(上接B14版)

(1)基金份额净值计算出现错误时,基金管理人应当立即予以纠正,通报基金托管人,并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

(2)错误偏差达到基金份额净值的0.25%时,基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案;错误偏差达到基金份额净值的0.5%时,基金管理人应当公告并报中国证监会备案。

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

①本基金的基金会计责任方由基金管理人担任,与本基金有关的会计问题,如经双方在平等基础上充分讨论后,尚不能达成一致时,按基金管理人的建议执行,由此给基金份额持有人和基金财产造成的损失,由基金管理人负责赔付。

②若基金管理人计算的基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告,由此给基金份额持有人造成损失的,应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金,就实际向投资者或基金支付的赔偿金额,基金管理人与基金托管人按照过错程度各自承担相应的责任。

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

④由于基金管理人提供的信息错误(包括但不限于基金申购或赎回金额等),进而导致基金份额净值计算错误而引起的基金份额持有人和基金财产的损失,由基金管理人负责赔付。

(4)前述内容如法律法规或监管机关另有规定的,从其规定处理。如果行业有通行做法,基金管理人和基金托管人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商。

六、暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券/期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;

2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时;

3、当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时,经与基金托管人协商一致的;

4、中国证监会和基金合同认定的其他情形。

七、基金净值的确认

用于基金信息披露的基金资产净值和各类基金份额净值由基金管理人负责计算,基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金资产净值和各类基金份额的基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人,由基金管理人对基金净值按约定予以公布。

八、特殊情况的处理

1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第8项进行估值时,所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

2、由于证券/期货交易所及其登记结算公司发送的数据错误,或由于其他不可抗力原因,基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查,但是未能发现该错误的,由此造成的基金资产估值错误,基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

第十二部分 基金的收益与分配

一、基金利润的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额;基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动损益后的余额。

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、在符合有关基金分红条件的前提下,本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配,具体分配方案以公告为准,若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配;

2、本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资;若投资人不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;

3、基金收益分配后每一类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该类别基金份额收益分配金额后不能低于面值;

4、由于本基金A类基金份额不收取销售服务费,C类基金份额收取销售服务费,两种基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同,本基金同一类别的每份基金份额享有同等分配权;

5、法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

在符合法律法规及基金合同约定,并对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下,基金管理人可对基金收益分配原则和支付方式进行调整,无须召开基金份额持有人大会。

四、收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截至收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

五、收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定,并由基金托管人复核,依据相关规定进行公告并报中国证监会备案。

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。

六、基金收益分配中发生的费用

基金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,基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为相应类别的基金份额。红利再投资的计算方法,依照《业务规则》执行。

第十三部分 基金费用与税收

一、基金费用的种类

1、基金管理人的管理费;

2、基金托管人的托管费;

3、C类基金份额的销售服务费;

4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;

5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费;

6、基金份额持有人大会费用;

7、基金的证券、期货交易等费用;

8、基金的银行汇划费用;

9、基金的账户开户费用、账户维护费用;

10、按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

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。

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

(1)或有管理费计提

本基金的或有管理费按前一日基金资产净值的0.3%年费率计提。或有管理费的计算方法如下:

Q=E×0.3%÷当年天数

Q为每日应计提的基金或有管理费

E为前一日的基金资产净值

(2)管理费确认

本管理人每日对当日有效退出份额是否满足管理费收取条件进行判断,如满足,则该退出份额对应的已计提或有管理费将确认为基金管理人的管理费;如不满足,则该退出份额对应的已计提或有管理费将随同赎回款项一并划付给申请退出的投资者。

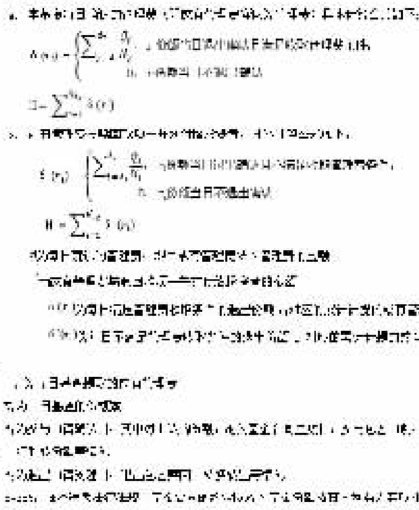
管理人将遵循"先进先出"原则确认退出份额,按份额明细进行上述判断。

1)管理费收取条件

同时满足下列两个条件,退出份额对应的已计提或有管理费将随同赎回款项一并划付给申请退出的投资者,其余情况退出份额对应的已计提或有管理费将确认为基金管理人的管理费:

