工银瑞信纯债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：工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司
注册登记人：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9月20日
公告日期：2012年9月17日

一、重要声明与提示

工银瑞信纯债定期开放债券型证券投资基金（以下简称"本基金"）上市交易公告书依据《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>》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，本基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，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。

本基金托管人交通银行股份有限公司保证本报告书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。

本上市交易公告书第七节"基金财务状况"已经审计。

凡本上市交易公告书未涉及的有关内容，请投资者详细查阅刊登在2012年5月18日《中国证券报》以及工银瑞信基金管理有限公司网站（www.icbccs.com.cn）上的《工银瑞信纯债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：工银瑞信纯债定期开放债券型证券投资基金
2、基金类型：债券型
3、基金简称：工银纯债定期开放债券
4、场内简称：工银纯债
5、基金代码：164810
6、基金运作方式：契约型开放式（本基金自基金合同生效日起每封闭三年集中开放申购与赎回一次）。
7、本基金的存续期为不定期。
8、本基金通过场外和场内两种方式公开发售。本基金份额在封闭期内不得赎回，但可以在深圳证券交易所上市交易。基金份额持有人可通过办理跨系统转登记业务实现基金份额在两个登记系统之间的转换。
9、基金份额上市：基金合同生效后3个月内本基金开始在深圳证券交易所上市交易。
10、基金份额总额：4,808,809,476.50份（截至2012年9月13日）。
11、基金份额净值：0.991元（截至2012年9月13日）
12、本次上市交易份额：3,130,497.00份（截至2012年9月13日）
13、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所
14、上市交易日期：2012年9月20日
15、基金管理人：工银瑞信基金管理有限公司
16、基金托管人：交通银行股份有限公司
17、本次上市交易的基金份额注册登记机构：中国证券登记结算有限责任公司

三、基金的募集与上市交易

（一）本基金上市前募集情况
1、本基金募集申请的核准机构和核准文号：中国证券监督管理委员会证监许可［2012］625号
2、基金运作方式：契约型开放式（本基金自基金合同生效日起每封闭三年集中开放申购与赎回一次）。
本基金以定期开放方式运作，其封闭期为自基金合同生效之日起（包括基金合同生效之日）或自每一开放期结束之日次日起（包括该日）三年的期间。本基金的第一个封闭期为自基金合同生效之日起三年。首个封闭期结束之后第一个工作日起进入首个开放期，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。本基金每个开放期最长不超过1个月，最短不少于5个工作日，开放期的具体时间以基金管理人届时公告为准，且基金管理人最迟应于开放期的2日前进行公告。如在开放期内发生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，开放期时间中止计算，在不可抗力或其他情形影响因素消除之日次日起，继续计算该开放期时间，直至满足开放期的时间要求。
3、基金存续期：不定期
4、发售日期：2012年5月21日至2012年6月15日
5、发售价格：1.00元人民币
6、发售方式：本基金通过场内、场外两种方式公开发售。
7、发售机构：
（1）深圳证券交易所（场内）发售机构
已经具有基金代销业务资格的深交所会员单位：
爱建证券、安信证券、渤海证券、财达证券、财富证券、财通证券、长城证券、长江证券、大通证券、大同证券、德邦证券、第一创业、东北证券、东方证券、东海证券、东莞证券、东吴证券、东兴证券、高华证券、方正证券、光大证券、广发证券、广州证券、国都证券、国海证券、国金证券、国开证券、国联证券、国盛证券、国泰君安、国信证券、国元证券、海通证券、恒泰长财、恒泰证券、红塔证券、宏源证券、华安证券、华宝证券、华创证券、华福证券、华林证券、华龙证券、华融证券、华泰联合、华泰证券、华西证券、华鑫证券、江海证券、金元证券、联讯证券、民生证券、民族证券、南京证券、平安证券、齐鲁证券、日信证券、瑞银证券、山西证券、上海证券、申银万国、世纪证券、首创证券、天风证券、天源证券、万和证券、万联证券、西部证券、西藏同信、西南证券、厦门证券、湘财证券、新时代证券、信达证券、兴业证券、银河证券、银泰证券、英大证券、招商证券、浙商证券、中航证券、中金公司、中山证券、中投证券、中天证券、中信建投、中信浙江、中信万通、中信证券、中银证券、中邮证券、中原证券等
（2）柜台（场外）发售机构
1）直销机构：工银瑞信基金管理有限公司。
2）代销银行：中国工商银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、杭州银行股份有限公司。
3）场外代销机构包括具有场外代销业务资格的券商机构。
国泰君安证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、国信证券股份有限公司、中信证券（浙江）有限责任公司、申银万国证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、中信万通证券有限责任公司、中信证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、信达证券股份有限公司等。
8、验资机构名称：普华永道中天会计师事务所有限公司
9、认购资金总额及入账情况：
本次认购总金额4,806,410,110.28元人民币，该资金已于2012年6月21日全额划入本基金在基金托管人交通银行股份有限公司开立的基金托管专户；认购资金的银行利息共元，已折算为基金份额分别计入各基金份额持有人基金帐户。
本基金按照每份基金份额1.00元计算，募集期间募集资金及其利息结转的基金份额共计4,808,809,476.50份，其中场外认购的工银纯债份额为4,805,788,226.50份，场内认购的工银纯债份额为3,021,250.00份。
10、基金备案情况
本基金已于2012年6月21日验资完毕，当日向中国证监会提交验资报告，办理基金备案手续，并于2012年6月21日获得书面确认，本基金基金合同自该日起正式生效。
11、基金合同生效日：2012年6月21日。
12、基金合同生效日的基金总份额：4,808,809,476.50份。
（二）本基金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］302号
2、上市交易日期：2012年9月20日
3、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所。投资者在深圳证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金交易。
4、基金简称：工银纯债定期开放债券
5、基金场内简称：工银纯债
6、交易代码：164810
7、本次上市交易份额：3,130,497.00份（截至2012年9月13日）
8、基金资产净值的披露：基金管理人每个估值日对基金资产估值。用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。本基金上市交易后，基金管理人于每个工作日交易结束后将经过基金托管人复核的基金份额净值传送给深交所，深交所于次日通过行情系统揭示。根据《基金法》，本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此基金管理人对公布的基金净值负责。
9、未上市交易份额的流通规定：如有未上市交易的份额托管在场外，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情况

