富国新天锋定期开放债券型证券投资基金上市交易公告书

基金管理人：富国基金管理有限公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司
注册登记机构：中国证券登记结算有限责任公司

上市地点：深圳证券交易所
上市时间：2012年6月28日
公告日期：2012年6月25日

一、重要声明与提示

富国新天锋定期开放债券型证券投资基金上市交易公告书（以下简称"本公告"）依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称"《基金法》"）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号<上市交易公告书的内容与格式>》、《深圳证券交易所交易规则》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，富国新天锋定期开放债券型证券投资基金（以下简称"本基金"）管理人富国基金管理有限公司的董事会及董事保证本公告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本基金托管人中国建设银行股份有限公司保证本公告中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、深圳证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。凡本公告未涉及的有关内容，请投资者详细查阅刊登在2012年3月28日《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》以及富国基金管理有限公司网站（www.fullgoal.com.cn）上的《富国新天锋定期开放债券型证券投资基金招募说明书》。

二、基金概览

1、基金名称：富国新天锋定期开放债券型证券投资基金。
2、基金类别：债券型。
3、基金运作方式：契约型开放式。

本基金以定期开放的方式运作。自基金合同生效日起（包括基金合同生效日）或者每一个开放期结束之日次日起（包括该次日）三年（含三年）的期间内，本基金采取封闭运作模式，期间基金份额总额保持不变，基金份额持有人不得申请申购、赎回本基金。本基金的第一个封闭期为自基金合同生效日起三年。下一个封闭期为首个开放期结束之日次日起的三年，以此类推。

每一个封闭期结束后，本基金即进入开放期，开放期的期限为自封闭期结束之日后第一个工作日起（含该日）五至二十个工作日，具体期间由基金管理人在封闭期结束前公告说明。如封闭期结束之日后第一个工作日因不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放申购与赎回业务的，开放期自不可抗力或其他情形的影响因素消除之日起的下一个工作日开始。开放期内因发生不可抗力或其他情形而发生基金暂停申购与赎回业务的，开放期将按因不可抗力或其他情形而暂停申购与赎回的期间相应延长。开放期间本基金采取开放运作模式，投资人可办理基金份额申购、赎回或其他业务。

4、基金存续期限：不定期。
5、基金份额总额：本基金总份额945,778,694.63份（截至2012年6月20日）。
6、富国新天锋定期开放债券型证券投资基金基金份额参考净值：1.022元（截至2012年6月20日）
8、本次上市交易的基金份额简称及代码：富国天锋，代码：161019
9、富国新天锋定期开放债券型证券投资基金本次上市交易的基金份额总额：63,776,496.00份（截至2012年6月20日）
10、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所
11、上市交易日期：2012年6月28日
12、基金管理人：富国基金管理有限公司
13、基金托管人：中国建设银行股份有限公司

三、富国新天锋定期开放债券型证券投资基金的募集与上市交易

（一）富国新天锋定期开放债券型证券投资基金上市前募集情况
1、本基金发售申请的核准机构和核准文号：中国证监会证监许可［2011］1946号
2、发售日期：2012年4月5日至2012年4月27日
3、发售面值：1.00元人民币
4、发售方式：场内、场外认购
5、发售机构：
（1）场内发售机构
已经具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员单位。
（2）场外发售机构
1）直销机构：富国基金管理有限公司。
2）代销银行：中国建设银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、宁波银行股份有限公司、杭州银行股份有限公司、中国工商银行股份有限公司、中国光大银行股份有限公司。
3）代销券商：海通证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、国海证券有限责任公司、华福证券有限责任公司、招商证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、国联证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、瑞银证券有限责任公司、齐鲁证券有限公司、江海证券有限公司、中信证券（浙江）有限责任公司、渤海证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、中原证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、中信万通证券有限责任公司、金元证券股份有限公司。
6、验资机构名称：安永华明会计师事务所有限责任公司
7、认购资金总额及入账情况：
本次富国新天锋定期开放债券型证券投资基金募集的有效认购户数为5,743户，净销售金额为人民币945,314,446.51元，认购款项在基金验资确认日前产生的利息共计人民币464,248.12元。
上述资金中，场内首次发行募集基金为人民币62,689,842.00元，场外首次发行募集基金为人民币883,088,852.63元，分别于2012年5月7日全额划入本基金在基金托管人中国建设银行股份有限公司开立的富国新天锋定期开放债券型证券投资基金托管专户。
按照每份基金份额初始面值1.00元计算，本次募集期的募集资金及其利息结转的份额共计945,778,694.63份，已全部计入基金份额持有人基金账户，归基金份额持有人所有。
8、基金备案情况
本基金于2012年5月7日验资完毕，2012年5月7日向中国证监会提交了验资报告，办理基金备案手续，并于2012年5月7日获得书面确认，本基金基金合同自该日起正式生效。
9、基金合同生效日：2012年5月7日。
10、本基金总份额945,778,694.63份。
（二）富国新天锋定期开放债券型证券投资基金基金份额上市交易的主要内容
1、基金上市交易的核准机构和核准文号：深圳证券交易所深证上［2012］196号
2、上市交易日期：2012年6月28日
3、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所
4、基金简称：富国新天锋
场内简称：富国天锋
5、交易代码：161019
6、本次上市交易份额：63,776,496.00份（截至2012年6月20日）
7、基金资产净值的披露：每个工作日的次日公布富国新天锋定期开放债券型证券投资基金的基金份额净值，并在深交所行情发布系统揭示。
8、未上市交易份额的流通规定：未上市交易的份额托管在场外，基金份额持有人将其转托管至深圳证券交易所场内后即可上市流通。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

