司证券投资基金注册登记业务规则》等相关业务规则和实施细则

48、认购：指在基金募集期间，基金投资者申请购买基金份额的行为

49、申购：指在基金存续期内（不含封闭期），基金投资者申请购买基金份额的行为

50、赎回：指在基金存续期内（不含封闭期）基金份额持有人按基金合同规定的条件要求卖出基金份额的行为

51、上市交易：指基金合同生效后投资人通过场内会员单位以集中竞价的方式买卖基金份额的行为

52、场外：指不通过深圳证券交易所的交易系统办理基金份额认购、申购和赎回等业务的销售机构和场所

53、场内：指通过深圳证券交易所的交易系统办理基金份额认购、申购和赎回等业务的销售机构和场所

54、场外份额：指登记在登记结算系统下的A类基金份额和登记在工银瑞信管理有限公司注册登记系统下的C类基金份额

55、场内份额：指登记在证券登记系统下的A类基金份额

56、日常交易：场外申购和赎回等场外基金交易，以及场内申购和赎回及买卖等场内基金交易

57、**证券登记系统**：指中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记结算系统，通过场内销售机构认购、申购的 A 类基金份额登记在本系统

58、**登记结算系统**：指中国证券登记结算有限责任公司基金登记结算系统，通过场外销售机构认购、申购的 A 类基金份额登记在本系统

59、**注册登记系统**：指工银瑞信基金管理有限公司注册登记系统，投资者申购的 C 类基金份额登记在本系统

60、**转托管**：指系统内转托管及跨系统转登记的总称

61、**系统内转托管**：指基金份额持有人将持有的 A 类基金份额在登记结算系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记系统内不同会员单位（席位）之间进行转托管的行为，以及基金份额持有人将持有的 C 类基金份额在工银瑞信基金管理有限公司注册登记系统内不同销售机构之间进行转托管的行为

62、**跨系统转登记**：指基金份额持有人将持有的 A 类基金份额在登记结算系统和证券登记系统间进行转登记的行为，C 类基金份额暂不开通跨系统转登记

63、**基金转换**：指基金份额持有人按照本基金合同和基金管理人届时的公告在本基金份额与基金管理人管理的且由同一注册登记机构办理注册登记的其他基金份额间的转换行为

64、**巨额赎回**：本基金单个开放日，基金净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一日基金总份额的 10%

65、**元**：指人民币元

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

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

68、**基金资产净值**：指基金资产总值减去基金负债后的价值

69、**基金份额净值**：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数的数值

70、**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

71、**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

72、**不可抗力**：指本基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服，且在本基金合同由基金管理人、基金托管人签署之日后发生的，使本基金合同当事人无法全部或部分履行本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、证券交易所非正常暂停或停止交易

73、销售服务费：指从基金资产中计提的，用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务的费用

74、基金份额类别：指本基金根据申购费用、赎回费用、销售服务费收取方式等事项的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人申购时收取申购费用、赎回时收取赎回费用，且不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资人申购时不收取申购费用、赎回时收取赎回费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额

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

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

77、基金产品资料概要：指《工银瑞信四季收益债券型证券投资基金基金产品资料概要》及其更新

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

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

### 三、基金管理人

#### （一）基金管理人概况

名称：工银瑞信基金管理有限公司

住所：北京市西城区金融大街 5 号、甲 5 号 9 层甲 5 号 901

办公地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 A 座 6-9 层

邮政编码：100033

法定代表人：赵桂才

成立日期：2005 年 6 月 21 日

批准设立机关：中国证监会

批准设立文号：中国证监会证监基金字[2005]93号

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务

组织形式：有限责任公司

注册资本：贰亿元人民币

联系人：朱碧艳

联系电话：400-811-9999

股权结构：中国工商银行股份有限公司占公司注册资本的80%；瑞士信贷银行股份有限公司占公司注册资本的20%。

存续期间：持续经营

## （二）主要人员情况

### 1、董事会成员

赵桂才先生，硕士，高级经济师，现任工银瑞信基金管理有限公司党委书记、董事长、法定代表人。1990年7月加入中国工商银行，先后在中国工商银行商业信贷部、营业部和公司业务二部工作，先后任副处长、处长、副总经理。2013年1月至2016年1月，任工银巴西执行董事、总经理；2016年1月至2020年12月，任工银租赁党委书记、执行董事、总裁。2020年加入工银瑞信基金管理有限公司。

高翀先生，董事，硕士，现任工银瑞信基金管理有限公司党委副书记、总经理。2000年7月至2021年7月，历任中国工商银行总行办公室副主任，资产管理部副总经理；中国工商银行上海市分行副行长、党委委员。2021年加入工银瑞信基金管理有限公司。

黄敏女士（Min Huang），董事，瑞士信贷资产管理亚太区代主管。黄敏女士毕业于麻省理工学院，自2006年加入瑞士信贷集团，先后担任瑞士信贷全球投资银行战略部助理副总裁、亚太区投资银行战略部副总裁、中国区执行首席运营官、资产管理大中国区首席运营官、资产管理中国区负责人。

洪贵路先生，董事，中国工商银行战略管理与投资者关系部高级专家、专职董事。历任农行监事会副处长、处长，中国工商银行监事会办公室处长、监事会办公室尽职监督处处长。曾赴美国乔治华盛顿大学学习。

林清胜先生，董事，高级经济师，中国人民大学经济学博士，中国工商银行战略管理与投资者关系部专家、专职董事。历任工行厦门同安支行行长、工行厦门分行国际业务部总经理、总行国际结算单证中心副总经理、工行厦门分行专家。

田国强先生，独立董事，经济学博士。上海财经大学经济学院院长，上海财经大学高等研究院院长，美国德州A&M大学经济系 Alfred F. Chalk 讲席教授。首批人文社会科学长江

学者讲座教授，曾任上海市人民政府特聘决策咨询专家，中国留美经济学会会长(1991-1992)。2006年被《华尔街电讯》列为中国大陆十大最具影响力的经济学家之一。主要研究领域包括经济理论、激励机制设计、中国经济等。

Alan H Smith 先生，独立董事，法学学士，香港太平绅士，香港律师公会律师。历任云顶香港有限公司副董事长，怡富控股有限公司董事长，香港大学法律专业讲师，恒生指数顾问委员会委员，香港会德丰集团咨询委员会委员，香港医院管理局公积金计划受托人，香港证监会程序复检委员会委员，香港政府经济顾问委员会发展局成员，香港联合交易所新市场发展工作小组主席，曾被《亚洲金融》杂志评为“年度银行家”。

程凤朝先生，独立董事，管理学博士，现为湖南大学博士生导师，中国社会科学院研究生院硕士生导师，中国上市公司协会并购融资委员会副主任委员。获湖南大学管理学博士学位，金融科学研究员，高级会计师，中国注册会计师，中国注册资产评估师。

## 2、监事会成员

张晓辛先生，监事，经济学学士。1986年加入中国工商银行，先后任工行吉林分行计划处副处长、处长，计划财务处处长，辽宁抚顺分行行长，辽宁分行副行长，吉林分行副行长，黑龙江分行副行长、行长。2021年被任命为中国工商银行战略管理与投资者关系部资深专家、专职派出董事。

Hans Urs Buchmann，监事，法学博士，现任瑞士信贷（香港）有限公司副董事长。布克曼先生自1985年加入瑞士信贷，先后任瑞信第一波士顿中国区业务主管、瑞信金融服务部中国区主管、瑞信一银行机构中国区企业银行部主管、瑞信企业及机构客户管理委员会成员、瑞信亚太区企业与机构客户部副主席。

洪波女士，监事，硕士。ACCA非执业会员。2005年至2008年任安永华明会计师事务所高级审计员；2008年至2009年任民生证券有限责任公司监察稽核总部业务主管；2009年6月加入工银瑞信法律合规部，现任内控稽核部总监，兼任工银瑞信投资管理有限公司监事。

倪莹女士，监事，硕士。2000年至2009年任职于中国人民大学，历任副科长、科长，校团委副书记。2009年至2011年就职于北京市委教工委，任干部处副调研员。2011年加入工银瑞信战略发展部，现任人力资源部总监。

章琼女士，监事，硕士。2001年至2003年任职于富友证券财务部；2003年至2005年任职于银河基金，担任注册登记专员。2005年加入工银瑞信运作部，现任中央交易室总监。

## 3、高级管理人员

赵桂才先生，董事长，简历同上。

高翀先生，总经理，简历同上。

朱碧艳女士，硕士，国际注册内部审计师，现任工银瑞信基金管理有限公司党委委员、

督察长。1997年—1999年，任中国华融信托投资公司证券总部债券部经理；2000年—2005年，任中国华融资产管理公司投资银行部、证券业务部高级副经理。2005年加入工银瑞信基金管理有限公司，兼任工银瑞信投资管理有限公司监事。

杜海涛先生，硕士，现任工银瑞信基金管理有限公司副总经理。1997年7月至2002年9月，任职于长城证券有限责任公司，历任职员、债券（金融工程）研究员；2002年10月至2003年5月，任职于宝盈基金管理有限公司，历任研究员、基金经理助理；2003年6月至2006年3月，任职于招商基金管理有限公司，历任研究员、基金经理。2006年加入工银瑞信基金管理有限公司，兼任工银瑞信资产管理（国际）有限公司董事长。

赵紫英女士，博士，现任工银瑞信基金管理有限公司党委委员、副总经理。1989年8月至2002年4月，任职于中国工商银行北京分行，历任国际业务部综合科科长、副总经理；2002年5月至2005年6月，任职于中国工商银行牡丹卡中心，任市场营销部副总经理。2005年加入工银瑞信基金管理有限公司，兼任工银瑞信投资管理有限公司董事。

郝炜先生，硕士，现任工银瑞信基金管理有限公司党委委员、副总经理。2001年4月至2005年6月，任职于中国工商银行资产托管部。2005年加入工银瑞信基金管理有限公司，兼任工银瑞信投资管理有限公司董事。

许长勇先生，硕士，高级经济师，金融风险管理师（FRM），现任工银瑞信基金管理有限公司党委委员、副总经理。2005年6月加入中国工商银行，先后在总行信贷管理部、授信业务部、公司金融业务部工作，先后担任副处长、处长。2017年加入工银瑞信基金管理有限公司，兼任工银瑞信投资管理有限公司董事长。

王建先生，硕士，高级工程师，现任工银瑞信基金管理有限公司首席信息官。1996年7月进入中国工商银行山东分行计算中心工作；2002年5月至2011年11月，历任中国工商银行山东分行开发运行中心副主任、信息科技部副总经理、资深技术经理；2011年11月至2016年8月，任中国工商银行山东分行信息科技部总经理；2016年8月至2022年6月，任职于中国工商银行总行，先后任产品创新管理部总经理助理、产品创新管理部产品专家、金融科技部产品专家。2022年加入工银瑞信基金管理有限公司。

#### 4、本基金基金经理

何秀红女士，15年证券从业经验；曾任广发证券股份有限公司债券研究员；2009年加入工银瑞信，现任固定收益部副总经理、投资总监、固收投资能力二中心兼宏观债券研究团队负责人、基金经理；2011年2月10日至今，担任工银瑞信四季收益债券型证券投资基金基金经理；2011年12月27日至2015年1月19日，担任工银瑞信保本混合型证券投资基金基金经理；2012年11月14日至2020年1月9日，担任工银瑞信信用纯债债券型证券投资基金基金经理；2013年3月29日至今，担任工银瑞信产业债债券型证券投资基金基金经

理；2013年5月22日至今，担任工银瑞信信用纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金经理；2013年6月24日至2018年2月23日，担任工银瑞信信用纯债两年定期开放债券型证券投资基金基金经理；2015年10月27日至今，担任工银瑞信丰收回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2016年9月12日至今，担任工银瑞信瑞享纯债债券型证券投资基金基金经理；2018年7月25日至今，担任工银瑞信添祥一年定期开放债券型证券投资基金基金经理；2018年7月27日至2020年6月11日，担任工银瑞信银和利混合型证券投资基金基金经理；2019年4月30日至2020年12月14日，担任工银瑞信尊利中短债债券型证券投资基金基金经理；2019年6月11日至2020年12月30日，担任工银瑞信添慧债券型证券投资基金基金经理；2020年12月9日至今，担任工银瑞信双盈债券型证券投资基金基金经理；2021年5月18日至今，担任工银瑞信宁瑞6个月持有期混合型证券投资基金基金经理；2021年6月11日至今，担任工银瑞信双玺6个月持有期债券型证券投资基金基金经理；2021年10月26日至今，担任工银瑞信稳健瑞盈一年持有期债券型证券投资基金基金经理。

本基金历任基金经理：

江明波先生，2011年2月10日至2017年5月27日，担任工银四季收益债券型基金基金经理。

#### 5、投资决策委员会成员

高翀先生，简历同上。

朱碧艳女士，简历同上。

杜海涛先生，投资决策委员会主任，简历同上。

欧阳凯先生，20年证券从业经验；曾任中海基金管理有限公司基金经理；2010年加入工银瑞信，现任固定收益部总经理、资深投资总监、固收投资能力一中心负责人、基金经理。2010年8月16日至今，担任工银瑞信双利债券型证券投资基金基金经理；2011年12月27日至2017年4月21日，担任工银瑞信保本混合型证券投资基金基金经理；2013年2月7日至2017年2月6日，担任工银瑞信保本2号混合型发起式证券投资基金(自2016年2月19日起变更为工银瑞信优质精选混合型证券投资基金)基金经理；2013年6月26日至2018年2月27日，担任工银瑞信保本3号混合型证券投资基金基金经理；2013年7月4日至2018年2月23日，担任工银瑞信信用纯债两年定期开放债券型证券投资基金基金经理；2014年9月19日至2021年7月2日，担任工银瑞信新财富灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2015年5月26日起至2018年6月5日，担任工银瑞信丰盈回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

李剑峰先生，19年证券从业经验；曾任中央国债登记结算有限责任公司业务经理、高级

副经理；2008年加入工银瑞信，现任首席投资官、养老金投资中心总经理。

修世宇先生，15年证券从业经验；博士；曾任工银瑞信基金管理有限公司研究员，民生人寿保险股份有限公司分析师；2012年加入工银瑞信，现任研究部总经理、研究总监、基金经理（牵头权益投资部工作）。2014年10月22日至2018年2月27日，担任工银瑞信高端制造行业股票型证券投资基金基金经理；2017年6月16日至2018年12月17日，担任工银瑞信工业4.0股票型证券投资基金基金经理；2022年8月22日至今，担任工银瑞信高端制造行业股票型证券投资基金基金经理；2022年9月9日至今，担任工银瑞信稳健成长混合型证券投资基金基金经理。

杜洋先生，12年证券从业经验；2010年加入工银瑞信，现任研究部副总经理、投资总监、基金经理。2015年2月16日至今，担任工银瑞信战略转型主题股票型证券投资基金基金经理；2016年11月2日至2018年10月12日，担任工银瑞信瑞盈18个月定期开放债券型证券投资基金基金经理；2017年1月25日至2018年6月11日，担任工银瑞信瑞盈半年定期开放债券型证券投资基金基金经理；2018年3月22日至今，担任工银瑞信稳健成长混合型证券投资基金基金经理；2018年11月14日至2021年1月18日，担任工银瑞信新能源汽车主题混合型证券投资基金基金经理；2019年4月24日至今，担任工银瑞信战略新兴产业混合型证券投资基金基金经理；2019年12月25日至2020年12月31日，担任工银瑞信产业升级股票型证券投资基金基金经理；2021年4月2日至今，担任工银瑞信创业板两年定期开放混合型证券投资基金基金经理；2021年4月26日至今，担任工银瑞信战略远见混合型证券投资基金基金经理；2022年1月13日至今，担任工银瑞信新能源汽车主题混合型证券投资基金基金经理。

袁芳女士，15年证券从业经验；2011年加入工银瑞信，现任权益投资部投资副总监、基金经理。2015年12月30日至今，担任工银瑞信文体产业股票型证券投资基金基金经理；2018年2月13日至2020年12月31日，担任工银瑞信新生代消费灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2019年5月6日至今，担任工银瑞信科技创新3年封闭运作混合型证券投资基金基金经理（本基金自2022年5月6日起更名为“工银瑞信科技创新混合型证券投资基金”）；2020年4月23日至今，担任工银瑞信圆兴混合型证券投资基金基金经理；2020年6月18日至今，担任工银瑞信高质量成长混合型证券投资基金基金经理；2021年1月13日至今，担任工银瑞信圆丰三年持有期混合型证券投资基金基金经理。

赵蓓女士，14年证券从业经验；曾任中再资产管理股份有限公司投资经理助理；2010年加入工银瑞信，现任研究部副总经理、投资总监、基金经理。2014年11月18日至今，担任工银瑞信医疗保健行业股票型证券投资基金基金经理；2015年4月28日至今，担任工银瑞信养老产业股票型证券投资基金基金经理；2016年2月3日至今，担任工银瑞信前沿



医疗股票型证券投资基金基金经理；2018年7月30日至2019年12月23日，担任工银瑞信医药健康行业股票型证券投资基金基金经理；2020年5月20日至2022年6月14日，担任工银瑞信科技创新6个月定期开放混合型证券投资基金基金经理；2021年3月25日至今，担任工银瑞信成长精选混合型证券投资基金基金经理。

林念先生，9年证券从业经验；博士；曾任光大证券股份有限公司宏观分析师；2014年加入工银瑞信，现任专户投资部副总经理（牵头工作）、投资副总监、基金经理。2016年9月27日至今，担任工银瑞信红利混合型证券投资基金基金经理；2020年12月21日至今，担任工银瑞信全球精选股票型证券投资基金基金经理；2022年3月4日至今，担任工银瑞信聚享混合型证券投资基金基金经理；2022年8月1日至今，担任工银瑞信主题策略混合型证券投资基金基金经理。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

### （三）基金管理人的职责

1、依法募集基金，办理或者委托经国务院证券监督管理机构认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

2、办理基金备案手续；

3、对所管理的不同基金资产分别管理、分别记账，进行证券投资；

4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

6、编制季度报告、中期报告和年度报告；

7、计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回价格；

8、办理与基金资产管理业务活动有关的信息披露事项；

9、召集基金份额持有人大会；

10、保存基金资产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

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

12、国务院证券监督管理机构规定的其他职责。

### （四）基金管理人承诺

1、本基金管理人将根据基金合同的规定，按照招募说明书列明的投资目标、策略及限制等全权处理本基金的投资。

2、本基金管理人不得从事违反《证券法》的行为，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反《证券法》行为的发生。

3、本基金管理人不得从事违反《基金法》的行为，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，保证基金财产不用于下列投资或者活动：

- (1) 将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
- (2) 不公平地对待其管理的不同基金财产；
- (3) 利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；
- (4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- (5) 其它法律法规以及国务院证券监督管理机构禁止的行为。

4、为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

- (1) 承销证券；
- (2) 向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
- (5) 向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- (6) 买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；
- (7) 将基金资产用于购买基金管理人股东发行和承销期内承销的有价证券；
- (8) 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；
- (9) 依照法律、行政法规有关规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

5、本基金管理人将加强人员管理，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，不从事以下行为：

- (1) 越权或违规经营；
- (2) 违反基金合同或托管协议；
- (3) 故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益；
- (4) 在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；
- (5) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
- (6) 玩忽职守、滥用职权；
- (7) 泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；
- (8) 除按基金管理人制度进行基金运作投资外，直接或间接进行其他股票投资；
- (9) 协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易；
- (10) 违反证券交易场所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；
- (11) 贬损同行，以提高自己；

- (12) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
- (13) 以不正当手段谋求业务发展；
- (14) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；
- (15) 其他法律、行政法规禁止的行为。

## 6、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利益。

(2) 不利用职务之便为自己、被代理人、被代表人、受雇人或任何其他第三人谋取不当利益。

(3) 不泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密以及尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息。

(4) 不以任何形式为除基金管理人以外的其他组织或个人进行证券交易。

### (五) 基金管理人的内部控制制度

#### 1、内部控制制度概述

为了保证公司规范运作，有效地防范和化解管理风险、经营风险以及操作风险，确保基金财务和公司财务以及其他信息真实、准确、完整，从而最大程度地保护基金份额持有人的利益，本公司建立了科学合理、控制严密、运行高效的内部控制制度。内部控制制度是公司为实现内部控制目标而建立的一系列组织机制、管理方法、操作程序与控制措施的总称。它由章程、内部控制大纲、基本管理制度、部门业务规章等部分组成。

公司内部控制大纲是对公司章程规定的内控原则的细化和展开，是对各项基本管理制度的纲要和总揽，内部控制大纲明确内控目标、内控原则、控制环境和内控措施等内容。公司基本管理制度包括风险管理制度、投资管理制度、基金会计核算制度、信息披露制度、档案管理制度、信息技术管理制度、财务管理制度、监察稽核制度、人力资源管理制度、危机处理制度等。部门业务规章是在基本管理制度的基础上，对各部门的主要职责、岗位设置、岗位职责、操作守则等进行了具体规定。

#### (1) 风险管理制度

风险管理制度由风险管理的目标和原则、风险管理的机构设置、风险类型的界定、风险管理的措施、风险管理的制度、风险管理制度的监督与评价等部分组成。风险管理的具体制度主要包括投资风险管理制度、交易风险管理制度、财务风险管理制度以及岗位分离制度、防火墙制度、岗位职责、反馈制度、保密制度、员工行为准则等程序性风险管理制度。

#### (2) 投资管理制度

基金投资管理制度包括基金投资管理的原则、投资研究、投资决策与执行、投资的风险

控制与绩效评估、投资授权制度、股票池管理、投资指令审核、投资指令实时监控、投资限制管理、投资禁止行为等方面内容,适用于基金投资的全过程。

### (3) 监察稽核制度

公司设立督察长,组织、指导监察稽核工作,督察长由总经理提名,经董事会聘任,对董事会负责,报中国证监会核准。督察长有权参加或者列席公司董事会以及公司业务、投资决策、风险管理等相关会议,有权调阅公司相关文件、档案,就内部控制制度的执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能。督察长应当定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况,董事会应当对督察长的报告进行审议。

公司设立监察稽核部门,具体执行监察稽核工作。公司配备了充足合格的监察稽核人员,明确规定了监察稽核部门及内部各岗位的职责和 workflow。监察稽核制度包括监察稽核体系、监察稽核工作内容、监察稽核方法和程序等。通过这些制度的建立,监督公司各业务部门和人员遵守法律、法规和规章的有关情况;评估公司各业务部门和人员执行公司内部控制制度、各项管理制度和业务规章的情况。

## 2、内部控制的原则

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

(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。

(4) 相互制约原则。基金管理人内部部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡。

(5) 成本效益原则。基金管理人运用科学化的经营管理方法降低运作成本,提高经济效益,以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