（一）本基金基金份额持有情况
截至2012年9月13日，本基金持有人户数为32,231户，平均每户持有的基金份额为149,198.27份。
（二）场内基金份额持有人结构
截至2012年9月13日，场内机构投资者持有的本基金份额有0份，占本基金场内总份额的0%；场内个人投资者持有的基金份额有3,130,497.00份，占本基金场内总份额的100%。
（三）场内工银纯债份额前十名持有人情况（截至2012年9月13日）

序号	持有人名称（全称）	持有工银纯债份额	所占比例
1	韩巍	300,029.00	9.58%
2	李映白	300,019.00	9.58%
3	吴盛平	300,009.00	9.58%
4	王瑛	200,075.00	6.39%
5	陆大祥	200,015.00	6.39%
6	游德勇	200,014.00	6.39%
7	张向淳	200,006.00	6.39%
8	白金亮	100,008.00	3.19%
9	周黎	100,007.00	3.19%
10	饶贤安	100,006.00	3.19%

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人
1、基本信息
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丙17号北京银行大厦
办公地址：北京市西城区金融大街丙17号北京银行大厦8层
邮政编码：100033
法定代表人：李晓鹏
总经理：郭特华
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
中国银监会银监复［2005］105号
组织形式：有限责任公司
注册资本：贰亿元人民币
营业执照注册号：100000400011263
经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、中国证监会许可的其他业务
信息披露联系人：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%；瑞士信贷占公司注册资本的20%.
存续期间：持续经营
2、经营概况
公司设立了三个专门机构：执行委员会、风险管理委员会和投资决策委员会。执行委员会负责公司日常经营管理活动中的重要决策，风险管理委员会负责公司整体运营风险的控制。投资决策委员会负责指导基金财产的运作、确定基本的投资策略和投资组合的原则。
本公司下设十九个部门，分别是：权益投资部、固定收益部、专户投资部、指数投资部、研究部、中央交易室、战略发展部、产品开发部、渠道销售部、营销策划部、客户服务中心、机构客户部、养老金部、风险管理部、法律合规部、运作部、信息科技部、人力资源及行政部、财务部。权益投资部负责根据投资决策委员会制定的投资原则进行股票选择和组合管理。固定收益部负责债券选择和组合管理。专户投资部负责管理公司旗下除共同基金外其余资产组合的日常投资管理工作。指数投资部负责公司境内外的指数投资及其它数量化投资基金与组合的管理工作。研究部完成对宏观经济、行业公司及市场的研究。中央交易室负责投资指令的交易。战略发展部从事公司发展战略研究。产品开发部负责新产品创新与开发。渠道营销部、机构客户部及客户服务中心从事市场开发及销售，项目管理，客户服务等工作。养老金部负责开拓及发展养老金、企业年金等项目。风险管理部负责基金投资风险管理及数量研究工作。法律合规部负责对公司管理和基金运作合规性进行全方位的监察稽核，并向公司管理层和监管机关提供独立、客观、公正的法律监察稽核报告。运作部负责公司开放式基金的注册登记、清算和会计工作。信息科技部负责公司的计算机设备维护、系统开发及网络运行和维护。人力资源及行政部负责公司人力资源招聘、薪酬、考核及培训等工作。财务部负责公司财务管理及日常行政事务管理等。。
截止到2012年8月31日，我公司共有员工202人，其中70%以上人员具有硕士以上学历，43%具有海外工作和学习背景（含短期国外培训）。所有人员在最近三年内均没有受到所在单位或有关管理部门的处罚。
目前，我公司已先后募集工银瑞信核心价值股票型基金、工银瑞信货币市场基金、工银瑞信精选平衡混合型基金、工银瑞信稳健成长股票型基金、工银瑞信增强收益债券型基金、工银瑞信红利股票型基金、工银瑞信中国机会全球配置股票型基金、工银瑞信信用添利债券型基金、工银瑞信大盘蓝筹股票型基金、工银瑞信沪深300指数基金、工银瑞信上证中央企业50交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信深证红利交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信深证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金、工银瑞信中小盘成长股票型基金、工银瑞信全球精选股票型基金、工银瑞信双利债券型证券投资基金、工银瑞信四季收益债券型证券投资基金、工银瑞信消费服务行业股票型证券投资基金、工银瑞信添颐债券型证券投资基金、工银瑞信主题策略股票型证券投资基金、工银瑞信保本混合型证券投资基金、工银瑞信睿智中证500分级指数证券投资基金、工银瑞信基本面量化策略股票型证券投资基金、工银瑞信纯债定期开放债券型证券投资基金、工银瑞信7天理财债券型基金。这样，本公司初步形成了风险水平从低到高的基金产品线。