（一）持有人户数
截至2012年6月20日，富国新天锋定期开放债券型证券投资基金场内基金份额持有人户数为185户，平均每户持有的富国新天锋定期开放债券型证券投资基金场内基金份额344,737.82份。
（二）持有人结构
截至2012年6月20日，场内基金份额持有人结构如下：
场内机构投资者持有的场内富国新天锋定期开放债券型证券投资基金基金份额47,186,099份，占比73.99%；场内个人投资者持有的场内富国新天锋定期开放债券型证券投资基金基金份额16,590,397份，占比26.01%。
（三）截至2012年6月20日，场内富国新天锋定期开放债券型证券投资基金基金份额前十名持有人情况

序号	基金份额持有人名称	持有份额	占场内基金总份额的比例（%）
1	上海证券有限责任公司	20,001,388	31.36%
2	金元证券股份有限公司	9,999,694	15.68%
3	中国民族证券有限责任公司	5,000,694	7.84%
4	招商证券股份有限公司	5,000,694	7.84%
5	广发证券股份有限公司	5,000,347	7.84%
6	郭钢	2,510,299	3.94%
7	钱海庆	1,494,103	2.34%
8	林彤	1,220,220	1.91%
9	上海新越企业管理顾问有限公司	1,183,213	1.86%
10	深圳市顺展实业有限公司	1,000,069	1.57%

注：以上信息依据中国证券登记结算有限公司深圳分公司提供的持有人信息编制

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人
1、基本情况
名称：富国基金管理有限公司
住所：上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期16、17层
办公地址：上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期16、17层
法定代表人：陈敏
总经理：窦玉明
成立日期：1999年4月13日
电话：（021）20361818
传真：（021）20361616
联系人：林志松
注册资本：1.8亿元人民币
股权结构（截止于2012年6月20日）：

股东名称	出资比例（%）
海通证券股份有限公司	27.775%
申银万国证券股份有限公司	27.775%
加拿大蒙特利尔银行	27.775%
山东省国际信托有限公司	16.675%

公司设立了投资决策委员会和风险控制委员会等专业委员会。投资决策委员会负责制定基金投资的重大决策和投资风险管理。风险控制委员会负责公司日常运作的风险控制和管理工作，确保公司日常经营活动符合相关法律法规和行业监管规则，防范和化解运作风险、合规与道德风险。

