（上接B14版）

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

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

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

（二）基金份额发售公告

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

（三）基金合同生效公告

基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日在指定媒体上登载基金合同生效公告。

（四）上市交易公告书

本基金获准在证券交易所上市交易后，基金管理人最迟在上市前 3 个工作日在指定媒体上公告。

（五）基金资产净值、基金份额净值

1、基金合同生效后，在期利A 的首次开放日或者期利B 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、基金份额净值、期利A 和期利B 的基金份额参考净值。

2、在期利 A 的首次开放或者期利B 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，披露基金份额净值、期利A 和期利B 的基金份额参考净值以及各自的基金份额累计参考净值。

3、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、基金份额净值以及期利A 和期利B 的基金份额参考净值。基金管理人应当在上述市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值、期利A 和期利B 的基金份额参考净值以及各自的基金份额累计参考净值登载在指定媒体上。

（六）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份额发售网点查阅或者复制前述信息资料。

（六）基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告

基金管理人应当在每年结束之日起90日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定媒体上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。

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

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

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

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

（七）临时报告

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在2日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地的中国证监会派出机构备案。

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

1、基金份额持有人大会的召开；

2、终止基金合同；

3、转换基金运作方式；

4、更换基金管理人、基金管理人；

5、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；

6、基金管理人股东及其出资比例发生变更；

7、基金募集期延长；

8、基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动；

9、基金管理人的董事在一年内变更超过百分之五十；

10、基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过百分之三十；

11、涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼；

12、基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查；

13、基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚，基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚；

14、重大关联交易事项；

15、基收益分配事项；

16、管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；

17、基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；

18、基金改聘会计师事务所；

19、变更基金销售机构；

20、更换基金托管人；

21、期利A开始办理申购、赎回，期利A进行基金份额折算，期利A 的收益率设定及其调整；

22、期利B的上市交易；

23、分级运作周期届满时的基金转换、转型后东吴鼎利债券基金（LOF）的上市交易开始办理申购、赎回；

24、本基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；

25、本基金发生巨额赎回并延期支付；

26、本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；

27、本基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；

28、中国证监会规定的其他事项。

（八）澄清公告

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

（九）基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报国务院证券监督管理机构核准或者备案，并予以公告。

（十）中国证监会规定的其他信息。

六、信息披露事务管理

基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度，指定专人负责管理信息披露事务。

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

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和基金合同的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告和定期更新的招募说明书等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人按双方约定方式确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定媒体中选择披露信息的报刊。

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

为基金信息披露义务人公开披露的基金信息出具审计报告、法律意见书的专业机构，应当制作工作底稿，并将相关档案至少保存到基金合同终止后15年。

七、信息披露文件的存放与查阅

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

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

二十、风险揭示

一、市场风险

本基金主要投资于证券市场，而证券市场价格受政治、经济、投资心理和交易制度等各种因素的影响会产生波动，从而对本基金投资产生潜在风险，导致基金收益水平发生波动。

1、宏观风险

货币政策、财政政策、产业政策等国家宏观经济政策的变化对货币市场产生一定影响，从而导致投资对象价格波动，影响基金收益而产生的风险。

2、 经济周期风险

证券市场是国民经济的晴雨表，而经济运行则具有周期性的特点。随宏观经济运行的周期性变化，基金所投资于证券的收益水平也会随之变化，从而产生风险。

3、 利率风险

金融市场利率的变化直接影响着债券的价格和收益率，也会影响企业的融资成本和利润，进而影响基金持仓证券的收益水平。

4、 收益率曲线风险

不同信用水平货币市场投资品种应具有不同短期收益率曲线结构，若收益率曲线没有如预期变化导致基金投资决策出现偏差将影响基金的收益水平。

5、 购买力风险

基金收益的一部分将通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀的影响而使购买力下降，从而使基金的实际投资收益下降。

