

# 光大保德信国企改革主题股票型证券投资 基金招募说明书（更新）

基金管理人：光大保德信基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

## 重要提示

基金募集申请注册文件名称：关于准予光大保德信国企改革主题股票型证券投资基金注册的批复（证监许可【2015】101号）

注册日期：2015年1月20日

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值和市场前景作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

投资有风险，投资人认购（或申购）本基金时应认真阅读本招募说明书、基金合同等信息披露文件，全面认识本基金产品的风险收益特征，自主判断基金的投资价值，应充分考虑投资人自身的风险承受能力，并对于认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，自行承担投资风险。

本基金为股票型基金，其预期收益和风险高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金的投资范围包括中小企业私募债券，中小企业私募债是根据相关法律法规由非上市中小企业采用非公开方式发行的债券。中小企业私募债的风险主要包括信用风险、流动性风险、市场风险等。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金净值

变化引致的投资风险，由投资人自行负责。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。

本更新招募说明书所载内容截止日为 2018 年 9 月 24 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2018 年 6 月 30 日。

交通银行股份有限公司于 2018 年 10 月 12 日复核了本次招募说明书中与基金托管业务有关的更新内容。

## 目 录

|                             |     |
|-----------------------------|-----|
| 一、绪言 .....                  | 1   |
| 二、释义 .....                  | 2   |
| 三、基金管理人.....                | 7   |
| 四、基金托管人.....                | 19  |
| 五、相关服务机构.....               | 23  |
| 六、基金的募集.....                | 44  |
| 七、基金合同的生效.....              | 45  |
| 八、基金份额的申购与赎回.....           | 46  |
| 九、基金的投资.....                | 62  |
| 十、基金的业绩.....                | 71  |
| 十一、基金的财产.....               | 72  |
| 十二、基金资产的估值.....             | 73  |
| 十三、基金的收益与分配.....            | 78  |
| 十四、基金的费用与税收.....            | 80  |
| 十五、基金的会计与审计.....            | 82  |
| 十六、基金的信息披露.....             | 83  |
| 十七、风险揭示.....                | 90  |
| 十八、基金合同的变更、终止与基金财产的清算 ..... | 95  |
| 十九、基金合同的内容摘要.....           | 97  |
| 二十、基金托管协议的内容摘要.....         | 112 |
| 二十一、对基金份额持有人的服务.....        | 126 |
| 二十二、其他应披露事项.....            | 129 |
| 二十三、招募说明书的存放及查阅方式.....      | 131 |
| 二十四、备查文件.....               | 132 |

---

## 一、绪言

本招募说明书由光大保德信基金管理有限公司依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性风险管理规定》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、《证券投资基金管理公司治理准则(试行)》、《光大保德信国企改革主题股票型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关规定编写。

本招募说明书阐述了光大保德信国企改革主题股票型证券投资基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资人投资决策有关的全部必要事项,投资人在作出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息,或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写,并经中国证监会注册。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

---

## 二、释义

本招募说明书中，除非文义另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

1、基金或本基金：指光大保德信国企改革主题股票型证券投资基金

2、基金管理人：指光大保德信基金管理有限公司

3、基金托管人：指交通银行股份有限公司

4、基金合同：指《光大保德信国企改革主题股票型证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充

5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《光大保德信国企改革主题股票型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充

6、招募说明书或本招募说明书：指《光大保德信国企改革主题股票型证券投资基金招募说明书》及其定期的更新

7、基金份额发售公告：指《光大保德信国企改革主题股票型证券投资基金基金份额发售公告》

8、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等

9、《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，2012 年 12 月 28 日经第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自 2013 年 6 月 1 日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订

10、《销售办法》：指中国证监会 2013 年 3 月 15 日颁布、同年 6 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

11、《信息披露办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 8 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

12、《运作办法》：指中国证监会 2014 年 7 月 7 日颁布、同年 8 月 8 日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

13、《流动性风险规定》：指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其

---

不时做出的修订

14、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

15、银行业监督管理机构：指中国银行业监督管理委员会

16、基金合同当事人：指受基金合同约束，根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人

17、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

18、机构投资者：指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织

19、合格境外机构投资者：指符合相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者

20、投资人、投资者：指个人投资者、机构投资者和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证券投资基金的其他投资人的合称

21、基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人

22、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务

23、销售机构：指光大保德信基金管理有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议，代为办理基金销售业务的机构

24、登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等

25、登记机构：指办理登记业务的机构。基金的登记机构为光大保德信基金管理有限公司或接受光大保德信基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构

26、基金账户：指登记机构为投资人开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户

27、基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机

---

构办理认购、申购、赎回、转换及转托管及定期定额投资等业务而引起基金的基金份额变动及结余情况的账户

28、基金合同生效日：指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期

29、基金合同终止日：指基金合同规定的基金合同终止事由出现后，基金财产清算完毕，清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期

30、基金募集期：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过3个月

31、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

32、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所及相关的期货交易所的正常交易日

33、T日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日

34、T+n日：指自T日起第n个工作日(不包含T日)，n为自然数

35、开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

36、开放时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

37、《业务规则》：指《光大保德信基金管理有限公司开放式基金业务规则》，是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金登记方面的业务规则，由基金管理人 and 投资人共同遵守

38、认购：指在基金募集期内，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

39、申购：指基金合同生效后，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

40、赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为

41、基金转换：指基金份额持有人按照基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金基金份额的行为

---

42、转托管：指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基金份额销售机构的操作

43、定期定额投资计划：指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期申购日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及受理基金申购申请的一种投资方式

44、巨额赎回：指本基金单个开放日，基金净赎回申请(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)超过上一开放日基金总份额的 10%

45、元：指人民币元

46、基金收益：指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约

47、基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收款项及其他资产的价值总和

48、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

49、基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

50、基金资产估值：指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程

51、流动性受限资产：指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等

52、指定媒介：指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站及其他媒介

53、不可抗力：指基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

54、中国：指中华人民共和国。就基金合同而言，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区

55、养老金客户：指基本养老金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投



---

资运营收益形成的补充养老基金，包括全国社会保障基金、可以投资基金的地方社会保障基金、企业年金单一计划以及集合计划。如将来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，基金管理人可在招募说明书更新时或发布临时公告将其纳入养老金客户范围，并按规定向中国证监会备案

56、非养老金客户：指除养老金客户外的其他投资人

---

### 三、基金管理人

#### (一) 基金管理人概况

名称：光大保德信基金管理有限公司

设立日期：2004年4月22日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2004]42号

注册地址：上海市黄浦区中山东二路558号外滩金融中心1幢，6层至10层

办公地址：上海市黄浦区中山东二路558号外滩金融中心1幢(北区3号楼)6层至10层

法定代表人：林昌

注册资本：人民币1.6亿元

股权结构：光大证券股份有限公司（以下简称“光大证券”）持55%的股权；保德信投资管理有限公司持45%的股权

电话：(021) 80262888

传真：(021) 80262468

客服电话：4008-202-888

网址：[www.epf.com.cn](http://www.epf.com.cn)

联系人：殷瑞峰

#### (二) 主要人员情况

##### 1、董事会成员

林昌先生，董事长，北京大学硕士，中国国籍。历任光大证券南方总部研究部总经理、投资银行一部总经理、南方总部副总经理、投资银行总部总经理、光大证券助理总裁。现任本基金管理人董事长。

Glenwyn P. Baptist 先生，副董事长，美国西北大学管理系硕士学位，CFA，美国国籍。历任保德信金融集团企业金融部助理副总裁、保德信金融集团研究部总监、保德信金融集团业务管理部首席运营官、保德信金融集团市场及业务管理部共同基金总监、保德信金融集团投资管理部首席投资官、保德信金融集团业务管理部总裁兼首席投资官。现任保德信国际投资总裁兼CIO。