3、本基金基金经理
杜海涛先生，15年证券从业经验；先后在宝盈基金管理有限公司担任基金经理助理，招商基金管理有限公司担任招商现金增值基金基金经理；2006年加入工银瑞信，现任固定收益部总监；2006年9月21日至2011年4月21日，担任工银货币市场基金基金经理；2007年5月11日至今，担任工银增强收益债券型基金基金经理；2010年8月16日至2012年1月10日，担任工银双利债券型基金基金经理；2011年8月10日至今，担任工银瑞信添颐债券型证券投资基金基金经理；2012年6月21日至今，担任工银纯债定期开放基金基金经理。
（二）基金托管人
1.基本情况：
公司法定中文名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）
公司法定英文名称：BANK OF COMMUNICATIONS CO.,LTD
法定代表人：胡怀邦
住所：上海市浦东新区银城中路188号
办公地址：上海市浦东新区银城中路188号
邮政编码：200120
注册时间：1987年3月30日
注册资本：618.85亿元
基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字［1998］25号
联系人：张咏东
电话：021-32169999
2.主要经营情况
交通银行始建于1908年，是中国历史最悠久的银行之一，也是近代中国发钞行之一。交通银行先后于2005年6月和2007年5月在香港联交所、上交所挂牌上市，是中国2010年上海世博会唯一的商业银行全球合作伙伴。《财资》（The Asset）杂志2010年全球最佳交易银行评选"中，交通银行荣膺 最佳次托管银行"大奖。英国《银行家》杂志2011年公布的全球1000家银行排名，交通银行以343.21亿美元的一级资本连续第三年跻身全球商业银行50强。截至2012年3月31日，交通银行资产总额达到人民币4.88万亿元，实现净利润人民币158.80亿元。
交通银行总行设资产托管部。现有员工具有多年基金、证券和银行的从业经验，具备基金从业资格，以及经济师、会计师、工程师和律师等中高级专业技术职称，员工的学历层次较高，专业分布合理，职业技能优良，职业道德素质过硬，是一支诚实勤勉、积极进取、开拓创新、奋发向上的资产托管从业人员队伍。
截止2012年二季度末，交通银行共托管证券投资基金64只，包括博时现金收益货币、博时新兴成长股票、长城久富股票（LOF）、富国汉兴封闭、富国天益价值股票、光大保德信中小盘股票、国泰金鹰增长股票、海富通精选混合、华安安顺封闭、华安宝利配置混合、华安策略优选股票、华安创新股票、华夏蓝筹混合（LOF）、华夏债券、汇丰晋信2016周期混合、汇丰晋信龙腾股票、汇丰晋信动态策略混合、汇丰晋信平稳增利债券、汇丰晋信大盘股票、汇丰晋信低碳先锋股票、汇丰晋信消费红利股票、建信优势封闭、金鹰红利价值混合、金鹰中小盘精选混合、大摩货币、农银恒久增利债券、农银行业成长股票、农银平衡双利混合、鹏华普惠封闭、鹏华普天收益混合、鹏华普天债券、鹏华中国50混合、鹏华信用增利、融通行业景气混合、泰达宏利成长股票、泰达宏利风险预算混合、泰达宏利稳定股票、泰达宏利周期股票、天治创新先锋股票、天治核心成长股票（LOF）、万家公用事业行业股票（LOF）、易方达科汇灵活配置混合、易方达科瑞封闭、易方达上证50指数、易方达科讯股票、银河银富货币、银华货币、中海优质成长混合、兴全磐稳增利债券、华富中证100指数、工银瑞信双利债券、长信量化先锋股票、华夏沪深中国指数、华安上证180ETF、博时深证基本面200ETF联接、建信信用增强债券、富安达优势成长股票、工银主题策略股票、汇丰晋信货币、农银汇理中证500指数、建信深证100指数、富安达策略精选混合、金鹰中证500指数分级、工银瑞信纯债定期开放债券。此外，还托管了全国社会保障基金、保险资产、企业年金、QFII、QDII、信托计划、证券公司集合资产计划、ABS、产业基金、专户理财等12类产品，托管资产规模超过一万亿元。
（三）基金验资机构
名　称：普华永道中天会计师事务所有限公司
住　所：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
办公地址：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
法定代表人：杨绍信
经办注册会计师：许康玮　吴海霞
联系电话：（021）23238888
传　真：（021）23238800