6、 国际竞争风险

随着中国市场开放程度的提高，上市公司的发展必然要受到国际市场同类技术或同类产品公司的强有力竞争，部分上市公司有可能不能适用新的行业形势而业绩下滑，尤其是中国加入WTO以后，中国境内公司将面临前所未有的市场竞争，上市公司在这长因素的影响下将存在更大不确定性。

7、 上市公司经营风险

上市公司的经营状况受多种因素的影响，如管理能力、行业竞争、市场前景、技术更新、财务状况、新产品研究开发等都会导致公司盈利发生变化，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。上市公司还可能出现退市风险，虽然基金可以通过投资多样化来分散这种非系统风险，但不能完全避免。

二、信用风险

基金交易对手方发生交易违约或者基金持仓债券的发行人拒绝支付债券本息，导致基金财产损失。

三、 管理风险

1、 在基金管理运作过程中，基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等会影响其对信息的占有以及对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平。

2、 基金管理人的管理手段和管理技术等因素的变化也会影响基金收益水平。

四、 流动性风险

流动性风险是指因证券市场交易量不足，导致证券不能迅速、低成本地变现的风险。流动性风险还包括基金出现巨额赎回，致使没有足够的现金应付赎回支付所引致的风险。

五、 本基金特有风险

1、特定投资对象风险

本基金为债券型基金，在具体投资管理中，本基金主要投资债券类资产，同时少量投资权益类资产，因此，本基金可能因投资债券类资产而面临较高的市场系统性风险，也可能面临股票市场表现不好甚至出现亏损所带来的风险。

2、期利A的特有风险

（1）流动性风险

期利A目基金合同生效之日起每满6个月的最后一个工作日开放一次，基金份额持有人只能在开放日赎回期利A份额，在非开放日，基金份额持有人将不能赎回期利A而出现流动性风险。另外，因不可抗力等原因，期利A的开放日可能延后，导致基金份额持有人不能按期赎回而出现风险。

（2）利率风险

在期利A的每次开放日，本基金将根据届时执行的1年期银行定期存款利率和当月第一个交易日的6个月Shibor利率设定期利A的年收益率。如果开放日利率下调，期利A的年收益率将相应向下进行调整；如果在非开放日出现利率上调，期利A的年收益率并不会立即进行相应调整，而是等到下一个开放日再根据实际情况作出调整，从而出现利率风险。

（3）开放日的赎回风险

在期利A的每次开放日，期利A将同时进行基金份额折算，期利A的基金份额净值调整为1.000元，并相应对期利A的份额数进行增减。基金份额折算后，基金份额持有人赎回期利A时，可能出现新增份额不能全部赎回的风险。

（4）基金的收益分配

自基金合同生效之日起3年内，本基金将不进行收益分配，对于期利A，在基金合同生效之日起每满6个月的最后一个工作日，基金管理人将根据基金合同的约定对期利A实施基金份额折算。期利A进行基金份额折算后，如果出现新增份额的情形，投资者可通过赎回折算后新增份额的方式获取投资回报，但是，投资者通过赎回折算后的新增份额以获取投资回报的方式并不等同于基金收益分配，投资者可能实际获得的收益水平低于预期水平，甚至出现亏损的风险。

（5）极端情形下的损失风险

期利A具有低风险、收益相对稳定的特征，但是，本基金为期利A设置的收益率并非保证收益，在极端情况下，如果基金在短期内发生大幅度的投资亏损，期利A可能不能获得收益甚至可能面临投资受损的风险。

（6）基金份额持有人风险收益特征变化风险

基金合同生效后3年期届满日，本基金将转换为上市开放式基金（LOF），基金类型为债券型。在基金转型前，基金份额持有人可选择将其持有的期利A份额赎回，或选择入“东吴鼎利债券型证券投资基金（LOF）”份额，期利A的基金份额转入本基金转型后的上市开放式基金（LOF）份额后，基金份额持有人所持有的每一份基金份额在各自份额级别内拥有同等的投票权。