a. 份额持有期限不少于Y日;

b.对于参与份额,该份额在退出申请受理日的基金份额累计净值小于其在参与申请受理日的基金份额累计净值;对于认购份额,该份额在退出申请受理日的基金份额累计净值小于基金发售面值



。

基金管理费在退出时确认,或有管理费转为管理费的金额逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人计算后,基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式在次月月初五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、公休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。基金管理人将依据基金托管人要求提供基金管理费计算所需相关数据,基金管理人需保证数据的真实准确。

发生基金合同终止事项导致基金进入清算期的,以基金最后运作日比照为退出申请受理日,根据前述规则计算并确认基金份额对应的或有管理费转入管理费的金额,并从基金剩余财产中扣除。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.10%÷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,由基金管理人与基金托管人核对一致后,基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月月初五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

3、C类基金份额的销售服务费

本基金A类基金份额不收取销售服务费,C类基金份额的销售服务费年费率为0.3%。本基金销售服务费主要用于本基金持续销售以及基金份额持有人服务等各项费用。

销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值的0.3%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.3%÷当年天数

H为每日应计提的C类基金份额销售服务费

E为前一日的C类基金份额的基金资产净值

销售服务费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人与基金托管人核对一致后,基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式在次月月初五个工作日内从基金财产中一次性支付至登记机构,由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、公休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。

上述"一、基金费用的种类"中第4—10项费用,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;

3、《基金合同》生效前的相关费用;

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

四、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

基金财产投资的相关税收,由基金份额持有人承担,基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

第十四部分 基金的会计与审计

一、基金会计政策

1、基金管理人为本基金的基金会计责任方;

2、基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日;基金首次募集的会计年度按如下原则:如果《基金合同》生效少于2个月,可以并入下一个会计年度披露;

3、基金核算以人民币为记账本位币,以人民币元为记账单位;

4、会计制度执行国家有关会计制度;

5、本基金独立建账、独立核算;

6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算,按照有关规定编制基金会计报表;

7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

二、基金的年度审计

1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的具有证券从业资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。

2、会计师事务所更换经办注册会计师,应事先征得基金管理人同意。

3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所,须通报基金托管人。更换会计师事务所需在2日内在指定媒介公告并报中国证监会备案。

第十五部分 基金的信息披露

一、本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《流动性风险规定》、《基金合同》及其他有关规定。相关法律法规关于信息披露的披露方式、登载媒介、报备方式等规定发生变化时,本基金从其最新规定。

二、信息披露义务人

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

本基金信息披露义务人按照法律法规和中国证监会的规定披露基金信息,并保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内,将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的媒介披露,并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

三、本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息,不得有下列行为:

1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏;

2、对证券投资业绩进行预测;

3、违规承诺收益或者承担损失;

4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构;

5、登载任何自然人、法人或者其他组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字;

6、中国证监会禁止的其他行为。

四、本基金公开披露的信息应采用中文文本。如同时采用外文文本的,基金信息披露义务人应保证两种文本的内容一致。两种文本发生歧义的,以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字;除特别说明外,货币单位为人民币元。

五、公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括:

(一)基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议

1、《基金合同》是界定《基金合同》当事人的各项权利、义务关系,明确基金份额持有人大会召开的规则及具体程序,说明基金产品的特性等涉及基金投资者重大利益的事项的法律文件。

2、基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项,说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。《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介上;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注册后,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》摘要登载在指定媒介上;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介上。

(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介上登载《基金合同》生效公告。

(四)基金资产净值、基金份额净值

基金合同生效后,在开始办理基金份额申购或者赎回前,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。

在开始办理基金份额申购或者赎回后,基金管理人应当在每个开放日的次日,通过网站、基金销售机构以及其他媒介,披露开放日各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和各类基金份额的基金份额净值。基金管理人应当在前述市场交易日的次日,将基金资产净值、各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定媒介上。