六、基金合同摘要

（一）基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务
1、基金份额持有人的权利、义务
（1）基金投资人持有本基金基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，基金投资人自依据招募说明书、基金合同取得本基金的的基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为当事人并不以在基金合同上书面签章为必要条件。每份基金份额具有同等的合法权益。
（2）基金份额持有人的权利
1）分享基金财产收益；
2）参与分配清算后的剩余基金财产；
3）依法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、注册登记机构、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、基金合同规定的其它权利。
（3）基金份额持有人的义务
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、申购款项及基金合同规定的费用；
3）在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；
4）不从事任何有损基金及其他基金合同当事人合法利益的活动；
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、基金托管人及代销机构处获得的不当得利；
7）基金合同规定的其他义务。
2、基金管理人的的权利、义务
（1）基金管理人的权利
1）依法募集基金，办理基金备案手续；
2）自基金合同生效之日起，依照法律法规和基金合同独立管理基金财产；
3）根据法律法规和基金合同的规定，制订、修改并公布有关基金募集、认购、申购、赎回、转托管、基金转换、非交易过户、冻结、收益分配等方面的业务规则；
4）根据法律法规和基金合同的规定获得基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
5）在符合有关法律法规和基金合同的前提下，决定本基金的相关费率结构和收费方式；
6）根据法律法规和基金合同之规定销售基金份额，收取认购费、申购费、基金赎回费及其它法律法规规定的费用；
7）依据法律法规和基金合同的规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了法律法规或基金合同规定对基金财产、其它基金合同当事人的利益造成重大损失的，应及时呈报中国证监会和中国银监会，以及采取其它必要措施以保护本基金及相关基金合同当事人的利益；
8）根据基金合同的规定选择、委托、更换适当的基金代销机构并有权依照代销协议对基金代销机构行为进行必要的监督和检查；
9）自行担任基金注册登记机构或选择、更换基金注册登记代理机构，办理基金注册登记业务，并按照基金合同规定对基金注册登记代理机构进行必要的监督和检查；
10）在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购、赎回和转换的申请；
11）在法律法规允许的前提下，为基金份额持有人的利益依法为基金进行融资融券；
12）依据法律法规和基金合同的规定，制订基金收益的分配方案；
13）按照法律法规，代表基金对被投资企业行使股东权利，代表基金行使因投资于其它证券所产生的权利；
14）在基金托管人职责终止时，提名新的基金托管人；
15）依据法律法规和基金合同的规定，召集基金份额持有人大会；
16）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；
17）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并确定有关费率；
18）法律法规、中国证监会、基金合同以及依据基金合同制订的其它法律文件所规定的其它权利。
（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）配备足够的专业人员办理基金份额的认购、申购和赎回业务；
6）配备足够的专业人员和相应的技术设施进行基金的注册登记或委托其他机构代理该项业务；
7）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资产相互独立，对所管理的不同基金和受托资产分别管理、分别记账，进行证券投资；
8）除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得以基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；
9）依法接受基金托管人的监督；
10）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，按照有关规定计算并公告基金份额净值，确定基金份额申购、赎回的价格；
11）严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
12）保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前，应予以保密，不得向他人泄露；
13）按基金合同确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；
14）按照法律法规和本基金合同的规定受理申购和赎回等申请，及时、足额支付赎回和分红款项；
15）不谋求对上市公司的控股和直接管理；
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）按规定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不少于15年；
18）进行基金会计核算并编制基金的财务会计报告；
19）编制季度、半年度和年度基金报告；
20）确保需要向基金份额持有人提供的各项文件或资料，能在规定时间内发出；保证投资人能够按照基金合同约定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件；
21）组织并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；
22）面临解散、依法被撤销、被依法宣告破产或者由接管人接管其资产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；
23）因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人的合法权益，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
24）监督基金托管人按法律法规和基金合同规定履行自己的义务，基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；
25）不从事任何有损基金财产及本基金其他当事人利益的活动；
26）公平对待所管理的不同基金和受托资产，防止在不同基金和受托资产间进行有损本基金基金份额持有人的利益的资源分配；
27）以基金管理人的名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；
28）基金合同规定的其他义务。
3、基金托管人的权利和义务
（1）基金托管人的权利
1）自基金合同生效日起依据法律法规和基金合同的规定保管基金财产；
2）依照基金合同的约定获得基金托管费；
3）监督基金管理人对本基金的投资运作，如托管人发现基金管理人的投资指令违反基金合同或有关法律法规的规定的，不予执行并向中国证监会报告；
4）在基金管理人职责终止时，提名新的基金管理人；
5）依据法律法规和基金合同的规定召集基金份额持有人大会；
6）依据法律法规和基金合同的规定监督基金管理人，如认为基金管理人违反了法律法规或基金合同规定对基金财产、其它基金合同当事人的利益造成重大损失的，有权及时呈报中国证监会，以及采取其它必要措施以保护本基金及相关基金合同当事人的利益；
7）法律法规、基金合同规定的其它权利。
（2）基金托管人的义务
1）以诚实信用、勤勉尽责的原则安全保管基金财产；
2）设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；
3）建立健全内部控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证其托管的基金财产与基金托管人自有资产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金和受托资产分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金、受托资产之间在名册登记、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》、本基金合同及其他有关规定外，不以基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；
5）按规定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）按照基金合同及托管协议的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
8）保守基金商业秘密。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予以保密，不得向他人泄露；
9）复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值及基金份额申购、赎回价格；
10）办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
11）对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人有未执行基金合同规定的行为，还应说明基金托管人是否采取了适当的措施；
12）按规定保存有关基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料，保存基金的会计账册、报表和记录等不少于15年；
13）根据有关法律法规，从基金管理人处接收并保存基金份额持有人名册；
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及调整基金份额持有人的基金转换份额；
16）按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金管理人或基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；
17）按照规定监督基金管理人的投资运作；
18）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；
19）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；
20）基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，基金托管人应为基金向基金管理人追偿；
21）因违反基金合同导致基金财产的损失，应承担赔偿责任，其责任不因其退任而免除；
22）不从事任何有损基金及基金合同其他当事人利益的活动；
23）本基金合同所规定的其他义务。
（二）基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则
1、本基金的基金份额持有人大会，由本基金的基金份额持有人或基金份额持有人的合法授权代表共同组成。本基金的基金份额持有人享有平等的表决权，每一基金份额具有一票表决权。
2、有以下事由情形之一时，应召开基金份额持有人大会：
（1）终止基金合同（不包括"五、基金备案"中约定的开放期最后一日日终可能终止基金合同的情形）；
（2）转换基金运作方式（不包括本基金封闭期与开放期运作方式的转换）；
（3）更换基金托管人；
（4）更换基金管理人；
（5）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；
（6）本基金与其它基金的合并；