公司目前下设十七个部门和四个分公司，分别是：权益投资部、固定收益部、另类投资部、研究部、集中交易部、专户投资部、机构业务部、零售业务部、营销策划与产品部、客服与电子商务部、战略发展部、监察稽核部、计划财务部、人力资源部、行政管理部、信息技术部、运营部、北京分公司、深圳分公司、成都分公司、广州分公司。权益投资部：负责权益类基金产品的投资管理；固定收益部：负责固定收益类产品的研究与投资管理；另类投资部：负责FOF、PE、定量类产品等的研究与投资管理；研究部：负责行业研究、上市公司研究和宏观研究等；集中交易部：负责投资交易和风险控制；专户投资部：在固定收益部、权益投资部和另类投资部内设立的虚拟部门，独立负责年金等专户产品的投资管理；机构业务部：负责年金、专户、社保以及共同基金的机构客户营销工作；零售业务部：管理华东营销中心、华中营销中心、华南营销中心（深圳分公司、广州分公司）、北方营销中心（北京分公司）、西部营销中心（成都分公司）、华北营销中心，负责共同基金的零售业务；营销策划与产品部：负责产品开发、营销策划和品牌建设等；客服与电子商务部：负责电子商务与客户服务；战略发展部：负责公司战略的研究、规划与落实；监察稽核部：负责监察、风控、法务和信息披露；信息技术部：负责软件开发与系统维护等；运营部：负责基金会计与清算；计划财务部：负责公司财务计划与管理；人力资源部：负责人力资源规划与管理；行政管理部：负责文秘、行政后勤等。

截止到2012年6月20日，公司有员工197人，其中59%以上具有硕士以上学历。所有人员在最近三年内均未受到所在单位及有关管理部门的处罚。

3、本基金基金经理
赵恒毅先生，1981年出生，金融学硕士。自2005年7月开始从事证券投资管理工作。2005年7月至2008年3月任通用技术集团投资管理有限公司研究员；2008年4月至2011年5月任富国基金管理有限公司研究员；2011年5月至今任富国天盈分级债券型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格，中国国籍。
邹卉女士，1980年出生，金融学硕士。自2006年3月开始从事证券投资管理工作。2006年3月至2007年8月任上海国泰人寿保险有限公司投资部投资助理；2007年8月至2008年8月任东方基金管理有限公司债券交易员；自2008年9月至2011年7月任富国基金管理有限公司债券研究员，自2011年8月起任富国天时货币市场基金基金经理。具有基金从业资格，中国国籍。

（二）基金托管人
1、基本情况
名称：中国建设银行股份有限公司（简称：中国建设银行）
住所：北京市西城区金融大街25号
办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人：王洪章
成立时间：2004年09月17日
注册资本：贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元
联系人：尹东
联系电话：（010）6759 5003
2、主要人员情况
中国建设银行总行设投资托管服务部，下设综合制度处、基金市场处、资产托管处、QFII托管处、基金核算处、基金清算处、监督稽核处和投资托管团队、涉外资产核算团队、养老金托管服务团队、养老金托管市场团队、上海备份中心等12个职能处室、团队，现有员工130余人。自2008年以来中国建设银行托管业务持续通过SAS70审计，并已经成为常规化的内控工作手段。
3、基金托管业务经营情况
作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持"以客户为中心"的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2011年12月31日，中国建设银行已托管224只证券投资基金。建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。2011年，中国建设银行以总分第一的成绩被国际权威杂志《全球托管人》评为2011年度"中国最佳托管银行"；并获和讯网2011年中国"最佳资产托管银行"奖。

（三）基金验资机构
名称：安永华明会计师事务所有限责任公司
注册地址：北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼16层
办公地址：上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心50楼
法定代表人：葛明
联系电话：021-22288888
传真：021-22280000
联系人：徐艳
经办注册会计师：徐艳、蒋燕华

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件

七、基金财务状况

深圳证券交易所在本基金募集期间未收取任何费用，其他各基金销售机构根据本基金招募说明书设定的费率收取认购费。

本基金募集结束后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

富国新天锋定期开放债券型证券投资基金2012年6月20日资产负债表如下：
（除特别注明外，金额单位为人民币元）

资 产	本期末2012年6月20日
资 产：	
银行存款	16,755,121.05
结算备付金	24,050,402.17
存出保证金	—
交易性金融资产	1,360,983,985.06
其中：股票投资	—
债券投资	1,360,983,985.06
资产支持证券投资	—
基金投资	—
衍生金融资产	—
买入返售金融资产	—
应收证券清算款	154,971,608.15
应收利息	35,470,741.59
应收股利	—
应收申购款	—
其他资产	—
资产合计：	1,592,231,858.02
负债和所有者权益	
负债：	
短期借款	—
交易性金融负债	—
衍生金融负债	—
卖出回购金融资产款	625,000,000.00
应付证券清算款	73,672.73
应付赎回款	—
应付管理人报酬	316,432.11
应付托管费	105,477.36
应付销售服务费	—
应付交易费用	6,863.25
应付税费	—
应付利息	78,594.78
应付利润	—
其他负债	69,665.40
负债合计	625,650,705.63
所有者权益：	—
实收基金	945,778,694.63
未分配利润	20,802,457.76
所有者权益合计	966,581,152.39
负债与持有人权益总计：	1,592,231,858.02