---

包爱丽女士，董事、总经理，美国哥伦比亚大学硕士，中国国籍。历任贝莱德资产管理公司研究员、经理、业务负责人，银华基金管理有限公司战略发展部负责人，国投瑞银基金管理有限公司产品发展团队负责人、总经理助理、督察长、副总经理。现任本基金管理人董事、总经理。

葛新元先生，董事，北京师范大学博士、南京大学博士后，中国国籍。历任上海社会科学院研究员，湘财证券研究所金融工程研究员，国信证券研究所金融工程首席分析师、衍生品部副总经理，国信证券研究所金融工程首席分析师、副所长。现任光大富尊投资有限公司总经理。

俞大伟先生，董事，同济大学工商管理硕士，中国国籍。历任江苏东华期货有限公司苏州办交易部经纪人，上海中期期货经纪有限公司苏州交易部经理，河南鑫福期货有限公司苏州代表处经理，上海中期期货经纪有限公司苏州营业部副经理、经理，上海中期期货经纪有限公司副总经理。现任光大期货有限公司常务副总经理。

王俪玲女士，董事，美国波士顿大学硕士，曾任荷兰银行（中国台湾）的法务长，联鼎法律事务所（中国台湾）、泰运法律事务所（中国台湾）律师。现任保德信金融集团高级副总裁兼区域顾问（中国台湾）。

夏小华先生，独立董事，复旦大学政治经济学系学士，中国国籍。历任交通银行研究开发部经济研究处处长、研究开发部副总经理，广东发展银行上海分行常务副行长、行长、党委书记，华夏银行上海分行行长。

金德环先生，独立董事，上海财经大学硕士、教授，中国国籍。曾任上海财经大学财政金融系教研室主任、财政系副主任、证券期货学院副院长。现任上海财经大学金融学院证券研究中心主任。

郑志先生，独立董事，华东政法学院（现华东政法大学）法律史专业硕士。曾任安徽国运律师事务所上海分所律师、国浩律师集团（上海）事务所律师、上海东方华银律师事务所合伙人及律师。现任北京市大成律师事务所上海分所律师。

## **2、监事会成员**

孙佚先生，监事长，复旦大学博士研究生。历任交通银行总行国际业务部产品策划经理，光大证券公司办公室综合处副处长、光大证券公司办公室副主任兼综合处处长。现任光大国际营运总监。

---

颜微滢女士，监事，新加坡国立大学经济和数学双学士，马来西亚国籍，香港证券业协会会员。历任新加坡 Farenw Mondial 投资私人有限公司分析员，DBS 唯高达亚洲有限公司合规经理，香港交易所上市部副总监，富通集团亚洲区域合规总监。现任香港保德信亚洲基金管理有限公司董事及首席合规总监。

王永万先生，监事，吉林财贸学院经济管理专业学士。曾任海口会计师事务所审计员，海南省国际租赁有限公司证券营业部财务主管，湘财证券有限责任公司海口营业部、深圳营业部及南方总部财务经理，宝盈基金管理有限公司基金会计主管，摩根士丹利华鑫基金管理有限公司基金运营部总监等职务。现任本基金管理人运营部总监。

赵大年先生，监事，中国科学技术大学统计与金融系学士，中国科学院数学与系统科学研究院统计学专业硕士。历任申万巴黎基金管理有限公司任职产品设计经理，钧锋投资咨询有限公司任职投资经理。2009年4月加入光大保德信基金管理有限公司，先后担任风险管理部风险控制专员、风险控制高级经理、副总监、总监（负责量化投资研究等）、量化投资部总监、基金经理，现任风险管理部副总监。

### 3、公司高级管理人员

林昌先生，现任本基金管理人董事长，简历同上。

包爱丽女士，现任本基金管理人董事、总经理，简历同上。

李常青先生，中欧国际工商学院 EMBA。历任中国科学技术大学化学系教师，安徽众城高昕律师事务所律师，天同（万家）基金管理有限公司市场拓展部高级经理、监察稽核部总监助理、北京办事处主任，诺德基金管理有限公司监察稽核部总监等职务，2010年7月加入光大保德信基金管理有限公司，先后担任监察稽核部总监、战略发展部总监，现任本基金管理人督察长兼风险管理部总监。

盛松先生，北京大学硕士，中国国籍。历任中国光大国际信托投资公司证券部交易部经理，光大证券资产管理总部总经理，2003年参加光大保德信基金管理有限公司筹备工作，2004年4月起担任光大保德信基金管理有限公司督察长。现任本基金管理人副总经理、首席投资总监、量化投资部总监兼光大保德信量化核心证券投资基金基金经理。

梅雷军先生，吉林大学博士。曾任深圳蛇口安达实业股份有限公司投资管理

---

部经理，光大证券股份有限公司南方总部机构管理部总经理兼任电脑部总经理、光大证券股份有限公司电子商务一部总经理、信息技术部总经理兼客户服务中心总经理。2004年7月加入光大保德信基金管理有限公司，现任本基金管理人副总经理兼首席运营总监。

董文卓先生，中山大学金融学硕士。历任招商基金管理有限公司实习研究助理、研究员，平安资产管理有限责任公司助理投资经理、投资经理，平安养老保险股份有限公司固定收益投资总监兼固定收益部总经理、投资决策委员会委员、另类投资决策委员会委员、年金基金经理、专户投资经理、基本养老投资经理等。2017年5月加入光大保德信基金管理有限公司，现任本基金管理人副总经理、固定收益投资总监兼投资经理。

#### **4、本基金基金经理**

历任基金经理：

王健女士，担任本基金基金经理时间为2015年3月25日至2015年5月29日。

魏晓雪女士，担任本基金基金经理时间为2015年5月20日至2017年1月24日。

现任基金经理：

董伟炜先生，毕业于西南财经大学金融学专业，获得上海财经大学证券投资专业硕士学位。2007年7月加入光大保德信基金管理有限公司，先后担任市场部产品经理助理、产品经理，2010年5月后担任投资部研究员、高级研究员。现任光大保德信国企改革主题股票型证券投资基金基金经理、光大保德信安和债券型证券投资基金基金经理、光大保德信安祺债券型证券投资基金基金经理、光大保德信红利混合型证券投资基金基金经理、光大保德信行业轮动混合型证券投资基金基金经理、光大保德信安泽债券型证券投资基金基金经理。

#### **5、投资决策委员会成员**

盛松先生，现任本基金管理人副总经理、首席投资总监、量化投资部总监兼光大保德信量化核心证券投资基金基金经理。

董文卓先生，现任本基金管理人副总经理、固定收益投资总监兼投资经理。

戴奇雷先生，现任本基金管理人权益投资部总监兼光大保德信中小盘混合型

---

证券投资基金基金经理、光大保德信均衡精选混合型证券投资基金基金经理、光大保德信动态优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

林晓凤女士，现任本基金管理人专户投资部总监兼投资经理。

上述人员无近亲属关系。

### **（三）基金管理人的职责**

- 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、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；
- 4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；
- 5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- 6、编制基金季度报告、基金半年度报告和基金年度报告；
- 7、计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；
- 8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；
- 9、召集基金份额持有人大会；
- 10、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；
- 11、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；
- 12、中国证监会规定和本基金基金合同约定的其他职责。

### **（四）基金管理人的承诺**

- 1、基金管理人承诺严格遵守法律、法规和基金合同，按照招募说明书列明的投资目标、策略及限制全权处理本基金的投资；
- 2、基金管理人承诺严格遵守《证券法》、《基金法》、《信息披露办法》、《运作办法》、《销售办法》、《治理准则》等法律法规，建立健全内部控制制度，采取有效措施，保证基金财产不用于下列投资或者活动：

- （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) 向本基金管理人、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、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

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重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合本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。

法律、行政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。

3、基金管理人承诺严格遵守法律法规，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止以下禁止性行为的发生：