（7）变更基金类别；
（8）变更基金投资目标、范围或策略（法律法规和中国证监会另有规定的除外）；
（9）变更基金份额持有人大会程序；
（10）对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；
（11）法律法规、基金合同或中国证监会规定的其它应当召开基金份额持有人大会的事项。
3、以下情况不需召开基金份额持有人大会：
（1）调低基金管理费、基金托管费；
（2）在法律法规和基金合同规定的范围内变更基金的申购费率、收费方式或调低赎回费率；
（3）因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改；
（4）对基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化；
（5）对基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；
（6）经中国证监会允许，基金推出新业务或服务；
（7）经中国证监会允许，基金管理人、注册登记机构、代销机构在法律法规规定的范围内调整有关基金交易、非交易过户、转托管等业务规则；
（8）除法律法规或基金合同规定应当召开基金份额持有人大会以外的其它情形。
4、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，会议时间、地点、方式和权益登记日由基金管理人选择确定。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（含10%，以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额10%以上（含10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开。
（4）代表基金份额10%以上（含10%）的基金份额持有人就同一事项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（含10%）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。
（6）基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。
5、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式
（1）召开基金份额持有人大会，召集人必须于会议召开日前40天在指定媒体及基金管理人网站上公告。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，不影响表决意见的计票效力。
6、基金份额持有人出席会议的方式
（1）会议方式
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。
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。
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。在法律法规或监管机构允许的情况下，在符合会议通知载明形式的前提下，基金份额持有人也可以采用网络、电话或其他方式表决。
会议的召开方式由召集人确定，但决定更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式和终止基金合同事宜必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。
（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：
a、对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示，有效的基金份额应占权益登记日基金总份额的50%以上（含50%）；
b、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：
a、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；
b、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书面表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取书面表决意见的，不影响表决效力；
c、本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额应占权益登记日基金总份额的50%以上（含50%）；
d、直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的其他代表，同时提交的持有基金份额的凭证符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与登记注册机构记录相符。
如果开会条件达不到上述条件，则召集人可另行确定并公告重新表决的时间，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。
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。
7、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（含10%）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天提交召集人。召集人对于临时提案应当在大会召开日前30天公布。
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：
a、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。
b、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）单独或合并持有权利登记日基金总份额10%以上（含10%）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或增加新的提案，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，经讨论后在公证机关监督下进行表决，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做出的决议的效力。
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，首先由召集人至少提前30天公布提案，在所通知的表决截止日期第2天在公证机构监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。
（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。
8、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特别决议和一般决议：
1）特别决议
特别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三分之二以上通过方为有效；更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式、终止基金合同的重大事项必须以特别决议方式通过；
2）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。
（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）基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。
（5）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。
（6）基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人和基金托管人均有约束力。
9、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，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。
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。
4）计票过程应由公证机关予以公证，基金管理人或基金托管人拒不参加基金份额持有人大会或拒不配合计票的，不影响计票的效力。
（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，由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。
10、基金份额持有人大会决议的生效与公告
（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。
（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日内由相关信息披露义务人在至少一种指定媒体公告。
11、其他
法律法规或监管部门对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。
（三）基金收益分配原则、执行方式
1、基金收益分配原则
本基金收益分配应遵循下列原则：
（1）本基金每份基金份额享有同等分配权；
（2）在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为12次，每年基金收益分配比例不低于该年度可供分配利润的90%；期末可供分配利润是指截至收益分配基准日（即可供分配利润计算截至日）期末资产负债表中基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数；
（3）若基金合同生效不满3个月，可不进行收益分配；
（4）基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即指基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；
（5）本基金的收益分配方式分为现金分红与红利再投资，投资人可自主选择，如投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金红利；
（6）本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至日）的时间不超过15个工作日。
（7）法律、法规或监管机构另有规定的，基金管理人在履行适当程序后，将对上述基金收益分配政策进行调整。
2、收益分配方案
基金收益分配方案中载明基金收益分配的范围、基金收益分配对象、基金期末可供分配利润、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式、支付方式及有关手续费等内容。
3、收益分配方案的确定与公告
基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人核实后确定，基金管理人应在2日内公告，并在公开披露日报中国证监会备案。
4、收益分配中发生的费用
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。
（四）与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例
1、基金费用的种类
（1）基金管理人的管理费；
（2）基金托管人的托管费；
（3）基金的证券交易费用；
（4）基金合同生效以后的与基金相关的信息披露费用；
（5）基金份额持有人大会费用；
（6）基金合同生效以后的与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
（7）基金银行汇划费用；
（8）基金上市费及年费；
（9）按照国家有关规定可以列入的其他费用。
本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。