## 3、内部控制的主要内容

### (1) 控制环境

董事会下设公司治理与风险控制委员会,负责对公司治理结构进行定期的评估、检验,提出对公司治理结构的修改和完善方案,对公司经营管理和基金投资业务进行风险管理和合规性控制,对公司内部稽核审计工作结果进行审查和监督并向董事会报告;董事会下设资格审查与薪酬委员会,负责对股东推荐的董事人选资格、高级管理人员资格、独立董事资格进行审查,拟定董事、监事、高级管理人员薪酬和激励政策,报股东会或董事会批准。

公司管理层在总经理领导下,认真执行董事会确定的内部控制战略,为了有效贯彻公司董事会制定的经营方针及发展战略,总经理下设执行委员会,负责公司日常经营管理活动中

的重要决策，执行委员会下设投资决策委员会和风险管理委员会，就基金投资和风险控制等发表专业意见及建议，投资决策委员会是基金的最高投资决策机构。

公司设立督察长，对董事会负责，主要负责对公司内部控制的合法合规性、有效性和合理性进行审查，发现重大风险事件时向公司董事会和中国证监会报告。

#### (2) 风险评估

a) 董事会下属的公司治理与风险控制委员会和督察长对公司内外部风险进行评估；

b) 执行委员会下属的风险管理委员会负责对公司经营管理中的重大突发性事件和重大危机情况进行评估，制定危机处理方案并监督实施；负责对基金投资和运作中的重大问题和重大事项进行风险评估；

c) 各级部门负责对职责范围内的业务所面临的风险进行识别和评估。

#### (3) 控制活动

控制活动包括自我控制、职责分离、监察稽核、实物控制、业绩评价、严格授权、资产分离等政策、程序或措施。

控制活动体现为：自我控制以各岗位的目标责任制为基础，是内部控制的第一道防线。在公司内部建立科学、严格的岗位分离制度、授权制度、资产分离制度等，在相关部门和相关岗位之间建立重要业务处理凭据传递和信息沟通制度，后续部门及岗位对前部门及岗位负有监督责任，使相互监督制衡的机制成为内部控制的第二道防线。充分发挥督察长和内控稽核部对各岗位、各部门、各机构、各项业务全面监察稽核作用，建立内部控制的第三道防线。

#### (4) 信息与沟通

公司建立双向的信息交流途径，形成了自上而下的信息传播渠道和自下而上的信息呈报渠道。通过建立有效的信息交流渠道，保证了公司员工及各级管理人员可以充分了解与其职责相关的信息，并及时送达适当的人员进行处理。公司根据组织架构和授权制度，建立了清晰的业务报告系统。

#### (5) 内部监控

内部监控由公司治理与风险控制委员会、督察长、风险管理委员会和内控稽核部等部门在各自的职权范围内开展。本公司设立了独立于各业务部门的内控稽核部，其中监察稽核人员履行内部稽核职能，检查、评价公司内部控制制度合理性、完备性和有效性，监督公司内部控制制度的执行情况，揭示公司内部管理及基金运作中的风险，及时提出改进意见，促进公司内部管理制度有效地执行。

### 4、基金管理人关于内部控制的声明

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

- (2) 上述关于内部控制的披露真实、准确；
- (3) 本公司承诺将根据市场环境的变化及公司的发展不断完善内部控制制度。

## 四、基金托管人

### (一) 基金托管人情况

#### 1、基本情况

名称：中国农业银行股份有限公司（简称中国农业银行）

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座九层

法定代表人：谷澍

成立日期：2009 年 1 月 15 日

批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复[2009]13 号

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]23 号

注册资本：34,998,303.4 万元人民币

存续期间：持续经营

联系电话：010-66060069

传真：010-68121816

联系人：秦一楠

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分，总行设在北京。经国务院批准，中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于 2009 年 1 月 15 日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡，成为国内网点最多、业务辐射范围最广，服务领域最广，服务对象最多，业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外，中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉，每年位居《财富》世界 500 强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行，中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念，坚持审慎稳健经营、可持续发展，立足县域和城市两大市场，实施差异化竞争策略，着力打造“伴你成长”服务品牌，依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品，致力为广大客户提供优质的金融服务，与广大客户共创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行，经验丰富，服务优质，业绩突出，2004 年被英国《全球托管人》评为中国“最佳托管银行”。2007 年中国农业银行通过了美国 SAS70 内部控制审计，并获得无保留意见的 SAS70 审计报告。自 2010 年起中国农业银行连续通过托管业务国际内控标准（ISAE3402）认证，表明了独立公正第三方对中国农

业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设,品牌声誉进一步提升,在2010年首届“‘金牌理财’TOP10颁奖盛典”中成绩突出,获“最佳托管银行”奖。2010年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的“最佳资产托管奖”。2012年荣获第十届中国财经风云榜“最佳资产托管银行”称号;2013年至2017年连续荣获上海清算所授予的“托管银行优秀奖”和中央国债登记结算有限责任公司授予的“优秀托管机构奖”称号;2015年、2016年荣获中国银行业协会授予的“养老金业务最佳发展奖”称号;2018年荣获中国基金报授予的公募基金20年“最佳基金托管银行”奖;2019年荣获证券时报授予的“2019年度资产托管银行天玑奖”称号;2020年被美国《环球金融》评为中国“最佳托管银行”。

中国农业银行证券投资基金托管部于1998年5月经中国证监会和中国人民银行批准成立,目前内设综合管理部、业务管理部、客户一部、客户二部、客户三部、客户四部、风险合规部、产品研发与信息技术部、营运一部、营运二部,拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

## 2、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工近310名,其中具有高级职称的专家60名,服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强,高级管理层均有20年以上金融从业经验和高级技术职称,精通国内外证券市场的运作。

## 3、基金托管业务经营情况

截止到2021年12月31日,中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共691只。

### (二) 基金托管人的内部风险控制制度说明

#### 1、内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定,守法经营、规范运作、严格监察,确保业务的稳健运行,保证基金财产的安全完整,确保有关信息的真实、准确、完整、及时,保护基金份额持有人的合法权益。

#### 2、内部控制组织结构

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

#### 3、内部控制制度及措施

具备系统、完善的制度控制体系,建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程,可以保证托管业务的规范操作和顺利进行;业务人员具备从业资格;业务管理实行严格

的复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

(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

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

当基金出现异常交易行为时，基金托管人应当针对不同情况进行以下方式的处理：

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

## 五、相关服务机构

(一) 基金销售机构

1、直销机构

名称：工银瑞信基金管理有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街5号、甲5号9层甲5号901

办公地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦A座6-9层

法定代表人：赵桂才

全国统一客户服务电话：400-811-9999

传真：010-81042588、010-81042599

联系电话：010-66583282

联系人：张钦

公司网址：[www.icbccs.com.cn](http://www.icbccs.com.cn)

直销机构网点信息：

本公司直销中心及直销电子自助交易系统（含APP、网上交易、微信自助交易）销售本基金，网点具体信息详见本公司网站。

2、其他销售机构

(1) 中国工商银行股份有限公司



注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：陈四清

联系人：官学清

电话：010-66105799 95588

传真：010-66107914

客户服务电话：95588

网址：<http://www.icbc.com.cn/>

(2) 中国农业银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座

法定代表人：谷澍

联系人：秦一楠

电话：010-66060069

传真：010-68121816

客户服务电话：95599

网址：<http://www.abchina.com>

(3) 交通银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 188

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188

法定代表人：任德奇

联系人：高天

电话：021-58781234

传真：021-58408483

客户服务电话：95559

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

(4) 招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：缪建民

联系人：季平伟

电话：0755-83198888

传真：0755—83195049

客户服务电话：95555

网址：<http://www.cmbchina.com/>

(5) 兴业银行股份有限公司

注册地址：福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦

办公地址：福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦

法定代表人：吕家进

联系人：孙琪虹

电话：021-52629999

传真：0591-87842633

客户服务电话：95561

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

(6) 中国光大银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心

办公地址：北京市西城区太平桥大街 25 号光大中心

法定代表人：李晓鹏

联系人：朱红

电话：010—63636153

传真：010—63636157

客户服务电话：95595

网址：<http://www.cebbank.com>

(7) 中国民生银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：高迎欣

联系人：董云巍

电话：010—58560666

传真：010—57092611

客户服务电话：95568

网址：<http://www.cmbc.com.cn/>

(8) 中国邮政储蓄银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 3 号

办公地址：北京市西城区金融大街 3 号 A 座

法定代表人：刘建军

联系人：马强

电话：010-68857221

传真：010-68858165

客户服务电话：95580

网址：www.psbc.com

(9) 平安银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南东路 5047 号平安银行大厦

办公地址：广东省深圳市福田区益田路 5023 号平安金融中心 B 座 26 楼

法定代表人：谢永林

联系人：赵杨

电话：0755-82080387

传真：0755-82080386

客户服务电话：95511-3

网址：<http://www.bank.pingan.com>

(10) 宁波银行股份有限公司

注册地址：浙江省宁波市宁东路 345 号

办公地址：浙江省宁波市宁东路 345 号

法定代表人：陆华裕

联系人：胡技勋

电话：0574-89068340

传真：0574-87050024

客户服务电话：95574

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

(11) 青岛银行股份有限公司

注册地址：山东省青岛市崂山区秦岭路 6 号 3 号楼

办公地址：山东省青岛市崂山区秦岭路 6 号 3 号楼

法定代表人：郭少泉

联系人：吕岚

电话：0532-85709728

传真：0532-85783866

网址：<http://www.qdccb.com/>

(12) 汉口银行股份有限公司

注册地址：湖北省武汉市江汉区建设大道 933 号

办公地址：湖北省武汉市江汉区建设大道 933 号

法定代表人：陈新民

联系人：李欣

电话：027-82656704

传真：027-82656236

客户服务电话：96558（武汉）4006096558（全国）

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

(13) 江苏银行股份有限公司

注册地址：江苏省南京市中华路 26 号

办公地址：江苏省南京市中华路 26 号

法定代表人：夏平

联系人：张洪玮

电话：025-58587036

传真：025-58587820

客户服务电话：95319

网址：<http://www.jsbchina.cn>

(14) 东莞农村商业银行股份有限公司

注册地址：广东省东莞市东城区鸿福东路 2 号

办公地址：广东省东莞市东城区鸿福东路 2 号

法定代表人：王耀球

联系人：洪晓琳

电话：0769-22866143

传真：0769-22866282

客户服务电话：0769-961122

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

(15) 青岛农村商业银行股份有限公司

注册地址：山东省青岛市崂山区秦岭路 6 号

办公地址：山东省青岛市崂山区秦岭路 6 号

法定代表人：刘仲生

联系人：李洪姣

电话：0532-66957228

传真：0532-66957536

客户服务电话：96668（青岛）；400-11-96668（全国）

网址：www.qrcb.com.cn

（16）中信百信银行股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安定路5号院3号楼8层

办公地址：北京市朝阳区安定路5号院3号楼中建财富国际中心6层-11层

法定代表人：李如东

联系人：白泽凡

电话：010-50925699

传真：010-50925690

网址：www.aibank.com

（17）国泰君安证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路618号

办公地址：上海市静安区南京西路768号国泰君安大厦

法定代表人：贺青

联系人：黄博铭

电话：021-38676666

传真：021-38670666

客户服务电话：400-8888-666 / 95521

网址：<http://www.gtja.com/>

（18）中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街188号

法定代表人：王常青

联系人：谢欣然

电话：010-86451810

传真：010-65186399

客户服务电话：95587/4008-888-108

网址：www.csc108.com

（19）国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址：广东省深圳市福田区福华一路 125 号国信金融大厦

法定代表人：张纳沙

联系人：李颖

电话：0755—82130833

传真：0755—82133952

客户服务电话：95536

网址：<http://www.guosen.com.cn/>

(20) 招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区福华一路 111 号招商证券大厦

办公地址：深圳市福田区福华一路 111 号招商证券大厦

法定代表人：霍达

联系人：黄婵君

电话：0755-82943666

传真：0755-83734343

客户服务电话：95565、4008888111

网址：<http://www.newone.com.cn/>

(21) 广发证券股份有限公司

注册地址：广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街 2 号 618 室

办公地址：广州市天河区马场路 26 号广发证券大厦 36 楼

法定代表人：孙树明

联系人：陈姗姗

电话：020—66336146

传真：020-87553600

客户服务电话：95575 或致电各地营业网点

网址：<http://www.gf.com.cn/>

(22) 中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座）

办公地址：广东省深圳市福田区中信三路 8 号中信证券大厦，北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人：张佑君

联系人：王一通

电话：010-60836029，0755-23835888

传真：010-6083 6029

客户服务电话：95548

网址：<http://www.citics.com/>

(23) 中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市丰台区西营街8号院1号楼7至18层101

办公地址：北京市丰台区西营街8号院1号楼青海金融大厦

法定代表人：陈亮

联系人：辛国政

电话：010-80928123

传真：010-66568640

客户服务电话：4008-888-888、95551

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

(24) 海通证券股份有限公司

注册地址：上海市黄浦区广东路689号

办公地址：上海市黄浦区广东路689号海通证券大厦

法定代表人：周杰

联系人：金芸、李笑鸣

电话：021-23219000

传真：021-23219100

客户服务电话：95553

网址：<http://www.htsec.com/>

(25) 申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路989号45层

办公地址：上海市徐汇区长乐路989号45层（邮编：200031）

法定代表人：杨玉成

联系人：余洁

电话：021-33389888

传真：021-33388224

客户服务电话：95523 或 4008895523

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

(26) 兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 268 号

办公地址：上海市浦东新区长柳路 36 号

法定代表人：杨华辉

联系人：乔琳雪

电话：021-38565547

传真：0591-38281508

客户服务电话：95562

网址：www.xyzq.com.cn

(27) 湘财证券股份有限公司

注册地址：湖南省长沙湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼

办公地址：湖南省长沙湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼

法定代表人：林俊波

联系人：周卫青

电话：0731-84451488

传真：0731-84413288

网址：<http://www.xcsc.com>

(28) 万联证券股份有限公司

注册地址：广州市天河区珠江东路 11 号 18、19 楼全层

办公地址：广东省广州市天河区珠江东路 13 号高德置地广场 E 座 12 层

法定代表人：袁笑一

联系人：丁思

电话：020-83988334

传真：020-38286588

客户服务电话：95322

网址：[www.wlzq.cn](http://www.wlzq.cn)

(29) 渤海证券股份有限公司

注册地址：天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

办公地址：天津市南开区滨水西道 8 号

法定代表人：王春峰

联系人：蔡霆

电话：022-28451991

传真：022-28451892



客户服务电话：4006515988

网址：<http://www.ewww.com.cn>

(30) 华泰证券股份有限公司

注册地址：南京市江东中路 228 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街丰盛胡同 28 号太平洋保险大厦 A 座 8 层

法定代表人：张伟

联系人：郭力铭

电话：(010) 57615957

传真：(010) 57617065

客户服务电话：95597

网址：<http://www.htsc.com.cn/>

(31) 山西证券股份有限公司

注册地址：山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

办公地址：山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

法定代表人：王怡里

联系人：王怡里

电话：0351-8686668

传真：0351-8686918

网址：<http://www.sxzq.com>

(32) 中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001

办公地址：青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座 5 层

法定代表人：冯恩新

联系人：焦刚

电话：0531-89606166

传真：0532-85022605

客户服务电话：95548

网址：[sd.citics.com](http://sd.citics.com)

(33) 信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

办公地址：北京市西城区宣武门西大街甲 127 号大成大厦 6 层

法定代表人：高冠江

联系人：唐静

电话：010-83252182

传真：010-63080978

客户服务电话：95321

网址：<http://www.cindasc.com>

（34）光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：刘秋明

联系人：郁疆

电话：021-22169999

传真：021-22169964

客户服务电话：95525

网址：<http://www.ebscn.com/>

（35）中信证券华南股份有限公司

注册地址：广州市天河区临江大道 395 号天德广场 T1 楼 10 楼

办公地址：广州市天河区珠江西路 5 号 501 房

法定代表人：胡伏云

联系人：陈靖

电话：020-88836999

传真：020-88836984

客户服务电话：（020）95396

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

（36）国联证券股份有限公司

注册地址：无锡市县前东街 168 号

办公地址：江苏省无锡市太湖新城金融一街 8 号国联金融大厦 702 室

法定代表人：范炎

联系人：沈刚

电话：0510-82831662

传真：0510-82830162

客户服务电话：95570

网址：<http://www.glsc.com.cn>

(37) 平安证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街益田路 5023 号平安金融中心 B 座第 22-25 层

办公地址：深圳市福田区福田街益田路 5023 号平安金融中心 B 座第 22-25 层

法定代表人：何之江

联系人：周驰

电话：021-58991896

传真：0755-82400862

客户服务电话：95511-8

网址：[www.stock.pingan.com](http://www.stock.pingan.com)

(38) 华安证券股份有限公司

注册地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

办公地址：安徽省合肥市南二环 959 号财智中心 B1 座

法定代表人：章宏韬

联系人：范超

电话：0551-65161821

传真：0551-65161672

客户服务电话：95318

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

(39) 中原证券股份有限公司

注册地址：郑州市郑东新区商务外环路 10 号

办公地址：郑州市郑东新区商务外环路 10 号

法定代表人：菅明军

联系人：程月艳 李盼盼 党静

电话：0371-69099882

传真：0371-65585899

客户服务电话：95377

网址：<http://www.ccnew.com/>

(40) 国都证券股份有限公司

注册地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

办公地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

法定代表人：翁振杰

联系人：刘河斌

电话：010-87413633

传真：010-84183311

客户服务电话：400-818-8118

网址：www.guodu.com

(41) 国盛证券有限责任公司

注册地址：江西省南昌市新建区子实路 1589 号

办公地址：江西省南昌市红谷滩新区凤凰中大道 1115 号北京银行南昌分行营业大楼

法定代表人：徐丽峰

联系人：占文驰

电话：0791-86283372

传真：0791-86281305

客户服务电话：956080

网址：<http://www.gszq.com/>

(42) 华西证券股份有限公司

注册地址：四川省成都市高新区天府二街 198 号华西证券大厦

办公地址：四川省成都市高新区天府二街 198 号华西证券大厦

法定代表人：杨炯洋

联系人：谢国梅

电话：028-86150207

传真：028-86150100

客户服务电话：95584

网址：[www.hx168.com.cn](http://www.hx168.com.cn)

(43) 申万宏源西部证券有限公司

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

办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室（邮编：830002）

法定代表人：王献军

联系人：梁丽

电话：0991-2307105

传真：0991-2301927

客户服务电话：95523 或 4008895523

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

(44) 中泰证券股份有限公司

注册地址：济南市市中区经七路 86 号

办公地址：山东省济南市市中区经七路 86 号

法定代表人：李峰

联系人：朱琴

电话：021-20315161

传真：021-20315125

客户服务电话：95538

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

(45) 德邦证券股份有限公司

注册地址：上海市普陀区曹杨路 510 号南半幢 9 楼

办公地址：上海市浦东新区福山路 500 号城建国际中心 26 楼

法定代表人：武晓春

联系人：刘熠

电话：021-68761616

传真：021-68761616

客户服务电话：4008888128

网址：<http://www.tebon.com.cn>

(46) 西部证券股份有限公司

注册地址：陕西省西安市新城东大街 319 号 8 幢 10000 室

办公地址：陕西省西安市新城东大街 319 号 8 幢 10000 室

法定代表人：刘建武

联系人：黄斌

电话：029-87406088 87406081 87406171

传真：029-87406100 87406259

网址：<http://www.west95582.com>

(47) 华福证券有限责任公司

注册地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层

办公地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7 至 10 层

法定代表人：黄金琳

联系人：张腾

电话：0591—87383623

传真：0591—87383610

客户服务电话：96326（福建省外请加拨 0591）

网址：<http://www.hfzq.com.cn>

（48）华龙证券股份有限公司

注册地址：甘肃省兰州市静宁路 308 号

办公地址：甘肃省兰州市城关区东岗西路 638 号财富大厦

法定代表人：祁建邦

联系人：周鑫

电话：0931-4890208

传真：0931-4890628

客户服务电话：0931-4890619 4890618 4890100

网址：<http://www.hlzqgs.com/>

（49）中国国际金融股份有限公司

注册地址：中国北京建国门外大街 1 号 国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

办公地址：中国北京建国门外大街 1 号 国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

法定代表人：毕明建

联系人：任敏

电话：010—65051166

传真：010—65058065

客户服务电话：010-65051166

网址：<http://www.cicc.com.cn/>

（50）上海华信证券有限责任公司

注册地址：浙江省宁波市鄞州区海晏北路 565、577 号 8-11 层

办公地址：浙江省宁波市鄞州区海晏北路 565、577 号 8-11 层

法定代表人：李抱

联系人：李兴

电话：021-6389-8610

传真：021-68776977-8610

客户服务电话：400-916-0666

网址：<http://www.yongxings.com>

（51）中国中金财富证券有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层-21 层及第 04 层 01、02、03、05、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、23 单元

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

法定代表人：高涛

联系人：万玉琳

电话：0755-82026907

传真：0755-82026590

客户服务电话：4006008008

网址：<https://www.ciccwm.com>

(52) 江海证券有限公司

注册地址：哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

办公地址：哈尔滨市松北区创新三路 833 号

法定代表人：赵洪波

联系人：姜志伟

电话：0451-87765732

传真：0451-82337279

客户服务电话：400-666-2288

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

(53) 国金证券股份有限公司

注册地址：成都市东城根上街 95 号

办公地址：四川省成都市青羊区东城根上街 95 号 13 楼

法定代表人：冉云

联系人：杜晶、黎建平

电话：028-86690057

传真：028-86690365

客户服务电话：95310

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

(54) 长城国瑞证券有限公司

注册地址：福建省厦门市思明区莲前西路 2 号莲富大厦 17 楼

办公地址：福建省厦门市思明区深田路 46 号深田国际大厦 20F

法定代表人：王勇

联系人：邱震

电话：0592-2079259

传真：0592-2079602

客户服务电话：400-0099-886

网址：www.gwgsc.com

(55) 天风证券股份有限公司

注册地址：湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦4楼

办公地址：湖北省武汉市中南路99号保利广场A座48楼

法定代表人：余磊

联系人：杨晨

电话：027-87618889

传真：027-87618863

客户服务电话：95391

网址：<http://www.tfzq.com>

(56) 大通证券股份有限公司

注册地址：辽宁省大连市沙河口区会展路129号大连国际金融中心A座-大连期货大厦  
38、39层

办公地址：辽宁省大连市沙河口区会展路129号大连国际金融中心A座-大连期货大厦

38、39层

法定代表人：董永成

联系人：岑汉峰、詹昕达

电话：4008-169-169 021-61762612

传真：021-61763699

客户服务电话：4008-169-169

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

(57) 万和证券股份有限公司

注册地址：海口市南沙路49号通信广场二楼

办公地址：深圳市福田区深南大道7028号时代科技大厦西厅20层

法定代表人：冯周让

联系人：王少峰

电话：0755-82830333

传真：0755-25842783

客户服务电话：4008-882-882



网址：<http://www.wanhesec.com.cn/>

(58) 太平洋证券股份有限公司

注册地址：云南省昆明市青年路 389 号志远大厦 18 层

办公地址：北京市西城区北展北街 9 号华远企业号 D 座 3 单元

法定代表人：李长伟

联系人：王婧

电话：010-88321763

传真：0871-68898100

客户服务电话：4006650999

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

(59) 深圳证券交易所

注册地址：深圳市罗湖区深南东路深业中心 2-5 层、7-19 层

办公地址：深圳市福田区莲花街道福田区深南大道 2012 号

法定代表人：桂敏杰

网址：[szse.cn](http://szse.cn)