- (1) 将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
- (2) 不公平地对待其管理的不同基金财产；
- (3) 利用基金财产或者职务之便为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；
- (4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- (5) 侵占、挪用基金财产；
- (6) 泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
- (7) 玩忽职守，不按照规定履行职责；
- (8) 法律法规及监管机关规定禁止从事的其他行为。

4、本基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下活动：

- (1) 越权或违规经营；

- 
- (2) 违反基金合同或托管协议；
  - (3) 故意损害基金份额持有人或其他基金合同当事人的合法权益；
  - (4) 在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；
  - (5) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
  - (6) 玩忽职守、滥用职权，不按照规定履行职责；
  - (7) 泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
  - (8) 违反证券交易场所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；
  - (9) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成份；
  - (10) 其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

#### 5、基金经理承诺

- (1) 依照有关法律、法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；
- (2) 不利用职务之便为自己、代理人、受雇人或任何第三人谋取不当利益；
- (3) 不泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；
- (4) 不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

### **(五) 基金管理人的内部控制制度**

#### 1、内部控制概述

内部控制是指基金管理人为防范和化解风险，保证经营运作符合基金管理人发展规划，在充分考虑内外部环境的基础上，通过建立组织机制、运用管理方法、实施操作程序与控制措施而形成的有机系统。

内部控制是由为保障业务正常运作、实现既定的经营目标、防范经营风险而设立的各种内部控制机制和一系列规范内部运作程序、描述控制措施和方法等制度构成的统一整体。

内部控制是由基金管理人的董事会、管理层和员工共同实施的合理保证。基



---

基金管理人的内部控制要达到的总体目标是：

（1）保证基金管理人的经营运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念；

（2）防范和化解经营风险，提高经营管理效益，确保经营业务的稳健运行和受托资产的安全完整，实现基金管理人的持续、稳定、健康发展；

（3）确保基金、基金管理人财务和其他信息真实、准确、完整、及时；

（4）确保基金管理人成为一个决策科学、经营规范、管理高效、运作安全的持续、稳定、健康发展的基金管理公司。

## 2、内部控制的五个要素

内部控制的基本要素包括控制环境、风险评估、控制活动、信息沟通和内部监控。

### （1）控制环境

控制环境是内部控制其他要素的基础，它决定了基金管理人的内部控制基调，并影响着基金管理人内部员工的内控意识。为此，基金管理人从两方面入手营造一个好的控制环境。首先，从“硬控制”来看，本基金管理人遵循健全的法人治理结构原则，设置了职责明确、相互制约的组织结构，各部门有明确的岗位设置和授权分工，操作相互独立。其次，基金管理人更注重“软控制”，基金管理人的管理层牢固树立内部控制和风险管理优先的理念和实行科学高效的运行方式，培养全体员工的风险防范意识，营造一个浓厚的内控文化氛围，加强全体员工道德规范和自身素质建设，使风险意识贯穿到基金管理人的各个部门、各个岗位和各个环节。

### （2）风险评估

本基金管理人的风险评估和管理分三个层次进行：一，各部门进行风险的自我评估和分析，通过制定相应的控制措施进行自我风险管理；二，管理层下属的风险管理工作委员会负责风险管理工作，设定明确的风险管理目标，建立科学严密的风险控制评估体系，辨认和识别基金管理人内外部的重大风险，评估和分析风险的重大性、制定相应的风险控制方案和有效防范措施。风险管理工作委员会通过定期与不定期风险评估及时防范和化解风险；三，董事会专门委员会——风险管理委员会负责基金管理人的全面风险管理工作，监控和评价管理层的风险管

---

理工作，并决策重大的风险管理事项。

### （3）控制活动

本基金管理人制定了各项规章制度，通过各种预防性的、检查性的和修正性的控制措施，把控制活动贯穿于基金管理人经营活动的始终，尤其是强调对于基金资产与基金管理人的资产、不同基金的资产和其他委托资产实行独立运作，分别核算；严格岗位分离，明确划分各岗位职责，明确授权控制；对重要业务部门和岗位进行了适当的物理隔离；制订应急应变措施，危机处理机制和程序。

### （4）信息沟通

本基金管理人建立清晰、有效的垂直报告制度和平行通报制度，以确保识别、收集和交换有关运营活动的关键指标，使员工了解各自的工作职责和基金管理人的各项规章制度，并建立与客户和第三方的合理交流机制。

### （5）内部监控

督察长和监察稽核部负责监督检查基金和公司运作的合法合规情况、公司内部风险控制以及公司内部控制制度的执行情况，保证内部控制制度的落实。各部门必须切实协助经营管理层对日常业务管理活动和各类风险的总体控制，并协助解决所出现的相关问题。按照基金管理人内部控制体系的设置，实现一线业务岗位、各部门及其子部门根据职责与授权范围的自控与互控，确保实现内部监控活动的全方位、多层次的展开。

## 3、内部控制原则

（1）健全性原则：内部控制应当包括基金管理人的各项业务、各个部门或机构和各级人员，并贯穿于到决策、执行、监督、反馈等各个环节；

（2）有效性原则：通过科学的内部控制手段和方法，建立合理的内部控制程序，维护内部控制制度的有效执行；

（3）独立性原则：各机构、部门和岗位职责应当保持相对独立，基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离；

（4）相互制约原则：部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡；

（5）成本效益原则：基金管理人运用科学化的经营管理方法降低运作成本，提高经济效益，以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

## 4、内部控制机制

---

内部控制机制是指基金管理人的组织结构及其相互之间的制约关系。内部控制机制是内部控制的重要组成部分，健全、合理的内部控制机制是基金管理人经营活动得以正常开展的重要保证。

从功能上划分，基金管理人的内部控制机制可分为“决策系统”、“执行系统”、“监督系统”三个方面。监督系统在各个内部控制层次上对决策系统和执行系统实施监督。

决策系统是指在基金管理人经营管理过程中拥有决策权力的有关机构及其之间的关系。执行系统是指具体负责将基金管理人决策系统的各项决议付诸实现的一些职能部门。

执行系统在总经理办公会的直接领导下，承担了公司日常经营管理、基金投资运作和内部管理工作。

监督系统对基金管理人的决策系统、执行系统进行全程、动态的监控，监督的对象覆盖基金管理人经营管理的全部内容。基金管理人的监督系统从监督内容划分，大致分为三个层次：

- (1) 监事会——对董事、高管人员的行为及董事会的决策进行监督；
- (2) 董事会专门委员会及督察长——根据董事会的授权对基金管理人的经营活动进行监督；
- (3) 监察稽核部——根据总经理及督察长的安排，对基金管理人的经营活动及各职能部门进行内部监督。

## 5、内部控制层次

(1) 员工自律和部门主管的监控。所有员工上岗前必须经过岗位培训，签署自律承诺书，保证遵守国家的法律法规以及基金管理人的各项管理制度；保证良好的职业操守；保证诚实信用、勤勉尽责等。基金管理人的各部门主管在权限范围之内，对其管理负责的业务进行检查、监督和控制，保证业务的开展符合国家法律、法规、监管规定、基金管理人的规章制度，并对部门的内部控制和风险管理负直接责任；

(2) 管理层的控制。管理层采取各种控制措施，管理和监督各个部门和各项业务进行，以确保基金管理人运作在有效的控制下。管理层对内部控制制度的有效执行承担责任；

---

(3) 董事会及其专门委员会的监控和指导。所有员工应自觉接受并配合董事会及其专门委员会对各项业务和工作行为的检查监督。合理的风险分析和管理建议应予采纳，基金管理人规定的风险控制措施必须坚决执行。董事会对内部控制负最终责任。

督察长和监察稽核部负责对基金管理人内部控制和风险控制的充分性、合理性和有效性实施独立客观的检查和评价。

## 6、内部控制制度

内部控制制度指规范内部控制的一系列规章制度和义务规则，是内部控制的重要组成部分。内部控制制度制订的基本依据为法律法规、中国证监会及其他主管部门有关文件的规定。内部控制制度分为四个层次：

