（上接B21版）

（5）内部稽核控制

基金管理人通过建立独立的监察稽核制度，确保内部控制的有效性。基金管理人设立督察长，督察长可以列席基金管理人召开的任何会议，调阅相关档案，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。督察长定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况。

另外，在经营管理层设立稽核监察部门，配备充足合格的稽核监察人员，并制订了《汇添富基金管理有限公司稽核监察制度》，明确规定了稽核监察部门及内部各岗位的职责和工作流程，监督各业务部门和人员遵守法律、法规和规章的有关情况；检查各业务部门和人员执行内部控制制度、各项管理制度和业务规章的情况。

4、基金管理人关于内部合规控制声明书

（1）基金管理人承诺以上关于内部控制的披露真实、准确；

（2）基金管理人承诺根据市场变化和基金管理人业务发展不断完善内部风险控制制度。

四、基金托管人

（一）基金托管人基本情况

名称：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
成立时间：1984 年1 月1 日
法定代表人：姜建清
注册资本：人民币349,018,545,827元
联系电话：010－66105799
联系人：赵会军

(二)主要人员情况

截至2013年6月末，中国工商银行资产托管部共有员工163人，平均年龄30岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

（三）基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、安心账户资金、企业年金基金、QFII资产、QDII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII专户资产、ESCROW等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2013年6月，中国工商银行共托管证券投资基金314只，其中封闭式3只，开放式311只。自2003 年以来，本行连续十年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的40项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

（四）基金托管人的职责

基金托管人应当履行下列职责：

（1）安全保管基金财产；
（2）按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户；
（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）保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
（5）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；
（6）办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
（7）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；
（8）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；
（9）按照规定召集基金份额持有人大会；
（10）按照规定监督基金管理人的投资运作；
（11）法律法规和基金合同规定的其它职责。

（五）基金托管人的内部控制制度

中国工商银行资产托管部自成立以来，各项业务飞速发展，始终保持在资产托管行业的优势地位。这些成绩的取得，是与资产托管部“一手抓业务拓展，一手抓内控建设”的做法是分不开的。资产托管部非常重视改进和加强内部风险管理工作，在积极拓展各项托管业务的同时，把加强风险防范和控制的力度，精心培育内控文化，完善风险控制机制，强化业务项目全过程风险管理作为重要工作来做。继2005、2007、2009、2010、2011年五次顺利通过评估组织内部控制和安全措施是否充分的最权威的SAS70（审计标准第70号）审阅后，2012年中国工商银行资产托管部第六次通过ISAE3402（原SAS70）审阅获得无保留意见的控制及有效性报告，表明独立第三方对我行托管服务在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可。也证明中国工商银行托管服务的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨，达到国际先进水平。目前，ISAE3402审阅已经成为年度化、常规化的内控工作手段。

1、内部风险控制目标

保证业务运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，强化和建立守法经营、规范运作的经营思想和经营风格，形成一个运作规范化、管理科学化、监控制度化的内控体系；防范和化解经营风险，保证托管资产的安全完整；维护持有人的权益；保障资产托管业务安全、有效、稳健运行。

2、内部风险控制组织结构

中国工商银行资产托管业务内部风险控制组织结构由中国工商银行稽核监察部门（内控合规部、内部审计局）、资产托管部内设风险控制处及资产托管部各业务处室共同组成。总行稽核监察部门负责制定全行风险管理政策，对各业务部门风险控制工作进行指导、监督。资产托管部内部设置专门负责稽核监察工作的内部风险控制处，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，对业务的运行独立行使稽核监察职权。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

3、内部风险控制原则

（1）合法性原则。内控制度应当符合国家法律法规及监管机构的监管要求，并贯穿于托管业务经营管理活动的始终。

（2）完整性原则。托管业务的各项经营管理活动都必须有相应的规范程序和监督制约；监督制约应渗透到托管业务的全过程和各个操作环节，覆盖所有的部门、岗位和人员。

（3）及时性原则。托管业务经营活动必须在发生时能准确及时地记录；按照“内控优先”的原则，新设机构或新增业务品种时，必须做到已建立相关的规章制度。

（4）审慎性原则。各项业务经营活动必须防范风险，审慎经营，保证基金资产和其他委托资产的安全与完整。

（5）有效性原则。内控制度应根据国家政策、法律及经营管理的需要适时修改完善，并保证得到全面落实执行，不得有任何空间、时限及人员的例外。

（6）独立性原则。资产托管部托管的基金资产、托管人的自有资产、托管人托管的其他资产应当分离；直接操作人员和控制人员应相对独立，适当分离；内控制度的检查、评价部门必须独立于内控制度的制定和执行部门。

4、内部风险控制措施实施

（1）严格的隔离制度。资产托管业务与传统业务实行严格分离，建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度，并采取了良好的防火墙隔离制度，能够确保资产独立、环境独立、人员独立、业务制度和管理独立、网络独立。

（2）高层检查。主管行领导与部门高级管理层作为工行托管业务政策和策略的制定者和管理者，要求下级部门及时报告经营管理情况和特别情况，以检查资产托管部在实现内部控制目标方面的进展，并根据检查情况提出内部控制措施，督促职能管理部门改进。

（3）人事控制。资产托管部严格落实岗位责任制，建立“自控防线”、“互控防线”、“监控防线”三道控制防线，健全绩效考核和激励机制，树立“以人为本”的内控文化，增强员工的责任心和荣誉感，培育团队精神和核心竞争力。并通过进行定期、定向的业务与职业道德培训、签订承诺书，使员工树立风险防范与控制理念。

（4）经营控制。资产托管部通过制定计划、编制预算等方法开展各种业务营销活动、处理各项事务，从而有效地控制和配置组织资源，达到资源利用和效益最大化目的。

（5）内部风险管理。资产托管部通过稽核监察、风险评估等方式加强内部风险管理，定期或不定期地对业务运作状况进行检查、监控，指导业务部门进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施，排查风险隐患。

（6）数据安全控制。我们通过业务操作区相对独立、数据和传真加密、数据传输线路的冗余备份、监控设施的运用和保障等措施来保障数据安全。

（7）应急准备与响应。资产托管业务建立了基于数据、应用、操作、环境四个层面的完备的灾难应急方案，并组织员工定期演练。除了在数据服务端和应用服务端实时同步备份与数据更新外，资产托管部还建立了操作端的异地备份中心，能够确保交易的及时清算和交割，保证业务不中断。

5、资产托管部内部风险控制情况

（1）资产托管部内部设置专职稽核监察部门，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，全面贯彻落实全程监控思想，确保资产托管业务健康、稳定地发展。

（2）完善组织结构，实施全员风险管理。完善的风险管理体系需要从上至下每个员工的共同参与，只有这样，风险控制制度和措施才会全面、有效。资产托管部实施全员风险管理，将风险控制责任落实到具体业务部门和业务岗位，每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责，通过建立纵向双人制、横向多部门制的内部组织结构，形成不同部门、不同岗位相互制衡的组织结构。

（3）建立健全规章制度。资产托管部十分重视内控制度的建设，一贯坚持把风险防范和控制的理念和方法融入岗位职责、制度建设和工作流程中。经过多年努力，资产托管部已经建立了一整套内部风险控制制度，包括：岗位职责、业务操作流程、稽核监察制度、信息披露制度等，覆盖所有部门和岗位，渗透各项业务过程，形成各个业务环节之间的相互制约机制。

（4）内部风险控制始终是托管部工作重点之一，保持与业务发展同等地位。资产托管业务是商业银行新兴的中间业务，资产托管部从成立之日起就特别强调规范运作，一直将建立一个系统、高效的风险防范和控制体系作为工作重点。随着市场环境的变化和托管业务的快速发展，新问题、新情况不断出现，资产托管部始终将风险管理放在与业务发展同等重要的位置，视风险防范和控制为托管业务生存和发展的生命线。

（六）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

根据《基金法》、基金合同、托管协议和有关基金法规的规定，基金托管人对基金的投资范围和投资对象、基金投融资比例、基金投资禁止行为、基金参与银行间债券市场、基金资产净值的计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查，其中对基金的投资比例的监督和核查自基金合同生效之后六个月开始。

基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、基金合同、基金托管协议或有关基金法律法规规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对，并以书面形式对基金托管人发出回函确认。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