八、基金投资组合

截至2012年6月20日，富国新天锋定期开放债券型证券投资基金的投资组合如下：
（一）期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	—	—
	其中：股票	—	—
2	固定收益投资	1,360,983,985.06	85.48
	其中：债券	1,360,983,985.06	85.48
	资产支持证券	—	—
3	金融衍生品投资	—	—
4	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
5	银行存款和结算备付金合计	40,805,523.22	2.56
6	其他资产	190,442,349.74	11.96
7	合计	1,592,231,858.02	100.00

（二）报告期末按行业分类的股票投资组合
注：截至2012年6月20日，本基金未持有股票。
（三）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
注：截至2012年6月20日，本基金未持有股票。
（四）报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	39,556,000.00	4.09
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	1,318,306,846.66	136.39
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债	3,121,138.40	0.32
8	其他	—	—
9	合计	1,360,983,985.06	140.80

（五）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	1280128	12渝地产债	700,000	72,422,000.00	7.49
2	122761	11萧国资	500,000	51,085,000.00	5.29
3	122949	09常投债	500,000	49,900,000.00	5.16
4	122968	09杭城投	500,000	49,500,000.00	5.12
5	122896	10芜开债	500,000	48,175,000.00	4.98

（六）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细
注：截至2012年6月20日，本基金未持有资产支持证券。
（七）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细
注：截至2012年6月20日，本基金未持有权证。
（八）投资组合报告附注
1、申明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。
截至2012年6月20日，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。
2、申明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。
截至2012年6月20日，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。
3、其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	—
2	应收证券清算款	154,971,608.15
3	应收股利	—
4	应收利息	35,470,741.59
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	190,442,349.74

4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注：截至2012年6月20日，本基金未持有处于转股期的可转换债券。
5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
注：截至2012年6月20日，本基金未持有股票。

九、重大事件揭示

本基金自基金合同生效至上市交易期间未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

十、基金管理人承诺

本基金管理人就本基金上市交易之后履行管理人职责做出承诺：
（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规、基金合同的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。
（二）真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件，披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息，并接受中国证监会、深圳证券交易所的监督管理。
（三）在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后，将及时予以公开澄清。

十一、基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺：
（一）严格遵守《基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及本基金基金合同、托管协议的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则托管基金资产。
（二）根据《基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及本基金基金合同、托管协议的规定，对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金份额净值计算进行监督和核查。如发现基金管理人违反《基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及本基金基金合同、托管协议的规定，将及时通知基金管理人纠正；基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人将及时向中国证监会报告。

十二、备查文件目录

以下备查文件存放于基金管理人和基金托管人的办公场所，投资者可在办公时间免费查阅。
（一）中国证监会核准基金募集的文件
（二）《富国新天锋定期开放债券型证券投资基金基金合同》
（三）《富国新天锋定期开放债券型证券投资基金招募说明书》
（四）《富国新天锋定期开放债券型证券投资基金托管协议》
（五）法律意见书
（六）基金管理人业务资格批件、营业执照
（七）基金托管人业务资格批件、营业执照