(五)基金份额申购、赎回价格

基金管理人应当在基金合同、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率,并保证投资人能够在基金销售机构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介上。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介上。

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介上。

《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。

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

基金管理人应当在基金年度报告和半年度报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。

(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、基金托管人;

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、涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼或仲裁;

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、基金收益分配事项;

16、管理费、托管费、销售服务费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更;

17、任一类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、更换基金登记机构;

21、本基金开始办理申购、赎回;

22、本基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更;

23、本基金发生巨额赎回并延期办理;

24、本基金暂停接受申购、赎回申请;

25、本基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回;

26、基金推出新业务或服务;

27、调整基金份额类别的设置;

28、发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时;

29、基金管理人采用摆动定价机制进行估值;

30、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,任何公共媒介中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动的,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,应当依法报中国证监会备案,并予以公告。

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

(十)投资中小企业私募债券的信息披露

基金管理人应当在基金投资中小企业私募债券后2个交易日内,在中国证监会指定媒介披露所投资中小企业私募债券的名称、数量、期限、收益率等信息。基金管理人应当在基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告等定期报告和招募说明书(更新)等文件中披露中小企业私募债券的投资情况。

(十一)投资资产支持证券的信息披露内容

基金管理人应在基金年报及半年报中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细。

基金管理人应在基金季度报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期末按市值占基金净资产比例大小排序的前10名资产支持证券明细。

(十二)投资国债期货的信息披露

基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书(更新)等文件中披露国债期货交易情况,包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等,并充分揭示国债期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标。

(十三)发起资金认购份额报告

基金管理人应当按照相关法律法规的规定,在基金合同生效公告、基金年报、半年报、季报中分别披露基金管理人固有资金、基金管理人高级管理人员、基金经理等人员以及基金管理人股东持有基金的份额、期限及期间的变动情况。

(十四)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、各类基金份额净值、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,并向基金管理人出具书面文件或者盖章或者XBRL电子方式复核确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定媒介中选择披露信息的媒介。

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

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

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办公场所,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办公场所,以供公众查阅、复制。

第十六部分 风险揭示

一、投资于本基金的主要风险

1、市场风险

证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响,导致基金收益水平变化而产生风险,主要包括:

(1)政策风险。因国家宏观政策(如货币政策、财政政策、行业政策、地区发展政策等)发生变化,导致市场价格波动而产生风险。

(2)经济周期风险。随经济运行的周期性变化,证券市场的收益水平也呈周期性变化。基金投资于债券,收益水平也会随之变化,从而产生风险。

(3)利率风险。利率直接影响着债券的价格和收益率,影响着企业的融资成本和利润。基金投资于债券,其收益水平会受到利率变化的影响。在利率上升时,基金持有的债券价格下降,如基金组合久期较长,则将造成基金资产的损失。

(4)购买力风险。基金的利润将主要通过现金形式来分配,而现金可能因为通货膨胀的影响而导致购买力下降,从而使基金的实际收益下降。

(5)再投资风险。再投资风险反映了利率下降对固定收益证券利息收入再投资收益的影响,这与利率上升所带来的价格风险(即利率风险)互为消长。具体为当利率下降时,基金从投资的固定收益证券所得的利息收入进行再投资时,将获得比以前较少的收益率,这将对基金的净值增长率产生影响。

(6)信用风险。基金所投资债券的发行人如出现违约、无法支付到期本息,或由于债券发行人信用等级降低导致债券价格下降,将造成基金资产损失。

(7)债券回购风险。债券回购为提升整体基金组合收益提供了可能,但也存在一定的风险。债券回购的主要风险包括信用风险、投资风险及波动性加大的风险,其中,信用风险指回购交易中交易对手在回购到期时,不能偿还全部或部分证券或价款,造成基金净值损失的风险;投资风险是指在进行回购操作时,回购利率大于债券投资收益而导致的风险以及由于回购操作导致投资总量放大,致使整个组合风险放大的风险;而波动性加大的风险是指在进行回购操作时,在对基金组合收益进行放大的同时,也对基金组合的波动性(标准差)进行了放大,即基金组合的风险将会加大。回购比例越高,风险暴露程度也就越高,对基金净值造成损失的可能性也就越大。