上述基金费用由基金管理人在法律法规规定的范围内按照公允的市场价格确定，法律法规和基金合同另有规定时从其规定。
2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式
（1）基金管理人的管理费
本基金的管理费率为年费率0.6%。
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×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。经基金管理人与基金托管人核对一致后，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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。
（2）基金托管人的基金托管费
本基金的托管费率为年费率0.2%。
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×年托管费率÷当年天数
H 为每日应计提的基金托管费
E 为前一日的基金资产净值
基金托管费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，于次月首日起3个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。
（3）除管理费、托管费之外的费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入或摊入当期基金费用。
3、不列入基金费用的项目
基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效之前的律师费、会计师费和信息披露费用等不得从基金财产中列支。
4、基金管理费和基金托管费的调整
在符合相关法律法规和履行了必备的程序的条件下，基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费、基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前2日在至少一种指定媒体上刊登公告。
5、其他费用
按照国家有关规定和基金合同约定，基金管理人可以在基金财产中列支其他的费用，并按照相关的法律法规的规定进行公告或备案。
（五）基金财产的投资方向和投资限制
1、投资目标
在控制风险并保持资产流动性的基础上，力争实现超过业绩比较基准的投资收益。
2、投资范围
本基金的投资范围包括国债、地方政府债、金融债、央行票据、中期票据、次级债、企业债、公司债、可分离交易可转债的纯债部分、资产支持证券、短期融资券、银行存款、债券回购等固定收益类金融工具，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。
本基金不直接在二级市场买入股票、权证等权益类资产，也不参与一级市场新股申购和新股增发，可转债仅投资二级市场可分离交易可转债的纯债部分。
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，其投资比例遵循届时有效法律法规或相关规定。
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%，但在每次开放期前三个月、开放期及开放期结束后三个月的期间内，基金投资不受上述比例限制；开放期内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%。
3、投资禁止行为与限制
（1）本基金投资组合应符合以下规定：
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%，但在每次开放期前三个月、开放期及开放期结束后三个月的期间内，基金投资不受上述比例限制；
2）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%；
3）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%；债券回购最长期限为1年，债券回购到期后不得展期；
4）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%；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%；同一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%；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%，但中国证监会规定的特殊品种除外；
5）本基金投资于信用类产品的债项评级应为AA以上（含AA）。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，持有的资产支持证券应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出，债券应在评级报告发布之日后择机予以全部卖出；
6）本基金开放期内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；
7）相关法律法规、监管部门及基金合同规定的其他投资限制。
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。
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。法律、法规另有规定时，从其规定。
对于因基金份额拆分、大比例分红等集中持续营销活动引起的基金净资产规模在10个交易日内增加10亿元以上的情形，而导致证券投资比例低于基金合同约定的，基金管理人可将调整时限从10个交易日延长到3个月。法律法规如有变更，从其变更。
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，本基金禁止从事下列行为：
1）承销证券；
2）将基金财产向他人贷款或者提供担保；
3）从事使基金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托管人、基金管理人发行的股票或债券；
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承销期内承销的证券；
7）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
8）依照法律、行政法规有关规定，由国务院证券监督管理机构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。
4、投资组合比例调整
基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的，基金管理人应当在10个工作日内进行调整，法律法规另有规定的，从其规定。
（六）基金资产净值的计算方法和公告方式
1、基金资产净值指基金资产总值减去基金负债后的价值；
T日基金份额净值=T日基金资产净值/T日基金总份额余额
基金份额净值的计算，精确到0.001元，小数点第四位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。
2、基金合同生效后，基金上市交易前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值。
基金上市交易后，基金管理人应当在每个交易日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露交易日的基金份额净值和基金份额累计净值。
基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在中国证监会指定媒体上。
（七）基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式
1、基金合同的变更
（1）基金合同变更涉及本基金合同第十节第（二）项规定的对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的，应经基金份额持有人大会决议同意。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，并自中国证监会核准之日起生效。
（2）除上述第（1）项规定的情形外，经基金管理人和基金托管人同意可对基金合同的内容进行变更，该等变更应当在2日内由基金管理人进行公告并报中国证监会备案。
2、基金合同的终止
有下列情形之一的，经履行适当程序后，本基金合同终止：
（1）基金份额持有人大会决定终止；
（2）基金管理人职责终止，在六个月内没有新基金管理人承接的；
（3）基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金托管人承接的；
（4）在开放期最后一日日终发生基金合同第五节第（五）条约定的情形的；
（5）法律法规和基金合同规定的其他情形。
3、基金财产的清算
（1）基金合同终止情形发生，应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。
（2）基金财产清算组
1）自基金合同终止情形发生之日起30个工作日内由基金管理人组织成立基金财产清算组，在基金财产清算组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。
2）基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、基金注册登记机构、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。
3）基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算组可以依法进行必要的民事活动。
（3）清算程序
1）基金合同终止情形发生后，由基金财产清算组统一接管基金财产；
2）基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；
3）基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；
4）对基金财产进行评估和变现；
5）基金清算组做出清算报告；
6）会计师事务所对清算报告进行审计；
7）律师事务所对清算报告出具法律意见书；
8）将基金清算结果报告中国证监会；
9）公布基金清算公告；
10）对基金剩余财产进行分配。
（4）清算费用
清算费用是指基金财产清算组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金清算组优先从基金财产中支付。
（5）基金剩余财产的分配
基金财产按如下顺序进行清偿：
1）支付基金财产清算费用；
2）缴纳基金所欠税款；
3）清偿基金债务；
4）清算后如有余额，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。
（6）基金财产清算的公告
基金财产清算组成立后2日内应就基金财产清算组的成立进行公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算组做出的清算报告经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并公告。
（7）基金财产清算账册及文件由基金托管人保存期限不少于15年。
（八）争议解决方式
1、本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。
2、本基金合同的当事人之间因本基金合同产生的或与本基金合同有关的争议可首先通过友好协商或调解解决。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。
3、除争议所涉内容之外，本基金合同的其他部分应当由本基金合同当事人继续履行。
（九）基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式
基金合同可印制成册，存放在基金管理人和基金托管人住所，供投资人查阅，基金合同条款及内容应以基金合同正本为准。