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

五、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、汇添富基金管理有限公司

（1）直销中心
住所：上海市黄浦区大沽路288号6幢538室
办公地址：上海市富城路99号震旦国际大楼22楼
法定代表人：林利军
电话：（021）28932823
传真：（021）28932803
联系人：丛菲
客户服务电话：400－888－9918（免长途话费）
网址：www.99fund.com

（2）汇添富基金管理有限公司网上直销系统（trade.99fund.com）

2、场外代销机构

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
法定代表人：姜建清
电话：010－66106912
传真：010－66107914
客户服务电话：95588
网址：www.icbc.com.cn

2) 交通银行股份有限公司
注册地址：上海市银城中路188号
办公地址：上海市银城中路188号
法定代表人：牛锡明
联系人：曹榕
电话：021－58781234
传真：021－58408483
客户服务电话：95559
网址：http://www.bankcomm.com/

3) 招商银行股份有限公司
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：傅育宁
开放式基金咨询电话：95555
开放式基金业务传真：0755－83195049
联系人：邓炯鹏
网址：www.cmbchina.com

4) 上海农村商业银行股份有限公司
注册地址：上海市银城中路8号中融碧玉蓝天大厦15－20楼、22－27楼
办公地址：上海市银城中路8号中融碧玉蓝天大厦15－20楼、22－27楼
法定代表人：胡平西
联系人：吴海平
电话：021－38576666
传真：021－50105124
客服电话：021－962999 4006962999
公司网站：www.srcb.com

5) 杭州银行股份有限公司
注册地址：杭州市庆春路46号杭州银行大厦
办公地址：杭州市庆春路46号杭州银行大厦
法定代表人：吴太普
电话：0571－85108309
传真：0571－85151339
联系人：严峻
客户服务电话：0571－96523 400－8888－508
网址：www.hzbank.com.cn

6) 爱建证券有限责任公司
注册地址：世纪大道1600号陆家嘴商务广场32楼
办公地址：世纪大道1600号陆家嘴商务广场32楼
法定代表人：郭林
电话：021－32229888
传真：021－68728703
联系人：戴莉丽
客户服务电话：021－63340678
网址：www.ajzq.com

7) 安信证券股份有限公司
注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
办公地址：深圳市福田区深南大道2008号中国凤凰大厦1栋9层
法定代表人：牛冠兴
开放式基金咨询电话：0755－82558305
开放式基金业务传真：0755－82558355
联系人：陈剑虹
统一客服电话：4008001001
公司网站地址：www.essence.com.cn

8) 渤海证券股份有限公司
住所：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：天津市南开区宾水西道8号
法定代表人：杜庆平
电话：022－28451709
传真：022－28451892
联系人：胡天彤
网址：www.bhzq.com
客户服务电话：400－6515－988

9) 财富里昂证券有限责任公司
注册地址：上海市浦东新区世纪大道100号 环球金融中心9楼
法定代表人：罗浩
电话：021－38784818
传真：021－68775878
联系人：倪丹
客户服务电话：68777877
公司网站：www.cf-clsa.com

10) 财富证券有限责任公司
住所：长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26楼
办公地址：长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26、27、28楼
法定代表人：周晖
咨询电话：0731－84403319
传真：0731－84403439
联系人：孙智勇
网址：www.cfzq.com

11) 长城证券有限责任公司
注册地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层
办公地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层
邮政编码：518034
法定代表人：黄耀华
电 话：0755－83516289
传 真：0755－83515567

12) 长江证券股份有限公司
注册地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦
法定代表人：胡运钊
客户服务热线：95579或4008－888－999
联系人：李良
电话：027－65799999
传真：027－85481900
长江证券客户服务网站：www.95579.com
代销资格批准文号：证监基金字【2003】25号

13) 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：姚文平
开放式基金咨询电话：4008888128
开放式基金业务传真：021－68767032
联系人：叶蕾
联系电话：021－68761616－8522
网址：www.tebon.com.cn

14) 第一创业证券股份有限公司
注册地址：深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25层
办公地址：深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25层
法定代表人：刘学民
开放式基金咨询电话：4008881888
开放式基金业务传真：0755－82485081
联系人：崔国良
联系电话：075525832852
网址：www.fcsc.cn

15) 东北证券股份有限公司
注册地址：长春市自由大路1138号
办公地址：长春市自由大路1138号
法定代表人：矫正中
联系人：安岩岩
电话：0431－85096517
客户服务电话：4006000686 0431－85096733
网址：www.nesc.cn

16) 东方证券股份有限公司
注册地址：上海市中山南路318号2号楼22层－29层
法定代表人：潘鑫军
联系人：胡月茹
电话：021－63325888
传真：021－63326729
客户服务热线：95503
东方证券网站：www.dfzq.com.cn

17) 东吴证券股份有限公司
注册地址：江苏省苏州市苏州工业园区星阳街5号东吴证券大厦
法定代表人：吴永敏
联系人：方晓丹
电话：0512－65581136
传真：0512－65588021
客服电话：4008601555
网址：www.dwzq.com.cn

18) 东兴证券股份有限公司
住所：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12、15层
邮编：100033
法定代表人：魏庆华
基金销售联系人：汤漫川
电话：010－66555316
传真：010－66555246

19) 方正证券股份有限公司
注册地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22－24层
公司地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22－24层
法定代表人：雷杰
全国统一客服热线：95571
方正证券网站：www.foundersc.com

20) 光大证券股份有限公司
注册地址：上海市静安区新闸路1508号
办公地址：上海市静安区新闸路1508号
法定代表人：徐浩明
联系人：刘晨、李芳芳
电话：021－22169999
传真：021－22169134
客户服务电话：95525、4008888788、10108998
公司网址：www.ebscn.com

21) 广州证券有限责任公司
注册地址：广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19层、20层
办公地址：广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19层、20层
法定代表人：刘东
开放式基金咨询电话：020－961303
开放式基金业务传真：020－88836654
联系人：林洁茹
联系电话：020－88836999

22) 国都证券有限责任公司
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：常喆
开放式基金咨询电话：400－818－8118
网址：www.guodu.com

23) 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：成都市东城根上街95号
法定代表人：冉云
联系人：刘一宏
客户服务电话：400－660－0109
网址：www.gjzq.com.cn

24) 国泰君安证券股份有限公司
注册地址：上海市浦东新区商城路618号
办公地址：上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼
法定代表人：万建华
客户服务热线：4008888666
网址：www.gtja.com

25) 海通证券股份有限公司
注册地址：上海市广东路689号
办公地址：上海市广东路689号
法定代表人：王开国
注册资本：95.85亿元人民币
电话：021－23219000
传真：021－ 23219100
联系人：李笑鸣
客服电话：95553或拨打各城市营业网点咨询电话
公司网址：www.htsec.com

26) 恒泰证券股份有限公司
注册地址：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号
办公地址：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号
法定代表人：庞介民
联系人：王旭华
联系电话：0471－4972343
网址：www.cnht.com.cn

27) 宏源证券股份有限公司
注册地址：新疆乌鲁木齐市文艺路233号
办公地址：北京市西城区太平桥大街19号
法定代表人：冯戎
电话：010－88085858
传真：010－88085195
联系人：李巍
客户服务电话：400－800－0562
网址：www.hysec.com

28) 华安证券股份有限公司
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：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号财智中心B1座
法定代表人：李工
电话：0551－65161821
传真：0551－65161672
联系人：甘霖
客户服务电话：96518（安徽）、400－80－96518（全国）
网址：www.hazq.com

29) 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
邮政编码：350003
联系人：张腾
联系电话：0591－87383623
业务传真：0591－87383610
统一客户服务电话：96326（福建省外请先拨0591）。
公司网址：www.hfzq.com.cn

30) 华龙证券有限责任公司
注册地址：甘肃省兰州市静宁路308号
办公地址：兰州市城关区东岗西路638号兰州财富中心
法定代表人：李晓安
联系人：李昕田
客服电话：0931－96668、400－689－8888
公司网址：www.hlzqgs.com

31) 华鑫证券有限责任公司
注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01（b）单元
办公地址：上海市肇嘉浜路750号
邮政编码：200030
法定代表人：洪家新
电 话：021－64339000
传 真：021－64333051