(60) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道民田路 178 号华融大厦 27 层 2704

办公地址：北京市西城区宣武门外大街 28 号富卓大厦 16 层

法定代表人：马勇

联系人：文雯

电话：010-83363101

传真：0010-83363072

客户服务电话：4008-166-1188

网址：<http://8.jrj.com.cn/>

(61) 和讯信息科技有限公司

注册地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号 1002 室

办公地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

法定代表人：王莉

联系人：陈慧慧

电话：010-85657353

传真：010-65884788

客户服务电话：400-920-0022

网址：<http://www.licaike.com/>

(62) 江苏汇林保大基金销售有限公司

注册地址：南京市高淳区经济开发区古檀大道 47 号

办公地址：南京市鼓楼区中环国际 1413 室

法定代表人：吴言林

联系人：林伊灵

电话：025-66046166-810

传真：025-66046166

客户服务电话：025-56663409

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

(63) 上海挖财基金销售有限公司

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

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

法定代表人：冷飞

联系人：孙琦

电话：021-50810683

传真：021-50810673

客户服务电话：021-50810687

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

(64) 北京度小满基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区西北旺东路 10 号院西区 4 号楼 1 层 103 室

办公地址：北京市海淀区西北旺东路 10 号院西区 4 号楼

法定代表人：葛新

联系人：孙博超

电话：010-59403028

传真：95055-4

客户服务电话：010-59403027

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

(65) 诺亚正行基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

办公地址：上海市杨浦区长阳路 1687 号 2 号楼

法定代表人：汪静波

联系人：谭静怡

电话：021-80358749

传真：021-38509777

客户服务电话：4008-215-399

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

（66）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号楼二层

办公地址：上海市徐汇区宛平南路88号东方财富大厦

法定代表人：其实

联系人：潘世友

电话：021-54509977

传真：021-64385308

客户服务电话：95021/400-1818-188

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

（67）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9楼

法定代表人：杨文斌

联系人：王诗琦

电话：021-20613999

传真：021-68596916

客户服务电话：400-700-9665

网址：<http://www.ehowbuy.com>

（68）蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路969号3幢5层599室

办公地址：浙江省杭州市西湖区西溪路556号

法定代表人：王珺

联系人：韩爱彬

电话：0571-28829790、021-60897869

传真：0571-26698533

客户服务电话：4000-766-123

网址：<http://www.fund123.cn/>

(69) 上海长量基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区东方路 1267 号 11 层

法定代表人：张跃伟

联系人：常艳琴

电话：021-20691832

传真：021-20691861

客户服务电话：400-089-1289

网址：<http://www.erichfund.com>

(70) 浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903 室

办公地址：杭州市余杭区五常街道同顺路 18 号同花顺大楼

法定代表人：凌顺平

联系人：吴强

电话：0571-88911818

传真：0571-86800423

客户服务电话：4008-773-772

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

(71) 北京展恒基金销售股份有限公司

注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号

办公地址：北京市朝阳区安苑路 15-邮电新闻大厦 6 层

法定代表人：闫振杰

联系人：李晓芳

电话：010-59601366-7167

传真：0351-4110714

客户服务电话：400-818-8000

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

(72) 上海利得基金销售有限公司

注册地址：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室

办公地址：上海市虹口区东大名路 1098 号浦江金融世纪广场 18F

法定代表人：李兴春

联系人：郭丹妮

电话：021-50583533

传真：021-61101630

客户服务电话：400-921-7755

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

(73) 嘉实财富管理有限公司

注册地址：海南省三亚市天涯区三亚湾路国际客运港区国际养生度假中心酒店B座(2#楼) 27楼 2714室

办公地址：北京市朝阳区建国路91号金地中心A座6层

法定代表人：张峰

联系人：李雯

电话：010-60842306

传真：010-85097308

客户服务电话：400-021-8850

网址：<http://www.harvestwm.cn/>

(74) 北京创金启富基金销售有限公司

注册地址：北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A

办公地址：北京市西城区白纸坊东街2号经济日报社综合楼A座712

法定代表人：梁蓉

联系人：王瑶

电话：010-66154828

传真：010-66154828

客户服务电话：010-63583991

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

(75) 泛华普益基金销售有限公司

注册地址：成都市成华区建设路9号高地中心1101室

办公地址：成都市锦江区东大街99号平安金融中心1501室

法定代表人：于海锋

联系人：陈金红

电话：028-86758820-803

传真：028-82000996-805

客户服务电话：4000803388

网址：<http://www.puyifund.com/>

(76) 宜信普泽（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809

办公地址：北京市朝阳区建国路 88 号 SOHO 现代城 C 座 1809

法定代表人：戎兵

联系人：魏晨

电话：010-52413385

传真：010-85894285

客户服务电话：400-609-9200

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

(77) 南京苏宁基金销售有限公司

注册地址：江苏省南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

办公地址：江苏省南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

法定代表人：王锋

联系人：张慧

电话：025-66996699-882796

传真：025-66008800-884131

客户服务电话：95177

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

(78) 北京格上富信基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区东三环北路 19 号楼 701 内 09 室

办公地址：北京市朝阳区东三环北路 19 号楼 701 内 09 室

法定代表人：李悦章

联系人：张林

电话：400-066-8586

传真：010-85594745

客户服务电话：010-85932427

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

(79) 浦领基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区望京东园四区 2 号楼 10 层 1001 号 04 室

办公地址：北京市朝阳区望京浦项中心 A 座 9 层 04-08

法定代表人：聂婉君

联系人：李艳

电话：010-59497361

传真：010-64788016

客户服务电话：400-876-9988

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

(80) 通华财富（上海）基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区同丰路 667 弄 107 号 201 室

办公地址：上海市浦东新区金沪路 55 号通华科技大厦 7 层

法定代表人：沈丹义

联系人：杨徐霆

电话：021-60818249

传真：021-60818187

客户服务电话：400-101-9301

网址：<https://www.tonghuafund.com>

(81) 北京中植基金销售有限公司

注册地址：北京市北京经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室

办公地址：北京朝阳区大望路金地中心 A 座 28 层

法定代表人：武建华

联系人：丛瑞丰

电话：010-59313555

传真：(010) 56642623

客户服务电话：400-8180-888

网址：<http://www.zzfund.com>

(82) 北京汇成基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108 号

办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲 1 号环球财讯中心 D 座 401

法定代表人：王伟刚

联系人：王骁骁

电话：010-56251471

传真：400-619-9059

客户服务电话：010-62680827

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

(83) 一路财富（北京）基金销售股份有限公司

注册地址：北京市西城区阜成门外大街 2 号 1 幢 2208 室

办公地址：北京市西城区阜成门大街 2 号万通新世界广场 A 座 2208

法定代表人：吴雪秀

联系人：徐越

电话：010-88312877-8032

传真：88312877

客户服务电话：400-001-1566

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

(84) 北京钱景基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012

办公地址：北京市海淀区丹棱街丹棱 SOH01008

法定代表人：赵荣春

联系人：高静

电话：010-59158282 4008936885

传真：010-57569671

网址：<http://www.qianjing.com>

(85) 北京唐鼎耀华基金销售有限公司

注册地址：北京市延庆县延庆经济开发区百泉街 10 号 2 栋 236 室

办公地址：北京市朝阳区建国门外大街 19 号 A 座 1505 室

法定代表人：张冠宇

联系人：王国壮

电话：010-85934903

传真：010-59200800

客户服务电话：400-819-9868

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

(86) 海银基金销售有限公司

注册地址：中国(上海)自由贸易试验区银城中路 8 号 402 室

办公地址：上海市浦东新区银城中路 8 号 4 楼

法定代表人：刘惠

联系人：毛林

电话：021-80133597

传真：400-808-1016



客户服务电话：021-80133413

网址：www.fundhaiyin.com

(87) 北京广源达信基金销售有限公司

注册地址：北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座六层 605 室

办公地址：北京市朝阳区宏泰东街浦项中心 B 座 19 层

法定代表人：齐剑辉

联系人：姜英华

电话：010-52798634

传真：400-623-6060

客户服务电话：010-82055860

网址：www.niuniufund.com

(88) 上海大智慧基金销售有限公司

注册地址：上海浦东杨高南路 428 号 1 号楼 10-11 层

办公地址：上海浦东杨高南路 428 号 1 号楼 10-11 层

法定代表人：申健

联系人：张蜓

电话：021-20219988\*35374

传真：021-20219923

客户服务电话：021-20292031

网址：<https://www.wg.com.cn/>

(89) 北京新浪仓石基金销售有限公司

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

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

法定代表人：穆飞虎

联系人：穆飞虎

电话：010-58982465

传真：010-62676582

客户服务电话：010-62675369

网址：www.xincai.com

(90) 济安财富（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区太阳宫中路 16 号院 1 号楼 3 层 307

办公地址：北京市朝阳区太阳宫中路 16 号院 1 号楼 3 层 307

法定代表人：杨健

联系人：李海燕

电话：010-65309516

传真：400-673-7010

客户服务电话：010-65330699

网址：www.jianfortune.com

(91) 上海万得基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

办公地址：上海市浦东新区浦明路 1500 号万得大厦 11 楼

法定代表人：王廷富

联系人：徐亚丹

电话：021-50712782

传真：400-821-0203

客户服务电话：021-50710161

网址：www.520fund.com.cn

(92) 上海联泰基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室

办公地址：上海市长宁区福泉北路 518 号 8 号楼 3 层

法定代表人：尹彬彬

联系人：兰敏

电话：021-52822063

传真：400-166-6788

客户服务电话：021-52975270

网址：www.66zichan.com

(93) 上海汇付基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区黄河路 333 号 201 室 A 区 056 单元

办公地址：上海市徐汇区宜山路 700 号普天信息产业园 2 期 C5 栋 2 楼

法定代表人：金佶

联系人：沈娟

电话：8621-34013996

客户服务电话：8621-34013999

网址：<https://www.hotjijin.com/>

(94) 上海基煜基金销售有限公司

注册地址：上海市崇明县长兴镇路潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室（上海泰和经济发展区）

办公地址：上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 1503 室

法定代表人：王翔

联系人：吴鸿飞

电话：021-65370077-268

传真：400-820-5369

客户服务电话：021-55085991

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

(95) 上海凯石财富基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区西藏南路 765 号 602-115 室

办公地址：上海市黄浦区延安东路 1 号凯石大厦 4 楼

法定代表人：陈继武

联系人：高皓辉

电话：021-63333389

传真：4006433389

客户服务电话：021-63333390

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

(96) 北京虹点基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区工人体育场北路甲 2 号裙房 2 层 222 单元

办公地址：北京市朝阳区工人体育场北路甲 2 号裙房 2 层 222 单元

法定代表人：郑毓栋

联系人：陈铭洲

电话：010-65951887

传真：400-618-0707

客户服务电话：010-65951887

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

(97) 上海陆金所基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号

法定代表人：王之光

联系人：宁博宇

电话：021-20665952

传真：4008219031

客户服务电话：021-22066653

网址：www.lufunds.com

（98）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：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼 B1201-1203

法定代表人：肖雯

联系人：邱湘湘

电话：020-89629099

传真：020-89629066

客户服务电话：020-89629011

网址：www.yingmi.cn

（99）奕丰基金销售有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市南山区海德三道航天科技广场 A 座 17 楼 1704 室

法定代表人：TEO WEE HOWE

联系人：叶健

电话：0755-89460500

传真：400-684-0500

客户服务电话：0755-21674453

网址：www.ifastps.com.cn

（100）中证金牛（北京）投资咨询有限公司

注册地址：北京市丰台区东管头 1 号 2 号楼 2-45 室

办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲 1 号环球财讯中心 A 座 5 层

法定代表人：钱昊旻

联系人：沈晨

电话：010-59336544

传真：4008-909-998

客户服务电话：010-59336586

网址：www.jnlc.com

(101) 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：北京市通州区亦庄经济技术开发区科创十一街 18 号院京东集团总部 A 座 17 层

法定代表人：王苏宁

联系人：陈龙鑫

电话：95118

传真：010-89189566

客户服务电话：010-89189566

网址：kenterui.jd.com

(102) 大连网金基金销售有限公司

注册地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号诺德大厦 2 层 202 室

办公地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号诺德大厦 2 层 202 室

法定代表人：樊怀东

联系人：贾伟刚

电话：0411-39027808

传真：0411-39027835

客户服务电话：4000-899-100

网址：www.yibaijin.com

(103) 北京雪球基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507

办公地址：北京市朝阳区创远路 34 号院融新科技中心 C 座 17 层

法定代表人：钟斐斐

联系人：侯芳芳

电话：010-61840688

传真：010-84997571

客户服务电话：400-159-9288

网址：<https://danjuanapp.com>

(104) 万家财富基金销售（天津）有限公司

注册地址：天津自贸区（中心商务区）迎宾大道 1988 号滨海浙商大厦公寓 2-2413 室

办公地址：北京市西城区丰盛胡同 28 号太平洋保险大厦 A 座 5 层

法定代表人：戴晓云

联系人：王茜蕊

电话：010-59093895

传真：010-59013828

客户服务电话：010-59013842

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

（105）上海华夏财富投资管理有限公司

注册地址：上海市虹口区东大名路 687 号 1 幢 2 楼 268 室

办公地址：北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

法定代表人：毛淮平

联系人：仲秋玥

电话：010-88066632

传真：400-817-5666

客户服务电话：010-63136184

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

（106）玄元保险代理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区张杨路 707 号 1105 室

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区张杨路 707 号 1105 室

法定代表人：马永谔

联系人：卢亚博

电话：021-50701053

传真：021-50701053

客户服务电话：021-50701053

网址：[http://www.xyinsure.com/kfit\\_xybx](http://www.xyinsure.com/kfit_xybx)

（107）方德保险代理有限公司

注册地址：北京市西城区阜成门大街 2 号 19 层 A2017

办公地址：北京市西城区阜成门大街 2 号 19 层 A2017

法定代表人：夏予柱

联系人：胡明哲

电话：010-64068617

传真：400-106-0101

客户服务电话：010-68091380

网址：www.fundsure.com

（108）中国人寿保险股份有限公司

注册地址：中国北京市西城区金融大街 16 号

办公地址：中国北京市西城区金融大街 16 号

法定代表人：王滨

联系人：陈慧、王睿

电话：王睿 010-63631751 13608034231、侯文蕾 010-63631543 18813036654

传真：010-66222276

客户服务电话：95519

网址：www.e-chinalife.com

（109）中信建投期货有限公司

注册地址：渝中区中山三路 107 号上站大楼平街 11-B，名义层 11-A，8-B4，9-B、C

办公地址：渝中区中山三路 107 号上站大楼平街 11-B，名义层 11-A，8-B4，9-B、C

法定代表人：王广学

联系人：刘芸

电话：023-86769637

传真：023-86769629

客户服务电话：4008-877-780

网址：<http://www.cfc108.com/>

（110）中信期货有限公司

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

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

法定代表人：张皓

联系人：梁美娜

电话：021-6081 2919

传真：021-6081 9988

客户服务电话：400-990-8826

网址：www.citicsf.com

(111) 腾安基金销售(深圳)有限公司

注册地址: 深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)

办公地址: 深圳市南山区高新科技园科技中一路腾讯大厦11层

法定代表人: 刘明军

联系人: 郑骏锋

电话: 0755-86013388 转 65864

客户服务电话: 95017 转 1 转 8

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

(112) 长江证券股份有限公司

注册地址: 湖北省武汉市江汉区新华路特8号

办公地址: 湖北省武汉市江汉区新华路特8号

法定代表人: 李新华

联系人: 奚博宇

电话: 027-65799866

传真: 027-85481900

客户服务电话: 95579; 4008-888-999

网址: <http://www.95579.com/>

(113) 东方财富证券股份有限公司

注册地址: 西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城10栋楼

办公地址: 上海市徐汇区宛平南路88号东方财富大厦16楼

法定代表人: 戴彦

联系人: 付佳

联系电话: 021-23586603

传真: 021-23586860

公司网址: <http://www.18.cn>

客户咨询电话: 95357

(114) 安信证券股份有限公司

注册地址: 深圳市福田区福田街道福华一路119号安信金融大厦

办公地址: 深圳市福田区福田街道福华一路119号安信金融大厦

法定代表人: 黄炎勋

联系人: 陈剑虹



电话：0755—82825551

传真：0755—82558355

客户服务电话：4008001001

网址：<http://www.essences.com.cn>

（115）第一创业证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼

办公地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 18 楼

法定代表人：刘学民

联系人：常科丰

传真：0755-25838701

客户服务电话：95358

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

（116）长城证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 16-17 层

办公地址：广东省深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

法定代表人：曹宏

联系人：梁浩

电话：0755—83530715

传真：0755—83515567

客户服务电话：4006666888

网址：<http://new.cgws.com/>

（117）博时财富基金销售有限公司

注册地址：深圳市福田区莲花街道福新社区益田路 5999 号基金大厦 19 层

办公地址：深圳市福田区莲花街道福新社区益田路 5999 号基金大厦 19 层

法定代表人：王德英

电话：0755-83169999

传真：0755-83195220

联系人：崔丹

客户服务电话：400-610-5568

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

其中，博时财富基金销售有限公司、东方财富证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、第一创业证券股份有限公司、长城证券股份有限公司仅销售本

基金 C 类份额。

### 3、场内代销机构

场内代销机构为具有基金销售资格的深圳证券交易所场内会员单位。

基金管理人可根据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》和本基金基金合同等的规定，选择其他符合要求的机构销售本基金，详见基金管理人网站。

#### （二）基金注册登记机构

本基金 A 类基金份额的注册登记机构：

名称：中国证券登记结算有限责任公司

注册地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

注册登记业务办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：于文强

电话：4008058058

传真：010-50938907

联系人：赵亦清

本基金 C 类基金份额的注册登记机构：

名称：工银瑞信基金管理有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 5 号、甲 5 号 9 层甲 5 号 901

注册登记业务办公地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 A 座 6 层

法定代表人：赵桂才

全国统一客户服务电话：400-811-9999

传 真：010-66583100

联系人：朱辉毅

#### （三）律师事务所及经办律师

名 称：北京德恒律师事务所

住 所：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座十二层

办公地址：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座十二层

负责人：王丽

电 话：(010) 66575888

传 真：(010) 65232181

经办律师：徐建军、李晓明

#### （四）会计师事务所及经办注册会计师

名称：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

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

办公地址：中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼

执行事务合伙人：李丹

经办注册会计师：魏佳亮、朱寅婷

联系电话：(021) 23238212

传真：(021) 23238800

联系人：魏佳亮

## 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》、《信息披露管理办法》、《业务规则》等有关法律、法规、规章及基金合同，并经中国证券监督管理委员会 2011 年 1 月 4 日证监许可（2011）7 号文核准公开募集。

### （一）基金类别、运作方式及存续期间

基金类别：债券型

基金运作方式：契约型，本基金合同生效后三年内（含三年）为首个封闭期，封闭期间投资者不能申购赎回本基金份额，但可在本基金上市交易后通过证券交易所转让基金份额。在距封闭期届满日 30 个工作日前，基金管理人将以现场或通讯方式召开基金份额持有人大会，投票决定是否同意本基金继续封闭三年。如果封闭期届满前基金份额持有人大会依据有关法律法规和本基金合同第十章的相关规定成功召开并决定进入下一个三年封闭期，经中国证监会核准，则本基金继续封闭三年，即在上个封闭期届满后的次日随即开始下一个三年封闭期。在本基金保持封闭运作方式期间，需在每个封闭期届满前按照前述程序召开基金份额持有人大会并决定基金运作方式。如果封闭期届满前基金份额持有人大会未能依据有关法律法规和本基金合同第十章的相关规定成功召开或基金份额持有人大会上本基金继续封闭的决议未获得通过，则本基金在上个封闭期届满后的次日转为上市开放式基金（LOF），投资者可进行基金份额的申购与赎回，一旦本基金转为上市开放式基金（LOF）后，本基金将以上市开放式基金的模式持续运作，无需每隔三年召开一次基金份额持有人大会决定基金运作方式。

本基金基金份额持有人大会表决投票时间自 2013 年 12 月 9 日起，至 2014 年 1 月 20 日 17:00 止。公司于 2014 年 1 月 23 日发布《工银瑞信基金管理有限公司关于工银瑞信四季收益债券型证券投资基金基金份额持有人大会出席统计结果及基金运作方式变更的公告》，本基金于封闭期届满后的次日起（即 2014 年 2 月 10 日）转为上市开放式基金（LOF），投资人可进行基金份额的申购与赎回。

存续期间：不定期

## （二）基金面值

本基金基金份额初始面值为人民币 1.00 元。

## 七、基金合同的生效

本基金合同已于 2011 年 2 月 10 日生效。

基金合同生效后的存续期内，基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元，基金管理人应当及时报告中国证监会；基金份额持有人数量连续 20 个工作日达不到 200 人，或连续 20 个工作日基金资产净值低于 5000 万元，基金管理人应当及时向中国证监会报告，说明出现上述情况的原因并提出解决方案。法律法规或监管部门另有规定的，按其规定办理。

## 八、基金份额的上市交易

### （一）基金份额的上市交易

本基金 A 类份额已自 2011 年 3 月 28 日起在深圳证券交易所上市。如无特指，本章节涉及的上市份额仅指本基金 A 类基金份额。

根据有关规定，本基金合同生效后，具备以下上市条件，经向深圳证券交易所申请上市交易：

- 1、经中国证监会核准募集且基金合同生效；
- 2、基金合同期限为五年以上；
- 3、基金份额持有人不少于一千人；
- 4、深圳证券交易所规定的其他条件。

### （二）上市交易的规则

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

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

### （三）上市交易的费用

本基金上市交易的费用按照深圳证券交易所有关规定办理。

### （四）上市交易的行情揭示

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

#### (五) 上市交易的停复牌

本基金的停复牌按照相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所的有关规定执行。

#### (六) 暂停上市的情形和处理方式

本基金上市后，发生下列情况之一时，应暂停上市交易：

- 1、不再具备本条第(一)款规定的上市条件；
- 2、违反国家有关法律、法规，中国证监会决定暂停其上市；
- 3、严重违反《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》；
- 4、深圳证券交易所认为应当暂停上市的其他情形。