2、管理风险

基金运作过程中由于基金投资策略、人为因素、管理系统设置不当造成操作失误或基金管理人内部失控而可能产生的损失。管理风险包括:

(1)决策风险:指基金投资的投资策略制定、投资决策执行和投资绩效监督检查过程中,由于决策失误而给基金资产造成的可能的损失;

(2)操作风险:指基金投资决策执行中,由于投资指令不明晰、交易操作失误等人为因素而可能导致的损失;

(3)技术风险:是指基金管理人管理信息系统设置不当等因素而可能造成的损失。

3、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。

(1)拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

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交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、中小企业私募债券、可分离交易可转债的纯债部分、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包含协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、国债期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但需符合中国证监会的相关规定。标的资产大部分为标准化债券金融工具,一般情况下具有较好的流动性。本基金严格控制投资于流动受限资产和不存在活跃市场需要采用估值技术确定公允价值的投资品种的比例。除此之外,本基金管理人将根据历史经验和现实条件,制定出现金持有量的上下限计划,在该限制范围内进行现金比例调控或现金与证券的转化。本基金管理人会进行标的的分散化投资并结合对各类标的资产的预期流动性合理进行资产配置,以防范流动性风险。

(2)巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

当基金出现巨额赎回情形时,基金管理人可以根据当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。从保护中小投资者的角度出发,针对单个基金份额持有人超过基金总份额20%以上的赎回申请,管理人有权对超出该比例的赎回申请实施延期办理。

(3)实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响

当基金出现极端流动性风险或其他特定情况时,出于公平对待投资者的考虑,基金管理人经与托管人协商,依照法律法规及基金合同的约定,审慎选择备用的流动性风险管理工具,包括但不限于:延期办理巨额赎回申请、暂停接受赎回申请、延缓支付赎回款项、收取短期赎回费、暂停基金估值、摆动定价等。上述流动性风险管理工具的使用将严格按照基金管理人内部制度完成决策和审批程序,并与基金托管人协商一致。实际运用时,将会影响投资者的赎回申请、赎回款项支付及申购申请,带来一定风险。

4、合规性风险

指基金管理或运作过程中,违反国家法律、法规的规定,或者基金投资违反法规及基金合同有关规定的风险。

5、本基金特有风险

(1)根据本基金投资范围的规定,本基金主要投资于各类固定收益证券,无法完全规避发债主体特别是短期融资券、中期票据、公司债、企业债的发债主体的信用质量变化造成的信用风险;另外,如果持有的信用债出现信用违约风险,将给基金净值带来较大的负面影响和波动。

(2)本基金可投资于资产支持证券。资产支持证券是一种债券性质的金融工具,其向投资者支付的本息来自于基础资产池产生的现金流或剩余权益。与股票和一般债券不同,资产支持证券不是对某一经营实体的利益要求权,而是对基础资产池所产生的现金流和剩余权益的要求权,是一种以资产信用为支持的证券,所面临的风险主要包括交易结构风险、各种原因导致的基础资产池现金流与对应证券现金流不匹配产生的信用风险、市场交易不活跃导致的流动性风险等。

(3)本基金的一部分资产将可能投资于中小企业私募债。由于中小企业私募债券发行门槛低,投资过程中的信用风险也相应增加。有可能出现债券到期后,企业不能按时清偿债务,或者在存续期内评级下调的风险。中小企业私募债券不能在交易所上市交易,而是通过上证所固定收益证券综合电子平台及深交所综合协议交易平台,或证券公司进行转让,同时,交易所按照申报时间先后顺序对私募债券转让进行确认,对导致私募债券持有账户超过200人的转让不予确认。因此,本基金在投资中小企业私募债券的过程中,面临着流动性风险。

(4)本基金可投资国债期货,国债期货采用保证金交易制度,由于保证金交易具有杠杆性,当出现不利行情时,可能会导致投资遭受较大损失。国债期货采用每日无负债结算制度,如果没有在规定的时间内补足保证金,按规定将被强制平仓,可能给投资带来重大损失。

(5)本基金为发起式基金,本基金的基金合同生效之日起三年后的对应日,若基金资产净值低于二亿元,本基金合同自动终止,且不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。本基金的基金合同生效三年后持续存续的,连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情形的,基金管理人应当在定期报告中予以披露;连续六十个工作日出现前述情形的,基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案,如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等,并召开基金份额持有人大会进行表决。因此,本基金存在基金合同终止等风险。