32) 江海证券有限公司
住所：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
注册地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
办公地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
法定代表人：孙名扬
联系人：张宇宏
电话：0451－82336863
传真：0451－82287211
客户服务热线：400－666－2288
网址：www.jhzq.com.cn

33) 平安证券有限责任公司
注册地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼
办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼（518048）
法定代表人：杨宇翔
全国免费业务咨询电话：95511－8
开放式基金业务传真：0755－82400862
联系人：郑舒丽 (zhengshuli001@pingan.com.cn,0755－22626391)
网址：http://www.pingan.com

34) 齐鲁证券有限公司
注册地址：山东省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：李玮
联系人：吴阳
电话：0531－68889155
传真：0531－6889185
客服电话：95538
网址：www.qlzq.com.cn

35) 日信证券有限责任公司
注册地址：呼和浩特市新城区锡林南路18号
联络地址：北京市西城区闹市口大街1号长安兴融中心西楼11层
法定代表人：孔佑杰
联系人：文思婷
联系电话：010－83991737
网址：www.rxzq.com.cn

36) 上海证券有限责任公司
注册地址：上海市西藏中路336号华旭国际大厦6楼
法定代表人：龚德雄
联系人：张瑾
客户服务电话：（021）962518、4008918918（全国热线）
公司网站：www.962518.com

37) 申银万国证券股份有限公司
注册地址：上海市徐汇区长乐路989号世纪商贸广场45楼
办公地址：上海市常熟路171号
法定代表人：储晓明
电话：021－33389888
传真：021－33388224
客服电话：95523或4008895523
电话委托：95523
网址：www.sywg.com

38) 世纪证券有限责任公司
注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦40－42层
法定代表人：卢长才
联系人：袁媛
电话：0755－83199511
传真：0755－83199545
网站：www.csco.com.cn
客服热线：0755－83199511

39) 万联证券有限责任公司
注册地址：广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F栋18、19层
办公地址：广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F栋18、19层
法定代表人：张建军
开放式基金咨询电话：400－8888－133
开放式基金接收传真：020－22373718－1013
联系人：王鑫
联系电话：020－38286651
邮箱：wangxin@wlzq.com.cn

40) 西藏同信证券有限责任公司
注册地址：拉萨市北京中路101号
联系人：刘宇
网址：www.xzsec.com
客户服务电话：400－881－1177

41) 西南证券股份有限公司
注册地址：重庆市江北区桥北苑8号
办公地址：重庆市江北区桥北苑8号西南证券大厦
法定代表人：余维佳
客户服务电话：4008－096－096
网址：www.swsc.com.cn

42) 厦门证券有限公司
地址：厦门市莲前西路2号
客户服务电话：0592－5163588
公司网址：www.xmzq.cn

43) 湘财证券有限责任公司
注册地址：湖南省长沙市天心区湘府中路198号标志商务中心A栋11层
办公地点：湖南省长沙市天心区湘府中路198号标志商务中心A栋11层
法定代表人：林俊波
电话：021－68634518
传真：021－68865680
联系人：赵小明021－68634510－8620
客服电话：400－888－1551
公司网址：www.xcsc.com

44) 新时代证券有限责任公司
注册地址：北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501
办公地址：北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501
法定代表人：刘汝军
开放式基金咨询电话：400－698－9898
开放式基金业务传真：010－83561094
联系人：孙恺
联系电话：010－83561149
网址：www.xsdzq.cn

45) 信达证券股份有限公司
注册（办公）地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
法定代表人：高冠江
联系人：唐静
联系电话：010－63081000
传真：010－63080978
客服电话：400－800－8899
公司网址：www.cindasc.com

46) 兴业证券股份有限公司
注册地址：福州市湖东路268号
邮政编码：350003
法定代表人：兰荣
办公地址：浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼20层
邮政编码：200135
客服电话：95562
业务联系电话：0591－38162212
业务联系人：黄英
传真：0591－38507538

47) 中航证券有限公司
注册地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦A座41楼
办公地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦A座41楼
法定代表人：王宜四
电话：0791－86768681
联系人：戴蕾
客户服务电话：400－8866－567
网址：www.avicsec.com

48) 中国中投证券有限责任公司
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：龙增来
联系人：刘毅
电话：0755－82023442
传真：0755－82026539
网址：www.china－invs.cn
客服电话：400－600－8008、95532

49) 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：北京市朝阳门内大街188号
法定代表人姓名：王常青
基金业务对外联系人：权唐
联系电话：400－8888－108
联系传真：010－65182261
公司网址：www.csc.com.cn
客服电话：400－8888－108

50) 中信万通证券有限责任公司
法定代表人：杨宝林
注册地址：青岛市崂山区苗岭路29号澳柯玛大厦15层（1507－1510室）
办公地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼第20层（266061）
基金业务联系人：吴忠超
电话：0532－85022326
传真：0532－85022605
客户服务电话：0532－96577
公司网址：www.zxwt.com.cn

51) 中信证券股份有限公司
住址：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦A层
法定代表人：王东明
电话：010－84588888
传真：010－84865560
联系人：陈忠
公司网址：www.ecitic.com

52) 中信证券（浙江）有限责任公司
公司注册地址：浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层
公司办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层
法人代表：沈强
邮政编码：310052
联系人：王霈霈
联系电话：0571－95548
公司网站：www.bigsun.com.cn

53) 天相投资顾问有限公司
注册地址：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701 邮编：100032
办公地址：北京市西城区金融街5号新盛大厦B座4层 邮编：100033
法定代表人：林义相
联系电话：010－66045608
客服电话：010－66045678
传真：010－66045521
联系人：林爽
天相基金网网址：www.jjm.com.cn

54) 深圳众禄基金销售有限公司
注册地址：深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元 邮编：518001
办公地址：深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元 邮编：518001
法定代表人：薛峰
联系电话：0755－33227950
客服电话：4006－788－887
传真：0755－82080798
联系人：童彩平
网址：www.zlfund.cn 及 www.jjmmw.com

55) 上海天天基金销售有限公司
注册地址：上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
办公地址：上海市徐汇区龙田路195号3C座10楼
邮政编码：200235
注册资本：人民币伍千万元
法定代表人：其实
电 话：021－54509998传 真：021－64385308

56) 上海好买基金销售有限公司
注册地址：上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室
办公地址：上海市浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903～906室
邮政编码：200120
法定代表人：杨文斌
电 话：021－58870011
传 真：021－68596919

57) 杭州数米基金销售有限公司
注册地址：杭州市余杭区仓前街道海曙路东2号
办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼
法定代表人：陈柏青
联系人：张裕
电话：021－60897840
传真：0571－26698533
客服电话：4000－766－123
网址：http://www.fund123.cn/

58) 上海长量基金销售投资顾问有限公司
注册地址：上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
办公地址：上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层
法定代表人：张跃伟
联系人：敖玲
电话：021－58788678－8201
传真：021—58787698
客服电话：400－089－1289
公司网站：www.erichfund.com

59) 北京展恒基金销售有限公司
注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街6号
办公地址：北京市朝阳区德胜门外华严北里2号民建大厦6层
邮政编码：100029
法定代表人：闫振杰
电 话：010－62020088
传 真：010－62020088－8002

60) 中期时代基金销售（北京）有限公司
注册地址：北京市朝阳区建国门外光华路16号1幢11层
法定代表人：路瑶
电话：010－65807865
传真：010－65807868
客服电话：95162 4008888160
网址：www.cifcofund.com

61) 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：上海市浦东新区东方路989号中达大厦2楼
法定代表人：盛大
电话：021－50583533－3006
传真：021－50583633
客服电话：400－005－6355
网址：www.leadfund.com.cn

62) 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
法定代表人：于海锋
电话：028－82000996
传真：028－82000996－805
客服电话：4008－588－588
网址：http://www.pyfund.cn/

3、场内代销机构

爱建证券、安信证券、渤海证券、财达证券、财富证券、财富里昂、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、方正证券、高华证券、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、开源证券、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（排名不分先后）。

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售基金，并及时公告。

（二）注册登记机构
名称：中国证券登记结算有限责任公司
住所：北京市西城区太平桥大街17号
办公地址：北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人：金颖
联系人：严峰、朱立元
电话：0755－25946013、010－59378839
传真：010－59378907