3、期利B的特有风险

（1）杠杆机制风险

在基金合同生效之日起3年内的分级基金运作期内，本基金在扣除费用和分红收益分配后的全部剩余收益将归期利B享有，亏损以期利B的净资产为限承担亏损。因此，期利B在可能获取较大的基金资产增值收益预期的同时，也将以自身净值为限承担基金投资的全部亏损且优先分配期利A的应计收益和本金，极端情况下，期利B可能遭受全部的投资损失。

（2）利率风险

在期利A的每次开放日，本基金将根据届时执行的1年期银行定期存款利率和当月第一个交易日的6个月Shibor利率设定期利A的年收益率，如果届时的利率上调，期利A的年收益率将相应向上作出调整，期利B的资产分配份额将减少，从而出现利率风险。

（3）份额配比变化风险

本基金的期利A、期利B的份额配比原则上不超过7:3，由于期利A、期利B将独立交易，两级份额在基金意集设立时的具体份额配比可能低于7:3，存在不确定性；本基金成立后，期利B封闭运作，期利A则在基金合同生效后每满6个月开放一次，由于期利A每次开放后的基金份额是不确定的，在期利A每次开放结束后，期利A、期利B的份额配比可能发生变化。两级份额配比的不确定性及其变化将引起期利B的杠杆率变化，出现份额配比变化风险。

（4）杠杆率变动风险

期利B具有较高风险、较高收益预期的特性，由于期利B内在杠杆机制，基金资产净值的波动将以一定的杠杆倍数反映到期利B的基金份额参考净值波动上，但是，期利B的预期收益杠杆率并不是固定的，取决于期利A和期利B的资产净值比。期利B的基金份额参考净值越高，杠杆率越低，收益放大效应越弱，从而产生杠杆率变动风险。

（5）上市交易风险

期利B的封闭期为3年，封闭期内上市交易。期利B上市交易后可能因信息披露导致基金停牌，投资者在停牌期间不能买卖期利B份额，产生风险；期利B上市后也可能因交易对手不足产生流动性风险。

（6）折/溢价交易风险

期利B上市交易后，受市场供求关系等的影响，期利B的上市交易价格与其基金份额参考净值之间可能发生偏离从而出现折/溢价交易的风险。

（7）基金的收益分配

自基金合同生效之日起3年内，本基金将不进行收益分配，期利B上市交易后，投资者可通过买卖基金份额的方式获取投资回报，但是，投资者通过变现基金份额以获取投资回报可能须承担相应的交易成本，还可能面临基金份额价格波动及折价交易等风险。

（8）基金份额持有风险收益特征变化风险

基金合同生效后3年期届满时，本基金将转换为上市开放式基金（LOF），基金类型为债券型。在基金转型时，所有期利B份额将自动转入本基金转型后的上市开放式基金（LOF）份额。在基金份额转换后，期利B将不再内含杠杆机制，基金份额持有人所持有的基金份额将面临风险收益特征变化的风险。

另外，本基金转型后，原有期利B份额持有人将有的转换后的基金份额，可能会因其业务办理所在证券公司的业务资格等方面的原因，不能顺利赎回。此时，投资者可选择卖出或者通过转托管业务转入具有基金代销资格的证券公司后赎回基金份额。

六、 其他风险

1、 技术风险主要指产生的风险，如电脑系统不可靠产生的风险；

2、 因基金业务快速发展而在制度建设、人员配备、内控制度建立等方面不完善而产生的风险；

3、 因人为因素而产生的风险，如内幕交易、欺诈等行为产生的风险；

4、 对主要业务人员如基金经理的依赖而可能产生的风险；

5、 因业务竞争压力可能产生的风险；

6、 其他风险。

二十一、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

一、基金合同的变更

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

2、关于基金合同变更的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准生效后方可执行，自决议生效之日起在指定媒体公告。

二、基金合同的终止事由

有下列情形之一的，基金合同应当终止：

1、基金份额持有人大会决定终止的；

2、基金管理人、基金托管人职责终止，在6个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；

3、基金合同约定的其他情形；

4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

三、基金财产的清算

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

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人共同组成，其中，基金管理人、基金托管人都不设人员的，则由中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