(6)本基金采用或有管理费模式,已在基金合同"基金费用与税收"部分详细阐述,与常规基金的计费模式有一定差异,存在投资人误解的风险。

6、其他风险

(1)随着符合本基金投资理念的新投资工具的出现和发展,如果投资于这些工具,基金可能会面临一些特殊的风险;

(2)因技术因素而产生的风险,如计算机系统不可靠产生的风险;

(3)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;

(4)因人为因素而产生的风险,如内幕交易、欺诈行为等产生的风险;

(5)对主要业务人员如基金经理的依赖而可能产生的风险;

(6)战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金资产的损失,影响基金收益水平,从而带来风险;

(7)其他意外导致的风险。

二、声明

1、投资人投资于本基金,须自行承担投资风险;

2、除基金管理人直接办理本基金的销售外,本基金还通过其他销售机构销售,基金管理人与其他机构都不能保证其收益或本金安全。

第十七部分 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基金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。对于法律法规规定和基金合同约定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自生效后方可执行,并自决议生效后两日内在指定媒介公告。

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的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、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)对基金剩余财产进行分配。

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

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依次扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务(不含未支付的基金管理费)后,按基金份额持有人持有的基金份额比例并扣除对应份额应支付的基金管理费(如有)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有关文件由基金托管人保存15年以上。

第十八部分 基金合同的内容摘要

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)基金份额持有人的权利、义务

基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受,基金投资者自依据《基金合同》取得基金份额,即成为本基金份额持有人和《基金合同》的当事人,直至其不再持有本基金的基金份额。

基金份额持有人作为《基金合同》当事人并不以在《基金合同》上书面签章或签字为必要条件。

同一类别每份基金份额具有同等的合法权益。

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金份额持有人的权利包括但不限于:

(1)分享基金财产收益;

(2)参与分配清算后的剩余基金财产;

(3)依法申请赎回或转让其持有的基金份额;

(4)按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集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、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁;

(9)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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》、招募说明书等信息披露文件;

(2)了解所投资基金产品,了解自身风险承受能力,自主判断基金的投资价值,自主做出投资决策,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《基金合同》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)发起资金提供方认购的基金份额持有期限不少于3年;

(10)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)依法募集资金;

(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)依照《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)按照规定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,应呈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者的利益;

(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、赎回或转换申请;

(12)依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使相关权利,为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利;

(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、会计师事务所、证券/期货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、转换和非交易过户等的业务规则;

(17)在不违反法律法规和监管规定且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下,为支付本基金应付的赎回、交易清算等款项,基金管理人有权代表基金份额持有人以基金资产作为抵押进行融资;

(18)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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)依法募集资金,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、赎回和注销价格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分配基金收益;

(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者提供的各项文件或资料在规定时间发出,并且保证投资者能够按照《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)组织并参加基金财产清算小组,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,基金管理人应当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活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)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,应呈报中国证监会,并采取必要措施保护基金投资者的利益;

(4)根据相关市场规则,为基金开设资金账户、证券账户等投资所需账户、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)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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等投资所需账户,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;

(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)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管理人、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业监督管理机构,并通知基金管理人;

(19)因违反《基金合同》导致基金财产损失时,应承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;

(20)按规定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,基金管理人因违反《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管理人追偿;

(21)执行生效的基金份额持有人大会的决议;

(22)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。

本基金份额持有人大会不设日常机构。

(一)召开事由

1、除法律法规、中国证监会另有规定或基金合同另有约定以外,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;

(5)调整基金管理人、基金托管人的报酬标准或提高销售服务费率;

(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)对基金合同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。

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)调低销售服务费率;

(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或在对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下调低赎回费率、变更收费方式或调整基金份额类别设置、对基金份额分类办法及规则进行调整;

(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重大变化;

(6)在不违反法律法规、基金合同的约定以及对份额持有人利益无实质性不利影响的情况下,基金管理人、销售机构、登记机构调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则;

(7)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由基金管理人召集。

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,应当由基金托管人自行召集,并自出具书面决定之日起60日内召开并告知基金管理人,基金管理人应当配合。