（三）律师事务所和经办律师
名称：上海市通力律师事务所
住所：上海市银城中路68号时代金融中心19楼
负责人：韩炯
电话：（021）31358666
传真：（021）31358600
经办律师：吕红、黎明
联系人：吕红

（四）会计师事务所和经办注册会计师
名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
首席合伙人：吴港平
住所：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：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
邮政编码：100738
公司电话：（010）58153000
公司传真：（010）85188298
签章会计师：陈露、方侃
业务联系人：方侃

六、基金份额的分级

（一）概要

本基金通过基金收益分配的安排，将基金份额分成预期收益与风险不同的两个级别，即互利A基金份额（基金份额简称“互利A”）和互利B基金份额（基金份额简称“互利B”）。除收益分配、基金合同终止时的基金清算财产分配和基金转换运作方式时的基金份额折算外，每份互利A和每份互利B享有同等的权利和义务。此外，所有法律法规涉及的关于基金份额的占比的计算，包括但不限于认购或持有基金份额的上限、参加基金份额持有人大会各种表决计票等，两级基金的基金份额应单独进行计算，且两级基金在各自级别基金中的基金份额占比均满足条件方为有效。

互利A和互利B分别募集并按照基金合同约定的比例进行初始配比，所募集的两级基金的基金资产合并运作。

（二）基金份额的配比

互利A与互利B两级基金的基金份额的初始配比原则上不超过7:3。

本基金基金合同生效之日起3年内，互利A将自基金合同生效之日起每满6个月开放一次，互利B封闭运作并上市交易。互利A的每次开放日，基金管理人将对互利A进行基金份额折算，互利A的基金份额净值调整为1.000元，基金份额持有人持有的互利A份额数按折算比例相应增减。

互利A的基金份额折算基准日与互利A的开放日为同一个工作日。

互利A的开放日结束后，两级基金的份额配比将根据申购份额与赎回份额实际成交确认情况重新进行确定。两级份额的基金份额配比计算结果保留至小数点后第9位，小数点第9位以后的部分四舍五入。在每次互利A的开放日后，根据互利A份额折算和申购、赎回情况可能会出现两级份额配比大于或小于7:3的情形。

（三）互利A的运作

1.收益率

在基金分级运作期内，互利A约定年收益率＝一年期银行定期存款利率（税后）×1.1+利差。

其中，计算互利A首个约定年收益率的一年期银行定期存款利率指基金合同生效之日中国人民银行最新公布并执行的金融机构人民币一年期定期存款基准利率，该收益率即为互利A在基金合同生效后最初6个月的年收益率，适用于基金合同生效日（含）到第1个开放日（含）的时间段；其后在互利A的每个开放日，基金管理人将根据该日中国人民银行最新公布并执行的金融机构人民币一年期定期存款基准利率重新设定互利A的约定年收益率，该收益率即为互利A在接下来6个月的年收益率，适用于该开放日（不含）到下一个开放日（含）的时间段。

基金管理人将视国内利率市场变化，在下一开放日开始前公告接下来6个月适用的、互利A约定收益的利差值，利差的取值范围从0%（含）到2%（含）。

自本基金合同生效日起至6个月的最后一个工作日止，互利A利差值为1.5%。

例：在本基金基金合同生效日，如果一年期银行定期存款利率为3%，利差为1.2%，则互利A 的年收益率（单利）为：

互利A 的年收益率（单利）＝1.1×3 %+1.5%＝4.8%

本基金净资产优先分配予互利A份额的本金及约定应得收益，剩余净资产分配予互利B份额；在分级运作期内每个开放日，如本基金净资产等于或低于互利A份额的本金及约定应得收益的总额，本基金净资产全部分配予互利A份额后，仍存在额外未弥补的互利A份额本金及约定收益总额的差额，则不再进行弥补。

基金管理人并不承诺或保证每个开放日互利A份额持有人的约定应得收益，即如在分级运作期内本基金资产出现极端损失情况下，互利A份额仍可能面临无法取得约定应得收益乃至投资本金受损的风险。

2.开放日

互利A 在分级运作期内每满6 个月开放一次，接受投资者的申购与赎回。

互利A 的开放日为自分级运作期起始日起每满6个月的最后一个工作日（基金管理人公告暂停申购或赎回时除外）。

因不可抗力或基金合同约定的其他情形致使基金无法按时开放申购与赎回的，开放日为不可抗力或其他情形影响因素消除之日的下一个工作日。

互利A 的第一次开放日为分级运作期起始日至6个月满的日期，如该日为非工作日，则为该日之前的最后一个工作日；第二次开放日为分级运作期起始日至12个月满的日期，如该日为非工作日，则为该日之前的最后一个工作日；以此类推。如基金合同的生效日为2013年11月15日，基金合同生效之日起满6个月、满12个月、满18个月的日期分别为2014年5月14日、2014年11月14日、2015年5月14日，以此类推。其他各个开放日的计算方法相同

3.基金份额折算

本基金分级运作期内，互利A将按以下规则进行基金份额折算。

（1）折算基准日

本基金分级运作期内，互利A的基金份额折算基准日为自分级运作期起始日起每满6个月的最后一个工作日。

互利A的基金份额折算基准日与其开放日为同一个工作日。

基金份额折算基准日的具体计算见“互利A的运作”关于开放日计算的相关内容。

（2）折算对象

基金份额折算基准日登记在册的互利A所有份额。

（3）折算频率

自分级运作期起始日起每满6个月折算一次。

（4）折算方式

折算日日终，互利A的基金份额净值调整为1.000 元，折算后，基金份额持有人持有的互利A的份额数按照折算比例相应增减。

互利A的基金份额折算公式如下：

互利A的折算比例＝折算日折算前互利A的基金份额净值／1.000

互利A经折算后的份额数＝折算前互利A的份额数×互利A的折算比例

互利A经折算后的份额数保留到小数点后两位，折算后的份额数以登记机构的记录为准，由此产生的误差计入基金财产。

在实施基金份额折算时，折算日折算前互利A的基金份额净值、互利A的折算比例的具体计算见基金管理人届时发布的相关公告。

（5）基金份额折算期间的基金业务办理

为保证基金份额折算期间本基金的平稳运作，基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停互利B 的上市交易等业务，具体见基金管理人届时发布的相关公告。

（6）基金份额折算的公告

1）基金份额折算方案须由基金管理人依照《信息披露办法》的规定在指定媒体公告，并报中国证监会备案。

2）基金份额折算结束后，基金管理人应依照《信息披露办法》的规定在指定媒体公告，并报中国证监会备案。

4.规模限制

本基金第一个分级运作期，互利A 与互利B 的份额初始配比原则上不超过7:3。其后分级运作期的份额配比原则由基金管理人届时公告。具体规模限制及其控制措施见招募说明书、基金份额发售公告以及基金管理人发布的其他相关公告。

（四）互利B的运作

1.互利B封闭运作，封闭期内不接受申购与赎回。

互利B的封闭期为自分级运作期起始日起至满3 年的最后一个工作日止。

2.本基金基金合同生效后6 个月内，在符合基金上市交易条件下，互利B 将申请在深圳证券交易所上市交易。

3.本基金在扣除互利A 的应计收益后的全部剩余收益归互利B享有，亏损以互利B 的资产净值为限由互利B 承担。

（五）本基金基金份额净值的计算

T日基金份额净值＝T日闭市后的基金资产净值／T日基金份额的余额数量

基金分级运作期内，T日基金份额的余额数量为互利A和互利B的份额总额；若本基金转型为上市开放式基金（LOF），T日基金份额的余额数量为该上市开放式基金份额总额。

基金份额净值的计算，保留到小数点后3 位，小数点后第4 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

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

（六）互利A和互利B的基金份额净值计算

按照上述本基金资产及收益分配规则，在基金分级运作期内互利A的开放日计算互利A的基金份额净值；在分级运作期届满日分别计算互利A与互利B的基金份额净值。

设第T日为分级运作期内的基金份额净值计算日，Ta为自互利A份额上一次开放日（若之前尚未进行开放，则为基金合同生效日或分级运作期起始日）至T日的运作天数，　　为T日闭市后的基金资产净值，Fa为T日互利A的份额余额，Fb为T日互利B的份额余额，NAVa为第T日互利A的基金份额净值，NAVb为第T日互利B的基金份额净值，Ra为互利A约定年收益率，Y为分级运作期内运作当年实际天数，即互利A上一次开放日（如T日之前无开放日，则为基金合同生效日）所在年度的实际天数。在分级运作期内，基金管理人可根据基金运作的实际情况对用于互利A和互利B基金份额净值计算的实际运作天数进行调整，如调整，届时可参见更新的基金招募说明书及基金管理人公告。