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

#### (七) 恢复上市的公告

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

#### (八) 终止上市的情形和处理方式

发生下列情况之一时，本基金应终止上市交易：

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

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

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

## 九、基金份额的申购与赎回

本基金合同生效后三年之内(含三年)为首个封闭期，封闭期间投资者不能申购、赎回基金份额，但可在本基金上市交易后通过证券交易所转让基金份额。

本基金已于2014年2月10日转为上市交易开放式基金(LOF)，投资者可进行A类基金份额的申购和赎回。本基金C类基金份额于2022年10月25日开始办理日常申购赎回业务。

本基金的运作方式变更及相关事项详见本基金基金合同第八章。

投资者可通过场外和场内两种方式申购与赎回 A 类基金份额；但仅可通过场外方式申购与赎回 C 类基金份额。

投资者的申购赎回遵循以下规则：

#### （一）申购和赎回场所

基金投资者可以使用基金账户，通过基金管理人、场外代销机构柜台系统办理两类份额场外的申购和赎回业务。基金投资者也可使用深圳证券账户通过深圳证券交易所交易系统办理场内申购和赎回业务，场内代销机构为具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员单位。

投资者应当在基金管理人和场内、场外代销机构办理基金申购、赎回业务或按基金管理人和场内、场外代销机构提供的其他方式办理基金的申购和赎回。本基金场内、场外代销机构名单将由基金管理人在招募说明书、发售公告或基金管理人网站列示。

基金管理人可根据情况变更或增减代销机构，并在基金管理人网站公示。投资者可以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的申购与赎回。

#### （二）申购和赎回的开放日及时间

##### 1、开放日及开放时间

基金投资者在开放日申请办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间。但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。开放日的具体时间和业务办理时间将另行公告。

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、申购与赎回的开始时间

本基金已于 2014 年 2 月 10 日转为上市交易开放式基金（LOF），投资者可进行 A 类基金份额的申购和赎回。本基金 C 类基金份额于 2022 年 10 月 25 日开始办理日常申购赎回业务。

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。本基金开放申购、赎回后，基金投资者在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回申请的，其基金份额申购、赎回价格为下次办理该类基金份额申购、赎回时间所在开放日的价格。

#### （三）申购与赎回的原则

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

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、场外的基金份额赎回业务遵循“先进先出”的业务规则，即先确认的认购或申购的基金份额先赎回；

4、当日的申购、赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；

5、基金投资者申购基金份额时，必须全额交付申购款项，基金投资者交付款项后，申购申请方为有效；

6、投资者通过场外申购、赎回应使用中国证券登记结算有限责任公司开立的深圳开放式基金账户，通过场内申购、赎回应使用中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开立的证券账户（人民币普通股票账户和证券投资基金账户）；

7、本基金的申购、赎回等业务，按照深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则执行。若相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对申购、赎回业务等规则有新的规定，按新规定执行；

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

基金管理人可根据基金运作的实际情况并不影响基金份额持有人实质利益的前提下调整上述原则。基金管理人必须在新规则开始实施前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介及基金管理人网站公告。

#### （四）申购与赎回的数量限制

##### 1、基金申购的限制

场外申购时，投资者每笔最低申购金额为 10 元人民币（含申购费），追加申购每笔最低金额为 10 元人民币（含申购费）。实际操作中，以各销售机构的具体规定为准。场内申购时，单笔申购金额最低为 10 元人民币（含申购费），且为 1 元人民币的整数倍。

投资人将当期分配的基金收益再投资时，不受最低申购金额的限制。

##### 2、基金赎回的限制

基金份额持有人办理场外赎回时，每次赎回基金份额不得低于 10 份，基金份额持有人赎回时或赎回后保留的基金份额余额不足 10 份的，在赎回时需一次全部赎回。实际操作中，以各代销机构的具体规定为准。

基金份额持有人办理场内赎回时，赎回份额必须是整数份额。

如遇巨额赎回等情况发生而导致延期赎回时，赎回办理和款项支付的办法将参照基金合同有关巨额赎回或连续巨额赎回的条款处理。

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，具体规定请参见相关公告。

4、基金管理人可以根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整上述规定的数量或比例限制。基金管理人必须在调整前依照有关规定在指定媒介和基金管理人网站上公告。

#### （五）申购与赎回的程序

1、投资者必须根据基金销售机构规定的程序，在开放日的业务办理时间向基金销售机构提出申购或赎回的申请。

2、投资者在提交申购本基金的申请时，须按销售机构规定的方式备足申购资金；投资者在提交赎回及转换申请时，帐户中必须有足够的基金份额余额，否则所提交的申请无效而不予成交。

3、申购、赎回的确认与通知：基金管理人应以交易时间结束前收到申购和赎回申请的当日作为申购或赎回申请日(T日)，在正常情况下，基金注册登记机构在T+1日内对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请，基金投资者可在T+2日（包括该日）后到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。

基金发售机构申购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表发售机构确实接收到申购申请。申购的确认以基金注册登记机构的确认结果为准。

4、申购、赎回款项支付：申购采用全额缴款方式，若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功。若申购不成功或无效，基金管理人或基金管理人指定的代销机构将基金投资者已缴付的申购款项本金退还给投资者。

基金投资者赎回申请成功后，基金管理人将在T+7日(包括该日)内支付赎回款项。在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照本基金合同有关条款处理。

5、发生延期赎回的情形时，款项的支付办法参照基金合同的有关条款处理。

#### （六）申购费与赎回费

1、本基金基金份额分为A类和C类基金份额。投资人申购A类基金份额时支付申购费用，申购C类基金份额不支付申购费用，而是从该类别基金资产中计提销售服务费。

##### 2、申购费用

本基金对A类基金份额申购设置级差费率，投资者在一天之内如有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。

本基金A类基金份额的申购费率如下表所示：

申购金额M（含申购费）	申购费率
M<100万	0.8%
100万≤M<300万	0.5%
300万≤M<500万	0.3%
500万≤M	按笔收取，1000元/笔

本基金A类基金份额的申购费用由申购A类基金份额的投资人承担，不列入基金资产，



用于基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

### 3、赎回费用

(1) 本基金 A 类基金份额场内赎回费率：

持有期限 (N)	赎回费率
N<7 天	1.50%
N≥7 天	0.10%

(2) 本基金 A 类基金份额场外赎回费率：本基金 A 类基金份额场外赎回费率按基金份额持有期限递减（如下表所示）

持有期限 (N)	赎回费率
N<7 天	1.50%
7 天≤N<30 天	0.75%
30 天≤N<1 年	0.10%
1 年≤N<2 年	0.05%
2 年≤N	0.00%

(3) 本基金 C 类基金份额赎回费率：本基金 C 类基金份额赎回费率按基金份额持有期限递减（如下表所示）

持有期限 (N)	赎回费率	
N<7 天	1.5%	
7 天≤N<30 天	0.5%	
30 天≤N	0%	

注：1 年指 365 天。根据《开放式证券投资基金销售费用管理规定》，按以上标准对持有期限少于 30 天的持有人收取的基金赎回费全额计入基金资产，对持有期限在 30 天以上的持有人收取的基金赎回费的 25%归基金资产所有。认购/申购的基金份额持有期限自注册登记系统确认之日起开始计算，自该部分基金份额赎回确认日止，且基金份额赎回确认日不计入持有期。

赎回费用的计算方法：赎回费用=赎回份额×赎回受理当日该类基金份额净值×赎回费率

赎回费用由赎回人承担，在投资者赎回基金份额时收取。

4、基金管理人可以在履行相关手续后，在基金合同约定的范围内调整申购、赎回费率或调整收费方式，基金管理人依照有关规定在最迟应于新的费率或收费方式实施日前在指定媒介和基金管理人网站上公告。

5、对特定交易方式（如网上交易、电话交易等），基金管理人可以采用低于柜台交易方式的基金申购费率和基金赎回费率。

6、基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情况下根据市场情况制定

基金促销计划，针对基金投资者定期和不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，基金管理人可以按中国证监会要求履行必要手续后，对基金投资者适当调整基金申购费率、赎回费率和转换费率。

#### （七）申购份额与赎回金额的计算方式

##### 1、A 类基金份额的申购

申购 A 类基金份额的计算方式：申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除申购费用后除以申请当日 A 类基金份额净值，有效份额单位为份，场内申购份额的计算采用截尾法保留至整数位，不足 1 份部分对应的申购资金将返回给投资者。场外申购份额的计算以四舍五入的方法保留小数点后两位，由此产生的收益或损失归基金财产。

A 类基金份额的申购金额包括申购费用和净申购金额，其中：

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

（注：对于适用固定金额申购费用的申购，净申购金额 = 申购金额 - 固定申购费用金额）

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

（注：对于适用固定金额申购费用的申购，申购费用 = 固定申购费用金额）

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

例：某投资者投资 1 万元申购本基金的 A 类基金份额，对应费率为 0.8%，假设申购当日 A 类基金份额净值为 1.0100 元，若投资者选择场外申购，则其可得到 A 类基金份额为：

$$\text{净申购金额} = 10,000 / (1 + 0.8\%) = 9,920.63 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 10,000 - 9,920.63 = 79.37 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 9,920.63 / 1.0100 = 9,822.41 \text{ 份}$$

若投资者选择场内申购 A 类基金份额，场内申购份额保留至整数份，故投资者申购所得 A 类基金份额为 9,822 份，整数位后小数部分的申购份额对应的资金返还投资者。退款金额为：

$$\text{实际净申购金额} = 9,822 \times 1.0100 = 9,920.22 \text{ 元}$$

$$\text{退款金额} = 10,000 - 9,920.22 - 79.37 = 0.41 \text{ 元}$$

##### 2、C 类基金份额的申购

申购 C 类基金份额的计算方式如下：申购的有效份额为按实际确认的申购金额除以申请当日 C 类基金份额净值，有效份额单位为份。C 类基金份额仅能通过场外方式申购，申购份额的计算以四舍五入的方法保留小数点后两位，由此产生的收益或损失归基金财产。

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

例：某投资者投资 5 万元申购本基金的 C 类基金份额，假设申购当日 C 类基金份额净值

为 1.0500 元，则可得到 C 类基金申购份额为：

申购份额=50,000/1.0500=47,619.05 份 3、赎回金额的计算方式：赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以申请当日该类基金份额净值的金额，净赎回金额为赎回金额扣除赎回费用的金额，各计算结果均按照四舍五入方法，保留小数点后两位，由此产生的收益或损失归基金财产。

#### (1) A 类基金份额的赎回

如果投资人赎回 A 类基金份额，则赎回金额的计算方法如下：

赎回金额=赎回份额×T 日 A 类基金份额净值

赎回费用=赎回金额×A 类基金份额赎回费率

净赎回金额=赎回金额－赎回费用

例：某投资者场外赎回本基金 1 万份 A 类基金份额，持有时间为 6 个月，对应的赎回费率为 0.1%，假设赎回当日 A 类基金份额净值是 1.0100 元，则其可得到的净赎回金额为：

赎回金额=10,000×1.0100=10,100.00 元

赎回费用=10,100.00×0.1%=10.10 元

净赎回金额=10,100.00×1.010－10.10=10,089.90 元

#### (2) C 类基金份额的赎回

如果投资人赎回 C 类基金份额，则赎回金额的计算方法如下：

赎回金额=赎回份额×T 日 C 类基金份额净值

赎回费用=赎回金额×C 类基金份额赎回费率

净赎回金额=赎回金额－赎回费用

例：某投资者赎回本基金 1 万份 C 类基金份额，持有时间为 10 天，对应的赎回费率为 0.5%，假设赎回当日 C 类基金份额净值是 1.010 元，则其可得到的净赎回金额为：

赎回金额=10,000×1.0100=10,100.00 元

赎回费用=10,100.00×0.5%=50.50 元

赎回金额=10,100.00－50.50=10,049.50 元

#### 4、基金份额净值计算

各类基金份额净值的计算公式为计算日各类基金资产净值除以计算日登记在册该类基金份额余额所得的单位基金份额的价值。

T 日 A 类基金份额净值=T 日 A 类基金份额的基金资产净值/T 日登记在册 A 类基金份额余额。

T 日 C 类基金份额净值=T 日 C 类基金份额的基金资产净值/T 日登记在册 C 类基金份额余额。

本基金 A 类和 C 类基金份额的基金份额净值的计算，均保留在小数点后四位，小数点后第五位四舍五入。由此产生的误差由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

T 日的各类基金份额净值在当日收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

#### （八）申购与赎回的注册登记

投资者申购基金成功后，基金注册登记机构在 T+1 日为投资者登记权益并办理注册登记手续，投资者自 T+2 日（含该日）后有权赎回该部分基金份额。

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

基金管理人可以在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，但不得实质影响投资者的合法权益，并最迟于开始实施前 3 个工作日在至少一家指定媒介及基金管理人网站公告。

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

#### （九）拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理

1、发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受基金投资者的申购申请，此时，本基金管理人管理的其他基金的转入申请按同样的方式处理：

- （1）因不可抗力导致基金无法正常工作；
- （2）证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；
- （3）发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况；
- （4）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，或基金管理人认为会损害已有基金份额持有人利益的申购；
- （5）接受某笔或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超过 50%，或者变相规避 50%集中度的情形时；
- （6）因基金收益分配或基金投资组合内某个或某些证券发生重大事项可能导致净值的较大波动等原因，使基金管理人认为继续接受申购可能会影响或损害现有基金份额持有人利益的；
- （7）基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时；
- （8）某笔或某些申购申请超过基金管理人设定的单日净申购比例上限、单一投资者单日或单笔申购金额上限的；
- （9）当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上的，经与基金托管人协商确认后，

基金管理人应当暂停接受基金申购申请；

(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)、(4)、(6)、(9)项暂停申购情形时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介和基金管理人网站上刊登暂停申购公告并报中国证监会备案。

如果基金投资者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者。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。

2、发生下列情形时，基金管理人可暂停接受基金投资者的赎回申请或延缓支付赎回款项，此时，本基金的转出申请按同样的方式处理：

(1) 因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。

(2) 证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

(3) 连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回，导致本基金的现金支付出现困难。

(4) 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况。

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

(6) 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形时，基金管理人应在当日向中国证监会报告，已接受的赎回申请，基金管理人应按时足额支付；如暂时不能足额支付，可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付，并以后续开放日的该类基金份额净值为依据计算赎回金额，若连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回，对已接受的赎回申请可延期支付赎回款，延期支付最长不得超过 20 个工作日，并在指定媒介和基金管理人网站公告。投资者在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

3、暂停基金的申购、赎回，基金管理人应按规定公告并报中国证监会备案。

4、暂停申购或赎回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，基金管理人应在指定媒介刊登暂停公告。

(2) 如发生暂停的时间为 1 日，基金管理人应于重新开放日，依照有关规定在指定媒介和基金管理人网站上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近 1 个开放日的各类基金份额净值。

(3) 如发生暂停的时间超过 1 日但少于 2 周，暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 2 个工作日在指定媒介和基金管理人网站上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近 1 个开放日的各类基金份额净值。

(4) 如发生暂停的时间超过 2 周，暂停期间，基金管理人应每 2 周至少刊登暂停公告

1 次。暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 2 个工作日在指定媒介和基金管理人网站上连续刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近 1 个开放日的各类基金份额净值。

#### （十）巨额赎回的情形及处理方式

##### 1、巨额赎回的认定

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总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一日基金总份额的 10%时，即认为发生了巨额赎回。

##### 2、巨额赎回的处理方式

出现巨额赎回时，基金管理人可以根据本基金当时的资产组合状况决定接受全额赎回或部分延期赎回。对于场内赎回部分，当日未获受理的赎回申请将自动撤销，不会延至下一开放日。

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

（2）部分顺延赎回：当基金管理人认为支付基金投资者的赎回申请有困难或认为支付投资者的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一日基金总份额的 10%的前提下，对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个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；基金投资者未能赎回部分，投资者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，当日未获赎回的部分申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以该开放日的该类基金份额净值为基础计算赎回金额。如基金投资者在提交赎回申请时未作明确选择，投资者未能赎回部分作自动延期赎回处理。

（3）若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额的 10%，基金管理人有权先行对该单个基金份额持有人超出 10%的赎回申请实施延期办理，而对该单个基金份额持有人 10%以内（含 10%）的赎回申请与其他基金份额持有人的赎回申请，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况或巨额赎回份额占比情况决定全额赎回或部分延期赎回。所有延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以以下一开放日的该类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。具体见相关公告。

（4）巨额赎回的公告：当发生巨额赎回并顺延赎回时，基金管理人应在 2 日内通过指定媒介刊登公告，同时以邮寄、传真或招募说明书规定的其他方式在 3 个工作日内通知基金

份额持有人，并说明有关处理方法。

(5) 暂停接受和延缓支付：连续 2 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，但不得超过正常支付时间 20 个工作日，并应当在指定媒介和基金管理人网站上进行公告。

#### (十一) 基金转换

本基金转为上市交易开放式基金（LOF）后，基金管理人可以根据相关法律法规以及本基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的且由同一注册登记机构办理注册登记的其他基金之间的转换业务，基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及本基金合同的规定制定并公告，并及时告知基金托管人与相关机构。如本基金开通转换业务的，转入的基金份额持有期限自注册登记系统确认之日起开始计算，自该部分基金份额赎回或转出确认日止，且基金份额赎回或转出确认日不计入持有期。

#### (十二) 定期定额投资计划

本基金转为上市交易开放式基金（LOF）后，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在届时发布公告或更新的招募说明书中确定。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。

本基金 A 类基金份额已于 2014 年 2 月 10 日起开始办理日常定期定额投资业务。本基金 C 类基金份额于 2022 年 10 月 25 日起开始办理日常定期定额投资业务。

#### (十三) 实施侧袋机制期间本基金的申购与赎回

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

## 十、基金运作方式的变更及相关事项

### (一) 基金运作方式的变更

本基金自封闭期届满后的次日(即 2014 年 2 月 10 日)转为上市开放式基金(LOF)。投资人可进行基金份额的申购与赎回。

### (二) 转换运作方式后基金份额的交易

本基金转为上市开放式基金(LOF)后，登记在证券登记结算系统中的基金份额仍将在深圳证券交易所上市交易。基金在深圳证券交易所上市交易的相关事宜并不因基金转换运作方式而发生调整。

## 十一、基金的投资

### （一）投资目标

在严格控制风险与保持资产流动性的基础上，追求基金资产的长期稳定增值。

### （二）投资理念

通过主要投资于公司债券、企业债券等企业机构发行的固定收益类金融工具，在承担适度风险的前提下，从利率、信用等角度深入研究，优化组合，获取可持续的、超出市场平均水平的稳定投资收益。

### （三）投资范围

本基金的投资范围包括具有良好流动性的企业债、公司债、短期融资券、地方政府债、商业银行金融债与次级债、可转换债券（含分离交易的可转换债券）、资产支持证券、债券回购、国债、中央银行票据、政策性金融债、银行存款等固定收益类资产，股票（含存托凭证）和权证等权益类资产，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。法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金投资组合资产配置比例：债券等固定收益类资产占基金资产的比例不低于 80%；其中公司债、企业债、短期融资券、商业银行金融债与次级债、企业资产支持证券、可转换债券（含分离交易的可转换债券）等企业机构发行的债券占基金固定收益类资产的比例不低于 80%；股票等权益类资产占基金资产的比例不超过 20%。本基金转换为开放式基金（LOF）以后，基金持有现金及到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金可以通过参与新股申购、增发新股、可转换债券转股票、权证行权以及要约收购类股票套利等低风险的投资方式来提高基金收益水平，但此类投资比例不超过基金资产的 20%。

### （四）业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：80%×中债信用债（财富）总指数收益率+20%×中债国开行债券（1~3 年）总财富指数收益率。

中债信用债（财富）总指数由中央国债登记结算有限责任公司编制的反映中国债券市场信用类债券市场总体走势的宽基指数。该指数的样本券覆盖我国银行间市场和交易所市场，成份债券包括企业债、公司债、商业银行债、短期融资券和中期票据等发行主体是企业的在境内债券市场公开发行的债券，对信用类债券市场具有广泛的市场代表性。中债国开行债券（1~3 年）总财富指数由中央国债登记结算有限责任公司编制的反映债券市场中国家开发银行在银行间债券市场公开发行的代偿期限在 1~3 年的可流通债券总体走势的分类指数。这两



个债券指数具有较好的市场代表性，能够较好的反映我国债券市场的总体走势。

本基金是债券型基金，债券等固定收益类资产占基金资产的比例不低于 80%；其中公司债、企业债、短期融资券、商业银行金融债与次级债、企业资产支持证券、可转换债券（含分离交易的可转换债券）等企业机构发行的债券占基金固定收益类资产的比例不低于 80%；股票等权益类资产占基金资产的比例不超过 20%。本基金对中债信用债（财富）总指数收益率和中债国开行债券（1~3 年）总财富指数收益率分别赋予 80%和 20%的权重符合本基金的投资特性。

如果今后证券市场中有其他代表性更强或者更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。调整业绩比较基准应经基金托管人同意，并报中国证监会备案。基金管理人应在调整前 2 个工作日在至少一种指定媒介上予以公告。

#### （五）风险收益特征

本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金、股票型基金，高于货币市场基金。在债券型基金产品中，本基金主要投资于公司债、企业债、短期融资券、商业银行金融债与次级债、企业资产支持证券、可转换债券（含分离交易的可转换债券）等企业机构发行的债券，其长期平均风险程度和预期收益率高于普通债券型基金。根据 2017 年 7 月 1 日实施的《证券期货投资者适当性管理办法》，基金管理人和销售机构按照新的风险等级分类标准对基金重新进行风险评级，本基金的具体风险评级结果应以基金管理人和销售机构提供的评级结果为准。

#### （六）投资策略

本基金在深入分析固定收益品种的投资价值的基础上，采用久期管理等组合管理策略，构建债券组合，通过重点投资公司债、企业债等企业机构发行的固定收益金融工具，以获取相对稳定的基础收益，同时，通过新股申购、增发新股、可转换债券转股票、权证行权以及要约收购类股票套利等投资方式来提高基金收益水平。

##### 1、资产配置策略

本基金采取自上而下的方法进行组合资产配置。研究与跟踪中国宏观经济运行状况和资本市场变动特征，采取定性分析和定量分析相结合的方法，考虑经济环境、政策取向、资金供求、信用风险、各类资产相对估值等因素，研判各类固定收益类资产与新股申购、增发新股、可转换债券转股票、权证行权以及要约收购类股票套利等权益类资产投资的风险收益预期，以确定各类金融资产的配置比例。

##### 2、固定收益类资产投资策略

###### （1）债券组合投资策略

本基金通过全面研究 GDP、物价、就业以及国际收支等主要经济变量，分析宏观经济运行的可能情景，并预测财政政策、货币政策等宏观经济政策取向，分析金融市场资金供求状况变化趋势及结构，预测利率水平变动趋势以及收益率曲线形状变化趋势。在定性分析的基础上，本产品还应用货币分析模型、长短债估值模型等定量分析工具进行辅助分析，以确定组合的久期及期限结构管理策略。