4、基金财产清算程序：

（1）基金合同终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；

（2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；

（3）对基金财产进行估值和变现；

（4）制作清算报告；

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

（6）将清算报告报中国证监会备案并公告。

（7）对基金财产进行分配；

5、基金财产清算的期限为 6个月。

四、清算费用

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

五、基金财产清算剩余资产的分配

（一）基金合同生效之日起3年内清算时的基金清算财产分配

本基金基金合同生效之日起3年内，如果本基金发生基金财产清算的情形，则依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，将优先满足期利A 的本金及应计收益分配，剩余部分（如有）由期利B 的基金份额持有人根据其持有的基金份额比例进行分配。

（二）分级运作周期届满转轨型东吴鼎利债券基金（LOF）后的基金清算财产分配

本基金分级运作周期届满，本基金转换为上市开放式基金（LOF）后，如果发生基金财产清算的情形，则依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

六、基金财产清算的公告

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

七、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及文件将保存至基金托管人保存 15年以上。

二十二、基金合同内容摘要

一、 基金合同当事人的权利和义务

（一）基金管理人的权利与义务

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

（1）依法募集基金；

（2）自基金合同生效之日起，根据法律法规和基金合同独立运用并管理基金财产；

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

（4）销售基金份额；

（5）召集基金份额持有人大会；

（6）依据基金合同及有关法律规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了基金合同及国家有关法律规定，应星报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资人的利益；

（7）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

（8）选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；

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

（10）依据基金合同及有关法律规定决定基金收益的分配方案；

（11）在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；

（12）依照法律法规为基金份额持有人的利益行使因基金财产投资而产生的权利；

（13）在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；

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

（15）选择、更换律师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；

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

（17）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》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

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

（2）办理基金备案手续；

（3）自基金合同生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；

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

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

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

（7）依法接受基金托管人的监督；

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

（9）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

（10）编制季度、半年度和年度基金报告；

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

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

（13）按基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人公布；

（14）按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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

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

（17）确保需要向基金投资人提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资人能够按照基金合同规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件；

（18）组织并参加基金会计核算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

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

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

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

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

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

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

（25）执行生效的基金份额持有人大会的决议；

（26）建立并保存基金份额持有人名册；

（27）法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

（二）基金托管人的权利与义务

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

（1）自基金合同生效之日起，依法律法规和基金合同的规定安全保管基金财产；

（2）依基金合同约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用；

（3）监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人有违反基金合同及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应星报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资人的利益；

（4）根据相关市场规则，为基金开设证券账户、为基金办理证券交易资金清算；

（5）提议召开或召集基金份额持有人大会；

（6）在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

（7）法律法规和基金合同规定的其他权利。

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

（1）以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

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

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

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

（5）保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

（6）按规定开设基金财产的资金账户和证券账户，按照本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；

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

（8）复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、赎回价格；

（9）办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

（10）对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人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；

（11）保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15年以上；

（12）从基金管理人处接收开保存基金份额持有人名册；

（13）按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

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

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

（16）按照法律法规和基金合同的规定监督基金管理人的投资运作；

（17）参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

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

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

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

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

（22）当基金管理人被法律法规和基金合同规定履行自己的义务，基金托管人未履行其义务或者履行义务不当而给基金财产或基金份额持有人造成损害时，应星报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资人的利益；