七、基金财务状况

深圳证券交易所在工银瑞信纯债定期开放债券型证券投资基金认购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或佣金比率收取认购费。
本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。
工银瑞信纯债定期开放债券型证券投资基金截至2012年9月13日资产负债表如下：
单位：人民币元

资产	期末数	负债及持有人权益	期末数
资产：		负债	
银行存款	31,794,164.56	应付证券清算款	–
清算备付金	28,568,593.76	应付赎回款	–
交易保证金	16,534.04	应付赎回费	–
应收证券清算款	91,193,058.83	应付管理人报酬	1,017,183.66
应收股利	–	应付托管费	339,061.23
应收利息	63,848,699.47	应付销售服务费	–
应收申购款	–	应付交易费用	15,477.45
其他应收款	–	应付利息	413,402.36
股票投资市值	–	应付收益	–
其中：股票投资成本	–	未交税金	–
债券投资市值	5,800,082,523.32	其他应付款	41,280.00
其中：债券投资成本	5,866,979,814.42	卖出回购证券款	1,247,600,000.00
权证投资市值	–	短期借款	–
其中：权证投资成本	–	其他负债	108,109.10
配股权证	–	负债合计	1,249,534,513.80
买入返售证券	–	持有人权益：	–
待摊费用	–	实收基金	4,808,809,476.50
其它资产	–	未实现利得	–
		未分配收益	-42,840,416.32
		持有人权益合计	4,765,969,060.18
资产合计：	6,015,503,573.98	负债与持有人权益总计	6,015,503,573.98