富国基金管理有限公司
2012年6月25日

附件：基金合同内容摘要

一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务
（一）基金管理人的权利
根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的权利为：
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.依照基金合同获得基金管理费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；
3.发售基金份额；
4.依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
5.在符合有关法律法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则，在法律法规和本基金合同规定的范围内决定和调整基金的除调高托管费率和管理费率之外的相关费率结构和收费方式；
6.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当事人的利益；
7.在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回申请；
8.在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资、融券；
9.自行担任或选择、更换注册登记机构，获取基金份额持有人名册，并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查；
10.选择、更换代销机构，并依据基金销售服务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；
11.选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；
12.在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
13.依法召集基金份额持有人大会；
14.法律法规和基金合同规定的其他权利。
（二）基金管理人的义务
根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的义务为：
1.依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
2.办理基金备案手续；
3.自基金合同生效之日起，以诚实信用、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管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；
6.除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得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.计算并公告基金资产净值，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、赎回和注销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.编制中期和年度基金报告；
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.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；
24.执行生效的基金份额持有人大会决议；
25.不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；
26.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；
27.法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。
（三）基金托管人的权利
根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的权利为：
1.依基金合同约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；
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，依法保管基金资产；
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，对基金资产、其他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资料；
8.法律法规和基金合同规定的其他权利。
（四）基金托管人的义务
根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的义务为：
1.安全保管基金财产；
2.设立专门的基金托管部，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；
3.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；
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、中期和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人有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；
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.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；
19.参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.面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行业监督管理机构，并通知基金管理人；
21.执行生效的基金份额持有人大会决议；
22.不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；
23.建立并保存基金份额持有人名册；
24.法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。
（五）基金份额持有人的权利
根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的权利为：
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.依法转让或在开放期内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、基金份额发售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。
每份基金份额具有同等的合法权益。
（六）基金份额持有人的义务
根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的义务为：
1.遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；
2.交纳基金认购、申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用；
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，自基金管理人及基金管理人的代理人、基金托管人、代销机构、其他基金份额持有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。
二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则
（一）基金份额持有人大会由基金份额持有人组成。基金份额持有人持有的每一基金份额具有同等的投票权。
（二）召开事由
1.当出现或需要决定下列事由之一的，经基金管理人、基金托管人或持有基金份额10%以上（含10%，下同）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）提议时，应当召开基金份额持有人大会：
（1）终止基金合同（本基金合同另有规定的除外）；
（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；
（5）变更基金份额持有人大会程序；
（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，但法律法规要求提高该等报酬标准的除外；
（8）本基金与其他基金的合并；
（9）对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；
（10）法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。
2.出现以下情形之一的，可由基金管理人和基金托管人协商后修改基金合同，不需召开基金份额持有人大会：
（1）调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；
（2）在法律法规和本基金合同规定的范围内变更基金的申购费率、赎回费率或收费方式；
（3）因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；
（4）对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重大变化；
（5）基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；
（6）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。
（三）召集人和召集方式
1.除法律法规或本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者不能召集时，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，基金托管人仍认为有必要召开的，应当自行召集。
3.代表基金份额10%以上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，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，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。
5.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。
（四）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30日在指定媒体公告。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基金份额持有人权益登记日；
（6）代理投票的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书面表决方式，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、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。
3.如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。
（五）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、通讯方式开会或法律法规和监管机关允许的其他方式。
（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，如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）通讯方式开会指按照本基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。
（4）会议的召开方式由召集人确定。