#### ①久期策略

基于利率预期理论，分析未来较长一段时间(比如未来 1 年)市场利率的变化趋势，如果预期市场利率将上升，导致中长期债券持有期收益低于短期债券或者货币市场工具收益时，则将债券组合久期降至较低水平；而在预期利率水平稳定或者下降，导致中长期债券持有收益高于短期债券和货币市场工具收益时，则将债券组合久期上调至较高水平。

#### ②期限结构管理策略

在确定组合久期的基础上，本基金针对收益率曲线形态变化确定合理的组合期限结构，包括采用子弹策略、哑铃策略和梯形策略等，在长期、中期和短期债券间进行动态调整。一般而言，当预期收益率曲线变陡时，本基金将采用子弹策略；当预期收益率曲线变平时，将采用哑铃策略；在预期收益率曲线不变或平行移动时，则采用梯形策略。

### (2) 企业机构类债券投资策略

本基金通过研究市场整体信用风险趋势，结合企业机构类债券的供需情况以及替代资产相对吸引力，研判信用利差趋势，并结合利率风险，以确定组合的企业机构类债券的投资比例。

#### ①企业（公司）债投资策略

在企业机构类债投资比例确定之后进行个券选择，信用风险和流动性风险是影响个券相对价值的主要因素。根据国民经济运行周期阶段，分析企业（公司）债券等发行人所处行业发展前景、发展状况、市场地位、财务状况、管理水平和债务水平等因素，评价债券发行人的信用风险，并根据特定债券的发行契约，评价债券的信用级别。根据单个债券到期收益率相对于市场收益率曲线的偏离程度，结合其信用等级、期限、流动性、票息率、选择权条款、税赋特点等因素，确定其相对投资价值，选择具有相对价值且信用风险较低的企业（公司）债券进行投资。

#### ②可转换债券投资策略

可转换债券兼具权益类证券与固定收益类证券的特性，具有抵御下行风险、分享股票价格上涨收益的特点。

本基金将选择公司基本素质优良、其对应的基础证券有着较高上涨潜力的可转换债券进行投资，并采用期权定价模型等数量化估值工具评定其投资价值，以合理价格买入并持有。

本基金持有的可转换债券可以转换为股票。

### ③企业资产支持证券等品种投资策略

企业资产支持证券是指中国证监会批准的企业资产支持证券类品种，其定价受多种因素影响，包括市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率等。

本基金将深入分析上述基本面因素，并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型，评估其内在价值。

## 3、权益类资产投资策略

### （1）新股申购投资策略

在股票发行市场上，股票供求关系不平衡经常导致股票发行价格与二级市场价格之间存在一定价差，从而使新股申购成为一种风险较低的投资方式。本基金将研究首次发行股票（IPO）及增发新股的上市公司基本面因素，根据股票市场整体定价水平，估计新股上市交易的合理价格，并参考一级市场资金供求关系，从而制定相应的新股申购策略。本基金对于通过参与新股认购所获得的股票，将根据其市场价格相对于其合理内在价值的高低，确定继续持有或者卖出。

### （2）要约收购类股票投资策略

本基金将充分挖掘和把握股票市场存在的固定收益机会，在有效控制风险的前提下参与要约收购类股票的投资。该类投资立足于资产的固定收益类特征，自收购人发布要约收购后进行投资。本基金将在严格的收益、风险和成本测算基础上，结合股票市场运行情况 and 基本面分析，并在充分评估和判断要约收购人的综合实力和收购意愿的前提下，谨慎参与要约收购类股票的投资。

### （3）权证投资策略

本基金不主动投资权证，因持有股票或可分离债而获得的权证，在有效控制风险的前提下，本基金将在对权证标的证券进行基本面研究及估值的基础上，结合股价波动率等参数，运用数量化期权定价模型，确定其合理内在价值，并结合未来标的证券的定价谨慎持有或择机抛售。

### （4）存托凭证投资策略

本基金可投资存托凭证，本基金将结合对宏观经济状况、行业景气度、公司竞争优势、公司治理结构、估值水平等因素的分析判断，选择投资价值高的存托凭证进行投资。

## （七）投资管理程序

本基金管理人实行“投资决策委员会领导下的团队制”管理模式，建立了严谨、科学的投资管理流程，具体包括投资研究、投资决策、组合构建、交易执行和风险管理及绩效评估等全过程，如图 1-1 所示。

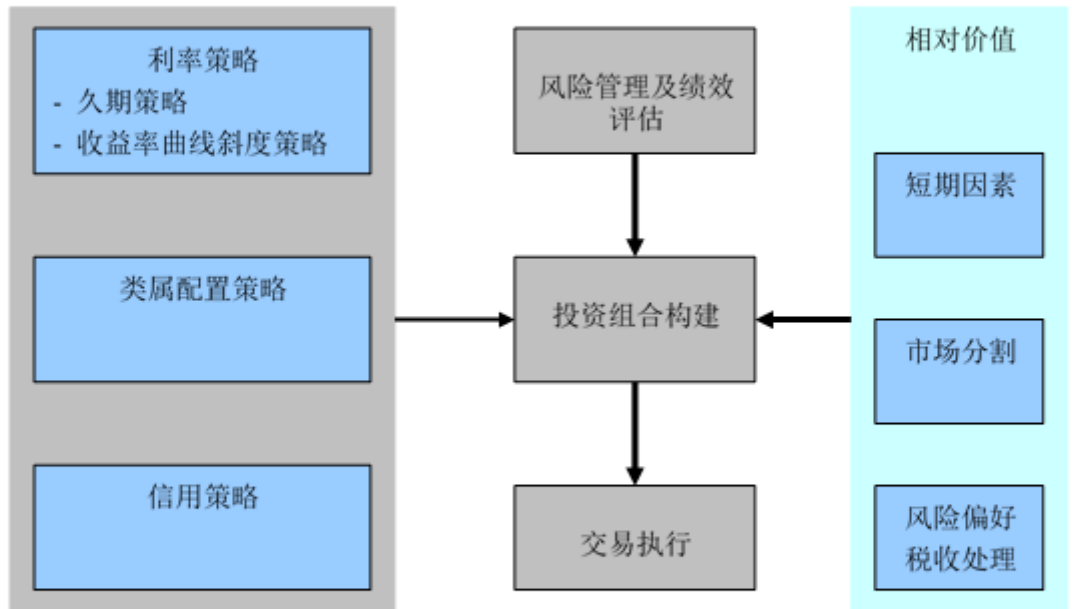


图 1-1 固定收益证券投资管理程序

### 1、投资研究及投资策略制定

本基金管理人在固定收益证券投资与研究方面，实行投资策略研究专业化分工制度，由基金经理与研究员组成专业小组，进行宏观经济及政策、产业结构、金融市场、单个证券等领域的深入研究，分别从利率、债券信用风险、相对价值等角度，提出独立的投资策略建议，经固定收益投资团队讨论，并经投资决策委员会批准后形成固定收益证券指导性投资策略。该投资策略是公司未来一段时间内对该领域的风险和收益的判断，对公司旗下管理的所有基金或组合的固定收益类证券投资具有指导作用。

各个专业领域的投资策略专业小组每季度定期举行策略分析研讨会议，提出下一阶段投资策略，每周定期举行策略评估会议，回顾本周的各项经济数据和重大事项，分析其对季度投资策略的影响，检讨投资策略的有效性，必要的时候进行调整。

### 2、投资决策

基金经理在公司固定收益证券总体投资策略的指导下,根据基金合同关于投资目标、投资范围及投资限制等规定,制定相应的投资计划,报投资决策委员会审批。

投资决策委员会是基金投资的最高决策机构,决定基金总体投资策略及资产配置方案,审核基金经理提交的投资计划,提供指导性意见,并审核其他涉及基金投资管理的重大问题。

### 3、投资组合构建

基金经理根据投资决策委员会的决议,在权限范围内,评估债券的投资价值,选择证券构建基金投资组合,并根据市场变化调整基金投资组合,进行投资组合的日常管理。

### 4、交易执行

交易员负责在合法合规的前提下,执行基金经理的投资指令。

### 5、风险管理及绩效评估

风险管理部对投资组合的风险水平及基金的投资绩效进行评估,报风险管理委员会,抄送投资决策委员会、投资总监及基金经理,并就基金的投资组合提出风险管理建议。

风险管理部对基金的投资行为进行合规性监控,并对投资过程中存在的风险隐患向基金经理、投资总监、投资决策委员会及风险管理委员会进行风险提示。

### (八) 投资组合限制

本基金的投资组合将遵循以下限制:

- 1、本基金持有的债券等固定收益类资产占基金资产的比例不低于 80%;
- 2、本基金持有的公司债、企业债、短期融资券、商业银行金融债与次级债、企业资产支持证券、可转换债券(含分离交易的可转换债券)等企业机构发行的债券占基金固定收益类资产的比例不低于 80%;
- 3、本基金投资于股票等权益类资产的比例不高于基金资产的 20%;
- 4、本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券,不超过该证券的 10%;
- 5、本基金持有一家上市公司的股票,其市值不超过基金资产净值的 10%;
- 6、除被动获得权证外,本基金不得进行权证投资;本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的 3%;
- 7、本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%;本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为 1 年,债券回购到期后不得展期;
- 8、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%;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%;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%;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）的债券或资产支持证券。基金持有债券或资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

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

11、本基金转换为开放式基金（LOF）后，基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；

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

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

14、本基金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；

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

如果法律法规对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

除第 9、11、12、14 条外，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

#### （九）禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

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

- 4、买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
- 5、向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- 6、买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；
- 7、从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- 8、依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

若法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，履行适当程序后，本基金投资可不受上述规定限制。

#### （十）基金管理人代表基金行使相关权利的处理原则及方法

- 1、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金份额持有人的利益；
- 2、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；
- 3、有利于基金财产的安全与增值；
- 4、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

#### （十一）基金的融资、融券

本基金可以根据有关法律法规和政策的规定进行融资、融券。

#### （十二）侧袋机制的实施和投资运作安排

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

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

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

#### （十三）基金的投资组合报告

本报告期自 2021 年 10 月 1 日起至 2021 年 12 月 31 日止（财务数据未经审计）。

##### 1.1 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	25,251,409.40	0.80
	其中：股票	25,251,409.40	0.80

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,968,338,333.73	93.71
	其中：债券	2,885,956,880.31	91.11
	资产支持证券	82,381,453.42	2.60
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	16,846,891.14	0.53
8	其他资产	157,239,019.97	4.96
9	合计	3,167,675,654.24	100.00

注：由于四舍五入的原因金额占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

## 1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 1.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	3,115,979.50	0.11
C	制造业	7,474,878.84	0.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	5,019,178.74	0.18
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	9,641,372.32	0.34
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	25,251,409.40	0.90

注：由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

### 1.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

## 1.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002142	宁波银行	186,440	7,136,923.20	0.26
2	601872	招商轮船	783,582	3,189,178.74	0.11
3	688186	广大特材	72,727	3,179,624.44	0.11



4	601899	紫金矿业	321,235	3,115,979.50	0.11
5	002311	海大集团	40,000	2,932,000.00	0.10
6	000001	平安银行	151,969	2,504,449.12	0.09
7	000089	深圳机场	250,000	1,830,000.00	0.07
8	300138	晨光生物	81,632	1,363,254.40	0.05

#### 1.4 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	5,001,000.00	0.18
2	央行票据	-	-
3	金融债券	981,134,000.00	35.06
	其中：政策性金融债	453,466,000.00	16.21
4	企业债券	540,734,261.21	19.32
5	企业短期融资券	20,014,000.00	0.72
6	中期票据	891,099,000.00	31.85
7	可转债（可交换债）	447,974,619.10	16.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,885,956,880.31	103.14

注：由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

#### 1.5 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	180210	18 国开 10	1,300,000	138,112,000.00	4.94
2	2028033	20 建设银行二级	1,000,000	103,740,000.00	3.71
3	190406	19 农发 06	800,000	83,488,000.00	2.98
4	190202	19 国开 02	800,000	80,032,000.00	2.86
5	1428011	14 建行二级 01	700,000	75,509,000.00	2.70

#### 1.6 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

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	136052	万科 22 优	250,000	25,027,500.00	0.89
2	183208	铁建 033A	200,000	19,998,553.42	0.71
3	136234	惠和 06A	150,000	15,061,500.00	0.54
4	136224	南链优 17	100,000	10,044,000.00	0.36
5	136230	瑞新 30A1	50,000	5,020,000.00	0.18
6	193388	和熙 9A1	50,000	5,003,000.00	0.18
7	165941	万安 9A3	30,000	2,226,900.00	0.08

#### 1.7 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。

#### 1.8 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。

#### 1.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

**1.9.1 本期国债期货投资政策**

本报告期内，本基金未运用国债期货进行投资。

**1.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未持有国债期货投资，也无期间损益。

**1.9.3 本期国债期货投资评价**

本报告期内，本基金未运用国债期货进行投资。

**1.10 投资组合报告附注****1.10.1 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**

本基金投资的前十名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。

**1.10.2 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**

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

**1.10.3 其他资产构成**

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	15,120.25
2	应收证券清算款	1,943,672.70
3	应收股利	-
4	应收利息	36,772,524.11
5	应收申购款	118,507,702.91
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	157,239,019.97

**1.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	110059	浦发转债	54,233,314.50	1.94
2	132018	G 三峡 EB1	43,909,014.00	1.57
3	113011	光大转债	19,043,400.00	0.68
4	132009	17 中油 EB	15,834,988.80	0.57
5	132015	18 中油 EB	15,589,500.00	0.56
6	110079	杭银转债	11,150,066.20	0.40
7	123111	东财转 3	10,090,800.00	0.36
8	128131	崇达转 2	8,352,037.06	0.30
9	128132	交建转债	7,620,200.00	0.27
10	113021	中信转债	7,529,538.40	0.27
11	127012	招路转债	7,280,386.20	0.26
12	123107	温氏转债	7,162,038.80	0.26
13	127022	恒逸转债	6,823,810.80	0.24
14	110080	东湖转债	6,712,800.00	0.24
15	132021	19 中电 EB	6,663,170.00	0.24
16	110052	贵广转债	6,585,600.00	0.24

17	127020	中金转债	6,204,500.00	0.22
18	110053	苏银转债	5,918,000.00	0.21
19	110073	国投转债	5,793,000.00	0.21
20	113033	利群转债	5,532,000.00	0.20
21	110047	山鹰转债	5,374,800.00	0.19
22	127006	敖东转债	5,172,156.72	0.18
23	113042	上银转债	4,418,941.50	0.16
24	113050	南银转债	4,196,810.40	0.15
25	110076	华海转债	3,903,229.20	0.14
26	127013	创维转债	3,630,300.00	0.13
27	123113	仙乐转债	3,593,100.00	0.13
28	113605	大参转债	3,570,639.60	0.13
29	123108	乐普转2	3,546,600.00	0.13
30	127018	本钢转债	3,545,100.00	0.13
31	113588	润达转债	3,347,554.30	0.12
32	110062	烽火转债	3,294,330.50	0.12
33	128015	久其转债	3,270,672.30	0.12
34	113037	紫银转债	3,257,700.00	0.12
35	128141	旺能转债	3,237,000.00	0.12
36	113624	正川转债	3,203,028.50	0.11
37	132008	17山高EB	3,170,400.00	0.11
38	113596	城地转债	2,952,000.00	0.11
39	123099	普利转债	2,894,200.00	0.10
40	113602	景20转债	2,867,000.00	0.10
41	128121	宏川转债	2,860,220.76	0.10
42	110075	南航转债	2,741,000.00	0.10
43	128107	交科转债	2,681,241.60	0.10
44	128081	海亮转债	2,678,200.00	0.10
45	113044	大秦转债	2,517,120.00	0.09
46	128048	张行转债	2,473,000.00	0.09
47	113036	宁建转债	2,455,097.40	0.09
48	110068	龙净转债	2,430,500.50	0.09
49	123049	维尔转债	2,400,844.80	0.09
50	127015	希望转债	2,389,968.00	0.09
51	127025	冀东转债	2,376,600.00	0.08
52	110045	海澜转债	2,339,600.00	0.08
53	123044	红相转债	2,334,783.40	0.08
54	110067	华安转债	2,332,400.00	0.08
55	128022	众信转债	2,307,200.00	0.08
56	110064	建工转债	2,296,245.00	0.08
57	128087	孚日转债	2,236,398.06	0.08
58	127016	鲁泰转债	2,233,000.00	0.08
59	128129	青农转债	2,197,250.55	0.08
60	110034	九州转债	2,124,000.00	0.08
61	113569	科达转债	2,087,732.00	0.07
62	128125	华阳转债	2,076,714.72	0.07
63	128035	大族转债	2,014,950.00	0.07
64	123064	万孚转债	1,963,534.30	0.07

65	127033	中装转 2	1,870,494.12	0.07
66	113621	彤程转债	1,746,900.00	0.06
67	128083	新北转债	1,678,277.82	0.06
68	110061	川投转债	1,552,500.00	0.06
69	113026	核能转债	1,521,345.00	0.05
70	113579	健友转债	1,426,900.00	0.05
71	113599	嘉友转债	1,320,400.00	0.05
72	113024	核建转债	1,304,900.00	0.05
73	127027	靖运转债	1,279,400.00	0.05
74	127005	长证转债	1,275,900.00	0.05
75	128136	立讯转债	1,262,300.00	0.05
76	128021	兄弟转债	1,258,200.00	0.04
77	127021	特发转 2	1,254,948.31	0.04
78	110057	现代转债	1,241,700.00	0.04
79	123090	三诺转债	1,234,200.00	0.04
80	128118	瀛通转债	1,229,200.48	0.04
81	113045	环旭转债	1,214,500.00	0.04
82	113046	金田转债	1,198,400.00	0.04
83	128139	祥鑫转债	1,169,600.00	0.04
84	128066	亚泰转债	1,160,200.00	0.04
85	128108	蓝帆转债	1,159,700.00	0.04
86	128123	国光转债	1,129,800.00	0.04
87	123010	博世转债	1,119,800.00	0.04
88	123076	强力转债	1,102,400.00	0.04
89	128114	正邦转债	1,092,400.00	0.04
90	113009	广汽转债	1,077,400.00	0.04
91	127019	国城转债	1,075,100.00	0.04
92	128071	合兴转债	915,720.00	0.03
93	123025	精测转债	801,950.00	0.03
94	132020	19 蓝星 EB	420,427.80	0.02
95	132022	20 广版 EB	365,750.00	0.01
96	113578	全筑转债	103,625.10	0.00
97	113618	美诺转债	57,151.60	0.00

注：上表包含期末持有的处于转股期的可转换债券和可交换债券明细。

#### 1.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	601872	招商轮船	3,189,178.74	0.11	非公开流通受限
2	688186	广大特材	3,179,624.44	0.11	非公开流通受限

#### 1.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## 十二、基金的业绩

基金管理人承诺以恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不向投资者保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

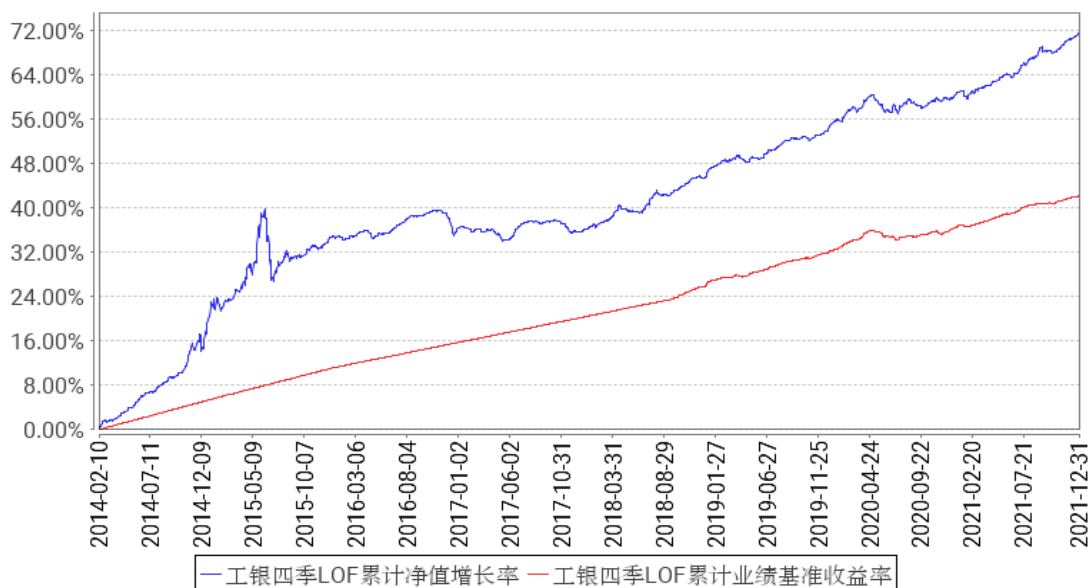
1、本基金合同生效日为2011年2月10日，于2014年2月10日转型为上市开放式基金（LOF）。基金合同生效以来（截至2021年12月31日）的投资业绩及同期基准的比较如下表所示：

阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基准 收益率③	业绩比较基准收 益率标准差④	①-③	②-④
2011.2.10- 2011.12.31	2.92%	0.14%	5.92%	0.02%	-3.00%	0.12%
2012年	13.02%	0.12%	6.42%	0.02%	6.60%	0.10%
2013年	3.25%	0.12%	6.05%	0.02%	-2.80%	0.10%
2014.1.1- 2014.2.9	0.00%	0.11%	0.63%	0.03%	-0.63%	0.08%
2014.2.10- 2014.12.31	20.42%	0.26%	5.42%	0.02%	15.00%	0.24%
2015年	12.10%	0.45%	5.80%	0.02%	6.30%	0.43%
2016年	1.05%	0.10%	4.55%	0.01%	-3.50%	0.09%
2017年	-0.50%	0.08%	4.55%	0.01%	-5.05%	0.07%
2018年	7.41%	0.09%	5.38%	0.02%	2.03%	0.07%
2019年	6.19%	0.07%	4.87%	0.03%	1.32%	0.04%
2020年	3.66%	0.11%	3.22%	0.05%	0.44%	0.06%
2021年	7.01%	0.09%	4.22%	0.02%	2.79%	0.07%
自基金转型起至 今	71.70%	0.20%	42.25%	0.03%	29.45%	0.17%

2、本基金转型后基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较：

（2014年2月10日至2021年12月31日）

工银四季LOF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、本基金于2014年2月10日转型为上市开放式基金（LOF）。

2、根据基金合同规定，本基金建仓期为6个月。截至本报告期末，本基金的投资符合基金合同关于投资范围及投资限制的规定。

### 十三、基金的财产

#### （一）基金资产总值

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

#### （二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的金额。

#### （三）基金财产的账户

本基金财产以基金名义开立银行存款账户，以基金托管人的名义开立证券交易清算资金的结算备付金账户，以基金托管人和本基金联名的方式开立基金证券账户，以本基金的名义开立银行间债券托管账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和注册登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