分级运作期内第T日，互利A和互利B的基金份额净值计算公式如下：

1.当　　<Fa×1.00×（1+Ra×Ta/Y）时，则互利A与互利B在分级运作期内第T日基金份额净值为：

NAVa=　　/Fa；

NAVb=0；

2.当Fa×1.00×（1+Ra×Ta/Y）≤　　时，则互利A与互利B在分级运作期内第T日基金份额净值为：

NAVa＝1.00×（1+Ra×Ta/Y）；

NAVb=（　　－NAVa×Fa）/Fb；

互利A与互利B基金份额净值的计算，保留到小数点后8位，小数点后第9位四舍五入。

例：本基金基金合同生效后满3 年的最后一个工作日，设自互利A 上一次开放日起的运作天数为180 天，基金运作当年的实际天数为365 天，基金资产净值为36亿元，互利A、互利B的份额余额分别为21 亿份和9 亿份，互利A上一次开放日设定的互利A年收益率为4.2%。则互利A、互利B的基金份额净值计算如下：

互利A的基金份额净值＝1.00×（1+4.2%×180/365）＝1.02071233元

互利B 的基金份额净值＝（36－1.02071233×21）/9＝1.61833790 元

（七）互利A和互利B基金份额参考净值的计算

基金管理人在基金资产净值计算的基础上，采用“虚拟清算”原则计算并公告互利A和互利B基金份额参考净值。基金分级运作期内的基金份额参考净值是对两级基金份额价值的一个估算，并不代表基金份额持有人可获得的实际价值。

互利A和互利B基金份额参考净值在当天收市后计算，并在T日内与本基金基金份额净值一同公告。如遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

设第T日为分级运作期内的基金份额参考净值计算日，Ta为自互利A份额上一次开放日（若之前尚未进行开放，则为基金合同生效日或分级运作期起始日）至T日的运作天数，　　为T日闭市后的基金资产净值，Fa为T日互利A的份额余额，Fb为T日互利B的份额余额，NAVa为第T日互利A的基金份额参考净值，NAVb为第T日互利B的基金份额参考净值，Ra为互利A约定年收益率，Y为分级运作期内运作当年实际天数，即互利A上一次开放日（如T日之前无开放日，则为基金合同生效日）所在年度的实际天数。在分级运作期内，基金管理人可根据基金运作的实际情况对用于互利A和互利B基金份额参考净值计算的实际运作天数进行调整，如调整，届时可参见更新的基金招募说明书及基金管理人公告。

分级运作期内第T日，互利A和互利B的基金份额参考净值计算公式如下：

1.当　　<Fa×1.00×（1+Ra×Ta/Y）时，则互利A与互利B在分级运作期内第T日基金份额参考净值为：

NAVa=　　/Fa；

NAVb=0；

2.当Fa×1.00×（1+Ra×Ta/Y）≤　　时，则互利A与互利B在分级运作期内第T日基金份额参考净值为：

NAVa＝1.00×（1+Ra×Ta/Y）；

NAVb=（　　－NAVa×Fa）/Fb；

互利A与互利B基金份额参考净值的计算，保留到小数点后3位，小数点后第4位四舍五入。

例：本基金基金合同生效之日起3 年内，设自互利A 上一次开放日起的运作天数为60天，基金运作当年的实际天数为365 天，基金资产净值为32亿元，互利A、互利B的份额余额分别为21亿份和9亿份，互利A 上一次开放日设定的互利A 年收益率为4.2%。则互利A、互利B的基金份额参考净值计算如下：

互利A 的基金份额参考净值＝1.00×（1+4.2%×60/365）＝1.007元

互利B 的基金份额参考净值＝（32－1.007×21）/9＝1.206元

七、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》、《信息披露办法》等有关法律法规以及基金合同的规定，经2013年5月13日中国证监会证监许可【2013】641号文件核准募集。

（一）基金的类型及存续期间

1、基金类型：债券型证券投资基金

2、基金运作方式：契约型

本基金分级运作期内，互利A自分级运作期起始日起每满6个月进行一次折算，同时开放一次申购、赎回，互利B封闭运作并在深圳证券交易所上市交易。

分级运作期届满，本基金转型为上市开放式基金（LOF）。

在届时法律法规及业务规则允许的条件下，经基金管理人与基金托管人协商一致，本基金将继续以分级运作模式存在（该事项无须召集基金份额持有人大会）。届时基金管理人将依据《信息披露办法》的规定发布相关公告以安排金申购、赎回等事项。

3、存续期间：不定期

（二）募集方式

互利A、互利B将分别通过各自发售机构的销售网点独立进行公开发售，两级份额的发售方式与发售机构不尽相同。

互利A通过场外发售机构公开发售，互利B通过场内、场外发售机构进行发售。

场外发售机构为基金管理人的直销网点和场外代销机构的代销网点（具体名单参见基金份额发售公告）；场内发售机构为通过深圳证券交易所内具有相应业务资格的会员单位发售（具体名单参见基金份额发售公告）。

通过场外认购的基金份额登记在注册登记系统基金份额持有人开放式基金账户下；通过场内认购的基金份额登记在证券登记结算系统基金份额持有人深圳证券账户下。基金份额持有人可以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换。

投资者可参与互利A或互利B中的某一级份额的认购，也可同时参与互利A和互利B的认购。本基金认购采取全额缴款认购的方式。基金投资者在募集期内可多次认购，认购一经受理不得撤销。

销售机构认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购的确认以登记机构的确认结果为准。

（三）募集期限

自基金份额发售之日起，最长不得超过3个月，具体发售时间见发售公告。

（四）募集对象

符合法律法规规定的个人投资者、机构投资者及合格境外机构投资者，以及法律法规或中国证监会允许购买开放式证券投资基金的其他投资者。

（五）募集场所

本基金将通过基金管理人的直销网点及基金代销机构的代销网点公开发售。

投资者还可以登录基金管理人网站（www.99fund.com）办理开户、认购等业务，网上交易开通流程、业务规则请登录基金管理人网站查询。

募集期间，基金管理人可根据情况变更或增减基金代销机构，并予以公告。具体销售城市（或网点）名单和联系方式，请参见本基金的发售公告以及当地基金代销机构以各种形式发布的公告。

（六）募集份额目标上限

本基金首次募集规模上限为30亿份（不包括利息折算的基金份额），其中互利A上限21亿份，互利B上限9亿份，规模控制措施详见基金份额发售公告的有关规定。

（七）基金份额的场外认购

通过场外方式认购的基金份额登记在注册登记系统中。

1.募集场所

互利A和互利B均可通过场外发售机构发行，本基金的场外认购通过基金管理人的直销网点及基金代销机构的代销网点（具体名单详见基金份额发售公告）进行。

销售机构办理本基金场外认购业务的城市（网点）的具体情况和联系方法，请参见本基金的基金份额发售公告。

2.基金份额的面值、认购费用、认购价格及计算公式

（1）基金份额初始发售面值：本基金份额初始发售面值为人民币1.00元。

（2）认购费率

本基金不收取认购费。

（3）场外认购份额的计算

基金场外认购采用金额认购的方式。基金的认购金额包括认购费用和净认购金额。计算公式为：

认购份额 ＝（认购金额+认购利息）/ 基金份额初始面值。

认购份额的计算保留到小数点后两位，小数点两位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。利息折算份额的计算保留到小数点后两位，小数点两位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