(1) 《公司章程》——指经股东会批准的《公司章程》，是基金管理人制定各项基本管理制度和具体管理规章的指导性文件；

(2) 内部控制大纲——是对《公司章程》规定的内部控制原则的细化和展开，是各项基本管理制度的纲要和总揽；

(3) 公司基本管理制度——是基金管理人在经营管理宏观方面进行内部控制的制度依据。基本管理制度须经董事会审议并批准后实施。基本管理制度包括但不限于风险管理制度、投资管理制度、基金会计核算办法、信息披露管理办法、监察稽核制度、信息技术管理制度、固有资金投资内部控制制度、公司财务制度、档案管理制度、印章管理办法、行政管理制度、人力资源管理制度、业绩评估考核制度、员工对外兼职管理办法、员工行为规范、纪律程序和应急情况处理与业务连续制度等；

(4) 部门规章制度以及业务流程——部门规章制度以及业务流程是在公司基本管理制度的基础上，对各部门的主要职责、岗位设置、岗位职责、操作守则等的具体说明。它不仅是基金管理人的业务、管理、监督的需要，同时也是避免工作中主观随意性的有效手段。部门制度及具体管理规章根据总经理办公会的决定进行拟订、修改，经总经理办公会批准后实施的。制定的依据包括法律法规、证监会规定和《公司章程》及公司基本管理制度。

## 7、基金管理人关于内部控制的声明

本基金管理人确知建立、维持、完善、实施和有效执行风险管理和内部控制

---

制度是本基金管理人董事会及管理层的责任，董事会承担最终责任。本基金管理人特别声明以上关于内部控制的披露真实、准确、完备，并承诺将根据市场环境的变化和业务的发展不断完善内部控制制度。

---

## 四、基金托管人

### （一）基金托管人基本情况

#### 1、基金托管人概况

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：彭纯

住 所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号

邮政编码：200120

注册时间：1987年3月30日

注册资本：742.62亿元

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：陆志俊

电 话：95559

交通银行始建于1908年，是中国历史最悠久的银行之一，也是近代中国的发钞行之一。1987年重新组建后的交通银行正式对外营业，成为中国第一家全国性的国有股份制商业银行，总部设在上海。2005年6月交通银行在香港联合交易所挂牌上市，2007年5月在上海证券交易所挂牌上市。根据2017年英国《银行家》杂志发布的全球千家大银行报告，交通银行一级资本位列第11位，较上年上升2位；根据2017年美国《财富》杂志发布的世界500强公司排行榜，交通银行营业收入位列第171位。

截至2018年6月30日，交通银行资产总额为人民币93227.07亿元。2018年1-6月，交通银行实现净利润(归属于母公司股东)人民币407.71亿元。

交通银行总行设资产托管业务中心（下文简称“托管中心”）。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。

#### 2、主要人员情况

---

彭纯先生，董事长、执行董事，高级会计师。

彭先生2018年2月起任本行董事长、执行董事。2013年11月起任本行执行董事。2013年11月至2018年2月任本行副董事长、执行董事，2013年10月至2018年1月任本行行长；2010年4月至2013年9月任中国投资有限责任公司副总经理兼中央汇金投资有限责任公司执行董事、总经理；2005年8月至2010年4月任本行执行董事、副行长；2004年9月至2005年8月任本行副行长；2004年6月至2004年9月任本行董事、行长助理；2001年9月至2004年6月任本行行长助理；1994年至2001年历任本行乌鲁木齐分行副行长、行长，南宁分行行长，广州分行行长。彭先生1986年于中国人民银行研究生部获经济学硕士学位。

袁庆伟女士，资产托管业务中心总裁，高级经济师。

袁女士2015年8月起任本行资产托管业务中心总裁；2007年12月至2015年8月，历任本行资产托管部总经理助理、副总经理，本行资产托管业务中心副总裁；1999年12月至2007年12月，历任本行乌鲁木齐分行财务会计部副科长、科长、处长助理、副处长，会计结算部高级经理。袁女士1992年毕业于中国石油大学计算机科学系，获得学士学位，2005年于新疆财经学院获硕士学位。

### 3、基金托管业务经营情况

截至2018年6月30日，交通银行共托管证券投资基金370只。此外，交通银行还托管了基金公司特定客户资产管理计划、证券公司客户资产管理计划、银行理财产品、信托计划、私募投资基金、保险资金、全国社保基金、养老保障管理基金、企业年金基金、QFII证券投资资产、RQFII证券投资资产、QDII证券投资资产和QDLP资金等产品。

#### （二）基金托管人的内部控制制度

##### （一）内部控制目标

交通银行严格遵守国家法律法规、行业规章及行内相关管理规定，加强内部管理，保证托管中心业务规章的健全和各项规章的贯彻执行，通过对各种风险的梳理、评估、监控，有效地实现对各项业务风险的管控，确保业务稳健运行，保护基金持有人的合法权益。

##### （二）内部控制原则

1、合法性原则：托管中心制定的各项制度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、全面性原则：托管中心建立各二级部自我监控和风险合规部风险管控的内部控制机制，覆盖各项业务、各个部门和各级人员，并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个经营环节，建立全面的风险管理监督机制。

3、独立性原则：托管中心独立负责受托基金资产的保管，保证基金资产与交通银行的自有资产相互独立，对不同的受托基金资产分别设置账户，独立核算，分账管理。

4、制衡性原则：托管中心贯彻适当授权、相互制约的原则，从组织结构的设置上确保各二级部和各岗位权责分明、相互牵制，并通过有效的相互制衡措施消除内部控制中的盲点。

5、有效性原则：托管中心在岗位、业务二级部和风险合规部三级内控管理模式的基础上，形成科学合理的内部控制决策机制、执行机制和监督机制，通过行之有效的控制流程、控制措施，建立合理的内控程序，保障内控管理的有效执行。

6、效益性原则：托管中心内部控制与基金托管规模、业务范围和业务运作环节的风险控制要求相适应，尽量降低经营运作成本，以合理的控制成本实现最佳的内部控制目标。

### （三）内部控制制度及措施

根据《证券投资基金法》、《中华人民共和国商业银行法》等法律法规，托管中心制定了一整套严密、高效的证券投资基金托管管理规章制度，确保基金托管业务运行的规范、安全、高效，包括《交通银行资产托管业务管理办法》、《交通银行资产托管业务风险管理办法》、《交通银行资产托管业务系统建设管理办法》、《交通银行资产托管部信息披露制度》、《交通银行资产托管业务商业秘密管理规定》、《交通银行资产托管业务从业人员行为规范》、《交通银行资产托管业务档案管理暂行办法》等，并根据市场变化和基金业务的发展不断加以完善。做到业务分工合理，技术系统规范管理，业务管理制度化，核心作业区实行封闭管理，有关信息披露由专人负责。

托管中心通过对基金托管业务各环节的事前指导、事中风控和事后检查措施实现全流程、全链条的风险控制管理，聘请国际著名会计师事务所对基金托管业务运行进行国际标准的内部控制评审。

### （三）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



---

交通银行作为基金托管人，根据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和有关证券法规的规定，对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、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、基金的申购资金的到账与赎回资金的划付、基金收益分配等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

交通银行作为基金托管人，发现基金管理人违反《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关证券法规和《基金合同》的行为，及时通知基金管理人予以纠正，基金管理人收到通知后及时核对确认并进行调整。交通银行有权对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人交通银行通知的违规事项未能及时纠正的，交通银行有权报告中国证监会。

交通银行作为基金托管人，发现基金管理人重大违规行为，有权立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

#### **四、其他事项**

最近一年内交通银行及其负责资产托管业务的高级管理人员无重大违法违规行为，未受到中国人民银行、中国证监会、中国银保监会及其他有关机关的处罚。负责基金托管业务的高级管理人员在基金管理公司无兼职的情况。