#### （四）基金财产的处分

基金财产独立于基金管理人、基金托管人和代销机构的固有财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益归入基金财产。基金管理人、基金托管人可以按基金合同的约定收取管理费、托管费以及其他基金合同约定的其他费用。基金管理人、基金托管人以其自有财产承担法律责任，其债权人不得对基金财产行使请求冻结、扣押和其他权利。

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。

基金财产的债权，不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债务相抵消；不同基金财产的债权债务，不得相互抵消。

除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定处分外，基金财产不得被处分。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

## 十四、基金资产估值

### （一）估值目的

基金资产的估值目的是客观、准确地反映基金相关金融资产的公允价值，并为基金份额提供计价依据。

### （二）估值日

本基金的估值日为相关的证券交易所的正常营业日，以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非营业日。

### （三）估值对象

基金依法拥有的股票、债券、权证和银行存款等基金资产和负债。

### （四）估值方法

本基金按以下方式进行估值：

#### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

（1）交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价（收盘价），确定公允价值进行估值。

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

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

价及重大变化因素，调整最近交易市价（收盘价），确定公允价值进行估值；

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

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

（1）送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在证券交易所上市同一股票的市价（收盘价）估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

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

（3）在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

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

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

5、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

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

7、交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量。

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

9、本基金投资存托凭证的估值核算，依照境内上市交易的股票进行。

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

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



### （五）估值程序

基金日常估值由基金管理人进行。各类基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以双方认可的方式发送给基金托管人，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金托管人复核无误后以双方认可的方式发送给基金管理人，由基金管理人依据本基金合同和有关法律法规的规定予以公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

### （六）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。

本基金合同的当事人应按照以下约定处理：

#### 1、差错类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人或注册登记机构、或代销机构、或投资者自身的过错造成差错，导致其他当事人遭受损失的，差错的责任人应当对由于该差错遭受损失的当事人（“受损方”）按下述“差错处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

上述差错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；对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平不能预见、不能避免、不能克服，则属不可抗力，按照下述规定执行。

由于不可抗力原因造成投资者的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

#### 2、差错处理原则

（1）差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已产生的差错，给当事人造成损失的，由差错责任方承担；若差错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。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正；

（2）差错的责任方对可能导致有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对差错的有关直接当事人负责，不对第三方负责；

（3）因差错而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但差错责任方仍应对差错负责。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，则差错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差错责任方；

(4) 差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式；

(5) 差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人的行为造成基金财产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人的行为造成基金财产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。基金管理人、基金托管人及基金销售机构之外的第三方造成基金财产的损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错方追偿；

(6) 如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿，并且依据法律法规、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有责任的当事人进行追索，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方式处理差错。

### 3、差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

(1) 查明差错发生的原因，列明所有的当事人，并根据差错发生的原因确定差错的责任方；

(2) 根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；

(3) 根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失；

(4) 根据差错处理的方法，需要修改基金注册登记机构交易数据的，由基金注册登记机构进行更正，并就差错的更正向有关当事人进行确认。

### 4、基金份额净值差错处理的原则和方法

(1) 当任一类基金份额净值小数点后 4 位以内（含第 4 位）发生差错时，视为该类基金份额净值错误；基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当错误达到或超过该类基金资产净值的 0.25% 时，基金管理公司应当及时通知基金托管人并报中国证监会；错误偏差达到该类基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应当公告、通报基金托管人并报中国证监会备案；当发生净值计算错误时，由基金管理人负责处理，由此给基金份额持有人和基金造成损失的，应由基金管理人先行赔付，基金管理人按差错情形，有权向其他当事人追偿。

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

① 本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，与本基金有关的会计问题，如经双方在平等基础上充分讨论后，尚不能达成一致时，按基金会计责任方的建议执行，由此给基金

份额持有人和基金造成的损失，由基金管理人负责赔付；

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

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

④ 由于基金管理人提供的信息错误（包括但不限于基金申购或赎回金额等），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的损失，由基金管理人负责赔付。

（3）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。

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

#### （七）暂停估值的情形

- 1、基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；
- 3、占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障投资者的利益，已决定延迟估值；
- 4、当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上的，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停估值；
- 5、中国证监会和基金合同认定的其他情形。

#### （八）基金净值的确认

用于基金信息披露的基金资产净值和各类基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后将当日的净值计算结果发送给基金托管人。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，由基金管理人依据本基金合同和有关法律法规的规定对基金净值予以公布。

各类基金份额净值的计算均精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

#### （九）特殊情形的处理

- 1、基金管理人按估值方法的 6 项进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

2、由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，有关会计制度变化或由于其他不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误而造成的基金份额净值计算错误，基金管理人、基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

#### （十）实施侧袋机制期间的基金资产估值

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

## 十五、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。

基金利润构成如下：

- 1、买卖证券差价；
- 2、基金投资所得红利、股息、债券利息；
- 3、银行存款利息；
- 4、已实现的其他合法收入。

因运用基金财产带来的成本或费用的节约应计入收益。

### （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、本基金在封闭期间，基金收益分配采用现金方式；本基金转换为上市开放式基金(LOF)后，基金收益分配方式分为现金分红与红利再投资，投资人可选择获取现金红利或将现金红利按再投日的该类基金份额净值自动转为相应类别的基金份额进行再投资，若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金红利；登记在深圳证券账户的基金份额只能采取现金红利方式，不能选择红利再投资；

2、本基金同一类别每份基金份额享有同等分配权，由于本基金各类基金份额在费用收取上不同，其对应的可分配收益可能有所不同；

3、在符合有关基金收益分配条件的前提下，每季度末每份基金份额可分配收益超过0.01元时，至少分配1次，每年收益分配次数最多为12次，每次收益分配的比例不低于收

益分配基准日可供分配利润的 60%。并且，在封闭期间本基金每年度的收益分配比例不得低于基金该年度可供分配利润的 90%。期末可供分配利润是指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数；

4、若基金合同生效不满 3 个月，可不进行收益分配；

5、基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即指基金收益分配基准日的该类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

6、法律、法规或监管机构另有规定的从其规定。

在不影响投资者利益的情况下，基金管理人可在法律法规允许的前提下酌情调整以上基金收益分配原则，此项调整不需要召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在指定媒介和基金管理人网站公告。

#### （四）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明基金期末可供分配利润、基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式、支付方式等内容。

#### （五）收益分配的时间和程序

1、本基金收益分配方案由基金管理人拟定、由基金托管人对相关数据核实后确定，依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

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

3、在分配方案公布后（依据具体方案的规定），基金管理人就支付的现金红利向基金托管人发送划款指令，基金托管人按照基金管理人的指令及时进行分红资金的划付。

#### （六）基金收益分配中发生的费用

1、收益分配采用红利再投资方式免收再投资的费用。

2、收益分配时发生的银行转账等手续费用由基金份额持有人自行承担；如果基金份额持有人所获现金红利不足支付前述银行转账等手续费用，注册登记机构自动将该基金份额持有人的现金红利按除权日的该类基金份额净值转为相应类别的基金份额。

#### （七）收益分配方案的确定与公告

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人对相关数据进行复核后确定，依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

#### （八）实施侧袋机制期间的收益分配

本基金实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配，详见招募说明书“侧袋机制”部分

的规定。

## 十六、基金的费用与税收

### （一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、本基金从C类基金份额的基金资产中计提的销售服务费；
- 4、基金合同生效后的信息披露费用；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
- 7、基金的证券交易费用；
- 8、基金财产划拨支付的银行费用；
- 9、基金上市费及年费；
- 10、按照国家有关规定可以在基金财产中列支的其他费用。

（二）上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

### （三）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

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}, \text{ 本基金年管理费率为 } 0.6\%$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

#### 2、基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}, \text{ 本基金年托管费率为 } 0.2\%$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，

若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

### 3、C类基金份额的销售服务费

本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值的0.40%的年费率计提。C类基金份额的销售服务费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。由基金管理人代付给销售机构。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

4、上述(一)中4到10项费用由基金托管人根据其他有关法律法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

#### (四) 不列入基金费用的项目

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、基金募集期间所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付，基金收取认购费的，可以从认购费中列支；

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。

(五) 基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率及销售服务费费率。降低基金管理费率、基金托管费率及销售服务费费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率实施日前在指定媒介和基金管理人网站上刊登公告。

#### (六) 实施侧袋机制期间的基金费用

本基金实施侧袋机制的，与处置侧袋账户资产相关的费用可以从侧袋账户中列支，但应待侧袋账户资产变现后方可列支，不得收取管理费，其他费用详见招募说明书“侧袋机制”部分或相关公告的规定。

#### (七) 基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

## 十七、基金份额的注册登记、非交易过户、转托管、冻结与解冻

### (一) 基金份额的注册登记

指基金登记、存管、清算和结算业务，具体内容包括基金投资者基金账户建立和管理、基金份额注册登记、基金份额销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等。

本基金的注册登记业务由基金管理人或基金管理人委托的其他符合条件的机构负责办理。基金管理人委托其他机构办理本基金注册登记业务的，应与代理机构签订委托代理协议，以明确基金管理人和代理机构在注册登记业务中的权利义务，保护基金投资者和基金份额持有人的合法权益。

本基金的份额采用分系统登记的原则。场内认(申)购或上市交易买入的基金份额登记在中登深圳分公司证券登记结算系统基金份额持有人深圳证券账户下；场外认(申)购的基金份额登记在中登注册登记系统基金份额持有人基金账户下。

注册登记机构享有如下权利：

- 1、建立和管理基金投资者基金份额账户；
- 2、取得注册登记费；
- 3、保管基金份额持有人开户资料、交易资料、基金份额持有人名册等；
- 4、在法律法规允许的范围内，对注册登记业务的办理时间进行调整，并依照有关规定在指定媒介上公告；
- 5、法律法规规定的其他权利。

注册登记机构承担如下义务：

- 1、配备足够的专业人员办理本基金的注册登记业务；
- 2、严格按照法律法规和基金合同规定的条件办理基金的注册登记业务；
- 3、保存基金份额持有人名册及相关的申购、赎回与转换等业务记录 15 年以上；
- 4、对基金份额持有人的基金账户信息负有保密义务，因违反该保密义务对投资者或基金造成的损失，须承担相应的赔偿责任，但司法强制检查情形除外；
- 5、按基金合同和招募说明书规定为投资者办理非交易过户业务、转托管和提供其他必要服务；
- 6、法律法规规定的其他义务。

## （二）基金的非交易过户

指基金注册登记机构受理继承、捐赠、司法强制执行和经注册登记机构认可的其它情况而产生的非交易过户。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投资者。

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



指司法机关依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供基金注册登记机构要求提供的相关资料，对于符合条件的非交易过户申请自申请受理日起 2 个月内办理，并按基金注册登记机构规定的标准收费。

### （三）基金的转托管

本基金的份额采用分系统登记的原则。场外认购或申购的基金份额登记在注册登记系统持有人开放式基金账户下；场内认购、申购或上市交易买入的基金份额登记在证券登记结算系统持有人证券账户下。登记在证券登记结算系统中的基金份额既可以在深圳证券交易所上市交易，也可以直接申请场内赎回。登记在注册登记系统中的基金份额可申请场外赎回。

本基金的转托管包括系统内转托管和跨系统转登记。

#### 1、系统内转托管

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

（2）基金份额登记在注册登记系统的基金份额持有人在变更办理基金赎回业务的销售机构（网点）时，可办理已持有基金份额的系统内转托管。

（3）基金份额登记在证券登记结算系统的基金份额持有人在变更办理上市交易或场内赎回的会员单位（席位）时，可办理已持有基金份额的系统内转托管。

具体办理方法参照《业务规则》的有关规定以及基金代销机构的业务规则。

#### 2、跨系统转登记

（1）跨系统转登记是指持有人将持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统之间进行转登记的行为。

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

### （四）其他情形

基金账户和基金份额冻结、解冻的业务，由注册登记机构办理。

基金注册登记机构只受理国家有关机关依法要求的基金账户或基金份额的冻结与解冻以及注册登记机构认可的其他情况的基金账户或基金份额的冻结与解冻。基金账户或基金份额被冻结的，被冻结基金份额所产生的权益一并冻结，法律法规、中国证监会或法院判决、裁定另有规定的除外。

当基金份额处于冻结状态时，基金注册登记机构或其他相关机构应拒绝该部分基金份额的赎回申请、非交易过户以及基金的转托管。

## 十八、基金的会计与审计

### （一）基金的会计政策

- 1、基金管理人为本基金的会计责任方；
- 2、本基金的会计年度为公历每年的1月1日至12月31日；
- 3、本基金的会计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的会计制度；
- 5、本基金独立建账、独立核算；
- 6、基金管理人及基金托管人分别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、基金托管人定期与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并书面确认。

### （二）基金的审计

- 1、基金管理人聘请具有从事证券、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年度财务报表及其他规定事项进行审计。会计师事务所及其注册会计师与基金管理人、基金托管人相互独立。
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师时，应事先征得基金管理人同意。
- 3、基金管理人(或基金托管人)认为有充足理由更换会计师事务所，经基金托管人(或基金管理人)同意后可以更换。基金管理人应当依据有关规定在指定媒介上公告。

## 十九、基金的信息披露

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

### （二）信息披露义务人

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

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

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

（三）本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

- 1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；
- 2、对证券投资业绩进行预测；
- 3、违规承诺收益或者承担损失；
- 4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金发售机构；
- 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。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

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

(1) 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。本基金合同生效后，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。

(2) 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事项的法律文件。

(3) 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。

##### 2、基金份额发售公告

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

### 3、基金合同生效公告

基金管理人应当在本基金合同生效的次日在指定报刊和基金管理人网站上登载基金合同生效公告。

### 4、基金上市交易公告书

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

### 5、基金净值信息公告

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

基金上市交易后,基金管理人应当在不晚于每个交易日的次日,通过指定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露各类基金份额的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、申购赎回代理机构以及其他媒介披露开放日的各类基金份额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各类基金份额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,并保证投资人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

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

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

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

《基金合同》生效不足2个月的,基金管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。本基金持续运作过程中,应当在基金年度报告和中期报告中披露基金组合资产情

况及其流动性风险分析等。

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

#### 8、临时报告

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 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) 《基金合同》终止、基金清算；
- (3) 转换基金运作方式、基金合并；
- (4) 更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；
- (5) 基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；
- (6) 基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- (7) 基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人的实际控制人变更；
- (8) 基金募集期延长或提前结束募集；
- (9) 基金管理人的高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；
- (10) 基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十，基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十；
- (11) 涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁；
- (12) 基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；
- (13) 基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易事项，但中国证监会另有规定的除外；
- (14) 基金收益分配事项；
- (15) 管理费、托管费、销售服务费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费

率发生变更；

- (16) 任一类基金份额净值计价错误达该类基金份额净值 0.5%；
- (17) 本基金开始办理申购、赎回；
- (18) 本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；
- (19) 基金份额暂停上市、恢复上市或终止上市；
- (20) 基金发生巨额赎回并延期办理；
- (21) 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；
- (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) 当基金管理人采用摆动定价机制进行估值；
- (24) 基金信息披露义务人认为可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的其他事项或中国证监会、深圳证券交易所规定的其他事项。

#### 9、澄清公告

在本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，应当依法报国务院证券监督管理机构备案，并予以公告。召开基金份额持有人大会的，召集人应当至少提前 40 日公告基金份额持有人大会的召开时间、会议形式、审议事项、议事程序和表决方式等事项。

基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会，本基金管理人、本基金托管人对基金份额持有人大会决定的事项不依法履行信息披露义务的，召集人应当履行相关信息披露义务。

#### 11、实施侧袋机制期间的信息披露

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

#### 12、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律法规规定。基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、各类基金份额净值、各类基金份额申购

赎回价格、基金定期报告、更新的招募说明书、基金产品资料概要、基金清算报告等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人进行书面或电子确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定报刊中选择一家报刊披露本基金信息。基金管理人、基金托管人应当向中国证监会基金电子披露网站报送拟披露的基金信息，并保证相关报送信息的真实、准确、完整、及时。基金管理人、基金托管人除依法在指定媒介披露信息外，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和基金上市交易的证券交易所网站披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

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

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

#### （七）信息披露文件的存放与查阅

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

（八）本基金信息披露事项以法律法规规定及本章节约定的内容为准。

## 二十、侧袋机制

### （一）侧袋机制的实施条件和实施程序

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

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

### （二）侧袋机制实施期间的基金运作安排

#### 1、基金份额的申购与赎回

##### （1）侧袋账户

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

## （2）主袋账户

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

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

本招募说明书“基金份额的申购、赎回”部分的申购、赎回规定适用于主袋账户份额。巨额赎回按照单个开放日内主袋账户份额净赎回申请超过上一日主袋账户总份额的 10% 认定。

## 2、基金的投资

侧袋机制实施期间，招募说明书“基金的投资”部分约定的投资组合比例、投资策略、组合限制、业绩比较基准、风险收益特征等约定仅适用于主袋账户；且本基金的各项投资运作指标和基金业绩指标应当以主袋账户资产为基准。

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

基金管理人不得在侧袋账户中进行除特定资产处置变现以外的其他投资操作。

## 3、基金的费用

本基金实施侧袋机制的，与侧袋账户有关的费用可以从侧袋账户中列支，但应待侧袋账户资产变现后方可列支，有关费用可酌情收取或减免，但不得收取管理费，其他费用详见届时发布的相关公告。

主袋账户的管理费和托管费等费用仍按主袋账户基金资产净值作为基数计提。

## 4、基金的收益分配

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

## 5、基金的信息披露

### （1）基金净值信息

基金管理人应按照招募说明书“基金的信息披露”部分规定的基金净值信息披露方式和频率披露主袋账户份额的基金净值信息。侧袋机制实施期间，基金管理人应当暂停披露侧袋账户的基金净值信息。

### （2）定期报告

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



侧袋机制实施期间，基金定期报告中的基金会计报表仅需针对主袋账户进行编制。会计师事务所对基金年度报告进行审计时，应对报告期内基金侧袋机制运行相关的会计核算和年度报告披露等发表审计意见。

### （3）临时报告

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

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

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

### 6、特定资产的处置清算

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

### 7、侧袋的审计

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

（三）本部分关于侧袋机制的相关规定，凡是直接引用法律法规或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，或将来法律法规或监管规则针对侧袋机制的内容有进一步规定的，基金管理人经与基金托管人协商一致并履行适当程序后，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。

## 二十一、风险揭示

本基金的投资风险包括投资组合的风险、管理风险、合规性风险、操作风险以及其他风险。

### （一）投资组合的风险

投资组合的风险主要包括市场风险、信用风险及流动性风险。

#### 1、市场风险

证券市场价格因受各种因素的影响而引起的波动，将使本基金资产面临潜在的风险，本基金的市场风险来源于基金股票资产与债券资产市场价格的波动。影响股票与债券市场价格波动的风险包括但不限于以下多种风险因素：

#### （1）政策风险

货币政策、财政政策、产业政策等国家宏观经济政策的变化导致证券市场价格波动，影

响基金收益而产生风险。

#### (2) 经济周期风险

经济运行具有周期性的特点，证券市场的收益水平受到宏观经济运行状况的影响，也呈现周期性变化，基金投资于债券与上市公司的股票，其收益水平也会随之发生变化，从而产生风险。

#### (3) 利率风险

金融市场利率的波动会导致股票市场及债券市场的价格和收益率的变动，同时直接影响企业的融资成本和利润水平。基金投资于股票和债券，其收益水平会受到利率变化的影响，从而产生风险。

#### (4) 通货膨胀风险

基金持有人的收益将主要通过现金形式来分配，如果发生通货膨胀，现金的购买力会下降，从而影响基金的实际收益。

#### (5) 汇率风险

汇率的变化可能对国民经济不同部门造成不同的影响，从而导致本基金所投资的上市公司业绩及其股票价格。

#### (6) 上市公司经营风险

上市公司的经营受多种因素影响。如果基金所投资的上市公司经营不善，其股票价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，使基金投资收益下降。虽然本基金可通过分散化投资减少这种非系统性风险，但并不能完全消除该种风险。

#### (7) 债券收益率曲线变动的风险

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

#### (8) 再投资风险

市场利率下降将影响固定收益类证券利息收入的再投资收益率，这与利率上升所带来的价格风险互为消长。

### 2、信用风险

债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下降的风险，信用风险也包括证券交易对手因违约而产生的证券交割风险。

### 3、流动性风险

因市场交易量不足，导致证券不能迅速、低成本地转变为现金的风险。流动性风险还包括由于本基金出现投资者大额赎回，致使本基金没有足够的现金应付基金赎回支付的要求所引致的风险。

#### 4、本基金特有的风险

(1) 由于本基金所持有的固定收益类资产主要投资于公司债、企业债、短期融资券、商业银行金融债与次级债、资产支持证券、可转换债券（含分离交易的可转换债券）等企业机构发行的债券，本基金相对于普通的债券型基金而言面临着相对更高的信用风险。

(2) 本基金在基金合同生效后3年内为封闭期，在此期间持有人只能通过证券交易所二级市场交易卖出基金份额变现。在证券市场持续下跌、基金二级市场交易不活跃等情形下，有可能出现基金份额二级市场交易价格低于基金份额净值的情形，即基金折价交易，从而影响持有人收益或产生损失。

(3) 基金资产可投资于科创板股票，会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于科创板个股上市前五日无涨跌幅限制，市场风险随之上升；科创板整体投资门槛较高，二级市场上个人投资者参与度相对较低，机构持有个股大量流通盘导致个股流动性性对较低，基金资产存在无法及时变现等流动性风险；科创板试点注册制，对经营状况不佳或财务数据造假的企业实行严格的退市制度，个股存在退市风险等。其他风险包括但不限于集中度风险、系统性风险、政策风险等。基金可根据投资策略需要或市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于科创板股票或选择不将基金资产投资于科创板股票，基金资产并非必然投资于科创板股票。

(4) 基金资产可投资于存托凭证，会面临与创新企业、境外发行人、中国存托凭证发行机制以及交易机制等差异带来的特有风险，包括但不限于创新企业业务持续能力和盈利能力等经营风险，存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险；存托协议自动约束存托凭证持有人的风险；存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险；存托凭证退市的风险；因多地上市造成存托凭证价格差异以及受境外市场影响交易价格大幅波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；已在境外上市的基础证券发行人，在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险；境内外法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险等。

#### (5) 启用侧袋机制的风险

当本基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制。侧袋机制实施期间，侧袋账户份额将停止披露基金净值信息，并不得办理申购、赎回和转换，基金份额持有人可能面临无法及时获得侧袋账户对应部分的资金的流动性风险。基金管理人将按照持有人利益最大化原则，采取将特定资产予以处置变现等方式，及时向侧袋账户份额持有人支付对应款项，但因特定资产的变现时间具有不确定性，最终变现价格也具有不确定性并且有可能大幅低于启用侧袋机制时的特定资产的估值，基金份额持有人可能因此面临损