（5）在法律法规或监管机构允许的情况下，经会议通知载明，基金份额持有人也可以采用网络、电话或其他方式进行表决，或者采用网络、电话或其他方式授权他人代为出席会议并表决。
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）对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示，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）到会的基金份额持有人身份证明及持有基金份额的凭证、代理人身份证明、委托人持有基金份额的凭证及授权委托代理手续完备，到会者出具的相关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注册登记资料相符。
（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）召集人按基金合同规定通知基金托管人或/和基金管理人（分别或共同称为"监督人"）到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；
3）召集人在监督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书面表决意见，如基金管理人或基金托管人经通知拒不到场监督的，不影响表决效力；
4）本人直接出具书面意见和授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的50%以上；
5）直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人提交的持有基金份额的凭证、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，并与注册登记机构记录相符。
（六）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。
（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。
（3）对于基金份额持有人提交的提案，大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：
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进行解释和说明。
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做出决定。如将其提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会做出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。
（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，应当在基金份额持有人大会召开前30日及时公告。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。
大会由召集人授权代表主持。基金管理人为召集人的，其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。
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、持有或代表有表决权的基金份额数量、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，首先由召集人提前30日公布提案，在所通知的表决截止日期后第2个工作日在公证机关及监督人的监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。如监督人经通知但拒绝到场监督，则在公证机关监督下形成的决议有效。
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。
（七）决议形成的条件、表决方式、程序
1.基金份额持有人所持每一基金份额享有平等的表决权。
2.基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：
（1）一般决议
一般决议须经出席会议的基金份额持有人（或其代理人）所持表决权的50%以上通过方为有效，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（或其代理人）所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方为有效；涉及更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式、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，否则表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。
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。
（八）计票
1.现场开会
（1）如大会由基金管理人或基金托管人召集，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，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基金管理人、基金托管人授权的一名监督员共同担任监票人；但如果基金管理人和基金托管人的授权代表未出席，则大会主持人可自行选举三名基金份额持有人代表担任监票人。
（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）如大会主持人对于提交的表决结果有异议，可以对投票数进行重新清点；如大会主持人未进行重新清点，而出席大会的基金份额持有人或代理人对大会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，大会主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。
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票人在监督人派出的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；如监督人经通知但拒绝到场监督，则大会召集人可自行授权3名监票人进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。
（九）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。关于本章第（二）条所规定的第（1）－（8）项召开事由的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准生效后方可执行，关于本章第（二）条所规定的第（9）、（10）项召开事由的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准或出具无异议意见后方可执行。
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决议。
3.基金份额持有人大会决议应自生效之日起2日内在指定媒体公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。
三、基金收益分配原则、执行方式
（一）基金利润的构成
基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额；基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。
（二）基金可供分配利润
基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。
（三）收益分配原则
本基金收益分配应遵循下列原则：
1.本基金的每份基金份额享有同等分配权；
2.收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记机构可将投资人的现金红利按除权后的单位净值自动转为基金份额；
3.本基金收益每年最多分配12次；若每月最后一个自然日基金每10份基金份额的可供分配利润不低于0.05元，则基金须进行收益分配，并以该日作为收益分配基准日，每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的50%；
4.若基金合同生效不满3个月则可不进行收益分配；
5.本基金收益分配采用现金分红方式；
6. 基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过15个工作日；
7. 基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；
8.法律法规或监管机构另有规定的从其规定。
（四）收益分配方案
基金收益分配方案中应载明收益分配基准日以及该日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式、支付方式等内容。
（五）收益分配的时间和程序
1.基金收益分配方案由基金管理人拟订，由基金托管人复核，依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告并报中国证监会备案；
2.在收益分配方案公布后，基金管理人依据具体方案的规定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。
四、与基金财产管理、运用有关费用的计提、支付方式与比例
（一）基金费用的种类
1.基金管理人的管理费；
2.基金托管人的托管费；
3.基金财产拨划支付的银行费用；
4.基金合同生效后的基金信息披露费用；
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.基金的开户费用、账户维护费用
9.在中国证监会规定允许的前提下，本基金可以从基金财产中计提销售服务费，具体计提方法、计提标准在招募说明书或相关公告中载明；
10.依法可以在基金财产中列支的其他费用。
（二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式
1.基金管理人的管理费
在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的0.6%年费率计提。计算方法如下：
$H=E\times$年管理费率÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日基金资产净值
基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人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5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、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0.2%年费率计提。计算方法如下：
$H=E\times$年托管费率÷当年天数
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5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.除管理费和托管费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关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。
五、基金财产的投资方向和投资限制
（一）投资目标
本基金在追求基金资产长期安全的基础上，力争为基金份额持有人创造高于业绩比较基准的投资收益。
（二）投资范围
本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的国家债券、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、可转换债券、可交换债券、可分离债券和回购等金融工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益证券品种（但须符合中国证监会的相关规定）。