---

## 五、相关服务机构

### (一) 直销机构

名称：光大保德信基金管理有限公司

注册地址：上海市黄浦区中山东二路 558 号外滩金融中心 1 幢，6 层至 10 层

办公地址：上海市黄浦区中山东二路 558 号外滩金融中心 1 幢(北区 3 号楼) 6 层至 10 层

电话：(021) 80262466、80262481

传真：(021) 80262482

客服电话：4008-202-888

联系人：王颖

网址：www.epf.com.cn

### (二) 代销机构

#### 1. 交通银行股份有限公司

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：彭纯

客服电话：95559

联系人：王菁

电话：021-58781234

传真：021-58408483

网址：www.bankcomm.com

#### 2. 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：深圳市深南大道 2028 号中国凤凰大厦 1 号楼 7 层

法定代表人：牛冠兴

联系人：陈剑虹

电话：0755-82558305

客服电话：400-800-1001

网址：www.essence.com.cn

---

3. 北京增财基金销售有限公司

注册地址：北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208 室

办公地址：北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208-1209 室

法定代表人：罗细安

客服电话：400-001-8811

联系人：孙晋峰

电话：010-67000988

传真：010-67000988-6000

公司网址：[www.zcvc.com.cn](http://www.zcvc.com.cn)

4. 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

法定代表人：闫振杰

客服电话：400 888 6661

联系人：张晶晶

电话：010-62020088-8105

传真：010-62020088-8802

地址：[www.myfund.com](http://www.myfund.com)

5. 财富证券有限责任公司

注册地址：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 楼

法定代表人：周晖

联系人：郭磊

联系电话：0731-84403319

传真：0731-84403439

网址：[www.cfzq.com](http://www.cfzq.com)

6. 大泰金石基金销售有限公司

注册地址：南京市建邺区江东中路 359 号国睿大厦一号楼 B 区 4 楼 A506 室

办公地址：（上海）上海市长宁区虹桥路 1386 号文广大厦 15 楼

法定代表人：袁顾明

客服电话：021-22267995

---

联系人：何庭宇  
电话：021-22267987  
传真：021-22268089  
网址：www.dtfunds.com

7. 东莞农村商业银行股份有限公司

注册地址：东莞市南城路2号  
办公地址：东莞市南城路2号  
法定代表人：何沛良  
客服电话：0769-961122  
联系人：谭少筠  
电话：0769-22118343  
传真：0769-22320896  
网址：www.drcbank.com

8. 深圳富济财富管理有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室  
办公地址：深圳市南山区高新南七道12号惠恒集团二期418室  
法定代表人：齐小贺  
客服电话：0755-83999913  
联系人：陈勇军  
电话：0755-83999906  
传真：0755-83999926  
网址：www.jinqianwo.cn

9. 中国光大银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心  
法定代表人：李晓鹏  
客服电话：95595  
联系人：朱红  
网址：www.cebbank.com

10. 光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路1508号  
办公地址：上海市静安区新闻路1508号

---

法定代表人：薛峰  
电话：021-22169999  
传真：021-22169134  
客服电话：4008888788、10108998、95525  
联系人：刘晨、李芳芳  
网址：www.ebscn.com

11. 广发证券股份有限公司  
注册地址：广州天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼（4301-4316 房）

办公地址：广东省广州天河北路大都会广场 5、18、19、36、38、41 和 42 楼

法定代表人：林治海  
联系人：黄岚  
客服电话：95575 或致电各地营业网点  
传真：（020）87555305  
网站：www.gf.com.cn

12. 广州证券股份有限公司  
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：邱三发  
客服电话：020-961303  
联系人：梁微  
电话：020-88836999-5408  
传真：020-88836920  
网址：www.gzs.com.cn

13. 国金证券股份有限公司  
注册地址：四川省成都市青羊区东城根上街 95 号  
办公地址：四川省成都市青羊区东城根上街 95 号  
法定代表人：冉云  
客服电话：4006600109

---

联系人：贾鹏  
电话：028-86690058  
传真：028-86690126  
网址：www.gjzq.com.cn

14. 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 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：杨德红  
联系人：芮敏祺  
联系电话：021-38676666  
客服电话：95521  
网址：www.gtja.com

15. 国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层  
办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层  
法定代表人：何如  
电话：0755-82130833  
传真：0755-82133952  
联系人：齐晓燕  
客服电话：95536  
网址：www.guosen.com.cn

16. 海银基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区东方路 1217 号 16 楼 B 单元  
办公地址：上海市浦东新区东方路 1217 号陆家嘴金融服务广场 6 楼  
法定代表人：刘惠  
联系人：毛林  
传真：021-80133413  
电话：021-80133597  
客户服务电话：400-808-1016  
公司网站：www.fundhaiyin.com

17. 蚂蚁（杭州）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：周熾旻  
电话：021-60897869、0571-28829790  
传真：0571-26698533  
客服电话：4000-766-123  
网址：www.fund123.cn

18. 和讯信息科技有限公司

注册地址：北京市朝阳区大街 22 号泛利大厦 10 层  
办公地址：北京市朝阳区大街 22 号泛利大厦 10 层  
法定代表人：王莉  
客服电话：400-920-0022  
联系人：周轶  
电话：021-20835789  
传真：021-20835885  
网址：licaik.hexun.com

19. 华泰证券股份有限公司

注册地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦  
办公地址：深圳市深南大道 4011 号港中旅大厦 24 层  
法定代表人：吴万善  
电话：0755-82569143  
传真：0755-82492962  
联系人：孔晓君  
客服电话：95597  
网址：www.htsc.com.cn

20. 上海汇付金融服务有限公司

注册地址：上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼  
办公地址：上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼  
法定代表人：冯修敏  
客服电话：400-820-2819  
联系人：陈云卉

---

电话：021-33323999\*5611

传真：021-33323837

21. 北京虹点基金销售有限公司（原乐融多源）

注册地址：北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙房2层222单元

办公地址：北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙房2层222单元

法定代表人：郑毓栋

客服电话：400-618-0707

联系人：姜颖

电话：13522549431

传真：010-65951887

网址：[www.hongdianfund.com](http://www.hongdianfund.com)

22. 中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

法定代表人：王洪章

客服电话：95533

联系人：王嘉朔

网址：[www.ccb.com](http://www.ccb.com)

23. 晋商银行股份有限公司

注册地址：山西省太原市万柏林区长风西街1号丽华大厦

办公地址：山西省太原市万柏林区长风西街1号丽华大厦

法定代表：阎俊生

客服电话：95105588

联系人：董嘉文

电话：0351-6819926

传真：0351-6819926

网址：[www.jshbank.com](http://www.jshbank.com)

24. 上海凯石财富基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区西藏南路765号602-115室

办公地址：上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦4楼

法定代表人：陈继武



---

客服电话：4000-178-000  
联系人：李晓明  
电话：021-63333319  
传真：021-63332523  
网址：www.lingxianfund.com

25. 联讯证券股份有限公司

注册地址：广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼

办公地址：广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼

法定代表人：徐刚  
客服电话：95564  
联系人：彭莲  
电话：13480169928  
传真：0572-2119391  
公司网址：<http://www.lxsec.com>

26. 上海陆金所基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1333号14楼09单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号

法定代表人：王之光  
客服电话：4008219031  
联系人：宁博宇  
电话：021-20665952  
传真：021-22066653  
网址：[www.lufunds.com](http://www.lufunds.com)

27. 诺亚正行基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室

办公地址：上海市杨浦区秦皇岛路32号c栋

法人代表：汪静波  
客服电话：400-821-5399  
联系人：曾传溢  
联系电话：15521232169

---

网址: [www.noah-fund.com](http://www.noah-fund.com)

28. 平安银行股份有限公司

注册地址: 深圳市深南中路 1099 号平安银行大厦

法定代表人: 孙建一

客服电话: 95511-3

网址: [www.pingan.com](http://www.pingan.com)