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日内召开并告知基金管理人,基金管理人应当配合。

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、方式和权益登记日。

(三)召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1、召开基金份额持有人大会,召集人应于会议召开前30日,在指定媒介公告。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、地点和会议形式;

(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、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;如召集人为基金托管人,则应另行书面通知基金管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督;如召集人为基金份额持有人,则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对表决意见的计票进行监督的,不影响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、通讯开会方式或法律法规、监管机构允许的其他方式召开,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授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,基金管理人或基金托管人不派代表列席的,不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时,可以进行基金份额持有人大会议程:

(1)亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定,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;

(2)经核对,汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示,有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一(含二分之一)。若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一,召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内,就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效的基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之一(含三分之一)。

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以会议通知载明的形式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址或系统。

在同时符合以下条件时,通讯开会的方式视为有效:

(1)会议召集人按《基金合同》约定公布会议通知后,在2个工作日内连续公布相关提示性公告;

(2)召集人按基金合同约定通知基金托管人(如果基金托管人为召集人,则为基金管理人)到指定地点对表决意见的计票进行监督。会议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基金份额持有人的表决意见;基金托管人或基金管理人经通知不参加收取表决意见的,不影响表决效力;

(3)本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的,基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的二分之一(含二分之一)。若本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一,召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内,就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上(含三分之一)基金份额的持有人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见;

(4)上述第(3)项中直接出具表决意见的基金份额持有人或受托代表他人出具表决意见的代理人,同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具表决意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定,并与基金登记机构记录相符。

3、在法律法规和监管机关允许的情况下,本基金的基金份额持有人亦可采用其他非书面方式进行表决或授权其代理人出席基金份额持有人大会并表决;在会议召开方式上,本基金亦可采用其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开基金份额持有人大会,会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。

(五)议事内容与程序

1、议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项,如《基金合同》的重大修改、决定终止《基金合同》、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及《基金合同》规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后,对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开前及时公告。

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。

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下列第(七)条规定程序确定和公布监票人,然后由大会主持人宣读提案,经讨论后进行表决,并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表,在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下,由基金托管人授权其出席会议的代表主持;如果基金管理人授权代表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所持表决权的二分之一以上(含二分之一)选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会,不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

会议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)、身份证明文件号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名(或单位名称)和联系方式等事项。

(2)通讯开会

在通讯开会的情况下,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2个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决,在公证机关监督下形成决议。

(六)表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

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,一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上(含二分之一)通过方为有效;除下列第2项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,特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上(含三分之二)通过方可做出。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》、本基金与其他基金合并以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时,除非在计票时有充分的相反证据证明,否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者,表面符合会议通知规定的表决意见视为有效表决,表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决,但应当计入出具表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

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。

在上述规则的前提下,具体规则以召集人发布的基金份额持有人大会通知为准。

(七)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,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选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人;如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集,但是基金管理人或基金托管人未出席大会的,基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的,不影响计票的效力。

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

(3)如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有怀疑,可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点,重新清点以一次为限。重新清点后,大会主持人应当当场公布重新清点结果。

(4)计票过程应由公证机关予以公证,基金管理人或基金托管人拒不出席大会的,不影响计票的效力。

2、通讯开会

在通讯开会的情况下,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(若由基金托管人召集,则为基金管理人授权代表)的监督下进行计票,并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对表决意见的计票进行监督的,不影响计票和表决结果。

(八)生效与公告

基金份额持有人大会的决议,召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起2日内在指定媒介上公告。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。

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议。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。

(九)本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定,凡是直接引用法律法规的部分,如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的,基金管理人与基金托管人协商一致并提前公告后,可直接对本部分内容进行修改和调整,无需召开基金份额持有人大会审议。

(十)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、基金合同的解除和终止的事由、程序

(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基金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。对于法律法规规定和基金合同约定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自生效后方可执行,并自决议生效后两日内在指定媒介公告。

(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的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、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)对基金剩余财产进行分配。

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

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依次扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务(不含未支付的基金管理费)后,按基金份额持有人持有的基金份额比例并扣除对应份额应支付的基金管理费(如有)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有关文件由基金托管人保存15年以上。