例如：某投资人认购本基金互利A（互利B）10,000元，假定该笔认购金额产生利息3元。则认购份额为：

认购份额＝（认购金额+认购利息）/基金份额面值＝（10,000+3）/1.00＝10,003.00份

即：投资人投资10,000元认购本基金份额，在基金合同生效时，投资人账户登记有本基金10,003.00份。

（八） 基金份额的场内认购

互利B可通过场内发售机构发售，本节内容仅适用于基金份额的场内认购，通过此种方式认购的基金份额登记在证券登记结算系统中。

1.募集场所

本基金的场内认购通过深圳证券交易所内具有相应业务资格的会员单位（具体名单详见基金份额发售公告或相关业务公告）进行。本基金募集期结束前获得基金代销资格的证券公司也可代理场内基金份额的发售。尚未取得相应业务资格，但属于深圳证券交易所会员的其他机构，可在本基金上市后，代理投资人通过深圳证券交易所交易系统参与本基金的上市交易。

2.基金认购金额的计算

（1）本基金场内认购采用份额认购方式认购，认购价格为 1.00 元/份。

（2）本基金不收认购费。

（3）场内认购金额和利息折算份额的计算

基金场内认购采用份额认购的方式。计算公式为：

认购金额 ＝ 认购价格 × 认购份额

认购份额总额 ＝ 认购份额 ＋ 利息折算的份额。

场内认购金额计算保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入。利息折算的份额保留至整数位（最小单位为1份），余额计入基金财产。

例如：某投资人认购本基金10,000份，假定该笔认购产生利息3元。则认购金额和利息折算的份额为：

认购金额＝认购价格 × 认购份额＝1.00×10,000＝10,000元

利息折算份额=3.00/1.00= 3份

认购份额总额 ＝ 认购份额 ＋ 利息折算的份额10,005份

即：投资人认购10,000份基金份额，需缴纳10,000元，若利息折算的份额为3份，则总共可得到10,003份基金份额。

（九）基金的认购

1、认购时间安排

投资者认购本基金份额的具体业务办理时间由基金管理人和基金代销机构确定，请参见本基金的发售公告。

2、投资人认购应提交的文件和办理的手续

投资者认购本基金份额应提交的文件和办理的手续详见本基金的发售公告。

3、认购的方式及确认

当日（T日）在规定时间内提交的申请，投资者通常可以在T+2日到网点查询认购申请的受理结果，并可在募集截止日后4个工作日内可以到网点打印交易确认书。

4、募集期利息的处理方式

互利A、互利B有效认购款项在募集期间产生的利息将各自折算为相应类别的基金份额归基金份额持有人所有，其中利息转份额以登记机构的记录为准。场内认购资金利息折算的份额保留至整数位，余额计入基金财产；场外认购资金利息折算的份额保留到小数点后两位，小数点两位以后部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

5、基金份额认购金额的限制

（1）本基金场内认购采用份额认购的方式，场外认购采用金额认购方式。

（2）投资人认购前，需按销售机构规定的方式全额缴款。

（3）投资人在募集期内可以多次认购基金份额，但已受理的认购申请不允许撤销。

（4）互利A 的认购限制

投资者通过代销机构网点申购互利A基金份额单笔最低金额为人民币1000元；通过基金管理人直销中心首次申购本基金基金份额的最低金额为人民币50000元。各代销机构对本基金最低申购金额及交易级差有其他规定的，以各代销机构的业务规定为准。

（5）互利B 的认购限制

1）场外认购限额

投资者通过代销机构网点认购互利B基金份额单笔最低金额为人民币50000元；通过基金管理人直销中心首次申购本基金基金份额的最低金额为人民币50000元。各销售机构对最低认购限额及交易级差有其他规定的，以各销售机构的业务规定为准。

2）场内认购限额

互利B 场内认购的单笔最低认购份额为50,000 份，超过50,000 份的须是1,000 份的整数倍，且每笔认购最高不得超过99,999,000 份。

（6）本基金对单个账户持有的基金份额不进行限制。

（7）基金募集期间单个投资人的累计认购规模没有限制。

（十）募集资金的管理

基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。

八、基金合同的生效

（一）基金备案的条件

本基金自基金份额发售之日起3个月内，在基金募集份额总额不少于2亿份，基金募集金额不少于2亿元人民币且基金认购人数不少于200人的条件下，基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售，并在10日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告之日起10日内，向中国证监会办理基金备案手续。

基金募集达到基金备案条件的，自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起，《基金合同》生效；否则《基金合同》不生效。基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对《基金合同》生效事宜予以公告。基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。

（二）基金合同不能生效时募集资金的处理方式

如果募集期限届满，未满足募集生效条件，基金管理人应当承担下列责任：

1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；

2、在基金募集期限届满后30日内返还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期存款利息。

3、如基金募集失败，基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和销售机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。

（三）基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

《基金合同》生效后，基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元的，基金管理人应当及时报告中国证监会；连续20个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会说明原因并报送解决方案。

法律法规另有规定时，从其规定。

九、基金份额的上市与交易

（一）上市交易的基金份额

基金合同生效后，在本基金符合法律法规和深圳证券交易所规定的上市条件的情况下，本基金在基金分级运作期内，互利B份额申请上市与交易。

本基金分级运作期届满后转型为上市开放式基金（LOF），则互利A与互利B将分别按照基金合同约定及深圳证券交易所规则转型转换为上市开放式基金（LOF）份额，转型后的基金份额将继续在深圳证券交易所上市与交易。

（二）上市交易的地点

深圳证券交易所

（三）上市交易的时间

基金合同生效后6个月内互利B开始在深圳证券交易所上市交易。

在确定上市交易的时间后，基金管理人最迟在上市日前3个工作日在指定媒体上刊登公告。

基金份额（基金分级运作期内专指互利B份额）上市后，登记在证券登记结算系统中的基金份额可直接在深圳证券交易所上市交易；登记在注册登记系统中的基金份额通过办理跨系统转托管业务将基金份额转至证券登记结算系统后，方可上市交易。

（四）上市交易的规则

1.本基金在基金分级运作期内互利B上市首日的开盘参考价为前一交易日互利B的参考净值；

2. 本基金分级运作期届满后转型为上市开放式基金（LOF），互利A与互利B份额转型转换为上市开放式基金（LOF）基金份额后，本基金基金份额上市首日的开盘参考价为前一交易日的基金份额净值；

3.本基金实行价格涨跌幅限制，涨跌幅比例为10%，自上市首日起实行；

4.本基金买入申报数量为100份或其整数倍；

5.本基金申报价格最小变动单位为0.001元人民币；

6.本基金上市交易遵循《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》、《深圳证券交易所上市开放式基金业务规则》及其更新以及其他有关规定。

（五）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的有关规定办理。

（六）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（基金分级运作期内为互利B前一交易日的基金份额参考净值）。

（七）上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市

本基金的停复牌、暂停上市、恢复上市按照深圳证券交易所的相关业务规则执行。

（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；

2.基金合同终止；

3.基金份额持有人大会决定终止上市；

4.深圳证券交易所认为须终止上市的其他情况。

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，并在指定媒体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相关规定内容进行调整的，本基金合同相应予以修改，并按照新规定执行，且此项修改无须召集基金份额持有人大会。

十、基金的申购与赎回

基金合同生效后，基金分级运作期内基金投资者可在互利A的开放日申购或赎回互利A份额。

本基金转型为上市开放式基金（LOF）后，投资者可通过场外或场内两种方式对上市开放式基金（LOF）进行申购与赎回。

（一）分级运作期内互利A的申购与赎回

1、申购和赎回场所

互利A 的销售机构包括基金管理人和基金管理人委托的代销机构。

基金投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理互利A 的申购与赎回。基金管理人可根据情况变更或增减基金代销机构，并予以公告。

2、申购和赎回的开放日及时间

本基金办理互利A 的申购与赎回的开放日为自分级运作期起始日每满6个月的最后一个工作日（基金管理人公告暂停申购或赎回时除外），互利A 的开放日具体计算见基金合同第四部分“互利A的运作”的相关内容。因不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放互利A 的申购与赎回的，开放日为不可抗力或其他情形影响因素消除之日的下一个工作日。