失。

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

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

启用侧袋机制后，基金管理人计算各项投资运作指标和基金业绩指标时仅需考虑主袋账户资产，并根据相关规定对分割侧袋账户资产导致的基金净资产减少进行按投资损失处理，因此本基金披露的业绩指标不能反映特定资产的真实价值及变化情况。

## 5、本基金主要的流动性风险及风险管理方法说明

### （1）基金申购、赎回安排

本基金将加强对开放式基金申购环节的管理，合理控制基金份额持有人集中度，审慎确认大额申购申请，在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，基金管理人将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对基金规模予以控制，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。具体内容详见本招募说明书第九章。

### （2）流动性风险评估

本基金可投资于国内依法发行上市的股票、债券、债券回购、银行存款和其他短期投资品种等。一般情况下，这些资产市场流动性较好，可以支持本基金的投资和应对日常申赎的需要，但不排除在特定阶段、特定市场环境下特定投资标的出现流动性较差的情况。因此，本基金投资于上述资产时，可能存在以下流动性风险：一是基金管理人建仓或进行组合调整时，可能由于特定投资标的流动性相对不足而无法按预期的价格买进或卖出；二是为应付投资者的赎回，基金被迫以不适当的价格卖出股票、债券或其他资产。两者均可能使基金净值受到不利影响。根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》的相关要求，本基金会审慎评估所投资资产的流动性，并针对性制定流动性风险管理措施，有效控制本基金流动性风险，保护基金投资者的合法权益。

### （3）巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

在本基金出现巨额赎回情形下，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况或巨额赎回份额占比情况决定全额赎回或部分延期赎回。同时，如本基金单个基金份额持有人在单个开放日申请赎回基金份额超过基金总份额一定比例以上的，基金管理人有权对其采取延期办理赎回申请的措施。具体内容详见本招募说明书第九章。

#### （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

本基金可能实施备用的流动性风险管理工具，以更好地应对流动性风险。基金管理人经与基金托管人协商，在确保投资者得到公平对待的前提下，可依照法律法规及基金合同的约定，综合运用各类流动性风险管理工具，对赎回申请等进行适度调整，作为特定情形下基金管理人流动性风险管理的辅助措施，包括但不限于：1）延期办理巨额赎回申请；2）暂停接受赎回申请；3）延缓支付赎回款项；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；5）暂停基金估值，当特定资产占前一估值日基金资产净值50%以上的，经与基金托管人协商一致，本基金应当暂停基金估值；6）侧袋机制。

当基金管理人实施流动性风险管理工具时，可能对投资者具有一定的潜在影响，包括但不限于不能申购本产品、赎回申请不能确认或者赎回款项延迟到账、如持有期限少于7日会产生较高的赎回费造成收益损失等。提示投资者了解自身的流动性偏好、合理做好投资安排。

#### （二）管理风险

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

#### （三）合规性风险

是指本基金的投资运作不符合相关法律、法规的规定和基金合同的要求而带来的风险。

#### （四）操作风险

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

#### （五）其他风险

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。金融市场危机、行业竞争、代理商违约等超出基金管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致基金或者基金份额持有人利益受损。

## 二十二、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、下列涉及到基金合同内容变更的事项应召开基金份额持有人大会并经基金份额持有人大会决议同意：

- （1）终止基金合同；
- （2）转换基金运作方式；
- （3）变更基金类别；

- (4) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略(法律法规和中国证监会另有规定的除外);
- (5) 变更基金份额持有人大会议事程序;
- (6) 更换基金管理人、基金托管人;
- (7) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准或提高销售服务费率。但根据法律法规的要求提高该等报酬标准或销售服务费率的除外;
- (8) 本基金与其他基金的合并;
- (9) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响,需召开基金份额持有人大会的变更基金合同等其他事项;
- (10) 终止基金上市,但因本基金不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市的除外;
- (11) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

《基金合同》生效后,当出现下述情形之一时,基金管理人应当召集召开基金份额持有人大会审议《基金合同》终止或与其他基金合并事项:

- (1) 基金资产净值连续 90 个工作日低于 3000 万元;
- (2) 基金份额持有人数量连续 90 个工作日不满 200 人;
- (3) 前十大基金份额持有人持有基金份额总和占基金总份额的比例连续 90 个工作日大于 90%。

若基金合同终止或与其他基金合并的决议获得基金份额持有人大会批准,基金管理人将按照有关规定将决议报中国证监会核准后执行。

若基金合同终止或与其他基金合并事项未获得基金份额持有人大会通过,基金管理人将按照有关规定将基金份额持有人大会表决结果报中国证监会核准并公告。若基金份额持有人大会不满足有关法律法规和本基金合同第十章的相关规定未能成功召开,或者基金合同终止或与其他基金合并事项未获得基金份额持有人大会通过,但自依法公告的基金份额持有人通知中载明的基金份额持有人大会召开之日起,再次出现上述情形之一时,基金管理人应再行召集基金份额持有人大会,审议有关基金《基金合同》终止或与其他基金合并事项。

但出现下列情况时,可不经基金份额持有人大会决议,由基金管理人和基金托管人同意变更后公布经修订的基金合同,并报中国证监会备案:

- (1) 因相应的法律法规发生变动并属于基金合同必须遵照进行变更的情形;
- (2) 基金合同的变更并不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化的;
- (3) 因为当事人名称、住所、法定代表人变更,当事人分立、合并等原因导致基金合同内容必须作出相应变动的;
- (4) 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的;

(5) 按照法律法规和基金合同规定不需要召开基金份额持有人大会的其他情形的。

2、关于变更基金合同的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准或备案，并经中国证监会核准或出具无异议意见之日起生效。基金管理人应在上述基金份额持有人大会决议生效后 2 日内在指定媒介和基金管理人网站公告。

## (二) 《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，本基金合同经中国证监会核准后将终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人职责终止，而在 6 个月内没有新的基金管理人承接的；
- 3、基金托管人职责终止，而在 6 个月内没有新的基金托管人承接的；
- 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

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

(2) 基金清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券、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。基金清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

### 2、基金财产清算程序

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

### 3、清算费用

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

#### 4、基金财产按下列顺序清偿：

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

基金财产未按前款(1)－(3)项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

#### 5、基金财产清算的公告

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。

#### 6、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

### 二十三、基金合同的内容摘要

详见附件一。

### 二十四、基金托管协议的内容摘要

详见附件二。

### 二十五、对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为本基金的份额持有人提供一系列的服务，并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) 关于基金账户确认

公司向首次开立基金账户的基金份额持有人寄送《基金账户确认书》(公司在获得基金份额持有人准确的邮寄地址信息基础上提供，因基金份额持有人在本公司未详实填写或更新账户资料导致无法寄送的除外)。《基金账户确认书》将在基金份额持有人开户确认后 15 个工作日内寄送。

在基金募集期间新开户的基金份额持有人，公司将于基金合同生效后的 15 个工作日内寄送《基金账户确认书》。

#### (二) 关于对账单服务

- 1、公司的官方网站和热线电话提供对账单自助查询、下载或传真服务。



(1) 基金份额持有人可登录公司官方网站(www.icbccs.com.cn)进入“网上交易”栏目,输入开户证件号码或基金账号,自助查询或下载对账单。

(2) 基金份额持有人用带有传真机的电话,拨打公司客户服务热线电话(4008119999),选择自助服务后,根据语音提示按指定键,输入需要下载的对账单日期,进行对账单自助传真。

2、公司为基金份额持有人提供电子邮件账单、短信账单、纸质账单等多种形式对账单服务。

(1) 电子邮件对账单:电子邮件对账单是通过基金份额持有人预留的电子邮箱向其提供份额及交易对账的一种电子化的账单形式。电子对账单的内容包括但不限于:期末基金份额余额、期末资产净值、期间交易明细等。公司向定制电子邮件对账单且在对应期间内有交易或最后一个交易日仍持有份额的投资人发送月度、季度和年度电子对账单,发送时间为每月、季、年度结束后15个工作日内。

(2) 手机短信对账单:短信对账单是通过手机短信向基金份额持有人预留的手机号码提供份额对账的一种电子化的账单形式。短信对账单的内容包括但不限于:期末基金份额余额、期末资产净值等。公司向定制手机短信对账单且最后一个交易日仍持有份额的投资者发送季度手机短信账单,发送时间为每季度结束后15个工作日内。

(3) 纸质对账单:纸质对账单是通过纸质信件向基金份额持有人提供份额及交易对账的一种书面化的账单形式。纸质对账单包括季度对账单和年度对账单,公司在每年第1-3季度结束后向定制季度对账单且在季度内有交易的投资者寄送季度对账单,在每年第4季度结束后向定制季度纸质对账单且在年度内有交易或最后一个交易日仍持有份额的投资者寄送年度对账单,同时公司向定制年度对账单且在年度内有交易或最后一个交易日仍持有份额的投资者寄送年度对账单,寄出时间为每季度或年度结束后的15个工作日内。

(4) 公司至少每年度以电子邮件、短信或其他形式主动向通过工银瑞信直销系统持有本公司基金份额的投资者提供基金保有情况信息。

本公司提供的对账单服务为基金份额持有人场外交易的对账单,不提供基金份额持有人的场内交易(本基金是否支持场内交易,请以基金合同和招募说明书相关条款为准)对账单服务,基金份额持有人可到销售机构交易网点打印或通过交易网点提供的自助、电话、网上服务等渠道查询。

3、温馨提示:(1) 因基金份额持有人提供的邮寄地址、手机号码、电子邮箱不详、错误、未及时变更等原因或因邮局投递差错、通讯故障、延误等原因,造成对账单无法按时准确送达,请及时到原基金销售网点或致电本公司客服中心办理相关信息变更。如需补发对账单,敬请拨打公司客户服务热线电话。(2) 因交易对账单记录信息属于个人隐私,如基金份

额持有人选择邮寄方式，请务必预留正确的通讯地址及联系方式，并及时进行更新。因基金份额持有人个人原因导致无法送达或送达错误，公司不承担任何责任。（3）本基金管理人提供的资料邮寄服务原则上采用邮政平信邮寄方式，由公司委托具有邮政业务服务资质的第三方进行处理，公司采取必要安全防护措施，但并不对邮寄资料的送达做出承诺和保证。

### （三）关于短信及电子邮件服务

基金份额持有人可以通过公司官方网站、客户服务热线电话申请定制信息服务，基金管理人通过短信、电子邮件等方式发送基金份额持有人定制的信息。可定制的内容包括：产品信息、基金净值、市场资讯、公司最新公告等。公司还将根据业务发展的实际需要，适时调整定制信息的内容、条件和方式。

除了发送基金份额持有人定制的各类信息外，基金公司也会定期或不定期向预留有效手机号码及电子邮箱地址的基金份额持有人发送基金分红、投资者教育信息、节日问候、产品推广及其他与产品、服务相关的通知等信息。如基金份额持有人不希望接收到该类信息，可以通过公司客户服务热线电话取消相关服务。

### （四）关于资讯服务

公司为基金份额持有人提供本基金产品信息、基金投资报告、宏观形势分析、基金净值等多种资讯（电子版）。如需通过手机或电子邮件获得相关资讯，基金份额持有人可通过公司官方网站或客户服务热线电话定制。

基金份额持有人知悉并同意基金管理人可根据基金份额持有人预留的个人信息不定期通过电话、短信、邮件、微信、网站、APP 等任一或多种方式或渠道为基金份额持有人提供与基金份额持有人相关的账户服务通知、交易确认通知、重要公告通知、活动消息、营销信息、基金份额持有人关怀等资讯及增值服务，购买本基金前请详阅工银瑞信基金官网服务介绍和隐私政策。如需取消相应资讯服务，可通过公司客户服务热线电话、在线客服等人工服务方式退订。

### （五）关于联络方式

公司提供多种联络方式，供基金份额持有人与公司及时沟通，主要包括：

1、热线电话服务：4008119999（免长途电话费），服务传真：010-81042598。

（1）人工电话服务：我公司为基金份额持有人提供每天 24 小时人工服务，内容包括：账户信息查询、基金产品咨询、业务规则解答及直销电子自助交易（含 APP、网上交易、微信自助交易）咨询等服务。

（2）自助电话服务：公司提供每天 24 小时自助语音服务，基金份额持有人可通过热线电话自助查询基金交易、基金份额、基金净值等信息，以及进行自助传真对账单等操作。

（3）电话留言服务：基金份额持有人可通过公司客户服务热线电话（4008119999 按指

定键)进行语音留言,将有关疑问、建议及联系方式告知公司,基金管理人在接收基金份额持有人服务需求后将在一个工作日内给予回复。

## 2、网络在线服务

公司官方网站、手机 APP 和微信服务平台设置了“在线客服”栏目,基金份额持有人可登录公司官方网站首页、手机 APP 或关注公司微信公众号,点击“在线客服”图标,通过网络在线方式进行相关业务咨询。

(1) 人工服务:在线人工服务时间为每天 24 小时,内容包括:基金产品咨询、业务规则解答及直销电子自助交易(含 APP、网上交易、微信自助交易)咨询等服务。

(2) 智能客服:公司提供每天 24 小时自助咨询服务,基金份额持有人可通过在线客服机器人对基金产品、业务规则等方面内容进行自助咨询。

## 3、电子信箱服务

基金份额持有人可向公司客户服务电子邮箱(customer-service@icbccs.com.cn)发送邮件,将有关疑问、建议及联系方式告知公司,基金管理人在接收基金份额持有人服务需求后将在一个工作日内给予回复。

### (六) 关于电子化交易

基金份额持有人可以通过本公司电子自助交易系统(7\*24 小时服务)办理基金交易业务,包括:基金认购、申购、定期定额申购、赎回、转换、撤单、分红方式变更及查询等业务。电子化交易方式有:

网上交易:基金份额持有人可以使用多家银行的银行卡通过网上交易系统自助办理基金交易业务。

网址: <https://etrade.icbccs.com.cn/webTrading/view/html/login/login.html>。

手机 APP:操作简单、应用灵活,基金份额持有人可随时随地通过手机 APP 办理业务。

下载方式:基金份额持有人可以通过在本公司官网下载,也可以通过 AppStore、华为应用市场、腾讯应用宝、小米应用市场等应用市场搜索下载。

微信交易:基金份额持有人可通过关注“工银微财富或工银瑞信基金”微信公众号办理基金交易业务。

有关基金管理人直销电子自助交易具体规则请参考公司官方网站相关公告和业务规则。

### (七) 关于网站服务

公司官方网站为基金份额持有人提供账户信息、交易信息、产品信息、公告信息、基金资讯等查询服务,以及基金申购/转换/定期定额查询理财工具、财富俱乐部积分兑换、客户活动参与和交流等服务。

### (八) 关于微信服务

公司通过官方微信等即时通讯服务平台为投资者提供理财资讯、基金信息查询及投资者教育等服务。投资者可在微信中搜索并关注“工银瑞信基金”（gyrx\_20050621）订阅号、“工银微财富”（gyrx\_wcf）服务号、“工银瑞信投教研习社”（gyrxtjyxs-2020）投教号，已开立工银瑞信基金账户的投资者，将微信账号与基金账户绑定后可通过微信“工银瑞信基金”订阅号、“工银微财富”服务号查询基金份额等信息。

#### （九）基金份额持有人意见、建议或投诉受理

基金份额持有人可以通过本公司客户服务热线电话、在线客服、电子邮箱、信函传真等渠道或方式对基金管理人和销售机构提出意见、建议或投诉。

## 二十六、其他应披露事项

1. 工银瑞信四季收益债券型证券投资基金（LOF）2021年第一次分红公告，2021-04-13；
2. 工银瑞信基金管理有限公司关于修订旗下部分公募基金基金合同和托管协议的公告，2021-04-30；
3. 工银瑞信基金管理有限公司关于法定代表人变更的公告，2021-07-08；
4. 工银瑞信四季收益债券型证券投资基金（LOF）2021年第二次分红公告，2021-07-12；
5. 工银瑞信基金管理有限公司关于旗下基金投资广大特材非公开发行股票的公告，2021-07-21；
6. 工银瑞信基金管理有限公司关于总经理任职的公告，2021-07-24；
7. 工银瑞信基金管理有限公司关于旗下深交所基金新增扩位简称的公告，2021-08-21；
8. 工银瑞信基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的长期停牌股票估值方法调整的公告，2021-09-01；
9. 工银瑞信四季收益债券型证券投资基金（LOF）2021年第三次分红公告，2021-10-19；
10. 工银瑞信基金管理有限公司关于旗下基金投资北交所上市股票的公告，2021-11-17；
11. 工银瑞信基金管理有限公司住所变更的公告，2021-12-21；
12. 工银瑞信基金管理有限公司关于在基金直销电子自助交易系统开展费率优惠活动的公告，2021-12-31；
13. 工银瑞信基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具准则的公告，2022-01-01；

14. 工银瑞信基金管理有限公司关于旗下基金投资浙江鼎力非公开发行股票的公告，2022-01-06；
15. 工银瑞信四季收益债券型证券投资基金(LOF) 2021 年第四次分红公告，2022-01-13；
16. 工银瑞信基金管理有限公司关于基金直销电子自助交易系统的业务公告，2022-01-15；
17. 工银瑞信基金管理有限公司投资旗下基金相关事项的公告，2022-01-27。

## 二十七、招募说明书的存放及查阅方式

本招募说明书存放在基金管理的办公场所和营业场所，并刊登在基金管理人的网站上。投资人可免费查阅，也可在支付工本费后在合理时间内获得本招募说明书的复印件或复制件，基金管理人保证文本的内容与公告的内容完全一致。

## 二十八、备查文件

- 1、中国证监会批准工银瑞信四季收益债券型证券投资基金募集的文件
- 2、《工银瑞信四季收益债券型证券投资基金基金合同》
- 3、《工银瑞信四季收益债券型证券投资基金托管协议》
- 4、法律意见书
- 5、工银瑞信基金管理有限公司业务资格批件和营业执照
- 6、中国农业银行股份有限公司业务资格批件和营业执照

以上第（一）至（五）项备查文件存放在基金管理人办公场所、营业场所，第（六）项文件存放于基金托管人的办公场所。基金投资者在营业时间可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

工银瑞信基金管理有限公司

二〇二二年十月二十四日

## 附件一

### 一、基金合同当事人的权利、义务

#### （一）基金管理人

##### 1、基金管理人的权利

- （1）自本基金合同生效之日起，依照有关法律法规和本基金合同的规定独立运用基金财产；
- （2）获得基金管理人报酬；
- （3）依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

(4) 在符合有关法律法规和本基金合同的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则，决定基金的除调高托管费和管理费之外的费率结构和收费方式；

(5) 根据本基金合同及有关规定监督基金托管人，对于基金托管人违反了本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金财产、其他基金当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会和银行业监督管理机构，并采取必要措施保护基金及相关基金当事人的利益；

(6) 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购、赎回和转换申请；

(7) 自行担任基金注册登记机构或选择、更换注册登记机构，并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查；

(8) 选择、更换代销机构，并依据销售代理协议和有关法律法规，对其行为进行必要的监督和检查；

(9) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

(10) 依法召集基金份额持有人大会；

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

(12) 根据国家有关规定，在法律法规允许的前提下，以基金的名义依法为基金融资、融券；

(13) 法律法规规定的其他权利。

## 2、基金管理人的义务

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

(2) 办理基金备案手续；

(3) 自基金合同生效之日起，以诚实信用、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财产分别管理，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) 计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回价格；
- (9) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；
- (10) 按规定受理基金份额的申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
- (11) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- (12) 编制季度报告、中期报告和年度报告；
- (13) 严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
- (14) 保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、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，不得向他人泄露；
- (15) 按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；
- (16) 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；
- (17) 保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- (18) 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- (19) 组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- (20) 因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- (21) 基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；
- (22) 按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；
- (23) 建立并保存基金份额持有人名册；
- (24) 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；
- (25) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；
- (26) 不从事任何有损基金及其他基金合同当事人利益的活动；
- (27) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利，不谋求对上市公司的控股和直接管理；
- (28) 法律法规、基金合同规定的以及中国证监会要求的其他义务。

## (二) 基金托管人

### 1、基金托管人的权利

- (1) 获得基金托管费；

- (2) 监督基金管理人对本基金的投资运作；
- (3) 自本基金合同生效之日起，依法保管基金财产；
- (4) 在基金管理人更换时，提名新任基金管理人；
- (5) 根据本基金合同及有关规定监督基金管理人，对于基金管理人违反本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金财产、其他基金合同当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关基金合同当事人的利益；
- (6) 依法召集基金份额持有人大会；
- (7) 按规定取得基金份额持有人名册；
- (8) 法律法规规定的其他权利。

## 2、基金托管人的义务

- (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，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；对所托管的不同基金财产分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在名册登记、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，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；
- (5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
- (6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；
- (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应予保密，不得向他人泄露；
- (8) 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；
- (9) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料不少于 15 年；
- (10) 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；
- (11) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
- (12) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、各类基金份额净值和基金份额申购、赎回价格；
- (13) 按照规定监督基金管理人的投资运作；



- (14) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
- (15) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；
- (16) 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；
- (17) 因违反基金合同导致基金财产损失，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- (18) 按规定监督基金管理人按照法律法规规定和基金合同履行其义务，基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿；
- (19) 根据本基金合同和托管协议规定建立并保存基金份额持有人名册；
- (20) 参加基金财产清算组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- (21) 面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告中国证监会和中国银监会，并通知基金管理人；
- (22) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；
- (23) 法律法规、基金合同规定的以及中国证监会要求的其他义务。

### (三) 基金份额持有人

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关法律法规的规定，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；
- (5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- (6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- (7) 监督基金管理人的投资运作；
- (8) 对基金管理人、基金托管人、基金份额代销机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；
- (9) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

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

- (1) 遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；
- (2) 缴纳基金认购、申购款项及法律法规、基金合同和招募说明书规定的费用；

- (3) 在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；
- (4) 不从事任何有损基金及其他基金份额持有人合法权益的活动；
- (5) 执行生效的基金份额持有人大会决议；
- (6) 返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人、基金托管人及基金管理人的代理人处获得的不当得利；
- (7) 法律法规和基金合同规定的其他义务。

(四) 本基金合同当事人各方的权利义务以本基金合同为依据，不因基金账户名称而有所改变。

## 二、基金份额持有人大会

基金份额持有人大会由基金份额持有人或基金份额持有人的合法授权代表共同组成。除法律法规另有规定或基金合同另有约定外，基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