八、基金投资组合

工银瑞信纯债定期开放债券型证券投资基金的投资组合如下：
（一）截至2012年9月13日，基金资产组合情况

资产项目	金额（人民币元）	占基金资产总值比例
银行存款和清算备付金	60,362,758.32	1.00%
股票市值	–	–
债券市值	5,800,082,523.32	96.42%
权证市值	–	–
买入返售金融资产	–	–
其他资产	155,058,292.34	2.58%
合计	6,015,503,573.98	100.00%

（二）截至2012年9月13日，按行业分类的股票投资组合
本基金截至2012年9月13日未持有股票。
（三）截至2012年9月13日，按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细
本基金截至2012年9月13日未持有股票。
（四）截至2012年9月13日，按券种分类的债券投资组合：

序号	债券品种	公允价值（元）	占资产净值比例（%）
1	国家债券	–	–
2	央行票据	–	–
3	金融债券	1,718,220,000.00	36.05
4	企业债券	4,081,862,523.32	85.65
5	可转债	–	–
6	其他（若有）	–	–
合计		5,800,082,523.32	121.70

注：由于四舍五入的原因公允价值占资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。
（五）截至2012年9月13日，按市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（股）	公允价值（人民币元）	占资产净值比例（%）
1	120220	12国开20	10,500,000	1,051,890,000.00	22.07
2	1282285	12中石油MTN3	8,000,000	795,600,000.00	16.69
3	112090	12中兴01	6,000,000	591,000,000.00	12.40
4	122149	12石化01	5,515,120	548,754,440.00	11.51
5	120222	12国开22	3,000,000	302,130,000.00	6.34
合计			33,015,120	3,289,374,440.00	69.01

（六）投资组合报告附注
1、声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
报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查，无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。
2、声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
基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。
3、本基金2011年9月13日，其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	16,534.04
2	应收证券清算款	91,193,058.83
3	应收股利	–
4	应收利息	63,848,699.47
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	155,058,292.34

九、重大事件揭示

本基金基金合同已于2012年6月21日正式生效，基金管理人已于2012年6月22日在《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》刊登工银瑞信纯债定期开放债券型证券投资基金基金合同生效公告。

十、基金管理人承诺

本基金管理人就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、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》及其他证券法律法规、基金合同的规定，设立专门的基金托管部，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。
（二）根据《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，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、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付等行为进行监督和核查。
（三）基金托管人发现基金管理人的行为违反《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，将及时以电话、提示函或者基金合同约定的其他方式通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

十二、备查文件目录

下列文件存放在本基金管理人和托管人的办公场所，投资者可在办公时间免费查阅；也可按工本费购买本基金合同复制件或复印件，但应以基金合同正本为准。
（一）中国证监会核准工银瑞信纯债定期开放债券型证券投资基金募集的文件；
（二）《工银瑞信纯债定期开放债券型证券投资基金基金合同》；
（三）《工银瑞信纯债定期开放债券型证券投资基金招募说明书》；
（四）《工银瑞信纯债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；
（八）中国证监会要求的其他文件。

工银瑞信基金管理有限公司
2012年9月17日

关于工银瑞信纯债定期开放债券型证券投资基金开通跨系统转托管业务的公告

工银瑞信纯债定期开放债券型证券投资基金（基金代码：164810，以下简称"本基金"）基金合同已于2012年6月21日正式生效。在本基金的募集期内，投资者通过场内、场外两种方式进行认购。通过场外认购的基金份额只有在办理跨系统转托管业务后，才可以在深圳证券交易所上市交易。本基金份额具体上市交易时间为2012年9月20日，请留意本基金管理人的相关公告。

为保证基金份额持有人的利益，本基金管理人向深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司提出申请，为场内、外认购本基金的基金份额持有人开通了跨系统转托管业务的办理事宜。场内、外认购本基金的基金份额持有人自2012年9月20日起可通过办理跨系统转托管业务实现基金份额在两个登记系统之间的转登记。本基金跨系统转托管的具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司的相关规定办理。

如有疑问，投资者可以拨打本公司客户服务电话400-811-9999或登录网站（www.icbccs.com.cn）咨询相关信息。

风险提示：本公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。敬请投资者留意投资风险。

特此公告。

工银瑞信基金管理有限公司
二〇一二年九月十七日