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

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

（25）执行生效的基金份额持有人大会的决议；

（26）建立并保存基金份额持有人名册；

（27）法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

（三）基金托管人的权利与义务

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

（1）分享基金财产收益；

（2）参与分配清算后的剩余基金财产；

（3）依法申请赎回其持有的基金份额；

（4）按照规定要求召开基金份额持有人大会；

（5）出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；

（6）查阅或者复制公开披露的基金信息资料；

（7）监督基金管理人的投资运作；

（8）对基金管理人、基金托管人、基金销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；

（9）法律法规和基金合同规定的其他权利。

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

1、认真阅读并遵守基金合同；

2、了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自行承担投资风险；

3、关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；

4、缴纳基金认购、申购、赎回款项及法律法规和基金合同所规定的费用；

5、在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金终止的有限责任；

6、不从事任何有损基金及其他基金合同当事人合法权益的活动；

7、执行生效的基金份额持有人大会的决议；

8、返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；

9、法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

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

在基金分级运作周期内，基金份额持有人大会的审议事项应分别由期利A、期利B的基金份额持有人独立进行表决。期利A、期利B的基金份额持有人持有的每一份基金份额在各自份额级别内拥有同等的投票权。

基金分级运作周期届满，本基金无需召开基金份额持有人大会，自动转换为上市开放式基金（LOF）。基金份额持有人持有的每一基金份额具有同等的投票权。

（一）召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

（1）终止基金合同；

（2）更换基金管理人；

（3）更换基金托管人；

（4）转换基金运作方式，但本基金分级运作周期届满后转为上市开放式基金（LOF）除外；

（5）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；

（6）变更基金类别；

（7）本基金与其他基金的合并；

（8）变更基金投资目标、范围或策略；

（9）变更基金份额持有人大会程序；

（10）基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；

（11）单独或合计持有本基金总份额10%以上（含10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；

（12）对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

（13）法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

基金合同生效之日起3年内，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或类似表述均指“单独或合计持有期利A、期利B各自的基金总份额10%以上（含10%）基金份额的基金份额持有人”或其类似表述。

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

（1）调低基金管理费、基金托管费；

（2）法律法规要求增加的基金费用的收取；

（3）在法律法规和基金合同规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率；

（4）因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改；

（5）对基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化；

（6）按照法律法规和基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

（二）会议召集人及召集方式

1、除法律法规规定或基金合同另有约定外，基金份额持有人大会的召集人为基金管理人召集。

2、基金管理人的托管费

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

H＝E×0.2%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，于次月前 5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

3、销售服务费

基金销售服务费用于支付销售机构佣金、基金的营销费用以及基金份额持有人服务费等。本基金的基金销售服务费按前一日基金资产净值的0.35%年费率计提，计算方法如下：

H＝E×0.35%÷当年天数

H为每日应计提的基金销售服务费

E为前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付，于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给注册登记机构，由注册登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日支付。

五、基金份额持有人大会的召集、议事及表决的程序和规则

（一）召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

（1）终止基金合同；

（2）更换基金管理人；

（3）更换基金托管人；

（4）转换基金运作方式，但本基金分级运作周期届满后转为上市开放式基金（LOF）除外；

（5）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；

（6）变更基金类别；

（7）本基金与其他基金的合并；

（8）变更基金投资目标、范围或策略；

（9）变更基金份额持有人大会程序；

（10）基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；

（11）单独或合计持有本基金总份额10%以上（含10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；

（12）对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

（13）法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

基金合同生效之日起3年内，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或类似表述均指“单独或合计持有期利A、期利B各自的基金总份额10%以上（含10%）基金份额的基金份额持有人”或其类似表述。

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

（1）调低基金管理费、基金托管费；

（2）法律法规要求增加的基金费用的收取；

（3）在法律法规和基金合同规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率；

（4）因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改；

（5）对基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化；

（6）按照法律法规和基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

（三）基金份额持有人大会召集人及召集方式

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的召集人为基金管理人召集。

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。

3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应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日内召开基金份额持有人大会。

4、代表基金份额 10%以上（含10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知提议人。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的，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，并书面告知提议人。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。

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

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

（三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

（1）会议召开的时间、地点、会议形式；

（2）会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；

（3）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；

（4）授权委托证明的内容要求（包括但不限于代理人身份、代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；

（5）会务常设联系人姓名及联系电话；

（6）出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；

（7）召集人需要通知的其他事项。

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

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

（四）基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式或通讯开会方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

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