四、争议解决方式

各方当事人同意,因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议,如经友好协商未能解决的,应提交中国国际经济贸易仲裁委员会,根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁,仲裁地点为上海市,仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力,仲裁费由败诉方承担。

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。

《基金合同》受中国法律(为本基金合同之目的,在此不包括香港、澳门特别行政区和台湾地区的有关规定)管辖。

五、基金合同存放地和投资人取得基金合同的方式

《基金合同》可印制成册,供投资者在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅。

第十九部分 基金托管协议的内容摘要

一、托管协议当事人

(一)基金管理人

名称:华泰证券(上海)资产管理有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区东方路18号21层
办公地址:上海市浦东新区东方路18号保利广场E栋21楼
邮政编码:200120
法定代表人:崔春
成立时间:2014年10月16日
批准设立机关:中国证券监督管理委员会
批准设立文号:中国证监会证监许可〔2014〕679号
组织形式:一人有限责任公司(法人独资)
注册资本:26亿元人民币
存续期间:持续经营
经营范围:证券资产管理、公开募集证券投资基金管理及中国证监会批准的其他业务。

(二)基金托管人

名称:招商银行股份有限公司(简称:招商银行)
住所:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码:518040
法定代表人:李建红
成立时间:1987年4月8日
基金托管业务批准文号:证监基金字[2002]83号
组织形式:股份有限公司
注册资本:人民币252.20亿元
存续期间:持续经营

二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

(一)基金托管人根据有关法律法规的规定以及《基金合同》的约定,对基金投资范围、投资比例、投资限制、关联方交易等,进行严格监督。《基金合同》明确约定基金投资证券选择标准的,基金管理人应事先或定期向基金托管人提供投资品种池,以便基金托管人对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督。

1.本基金将投资于以下金融工具:

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交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、中小企业私募债券、可分离交易可转债的纯债部分、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包含协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、国债期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但需符合中国证监会的相关规定。

基金的投资组合比例为:本基金投资于债券资产比例不低于基金资产的80%;每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。

本基金不投资于股票、权证等资产,也不投资于可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分除外)、可交换债券。

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。

2.本基金各类品种的投资比例、投资限制为:

(1)投资组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制:

1)本基金债券的投资比例不低于基金资产的80%;

2)每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金所持有现金及到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等;

3)本基金持有一家公司发行的证券,其市值不超过基金资产净值的10%;

4)本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券,不超过该证券的10%;

5)本基金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%;

6)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%;

7)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%;

8)本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%;

9)本基金应投资于信用级别评级为BBB以上(含BBB)的资产支持证券。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;

10)本基金持有单只中小企业私募债券,其市值不得超过本基金资产净值的10%;

11)本基金投资国债期货,遵循以下投资比例限制:

在任何交易日日终,持有的买入国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的15%;在任何交易日日终,持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的30%;本基金所持有的债券(不含到期日在一年以内的政府债券)市值和买入、卖出国债期货合约价值,合计(轧差计算)应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定;在任何交易日内交易(不包括平仓)的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的30%;

12)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%;在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年,债券回购到期后不展期;

13)本基金资产总值不得超过基金净资产的140%;

14)本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的15%。因证券市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使本基金不符合该比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;

15)本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的,可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致;

16)法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他投资限制。

除上述第2)、9)、14)、15)项外,因证券、期货市场波动、证券发行人合并、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,但法律法规或中国证监会规定的特殊情形除外。

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。在上述期间内,本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

如果法律法规或监管部门对上述投资组合比例限制进行变更的,以变更后的规定为准,不需要经基金份额持有人大会审议。法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制。

3.本基金财产不得用于以下投资或者活动:

(1)承销证券;

(2)违反规定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,但是中国证监会另有规定的除外;

(5)向基金管理人、基金托管人出资;

(6)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;

(7)法律、行政法规或者中国证监会规定禁止的其他活动。

法律、行政法规和监管部门取消或调整上述禁止性规定的,在适用于本基金的情况下,则本基金投资不再受相关限制或以调整后的规定为准。

4.基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有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,或者从事其他重大关联交易的,应当符合基金的投资目标和投资策略,遵循基金份额持有人利益优先的原则,防范利益冲突,建立健全内部审批机制和评估机制,按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意,并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议,并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

(下转B16版)