互利A 的开放日以及开放日办理申购与赎回业务的具体事宜见基金管理人届时发布的相关公告。

3、申购与赎回的原则

（1）分级运作期内采取“确定价”原则，即互利A的申购、赎回价格以人民币1.00元为基准进行计算；

（2）“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

（3）当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；

（4）赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人认购、申购的先后次序进行顺序赎回；

基金管理人可在法律法规允许的情况下，对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

4、申购与赎回的程序

（1）申购和赎回的申请方式

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

（2）申购和赎回的款项支付

投资人申购基金份额时，必须全额交付申购款项，投资人交付款项，申购申请即为有效。

投资人赎回申请成功后，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。

（3）申购和赎回申请的确认

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

（4）申购和赎回申请的成交确认原则

在本基金第一个分级运作期内，在互利A的开放日，本基金以互利B的份额余额为基准，在互利A和互利B的份额配比不超过7:3的范围内对互利A 的申购进行确认。

在互利A的开放日，所有经确认有效的互利A 的赎回申请全部予以成交确认。

在本基金第一个分级运作期内，对于互利A的申购申请，如果对互利A的全部有效申购申请进行确认后，互利A与互利B的份额配比小于7:3，则所有经确认有效的互利A 的申购申请全部予以成交确认；如果对互利A的全部有效申购申请进行确认后，互利A与互利B 的份额配比超过7:3，则在经确认后的互利A与互利B 的份额配比不超过7:3的范围内，对全部有效申购申请按比例进行成交确认。

互利A每次开放日的申购与赎回申请确认办法及确认结果见基金管理人届时发布的相关公告。

基金销售机构对互利A申购和赎回申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到互利A申购和赎回申请。互利A申购和赎回申请的确认以登记机构的确认结果为准。

5、申购和赎回的数量限制

（1）投资者通过代销机构网点申购本基金基金份额单笔最低金额为人民币1000元（含申购费）；通过基金管理人直销中心首次申购本基金基金份额的最低金额为人民币50000元（含申购费）。若发生比例确认，申购金额不受最低申购金额限制。各代销机构对本基金最低申购金额及交易级差有其他规定的，以各代销机构的业务规定为准。

（2）投资者可多次申购，对单个投资者累计持有基金份额的比例或数量不设上限限制。法律法规、中国证监会另有规定的除外。

（3）投资者可将其全部或部分基金份额赎回，赎回最低份额1份，基金份额持有人在销售机构保留的基金份额不足1份的，注册登记系统将全部剩余份额自动赎回。

（4）基金管理人可根据市场情况，合理调整对申购金额和赎回份额的数量限制，在进行调整前，基金管理人应当依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

6、申购和赎回的费用及其用途

互利A不收取申购费用和赎回费用。

基金管理人可以在法律法规和基金合同规定范围内调整申购费率和赎回费率。费率如发生变更，基金管理人应在调整实施3个工作日前在至少一种指定媒体上公告。

7、申购份额与赎回金额的计算方式

（1）互利A申购份额的计算方式：

互利A的申购份额按实际确认的申购金额除以1.00元确定。互利A的申购份额计算结果均按照四舍五入方法，保留小数点后两位，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。互利A申购份额的计算公式：

申购份额＝申购金额／1.00

例，在互利A的开放日，某投资者投资10,000元申购互利A，则其可得到的互利A份额计算如下：

申购份额＝10,000/1.00＝10,000份

（2）互利A赎回金额的计算方式：

互利A的赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以1.00元确定。赎回金额计算结果按照四舍五入方法，保留小数点后两位，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

采用“份额赎回”方式，赎回金额计算公式：

赎回金额＝赎回份额×1.00

例，在互利A的开放日，某投资者赎回10,000份互利A，则其可得到的赎回金额计算如下：

赎回金额＝10,000×1.00＝10,000元

8、拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

（1）因不可抗力导致基金无法正常运作。

（2）发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接收投资人的申购申请。

（3）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。

（4）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。

（5）基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人利益的情形。

（6）根据申购规则和程序导致部分或全部申购申请没有得到成交确认。

（7）法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第（1）、（2）、（3）、（5）、（6）、（7）项暂停申购情形且基金管理人暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒体上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

9、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

（1）因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。

（2）发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接收投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。

（3）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。

（4）互利A在单个开放日发生巨额赎回，导致本基金的现金支付出现困难。

（5）法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述除第（4）条以外的情形且基金管理人决定拒绝接受或暂停基金份额持有人的赎回申请时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付，基金管理人按照发生的情况制定相应的处理办法在后续工作日予以支付。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

10、巨额赎回的情形

（1）巨额赎回的认定

若本基金互利A的单个开放日内，经过申购与赎回申请的成交确认后，互利A 的净赎回金额超过本基金前一日基金资产净值的10%时，即认为是发生了互利A巨额赎回。

（2）巨额赎回的公告

当发生上述延期赎回并延缓支付款项时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在3个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在指定媒体上刊登公告。

（二）基金转型为上市开放式基金后的申购与赎回

基金分级运作期届满后，互利A与互利B两类基金份额将转型转换为上市开放式基金（LOF）份额，并开放申购、赎回业务。申购、赎回规则具体如下：1、申购和赎回场所

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行，通过基金管理人、场外代销机构柜台系统办理申购和赎回业务。投资人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申购和赎回业务。

投资人可通过下述场所按照规定的方式进行申购或赎回：

（1）本基金管理人的直销中心；

（2）场内申购、赎回，即通过深圳证券交易所交易系统办理本基金申购、赎回及相关业务的深圳证券交易所会员单位；

（3）场外申购、赎回，即不通过深圳证券交易所交易系统办理申购、赎回及相关业务的场外代销机构的代销网点。

具体的销售网点和办理申购赎回业务的会员单位将由基金管理人在招募说明书或其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减代销机构，并予以公告。若基金管理人或其指定的代销机构开通电话、传真或网上等交易方式，投资人可以通过上述方式进行申购与赎回，具体办法由基金管理人另行公告。

2、申购和赎回的开放日及时间

（1）开放日及开放时间

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

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体上公告。

（2）申购、赎回开始日及业务办理时间

本基金转型为上市开放式基金（LOF）后，在本基金转换运作方式之日起不超过30天开始办理日常申购、赎回。

在确定申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告申购与赎回的开始时间。

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

3、申购与赎回的原则

（1）“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算；

（2）“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

（3）当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；

（4）场外基金份额的赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人认购、申购的先后次序进行顺序赎回。

基金管理人可在法律法规允许的情况下，对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

4、申购与赎回的程序

（1）申购和赎回的申请方式

投资人必须根据销售机构及深圳证券交易所规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

（2）申购和赎回的款项支付

投资人申购基金份额时，必须全额交付申购款项，投资人交付款项，申购申请即为有效。

投资人赎回申请成功后，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。

（3）申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T日)，在正常情况下，本基金登记机构在T+1日内对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请，投资人可在T+2日后(包括该日)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。若申购不成功，则申购款项退还给投资人。

5、申购和赎回的数量限制

（1）场外申购时，投资者通过代销机构网点申购本基金基金份额单笔最低金额为人民币1,000元（含申购费）；通过基金管理人直销中心首次申购本基金基金份额的最低金额为人民币50,000元（含申购费）。各代销机构对本基金最低申购金额及交易级差有其他规定的，以各代销机构的业务规定为准。

（2）场内申购时，每笔申购金额最低为1,000元，同时申购金额必须是整数金额。

（3）投资者可多次申购，对单个投资者累计持有基金份额的比例或数量不设上限限制。法律法规、中国证监会另有规定的除外。

（4）投资者可将其全部或部分基金份额赎回，赎回最低份额5份，基金份额持有人在销售机构保留的基金份额不足5份的，注册登记系统将全部剩余份额自动赎回。

（5）基金管理人可以根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整前依照《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。

6、申购和赎回的价格、费用及其用途

（1）本基金份额净值的计算，保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T日的基金份额净值在当天收市后计算，并在T+ 1 日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

（2）申购费用由投资人承担，不列入基金财产。

（3）赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。不低于赎回费总额的25%应归基金财产，其余用于支付登记费和其他必要的手续费。

（4）申购费率

购买金额（M，含申购费）	申购费率
M＜100 万	0.80%
100 万≤M＜500 万	0.40%
M≥500 万	每笔1000元

（5）赎回费率

本基金的场内赎回适用固定的赎回费率，定为0.1%。

本基金的场外赎回费率按持有时间递减，具体费率如下：

持有时间（N）	赎回费率
N＜1年	0.10%
1年≤N＜2年	0.05%
N≥2年	0%

注：1年指365天。

其中，在场外认购以及本基金开放期场外申购的投资者其份额持有年限以份额实际持有年限为准；在场内认购、场内申购以及场内买入，并转托管至场外赎回的投资者其份额持有年限自份额转托管至场外之日起开始计算。