29. 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

法定代表人: 杨宇翔

联系人: 郑舒丽

电话: (0755) 22626172

传真: (0755) 82400862

客服电话: 95511-8

网址: [www.pingan.com](http://www.pingan.com)

30. 中泰证券股份有限公司

注册地址: 济南市市中区经七路 86 号

法定代表人: 李玮

客服电话: 95538

网站: [www.qlzq.com.cn](http://www.qlzq.com.cn)

31. 北京钱景财富投资管理有限公司

注册地址: 北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012

办公地址: 北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012

法定代表人: 赵荣春

客服电话: 400-678-5095

联系人: 魏争

电话: 010-57418829

传真: 010-57569671

公司网址: [www.niuji.net](http://www.niuji.net)

32. 山西证券股份有限公司

地址: 山西省太原市府西街 69 号山西国贸中心东塔楼

---

法定代表人：侯巍  
电话：(0351) 8686659  
传真：(0351) 8686619  
客服电话：400-666-1618  
联系人：郭熠  
网址：www.i618.com.cn

33. 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：沈雯斌  
联系电话：021-58788678-8201  
传真：021-58787698  
客服电话：400-089-1289  
公司网站：www.erichfund.com

34. 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  
法定代表人：杨文斌  
客服电话：400-700-9665  
联系人：张茹  
电话：021-58870011  
传真：021-68596919  
网址：www.ehowbuy.com

35. 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 号中达广场 201 室  
法定代表人：盛大  
客服电话：400-005-6355  
联系人：程毅  
电话：021-50583533  
传真：021-50583633

---

网址: [www.leadfund.com.cn](http://www.leadfund.com.cn)

36. 上海联泰资产管理有限公司

注册地址: 上海市自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室

办公地址: 上海市金钟路 658 号 2 号楼 B 座 6 层

法定代表人: 燕斌

客服电话: 021-51507071

联系人: 凌秋艳

电话: 021-51507071

传真: 021-62990063

公司网址: [www.66zichan.com](http://www.66zichan.com)

37. 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

办公地址: 上海市徐汇区宛平南路 88 号东方财富大厦

法定代表人: 其实

客服电话: 400-1818-188

联系人: 潘世友

电话: 021-54509988

分机 7019

传真: 021-64385308

网址: [www.1234567.com.cn](http://www.1234567.com.cn)

38. 上海农村商业银行股份有限公司

注册地址: 上海市浦东新区浦东大道 981 号

办公地址: 上海市浦东新区银城中路 8 号中融碧玉蓝天大厦 15-23 层

法定代表人: 胡平西

客服电话: 021-962999

联系人: 吴海平

电话: 021-38576969

网址: [www.srcb.com](http://www.srcb.com)

39. 上海银行股份有限公司

注册地址: 上海市浦东新区银城中路 168 号

办公地址: 上海市浦东新区银城中路 168 号

---

法定代表人：范一飞  
电话：021-68475888  
传真：021-68476111  
联系人：张萍  
客服电话：021-962888  
网址：www.bankofshanghai.com

40. 上海证券有限责任公司  
注册地址：上海市西藏中路 336 号  
法定代表人：郁忠民  
联系电话：021-51539888  
联系人：张瑾  
公司网址：www.962518.com  
客服电话：021-962518、4008918918（全国）

41. 申万宏源证券有限公司  
注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层  
办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层  
法定代表人：李梅  
联系人：黄莹  
电话：021-33388211  
传真：021-33388224  
客服热线：95523 或 4008895523  
网址：www.swhysc.com

42. 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司  
注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006#  
办公地址：深圳市福田区福田街道民田路 178 号华融大厦 27 层 2704  
法定代表人：杨懿  
客服电话：400-166-1188  
联系人：刘宝文  
电话：0755-88394688  
公司网址：www.xinlande.com.cn

43. 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  
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  
法定代表人：薛峰  
客服电话：4006-788-887  
联系人：汤素娅  
电话：0755-33227950  
传真：0755-82080798  
网址：www.zlfund.cn 及 www.jjmmw.com

44. 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  
法定代表人：林义相  
客服电话：010-66045678  
网站：www.txsec.com 或 www.jjm.com.cn

45. 万银财富（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号盘古大观 3201  
办公地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号盘古大观 3201  
法定代表人：李招弟  
客服电话：400-808-0069  
联系人：高晓芳  
电话：010-59393923  
传真：010-59393074

46. 信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区三里河东路 5 号中商大厦 10 层  
办公地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼信达金融中心  
法定代表人：张志刚  
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

47. 兴业证券股份有限公司

---

注册地址：福州市湖东路 99 号标力大厦

法定代表人：兰荣

电话：(021) 38565783

客服电话：400-8888-123

联系人：谢高得

网址： [www.xyzq.com.cn](http://www.xyzq.com.cn)

48. 一路财富（北京）信息科技有限公司

注册地址：北京市西城区车公庄大街 9 号院 5 号楼 702（德胜园区）

办公地址：北京市西城区阜成门大街 2 号万通新世界广场 A 座 2208

法定代表人：吴雪秀

客服电话：400-001-1566

联系人：卜石红

电话：010-88312877

传真：010-88312885

公司网址：[www.yilucaifu.com](http://www.yilucaifu.com)

49. 阳光人寿保险股份有限公司

注册地址：海南省三亚市河东区三亚河东路海康商务 12、13 层

办公地址：北京市朝阳区朝外大街乙 12 号 1 号楼昆泰国际大厦 12 层

法定代表人：李科

联系人：高晓芳

传真：010-59053700

电话：010-59053566

客户服务电话：95510

公司网站：[fund.sinosig.com](http://fund.sinosig.com)

50. 宜信普泽投资顾问（北京）有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809

办公地址：北京市朝阳区建国路 88 号 SOHO 现代城 C 座 1809 室

法定代表人：沈伟桦

客服电话：400-6099-200

联系人：宋欣晔

电话：010-52361860

传真 010-85894285

---

公司网址： [www.yixinfund.com](http://www.yixinfund.com)

51. 珠海盈米财富管理有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼

B1201-1203

法定代表人：肖雯

客服电话：020-89629066

联系人：黄敏嫦

电话：020-89629099

传真：020-89629011

网址：[www.yingmi.cn](http://www.yingmi.cn)

52. 中国邮政储蓄银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融街 3 号

办公地址：北京市西城区金融街 3 号

法定代表人：李国华

客户服务电话：95580

联系人：陈春林

传真：010-68858117

公司网址：[www.psbc.com](http://www.psbc.com)

53. 招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行股份有限公司大厦

法定代表人：李建红

客服电话：95555

联系人：邓炯鹏

电话：0755-83198888

传真：0755-83195109

网址：[www.cmbchina.com](http://www.cmbchina.com)

54. 招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

法定代表人：宫少林

电话：0755-82960223



---

传真：0755-82943100  
客服电话：95565、4008888111  
联系人：林生迎  
网址：www.newone.com.cn

55. 浙江金观诚财富管理有限公司  
注册地址：浙江省杭州市拱墅区登云路 45 号（锦昌大厦）1 幢 10 单元 1001 室

办公地址：浙江省杭州市拱墅区登云路 55 号（锦昌大厦）1 号楼 1 楼金观诚财富大厅

法定代表人：徐黎云  
客服电话：400-068-0058  
联系人：来舒岚  
电话：0571-88337888  
传真：0571-88337666

56. 浙江同花顺基金销售有限公司  
注册地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903 室  
办公地址：浙江省杭州市余杭区五常街道同顺街 18 号同花顺大楼 4 层  
法定代表人：凌顺平  
联系电话：0571-88911818-8653  
传真：0571-86800423  
客服电话：4008-773-772  
公司网站：www.5ifund.com

57. 北京加和基金销售有限公司（原中经北证）  
注册地址：北京市西城区金融大街 11 号 703 室  
办公地址：北京市西城区金融大街 11 号 703 室  
法定代表人：曲阳  
联系人：王晨  
联系电话：13811685981 010-50866170  
传真电话：010-5086 6173  
客服电话：400-803-1188  
网址：www.bzfunds.com