本基金也可投资于非固定收益类金融工具。本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产，但可以参与一级市场的新股申购或增发新股（包括创业板、中小板以及其他经中国证监会批准上市的股票），并可持有因可转债、可交换债转股所形成的股票、因所持股票所派发的权证以及因投资可分离债券而产生的权证等，以及法律法规或中国证监会允许投资的其他非固定收益类品种（但须符合中国证监会的相关规定）。因上述原因持有的股票和权证等资产，本基金应在其可交易之日起的30个交易日内卖出。
如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。
基金的投资组合比例为：本基金在封闭期间，投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的80%，投资于非固定收益类资产的比例不高于基金资产的20%，其中在封闭期开始的3个月和封闭期最后的3个月不受前述投资组合比例的限制；本基金在开放期间也不受前述投资组合比例的限制，但本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。
（三）投资限制
1.组合限制
本基金在投资策略上兼顾投资原则以及开放式基金的固有特点，通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。基金的投资组合将遵循以下限制：
（1）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%；
（2）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%；
（3）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%；
（4）本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的10%；
（5）本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%；
（6）本基金在封闭期间，投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的80%，投资于非固定收益类资产的比例不高于基金资产的20%，其中在封闭期开始的3个月和封闭期最后的3个月不受前述投资组合比例的限制；本基金在开放期间也不受前述投资组合比例的限制，但本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。
（7）本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的10%；
（8）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%；
（9）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%；
（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%；
（11）本基金应投资于信用级别评级为BBB以上（含BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出；
（12）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；
（13）本基金投资流通受限证券，基金管理人应事先根据中国证监会相关规定，与基金托管人在本基金托管协议中明确基金投资流通受限证券的比例，根据比例进行投资。基金管理人应制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险。
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。
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。
基金管理人应当自每个封闭期开始日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。
2.禁止行为
为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：
（1）承销证券；
（2）向他人贷款或者提供担保；
（3）从事承担无限责任的投资；
（4）买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
（5）向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
（6）买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；
（7）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
（8）依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动；
（9）法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。
六、基金资产净值的计算方法和公告方式
（一）基金资产净值的计算方法
基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。
（二）基金资产净值、基金份额净值的公告方式
1.本基金的基金合同生效后，在基金上市交易之前，基金管理人将至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值；
2. 在本基金上市交易后，基金管理人将在每个交易日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露基金份额净值和基金份额累计净值；
3.基金管理人将公告半年度和年度最后一个市场交易日（或自然日）基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在上述市场交易日（或自然日）的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定报刊和网站上。
七、基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产的清算方式
（一）基金合同的变更
1.基金合同变更内容对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的，应召开基金份额持有人大会，基金合同变更的内容应经基金份额持有人大会决议同意。
（1）转换基金运作方式；
（2）变更基金类别；
（3）变更基金投资目标、投资范围或投资策略；
（4）变更基金份额持有人大会程序；
（5）更换基金管理人、基金托管人；
（6）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准。但根据适用的相关规定提高该等报酬标准的除外；
（7）本基金与其他基金的合并；
（8）对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；
（9）法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。
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，并报中国证监会备案：
（1）调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；
（2）在法律法规和本基金合同规定的范围内变更基金的申购费率、赎回费率或收费方式；
（3）因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；
（4）对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重大变化；
（5）基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；
（6）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。
2.关于变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案，并于中国证监会核准或出具无异议意见后生效执行，并自生效之日起2日内在至少一种指定媒体公告。
（二）本基金合同的终止
有下列情形之一的，本基金合同经中国证监会核准或备案后将终止：
1.基金份额持有人大会决定终止的；
2.基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在6个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务；
3.基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而在6个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务；
4.在开放期最后一日本基金的份额持有人数量不满200人，或者基金资产净值加上当日净申购的基金份额对应的资产净值或减去当日净赎回的基金份额对应的资产净值低于2亿元；
5.在开放期，基金发生大规模净赎回申请（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），且申请确认后因交易成本等因素该等申请将明显损害剩余持有人的利益；
6.中国证监会规定的其他情况。
（三）基金财产的清算
1.基金财产清算组
（1）基金合同终止时，成立基金财产清算组，基金财产清算组在中国证监会的监督下进行基金清算。
（2）基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。
（3）基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算组可以依法进行必要的民事活动。
2.基金财产清算程序
基金合同终止，应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。基金财产清算程序主要包括：
（1）基金合同终止后，发布基金财产清算公告；
（2）基金合同终止时，由基金财产清算组统一接管基金财产；
（3）对基金财产进行清理和确认；
（4）对基金财产进行估价和变现；
（5）聘请会计师事务所对清算报告进行审计；
（6）聘请律师事务所出具法律意见书；
（7）将基金财产清算结果报告中国证监会；
（8）参加与基金财产有关的民事诉讼；
（9）公布基金财产清算结果；
（10）对基金剩余财产进行分配。
3.清算费用
清算费用是指基金财产清算组在进行基金财产清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算组优先从基金财产中支付。
4.基金财产按下列顺序清偿：
（1）支付清算费用；
（2）交纳所欠税款；
（3）清偿基金债务；
（4）按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。
基金财产未按前款（1）－（3）项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。
5.基金财产清算的公告
基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算组公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算结果经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，由基金财产清算组报中国证监会备案并公告。
6.基金财产清算账册及文件的保存
基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。
八、争议解决方式
对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。
争议处理期间，基金合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。
本基金合同受中国法律管辖。
九、基金合同存放地和投资者取得合同的方式
本基金合同可印制成册，供投资人在基金管理人、基金托管人、代销机构和注册登记机构办公场所查阅，但其效力应以基金合同正本为准。