（6）基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对以特定交易方式（如网上交易、电话交易等）等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

7、申购份额与赎回金额的计算

（1）本基金申购份额的计算：

净申购金额=申购金额/（1+申购费率）

申购费用=申购金额－净申购金额

申购份额=净申购金额/申购当日基金份额净值

例：某投资者投资5万元申购本基金基金份额，假设申购当日基金份额净值为1.052元，则可得到的申购份额为：

净申购金额 ＝ 50000 / (1+0.80%) =49603.17元

申购费用 ＝ 50000 —49603.17 =396.83 元

申购份额 ＝ 49603.17/ 1.052 ＝ 47151.30份

如果投资人是场内申购，申购份额为47151份，其余0.03份对应金额返回给投资人。

（2）本基金赎回金额的计算：

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

赎回总金额 ＝ 赎回份额 × T日基金份额净值

赎回费用 ＝ 赎回总金额 × 赎回费率

净赎回金额 ＝ 赎回总金额 — 赎回费用

例1：某投资者场外赎回本基金1万份基金份额，持有时间为180天，对应的赎回费率为0.10%，假设赎回当日基金份额净值是1.052元，则其可得到的净赎回金额为：

赎回总金额 ＝ 10000 × 1.052 ＝ 10520元

赎回费用 ＝ 10520 × 0.10% ＝ 10.52元

净赎回金额 ＝ 10520 — 10.52 ＝ 10509.48元

即：投资者场外赎回本基金1万份基金份额，则其可得到的净赎回金额为10509.48元。

例2：某投资者场内赎回本基金1万份基金份额，对应的赎回费率为0.10%，假设赎回当日基金份额净值是1.052元，则其可得到的净赎回金额为：

赎回总金额 ＝ 10000 × 1.052 ＝ 10520元

赎回费用 ＝ 10520 × 0.10% ＝ 10.52元

净赎回金额 ＝ 10520 — 10.52 ＝ 10509.48元

即：投资者场内赎回本基金1万份基金份额，则其可得到的净赎回金额为10509.48元。

（3）申购份额、余额的处理方式：

申购的有效份额为净申购金额除以当日的基金份额净值，有效份额单位为份，场内申购份额保留至整数位，非整数份额部分对应金额返回投资人；场外申购份额按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

（4）赎回金额的处理方式：

赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以以当日基金份额净值为基准计算的赎回价格。上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

8、拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

（1）因不可抗力导致基金无法正常运作。

（2）发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接收投资人的申购申请。

（3）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。

（4）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。

（5）基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人利益的情形。

（6）法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第（1）、（2）、（3）、（5）、（6）项暂停申购情形且且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒体上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

9、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

（1）因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。

（2）发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接收投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。

（3）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。

（4）连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

（5）法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定拒绝接受或暂停基金份额持有人的赎回申请时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。若出现上述第（4）项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

10、巨额赎回的情形及处理方式

（1）巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请 (赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过前一开放日的基金总份额的10%，即认为是发生了巨额赎回。

（2）巨额赎回的处理方式

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

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

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

场内巨额赎回按照登记机构的有关规则处理。

3）暂停赎回：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20个工作日，并应当在指定媒体上进行公告。

（3）巨额赎回的公告

当发生上述延期赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在3个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在指定媒体上刊登公告。

10、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，基金管理人当日应立即向中国证监会备案，并在规定期限内在指定媒体上刊登暂停公告。

（2）如发生暂停的时间为1日，基金管理人应于重新开放日，在指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近1个开放日的基金份额净值。

（3）如发生暂停的时间超过1日，基金管理人自行确定公告增加次数，并根据信息披露管理办法在指定媒体刊登公告。

（三）基金转换

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，并提前告知基金托管人与相关机构。

（四）基金的非交易过户

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

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

（五）基金的转托管

基金份额持有人可办理已持有基金份额在不同销售机构之间的转托管，基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。

1、本基金分级运作期内的转托管

本基金分级运作期内，互利A 的基金份额登记在注册登记系统基金份额持有人开放式基金账户下，基金份额持有人可将持有的互利A份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间进行转托管，基金份额持有人在变更办理互利A 赎回业务的销售机构（网点）时，可办理已持有互利A 的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。

互利B 的转托管与以下“本基金转型为上市开放式基金（LOF）后的转托管”相同。

2、本基金转型为上市开放式基金（LOF）后的转托管

（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中国结算TA系统内不同销售机构（网点）之间或场内系统内不同会员单位（席位或交易单元）之间进行转托管的行为。

2）份额登记在中国结算场内系统的基金份额持有人在变更办理上市交易的会员单位时，可办理已持有基金份额的系统内转托管。

（2）跨系统转托管

跨系统转托管是指持有人将持有的基金份额在中国结算深圳分公司场内系统和中国结算TA系统之间进行转托管的行为。

本基金跨系统转托管的具体业务按照中国结算的相关规定办理。

（六）定期定额投资计划

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

（七）基金的冻结和解冻

基金登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻，以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。

十一、基金的投资

基金分级运作期届满，本基金继续存续并转型为上市开放式基金（LOF）后，则本基金的投资目标、投资理念、投资范围、投资策略、投资管理程序不变，有关投资限制继续符合基金合同的约定，并符合相关法律法规的规定。

（一）投资目标

在严格控制风险的基础上，本基金通过深入分析固定收益类金融工具的投资价值并进行主动管理，力争实现资产的长期稳健增值。

（二）投资范围

本基金的投资范围为固定收益类品种，国债、金融债、央行票据、公司债、企业债、地方政府债、可转换债券、可分离债券、短期融资券、中期票据、中小企业私募债券、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款及协议存款），以及法律法规或中国证监会允许投资的其他固定收益类品种。本基金不直接从二级市场上买入股票和权证，也不参与一级市场新股申购。因持有可转债转股所得的股票、因所持股票派发的权证以及因投资可分离债券而产生的权证，应当在其可上市交易后的10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：本基金投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的80%，持有的现金或到期日在1年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

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

（三）投资策略

本基金将密切关注债券市场的运行状况与风险收益特征，分析宏观经济运行状况和金融市场运行趋势，自上而下决定类属资产配置及组合久期，并依据内部信用评级系统，深入挖掘价值被低估的标的券种。本基金采取的投资策略主要包括类属资产配置策略、利率策略、信用策略、可转债投资策略等。在谨慎投资的基础上，力争实现组合的稳健增值。

1、类属资产配置策略

不同类属的券种，由于受到不同的因素影响，在收益率变化及利差变化上表现出明显不同的差异。本基金将分析各券种的利差变化趋势，综合分析收益率水平、利息支付方式、市场偏好及流动性等因素，合理配置并动态调整不同类属债券的投资比例。

2、普通债券投资策略

（1）利率策略

本基金将通过全面研究和分析宏观经济运行情况和金融市场资金供求状况变化趋势及结构，结合对财政政策、货币政策等宏观经济政策取向的研判，从而预测出金融市场利率水平变动趋势。在此基础上，结合期限利差与凸度综合分析，制定出具体的利率策略。

具体而言，本基金将首先采用“自上而下”的研究方法，综合研究主要经济变量指标，分析宏观经济情况，建立经济前景的场景模拟，进而预测财政政策、货币政策等宏观经济政策取向。同时，本基金还将分析金融市场资金供求状况变化趋势与结构，对影响资金面的因素进行详细分析与预测，建立资金面的场景模拟。

在此基础上，本基金将结合历史与经验数据，区分当前利率债收益率曲线的期限利差、曲率与券间利差所面临的历史分位，判断收益率曲线参数变动的程度与概率，即对收益率曲线平移的方向，陡峭化的程度与凸度变动的趋势进行敏感性分析，以此为依据动态调整投资组合。如预期收益率曲线出现正向平移的概率较大时，即市场利率将上升，本基金将降低组合久期以规避损失；如出现负向平移的概率较大时，则提高组合久期；如收益率曲线过于陡峭时，则采用骑乘策略获取超额收益。本基金还将在对收益率曲线凸度判断的基础上，利用蝶形策略获取超额收益。

（下转B23版）