---

58. 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：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：王常青

电话：(010) 85130588

传真：(010) 65182261

客服电话：400-8888-108

联系人：权唐

网址： [www.csc108.com](http://www.csc108.com)

59. 中信证券股份有限公司

注册地址：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：(0755) 83073087

传真：(0755) 83073104

联系人：陈忠

网址： [www.cs.ecitic.com](http://www.cs.ecitic.com)

60. 中信证券（浙江）有限责任公司

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

法定代表人：沈强

客服电话：(0571) 96598

传真：(0571) 85783771

联系人：丁思聪

网址： [www.bigsun.com.cn](http://www.bigsun.com.cn)

61. 中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼 20 层  
(266061)

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

法定代表人：杨宝林

电话：(0532) 85022326

传真：(0532) 85022605

联系人：吴忠超

网址： [www.citicssd.com](http://www.citicssd.com)

---

62. 和耕传承基金销售有限公司

注册地址：郑州市郑东新区东风东路、康宁北街 6 号楼 6 楼

办公地址：郑州市郑东新区东风东路、康宁北街 6 号楼 6 楼

法定代表人：李淑慧

客服电话：4000-555-671

联系人：胡静华

网址：www.hgccpb.com

63. 南京苏宁基金销售有限公司

注册地址：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

办公地址：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

法定代表：钱燕飞

联系人：喻明明

传真：025-66008800-884131

电话：025-66996699-884131

客服电话：95177

网址：www.snjijin.com

64. 上海万得基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

办公地址：上海市浦东新区浦明路 1500 号万得大厦 11 楼

法定代表人：王廷富

联系人：徐亚丹

传真：021-5071-0161

电话：021-5071-2782

客服电话：400-821-0203

65. 北京肯特瑞财富投资管理有限公司

注册地址：北京市海淀区海淀东三街 2 号 4 层 401-15

办公地址：北京市亦庄经济开发区科创十一街 18 号院 A 座 17 层。

法定代表人：陈超

联系人：江卉

传真：89188000

电话：13141319110

---

客户服务电话：400 098 8511

网址：[list.jr.jd.com/fundlist/1-11-112.htm](http://list.jr.jd.com/fundlist/1-11-112.htm)

66. 东北证券股份有限公司

注册地址：长春市生态大街 6666 号

办公地址：吉林省长春市生态大街 6666 号

法定代表人：李福春

联系人：安岩岩

联系电话：0431-85096517

客服电话：95360

公司网址：[www.nesc.cn](http://www.nesc.cn)

67. 东兴证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 12-15 层

办公地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 12-15 层

法定代表人：魏庆华

联系人：汤漫川

电话：010-66555316

传真：010-66555133

客服电话：4008888993

网址：[www.dxzq.net](http://www.dxzq.net)

68. 上海基煜基金销售有限公司

注册地址：上海市崇明县长兴镇路潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室（上海泰和经济发展区）

办公地址：上海市杨浦区昆明路 518 号 A1002 室

法定代表人：王翔

联系人：蓝杰

电话：021-65370077

传真：021-55085991

客户服务电话：4008-205-369

网址：[www.jiyufund.com.cn](http://www.jiyufund.com.cn)

69. 江苏汇林保大基金销售有限公司

注册地址：南京市高淳区砖墙集镇 78 号

---

办公地址：江苏省南京市中山东路9号天时国际商贸大厦11楼E座

法定代表人：吴言林

客户服务电话：025-56663409

联系人：张宏鹤

传真：021-53086809

公司网址：www.huilinbd.com

70. 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

办公地址：北京市西城区复兴门内大街55号

法定代表人：姜建清

客服电话：95588

网址：www.icbc.com.cn

71. 北京汇成基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村大街11号11层A座1108号

办公地址：北京市海淀区中关村大街11号11层A座1108号

法定代表人：王伟刚

客服电话：400-619-9059

联系人：熊小满

电话：010-56251471

分机：无分机

传真：010-62680827

网址：www.hcjijin.com

### （三）登记机构

名称：光大保德信基金管理有限公司

注册地址：上海市黄浦区中山东二路558号外滩金融中心1幢，6层至10层

办公地址：上海市黄浦区中山东二路558号外滩金融中心1幢（北区3号楼），6层至10层

法定代表人：林昌

电话：（021）80262888

传真：（021）80262483

联系人：杨静

---

#### **（四）律师事务所和经办律师**

名称：上海源泰律师事务所

注册地址：上海浦东南路 256 号华夏银行大厦 1405 室

办公地址：上海浦东南路 256 号华夏银行大厦 1405 室

负责人：廖海

电话：（021）51150298

传真：（021）51150398

联系人：刘佳

经办律师：廖海、刘佳

#### **（五）会计师事务所和经办注册会计师**

公司全称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：中国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：中国上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

法定代表人：李丹

电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

联系人：周祎

经办会计师：薛竞、周祎

---

## 六、基金的募集

本基金募集期为 2015 年 3 月 2 日至 2015 年 3 月 20 日，本次募集的最终有效确认净认购金额为 2,909,225,581.65 元人民币，认购款项在基金验资确认日之前产生的银行利息共计 989,166.01 元人民币。本次募集有效认购户数为 36,014 户，按照每份基金份额面值 1.00 元人民币计算，本次募集资金及其产生的利息折算成基金份额共计 2,910,214,747.66 份基金份额，已全部计入投资者基金账户，归投资者所有。

---

## 七、基金合同的生效

根据有关规定,本基金满足基金合同生效条件,基金合同于 2015 年 3 月 25 日正式生效。自基金合同生效日起,本基金管理人正式开始管理本基金。



---

## 八、基金份额的申购与赎回

### （一）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。具体的销售机构见本招募说明书第五部分或其他相关公告。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并予以公告。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基金份额的申购与赎回。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。

### （二）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基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

基金合同生效后，若出现新的证券或期货交易市场、证券或期货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介上公告。

#### 2. 申购、赎回开始日及业务办理时间

基金管理人自基金合同生效之日起不超过 3 个月开始办理申购，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。

基金管理人自基金合同生效之日起不超过 3 个月开始办理赎回，具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。

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介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、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、赎回或转换价格为下一开放日基金份额申购、赎回或转换的价格。

---

### （三）申购与赎回的数额限制

- 1、代销网点每个账户每次申购的最低金额为人民币 1,000 元；
- 2、直销网点每个账户每次申购的最低金额为人民币 1 元；
- 3、本基金对单个基金份额持有人持有基金份额的比例或数量不设限制，法律另有规定的除外；
- 4、赎回的最低份额为 100 份基金份额，基金份额持有人可将其全部或部分基金份额赎回，但某笔赎回导致单个交易账户的基金份额余额少于 100 份时，余额部分基金份额将由登记机构发起强制赎回；
- 5、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。具体见基金管理人相关公告；
- 6、基金管理人可根据市场情况，调整申购金额和赎回份额的数量限制，基金管理人必须最迟在调整前依照《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。

### （四）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、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；
- 5、办理申购、赎回业务时，应当遵循基金份额持有人利益优先原则。

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介上公告。

### （五）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，若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成立。投资人交付申购款项，申购成立；基金份额登记机构确认基金份额时，申购生效。

基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；登记机构确认赎回时，赎回生效。投资人赎回生效后，基金管理人将在 T+7 日(包括该日)内将赎回款项划往基金份额持有人账户。遇证券、期货交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其它非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程时，赎回款项顺延至上述情形消除后的下一个工作日划出。在发生巨额赎回或基金合同载明的其他暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付办法参照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。若申购不成功或无效，则申购款项本金退还给投资人。基金销售机构对申购、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申购、赎回申请。申购、赎回的确认以登记机构的确认结果为准。对于申购、赎回申请的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利。