### (一) 召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

- (1) 终止基金合同；
- (2) 转换基金运作方式；
- (3) 变更基金类别；
- (4) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略(法律法规和中国证监会另有规定的除外)；
- (5) 变更基金份额持有人大会议事程序；
- (6) 更换基金管理人、基金托管人；
- (7) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准或提高销售服务费率，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准或销售服务费率的除外；
- (8) 本基金与其他基金的合并；
- (9) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响，需召开基金份额持有人大会的变更基金合同等其他事项；
- (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) 基金扩募或者延长基金合同期限；
- (13) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。。

2、以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改,不需召开基金份额持有人大会:

(1) 调低基金管理费、基金托管费、其他应由基金或基金份额持有人承担的费用;

(2) 法律法规要求增加的基金费用的收取;

(3) 在法律法规和本基金合同规定的范围内调整基金的申购费率、调低赎回费率、调低销售服务费率或变更收费方式;

(4) 因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改;

(5) 基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化;

(6) 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;

(7) 按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

## (二) 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;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;

2、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或在规定时间内未能作出书面答复,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。

3、代表基金份额 10%以上(以上含本数,下同)的基金份额持有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或在规定时间内未能作出书面答复,代表基金份额 10%以上的基金份额持有人仍认为有必要召开的,应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集,并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人;基金托管人决定召集的,应当自出具书面决定之日起 60 日内召开。

4、代表基金份额 10%以上的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会,而基金管理人、基金托管人都不召集的或在规定时间内未能作出书面答复的,代表基金份额 10%以上的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会,但应当至少提前 30 日向中国证监会备案。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。

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

## (三) 召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1、基金份额持有人大会的召集人(以下简称“召集人”)负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。召开基金份额持有人大会,召集人必须于会议召开日前40日在指定媒介和基金管理人网站公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容:

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

2、采用通讯方式开会并进行表决的情况下,由召集人决定通讯方式和表决方式,并在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、表达意见的寄交的截止时间和收取方式。

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

#### (四)基金份额持有人出席会议的方式

##### 1、会议方式

(1)基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会,会议的召开方式由会议召集人确定。

(2)现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席,现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席,基金管理人或基金托管人拒不派代表出席的,不影响表决效力。

(3)通讯方式开会指基金份额持有人将其对表决事项的表决意见以书面形式或会议通知等相关公告中指定的其他形式在表决截至日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式或会议通知等相关公告中指定的其他形式进行表决。

## 2、召开基金份额持有人大会的条件

### (1) 现场开会方式

在同时符合以下条件时，现场会议方可举行：

1) 经核对、汇总，到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，全部有效凭证所对应的基金份额应占权益登记日基金总份额的 50%以上（含 50%，下同）；

2) 亲自出席会议者持有基金份额持有人凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及授权委托书等文件符合有关法律、法规和基金合同及会议通知的规定，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。

未能满足上述条件的情况下，则召集人可另行确定并公告重新开会的时间（至少应在 25 个工作日后）和地点，但确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不变。

### (2) 通讯开会方式

在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

1) 召集人按本基金合同规定公布会议通知后，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和统计基金份额持有人的表决意见，基金管理人或基金托管人经通知拒不参加收取和统计表决意见的，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代表的基金份额应占权益登记日基金总份额的 50%以上（含 50%）；

4) 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表，同时提交的持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与登记注册机构记录相符，并且委托人出具的代理投票授权委托书符合法律法规、基金合同和会议通知的规定；

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

## （五）议事内容与程序

### 1、议事内容及提案权

(1) 议事内容为本基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容以及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。

(2) 基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日本基金总份额 10%以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前就召开事由向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案；也可以在会议通知发出后向大会召集人提交临时提案，临时

提案应当在大会召开日前 35 日提交召集人。召集人对于临时提案应当在大会召开日前 30 日公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少与临时提案公告日期有 30 日的间隔期。

(3) 对于基金份额持有人提交的提案(包括临时提案)，大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

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

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

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

(5) 基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后，如果需要对原有提案进行修改，应当最迟在基金份额持有人大会召开日前 30 日公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有 30 日的间隔期。

## 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规定程序宣布会议议事程序及注意事项，确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，经合法执业的律师见证后形成大会决议。

大会由基金管理人授权代表主持。在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权代表主持；如果基金管理人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以所代表的基金份额 50%以上（含 50%）多数选举产生一名代表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。

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)、身份证号码、住所地址、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名(或单位名称)等事项。

### (2) 通讯方式开会

在通讯表决开会的方式下，首先由召集人按照前述约定公布提案，在所通知的表决截止日期第 2 日在公证机构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。

3、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。

#### （六）决议形成的条件、表决方式、程序

1、基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

2、基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

##### （1）一般决议

一般决议须经出席会议的基金份额持有人及其代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）通过方为有效，除下列(2)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

特别决议须经出席会议的基金份额持有人及代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方为有效；更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式、提前终止基金合同必须以特别决议通过方为有效。

3、基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会核准，或者备案，并予以公告。

4、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，表面符合法律法规和会议通知规定的表决意见即视为有效的表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

5、基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

#### （七）计票

##### 1、现场开会

(1)如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，则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推举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集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和代理人中推举 3 名基金份额持有人担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力及表决结果。

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

(3) 如会议主持人对于提交的表决结果有怀疑，可以对投票数进行重新清点；如会议主持人未进行重新清点，而出席会议的基金份额持有人或代理人对会议主持人宣布的表决结果有异议，其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点，会议主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。重新清点后，大会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。

## 2、通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，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(如果基金托管人为召集人，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不派代表监督计票的，不影响计票效力及表决结果。但基金管理人或基金托管人应当至少提前两个工作日通知召集人，由召集人邀请无直接利害关系的第三方担任监督计票人员。

### (八) 基金份额持有人大会决议报中国证监会核准或备案后的公告时间、方式

1、基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效，并在生效后方可执行。

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

3、基金份额持有人大会决议应自生效之日起 2 个工作日内在指定媒介和基金管理人网站公告。

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

### (九) 实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定

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

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

2、现场开会的到会者在权益登记日代表的基金份额不少于本基金在权益登记日相关基



金份额的二分之一（含二分之一）；

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

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

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

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

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

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

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

### 三、基金合同的变更、终止及基金财产的清算

#### （一）《基金合同》的变更

1、下列涉及到基金合同内容变更的事项应召开基金份额持有人大会并经基金份额持有人大会决议同意：

(1) 终止基金合同；

(2) 转换基金运作方式；

(3) 变更基金类别；

(4) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略（法律法规和中国证监会另有规定的除外）；

(5) 变更基金份额持有人大会议事程序；

(6) 更换基金管理人、基金托管人；

(7) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准或提高销售服务费率。但根据法律法规的要求提高该等报酬标准或销售服务费率的除外；

(8) 本基金与其他基金的合并；

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

金合同等其他事项；

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

(11) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

《基金合同》生效后，当出现下述情形之一时，基金管理人应当召集召开基金份额持有人大会审议《基金合同》终止或与其他基金合并事项：

(1) 基金资产净值连续 90 个工作日低于 3000 万元；

(2) 基金份额持有人数量连续 90 个工作日不满 200 人；

(3) 前十大基金份额持有人持有基金份额总和占基金总份额的比例连续 90 个工作日大于 90%。

若基金合同终止或与其他基金合并的决议获得基金份额持有人大会批准，基金管理人将按照有关规定将决议报中国证监会核准后执行。

若基金合同终止或与其他基金合并事项未获得基金份额持有人大会通过，基金管理人将按照有关规定将基金份额持有人大会表决结果报中国证监会核准并公告。若基金份额持有人大会不满足有关法律法规和本基金合同第十章的相关规定未能成功召开，或者基金合同终止或与其他基金合并事项未获得基金份额持有人大会通过，但自依法公告的基金份额持有人通知中载明的基金份额持有人大会召开之日起，再次出现上述情形之一时，基金管理人应再行召集基金份额持有人大会，审议有关基金《基金合同》终止或与其他基金合并事项。

但出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会决议，由基金管理人和基金托管人同意变更后公布经修订的基金合同，并报中国证监会备案：

(1) 因相应的法律法规发生变动并属于基金合同必须遵照进行变更的情形；

(2) 基金合同的变更并不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化的；

(3) 因为当事人名称、住所、法定代表人变更，当事人分立、合并等原因导致基金合同内容必须作出相应变动的；

(4) 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的；

(5) 按照法律法规和基金合同规定不需要召开基金份额持有人大会的其他情形的。

2、关于变更基金合同的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准或备案，并经中国证监会核准或出具无异议意见之日起生效。基金管理人应在上述基金份额持有人大会决议生效后 2 日内在指定媒介和基金管理人网站公告。

(二) 《基金合同》的终止

有下列情形之一的，本基金合同经中国证监会核准后将终止：

1、基金份额持有人大会决定终止的；

- 2、基金管理人职责终止，而在 6 个月内没有新的基金管理人承接的；
- 3、基金托管人职责终止，而在 6 个月内没有新的基金托管人承接的；
- 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

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

(2) 基金清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券、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。基金清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

#### 2、基金财产清算程序：

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

#### 3、清算费用

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

#### 4、基金财产按下列顺序清偿：

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

基金财产未按前款(1)－(3)项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

#### 5、基金财产清算的公告

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。

#### 6、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

#### 四、争议的处理

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

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

本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

#### 五、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

基金合同可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、代销机构的办公场所和营业场所查阅；投资者也可按工本费购买基金合同复制件或复印件，但内容应以本基金合同正本为准。

## 附件二

### 一、托管协议当事人

#### (一) 基金管理人

名称：工银瑞信基金管理有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 5 号、甲 5 号 9 层甲 5 号 901

办公地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 A 座 6-9 层

邮政编码：100033

法定代表人：赵桂才

成立日期：2005 年 6 月 21 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2005]93 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：贰亿元人民币

存续期间：持续经营

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。

## （二）基金托管人

名称：中国农业银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座九层

邮政编码：100031

法定代表人：谷澍

成立时间：2009 年 1 月 15 日

基金托管资格批准文号：中国证监会证监基字[1998]23 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：34,998,303.4 万元人民币

存续期间：持续经营

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；结汇、售汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；代理资金清算；各类汇兑业务；代理政策性银行、外国政府和国际金融机构贷款业务；贷款承诺；组织或参加银团贷款；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇借款；发行、代理发行、买卖或代理买卖股票以外的外币有价证券；外汇票据承兑和贴现；自营、代客外汇买卖；外币兑换；外汇担保；资信调查、咨询、见证业务；企业、个人财务顾问服务；证券公司客户交易结算资金存管业务；证券投资基金托管业务；企业年金托管业务；产业投资基金托管业务；合格境外机构投资者境内证券投资托管业务；代理开放式基金业务；电话银行、手机银行、网上银行业务；金融衍生产品交易业务；经国务院银行业监督管理机构等监管部门批准的其他业务。

## 二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

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

本基金的投资范围包括具有良好流动性的企业债、公司债、短期融资券、地方政府债、商业银行金融债与次级债、可转换债券（含分离交易的可转换债券）、资产支持证券、债券

回购、国债、中央银行票据、政策性金融债、银行存款等固定收益类资产，股票（含存托凭证）和权证等权益类资产，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。法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金投资组合资产配置比例：债券等固定收益类资产占基金资产的比例不低于 80%；其中公司债、企业债、短期融资券、商业银行金融债与次级债、企业资产支持证券、可转换债券（含分离交易的可转换债券）等企业机构发行的债券占基金固定收益类资产的比例不低于 80%；股票等权益类资产占基金资产的比例不超过 20%。本基金转换为开放式基金（LOF）以后，基金持有现金及到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金可以通过参与新股申购、增发新股、可转换债券转股票、权证行权以及要约收购类股票套利等低风险的投资方式来提高基金收益水平，但此类投资比例不超过基金资产的 20%。

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

- 1、 本基金持有的债券等固定收益类资产占基金资产的比例不低于 80%；
- 2、 本基金持有的公司债、企业债、短期融资券、商业银行金融债与次级债、企业资产支持证券、可转换债券（含分离交易的可转换债券）等企业机构发行的债券占基金固定收益类资产的比例不低于 80%；
- 3、 本基金投资于股票等权益类资产的比例不高于基金资产的 20%；
- 4、 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；
- 5、 本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%；
- 6、 除被动获得权证外，本基金不得进行权证投资；本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；
- 7、 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；
- 8、 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%；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%；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%；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）的债券或资产支持证券。基金持有债券或资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

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

11、本基金转换为开放式基金（LOF）后，基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；

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

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

14、本基金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；

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

如果法律法规对基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

除第 9、11、12、14 条外，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

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

准确性、完整性，并负责及时将更新后的名单发送给对方。

若基金托管人发现基金管理人与关联交易名单中列示的关联方进行法律法规禁止基金从事的关联交易时，基金托管人应及时提醒并协助基金管理人采取必要措施阻止该关联交易的发生，如基金托管人采取必要措施后仍无法阻止关联交易发生时，基金托管人有权向中国证监会报告。对于基金管理人已成交的关联交易，基金托管人事前无法阻止该关联交易的发生，只能进行事后结算，基金托管人不承担由此造成的损失，并向中国证监会报告。

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

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

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

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

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

2、流通受限证券与上文提及的流动性受限资产的定义并不一致，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。



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

4、在投资流通受限证券之前，基金管理人应至少提前两个交易日向基金托管人提供有关流通受限证券的相关信息，具体应当包括但不限于如下文件（如有）：

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

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

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

7、如果基金管理人未按照本协议的约定向基金托管人报送相关数据或者报送了虚假的数据或者出现其他影响基金托管人履行托管人监督职责的行为，导致基金托管人不能履行托管人职责的，基金管理人应承担相应法律后果，包括但不限于承担基金托管人可能遭受的监管部门罚款以及基金托管人向基金份额持有人承担的赔偿。因投资流动受限证券产生的损失，除依据法律法规的规定以及基金合同的约定应当由基金份额持有人承担的之外，由基金管理人承担，基金托管人不承担上述损失。如因基金管理人未遵守相关制度、流动性风险处置方案以及投资额度和比例限制要求的原因导致本基金出现风险损失致使基金托管人承担连带赔偿责任的，基金管理人应赔偿基金托管人由此遭受的损失。法律法规及监管机构另有规定的除外。

（七）基金托管人对基金管理人选择存款银行进行监督。

基金投资银行定期存款的，基金管理人应根据法律法规的规定及基金合同的约定，确定符合条件的所有存款银行的名单，并及时提供给基金托管人，基金托管人应据以对基金投资银行存款的交易对手是否符合有关规定进行监督。本基金投资银行存款应符合如下规定：

1、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

务账目及核算的真实、准确。

2、基金管理人与基金托管人应根据相关规定，就本基金银行存款业务另行签订书面协议，明确双方在相关协议签署、账户开设与管理、投资指令传达与执行、资金划拨、账目核对、到期兑付、文件保管以及存款证实书的开立、传递、保管等流程中的权利、义务和职责，以确保基金财产的安全，保护基金份额持有人的合法权益。

3、基金托管人应加强对基金银行存款业务的监督与核查，严格审查、复核相关协议、账户资料、投资指令、存款证实书等有关文件，切实履行托管职责。

4、基金管理人与基金托管人在开展基金存款业务时，应严格遵守《基金法》、《运作办法》等有关法律法规，以及国家有关账户管理、利率管理、支付结算等的各项规定。

基金托管人发现基金管理人在选择存款银行时有违反有关法律法规的规定及基金合同的约定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人在 10 个工作日内纠正。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在 10 个工作日内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人在 10 个工作日内纠正或拒绝结算。

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

(九) 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执行核查。对基金托管人发出的书面提示，基金管理人应在规定时间内答复并改正，或就基金托管人的疑义进行解释或举证；对基金托管人按照法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

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

### 三、基金管理人对基金托管人的业务核查

(一) 基金管理人对基金托管人履行托管职责情况进行核查, 核查事项包括基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和各类基金份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

(二) 基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、基金合同、本协议及其他有关规定时, 应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正。基金托管人收到通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金管理人发出回函, 说明违规原因及纠正期限, 并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内, 基金管理人有权随时对通知事项进行复查, 督促基金托管人改正。基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为, 包括但不限于: 提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性, 在规定时间内答复基金管理人并改正。

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

#### 四、基金财产的保管

##### (一) 基金财产保管的原则

- 1、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。
- 2、基金托管人应安全保管基金财产。未经基金管理人依据合法程序作出的合法合规指令, 基金托管人不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。
- 3、基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户。
- 4、基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户, 确保基金财产的完整与独立。
- 5、基金托管人根据基金管理人的指令, 按照基金合同和本协议的约定保管基金财产, 如有特殊情况双方可另行协商解决。
- 6、对于因为基金投资产生的应收资产, 应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人, 到账日基金财产没有到达基金账户的, 基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金财产造成损失的, 基金托管人对此不承担任何责任。
- 7、除依据法律法规和基金合同的规定外, 基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

##### (二) 基金募集期间及募集资金的验资

- 1、基金募集期间的资金应存于基金管理人在具有托管资格的商业银行开设的基金认购专户。该账户由基金管理人开立并管理。

2、基金募集期满或基金停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，基金管理人应将属于基金财产的全部资金划入基金托管人开立的基金银行账户，同时在规定时间内，聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的 2 名或 2 名以上中国注册会计师签字方为有效。

3、若基金募集期限届满，未能达到基金合同生效的条件，由基金管理人按规定办理退款等事宜，基金托管人应提供充分协助。

### （三）基金资金账户的开立和管理

1、基金托管人应负责本基金的资金账户的开设和管理。

2、基金托管人可以本基金的名义在其营业机构开设本基金的资金账户，并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。本基金的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益、收取申购款，均需通过本基金的资金账户进行。

3、基金资金账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立任何其他银行账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

4、基金资金账户的开立和管理应符合相关法律法规的有关规定。

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

### （四）基金证券账户的开立和管理

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

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

3、基金托管人以自身法人名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户，并代表所托管的基金完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级法人清算工作，基金管理人应予以积极协助。结算备付金的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

4、基金证券账户的开立和证券账户卡的保管由基金托管人负责，账户资产的管理和运用由基金管理人负责。

5、在本托管协议生效日之后，本基金被允许从事其他投资品种的投资业务，涉及相关账户的开设、使用的，按有关规定开设、使用并管理；若无相关规定，则基金托管人应当比

照并遵守上述关于账户开设、使用的规定。

#### （五）债券托管专户的开设和管理

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

#### （六）其他账户的开立和管理

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

2、法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

#### （七）基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的有关实物证券、银行定期存款存单等有价凭证由基金托管人负责妥善保管，保管凭证由基金托管人持有。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。属于基金托管人实际有效控制下的实物证券在基金托管人保管期间的损坏、灭失，由此产生的责任应由基金托管人承担。托管人对托管人以外机构实际有效控制的证券不承担保管责任。

#### （八）与基金财产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的、与基金有关的重大合同的原件分别由基金管理人、基金托管人保管。除协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时应当保证基金一方持有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。重大合同的保管期限为基金合同终止后 15 年。

### 五、基金资产净值计算和会计核算

#### （一）基金资产净值的计算及复核程序

##### 1、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的金额。

基金份额净值是指基金资产净值除以基金份额总数。各类基金份额净值的计算，均精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。国家另有规定的，从其规定。

每工作日计算基金资产净值及各类基金份额净值，并按规定公告。

##### 2、复核程序

基金管理人每工作日对基金资产进行估值后，将各类基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人按合同规定的净值披露日对外公布。

## （二）基金资产估值方法和特殊情形的处理

### 1、估值对象

基金依法拥有的股票、债券、权证和银行存款等基金资产和负债

### 2、估值方法

本基金按以下方式进行估值：

#### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

（1）交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价（收盘价），确定公允价值进行估值。

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

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

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

#### 2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

（1）送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在证券交易所上市的同一种股票的市价（收盘价）估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

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

（3）首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一种股票的市价（收盘价）估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

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

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

5、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

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

7、交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量。

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

9、本基金投资存托凭证的估值核算，依照境内上市交易的股票进行。

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

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

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。

### （三）基金份额净值错误处理的原则和方法

（1）当任一类基金份额净值小数点后4位以内（含第4位）发生差错时，视为该类基金份额净值错误；基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；错误偏差达到或超过该类基金资产净值的0.25%时，基金管理公司应当及时通知基金托管人并报中国证监会；错误偏差达到该类基金份额净值的0.50%时，基金管理人应当公告、通报基金托管人并报中国证监会备案；当发生净值计算错误时，由基金管理人负责处理，由此给基金份额持有人和基金造成损失的，应由基金管理人先行赔付，基金管理人按差错情形，有权向其他当事人追偿。

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

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

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

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

④由于基金管理人提供的信息错误（包括但不限于基金申购或赎回金额等），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的损失，由基金管理人负责赔付。

(3) 由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，有关会计制度变化或由于其他不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误而造成的基金份额净值计算错误，基金管理人、基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

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

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

(四) 暂停估值与公告基金份额净值的情形

(1) 基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

(2) 因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

(3) 占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障基金份额持有人的利益，已决定延迟估值时；

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

(5) 中国证监会和基金合同认定的其他情形。

(五) 基金会计制度

按国家有关部门规定的会计制度执行。

(六) 基金账册的建立



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

#### （七）基金财务报表与报告的编制和复核

##### 1、财务报表的编制

基金管理人应当及时编制并对外提供真实、完整的基金财务会计报告。月度报表的编制，基金管理人应于每月终了后 5 个工作日内完成；招募说明书在基金合同生效后每 6 个月更新并公告一次，于该等期间届满后 45 日内公告。季度报告应在每个季度结束之日起 10 个工作日内编制完毕并于每个季度结束之日起 15 个工作日内予以公告；半年度报告在会计年度半年终了后 40 日内编制完毕并于会计年度半年终了后 60 日内予以公告；年度报告在会计年度结束后 60 日内编制完毕并于会计年度终了后 90 日内予以公告。基金合同生效不足 2 个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。

##### 2、报表复核

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

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

#### 六、基金份额持有人名册的登记与保管

本基金的基金管理人和基金托管人须分别妥善保管的基金份额持有人名册，包括基金合同生效日、基金合同终止日、基金权益登记日、基金份额持有人大会权益登记日、每年 6

月 30 日、12 月 31 日的基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容至少应包括持有人的名称和持有的基金份额。

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

基金管理人应及时向基金托管人提交基金份额持有人名册。每年 6 月 30 日和 12 月 31 日的基金份额持有人名册应于下月前十个工作日内提交；基金合同生效日、基金合同终止日等涉及到基金重要事项日期的基金份额持有人名册应于发生日后十个工作日内提交。

基金管理人和基金托管人应妥善保管基金份额持有人名册，保存期限为 15 年。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。若基金管理人或基金托管人由于自身原因无法妥善保管基金份额持有人名册，应按有关法规规定各自承担相应的责任。

#### （七）争议解决方式

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

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

本协议适用中华人民共和国法律并从其解释。

注：本基金信息披露事项以法律法规规定及基金合同“二十、基金的信息披露”约定的内容为准。若本基金实施侧袋机制的，侧袋机制实施期间的相关安排见基金合同和招募说明书的规定。