## (六) 申购和赎回的费用

1、本基金的申购费率见下表：

通过直销机构申购本基金份额的养老金客户申购费率见下表：

| 申购金额（含申购费）              | 申购费率  |
|-------------------------|-------|
| 50 万元以下                 | 0.15% |
| 50 万元（含 50 万元）到 100 万元  | 0.12% |
| 100 万元（含 100 万元）到 500 万 | 0.08% |

|                    |             |
|--------------------|-------------|
| 元                  |             |
| 500 万元以上（含 500 万元） | 每笔交易 1000 元 |

其他投资者申购本基金基金份额申购费率见下表：

| 申购金额（含申购费）               | 申购费率        |
|--------------------------|-------------|
| 50 万元以下                  | 1.50%       |
| 50 万元（含 50 万元）到 100 万元   | 1.20%       |
| 100 万元（含 100 万元）到 500 万元 | 0.80%       |
| 500 万元以上（含 500 万元）       | 每笔交易 1000 元 |

2、本基金的赎回费率见下表

| 持续持有期             | 赎回费率  |
|-------------------|-------|
| 7 天以内             | 1.5%  |
| 7 天（含 7 天）到 30 天  | 0.75% |
| 30 天（含 30 天）到 1 年 | 0.5%  |
| 1 年（含 1 年）到 2 年   | 0.2%  |
| 2 年以上（含 2 年）      | 0     |

注：赎回费的计算中 1 年指 365 个公历日。

3、对持续持有期少于 30 日的投资人收取的赎回费全额计入基金财产；对持续持有期少于 3 个月的投资人收取的赎回费，将不低于赎回费总额的 75% 计入基金财产；对持续持有期长于 3 个月但少于 6 个月的投资人收取的赎回费，将不低于赎回费总额的 50% 计入基金财产；对持续持有期长于 6 个月的投资人收取的赎回费，将不低于赎回费总额的 25% 计入基金财产，未计入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。

4、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，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。

## （七）申购与赎回的数额和价格

1、申购份额余额及赎回金额的处理方式

---

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，上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后2位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

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当日基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后2位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

## 2、基金申购份额的计算：

(1)基金的申购金额包括申购费用和净申购金额，计算公式如下：

1) 申购费用适用比例费率时，申购份数的计算方法如下：

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} / (1 + \text{申购费率})$$

$$\text{申购费用} = \text{申购金额} - \text{净申购金额}$$

$$\text{申购份数} = \text{净申购金额} / \text{申购当日基金份额净值}$$

2) 申购费用为固定金额时，申购份数的计算方法如下：

$$\text{申购费用} = \text{固定金额}$$

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} - \text{申购费用}$$

$$\text{申购份数} = \text{净申购金额} / \text{申购当日基金份额净值}$$

(2)基金份额按照四舍五入方法，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。

例2：某投资人（非养老金客户）在T日投资5000.00元申购本基金，对应费率为1.50%，申购当日的基金份额净值为1.20元，则其可得到的基金份额为：

$$\text{净申购金额} = 5,000 / (1 + 1.50\%) = 4,926.11 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 5,000 - 4,926.11 = 73.89 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 4,926.11 / 1.20 = 4,105.09 \text{ 份}$$

即投资人（非养老金客户）T日投资5,000元申购本基金，可得到4,105.09份基金份额。

例3：某投资人（养老金客户）在T日通过本管理人的直销中心投资5000.00元申购本基金，申购费率为0.15%。假设申购当日基金份额净值为1.10元，则其可得到的申购份额为：

$$\text{净申购金额} = 5000.00 / (1 + 0.15\%) = 4992.51 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 5000.00 - 4992.51 = 7.49 \text{ 元}$$

---

申购份数=4992.51 / 1.10=4538.65 份

即投资人（养老金客户）T日投资5,000元申购本基金,可得到4538.65份基金份额。

### 3、基金赎回金额的计算：

(1)基金的净赎回金额为赎回金额扣减赎回费用，计算公式如下：

赎回价格=申请日基金份额净值

赎回金额=赎回份额×赎回价格

赎回费用=赎回金额×赎回费率

净赎回金额=赎回金额-赎回费用

例4:假定某投资者在T日赎回10,000份本基金基金份额,持有期限10天,该日基金份额净值为1.150元,则其获得的赎回金额计算如下：

赎回金额=10,000×1.150=11,500.00元

赎回费用=11,500×0.75%=86.25元

净赎回金额=11,500-86.25=11,413.75元

### 4、基金份额净值的计算公式

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。基金份额净值计算公式为：

T日基金份额净值=T日基金资产净值/T日基金份额总数。

### （八）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。
- 3、证券、期货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，或基金管理人认定的其他损害现有基金份额持有人利益的情形。

6、基金管理人、基金托管人、基金销售机构或登记机构的异常情况导致基金销售系统、基金登记系统或基金会计系统无法正常运行。

7、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过 50%，或者变相规避 50%集中度的情形。

8、申请超过基金管理人设定的单笔申购的最高金额、单个投资人单日申购金额上限、本基金单日净申购比例上限、本基金总规模上限的。

9、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确认后，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。

10 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、9、10 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受基金投资者的申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的，被拒绝的申购款项本金将退还给投资人。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。

### **（九）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。

3、证券、期货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、继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时。

---

6、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确认后，基金管理人应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施。

7、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暂停接受基金份额持有人的赎回申请或延缓支付赎回款项时，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。

#### **(十) 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。部分延期赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

但若赎回申请人中存在当日申请赎回的份额超过前一工作日基金总份额 30% 的单个赎回申请人（“大额赎回申请人”）的情形下，基金管理人应当按照保护其他赎回申请人（“小额赎回申请人”）利益的原则，优先确认小额赎回申请人的赎回申请，具体为：如小额赎回申请人的赎回申请在当日被全部确认，则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，在仍可接受赎回申请的范围内对该等大额赎回申请人的赎回申请按比例确认，对大额赎回申请人未予确认的赎回申请延期办理。如小额赎回申请人的赎回申请在当日未被全部确认，则对全部未确认的赎回申请（含小额赎回申请人的其余赎回申请与大额赎回申请人的全部赎回申请）延期办理。延期办理的具体程序，按照本条规定的延期赎回或取消赎回的方式办理。基金管理人应当对延期办理事宜在指定媒介上刊登公告。

（3）暂停赎回：连续 2 个开放日以上（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，并应当在指定媒介上进行公告。

### 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 个工作日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在指定媒介上刊登公告。

## （十一）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，并在规定期限内指定媒介上刊登暂停公告。

2、如发生暂停的时间为 1 日，基金管理人应于重新开放日，在指定媒介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、若暂停时间超过 1 日，基金管理人可以根据暂停申购或赎回的时间，依照，《信息披露办法》的有关规定，最迟于重新开放申购或赎回日在指定媒介上刊登重新开放申购或赎回的公告；也可以根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间，届时不再另行发布重新开放的公告。

---

## （十二）基金转换

### 1、基金转换业务适用投资者范围

已持有本公司管理的基金中任一只基金的投资者。

### 2、销售机构

投资者投资者可通过安信证券股份有限公司、北京增财基金销售有限公司、北京展恒基金销售有限公司、财富证券有限责任公司、大泰金石基金销售有限公司、东莞农村商业银行股份有限公司、深圳富济财富管理有限公司、中国光大银行股份有限公司、光大证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、广州证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、海银基金销售有限公司、蚂蚁（杭州）基金销售有限公司、和讯信息科技有限公司、华泰证券股份有限公司、上海汇付金融服务有限公司、北京虹点基金销售有限公司（原乐融多源）、中国建设银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、晋商银行股份有限公司、上海凯石财富基金销售有限公司、联讯证券股份有限公司、诺亚正行基金销售有限公司、平安银行股份有限公司、平安证券有限责任公司、中泰证券股份有限公司、北京钱景财富投资管理有限公司、山西证券股份有限公司、上海长量基金销售投资顾问有限公司、上海好买基金销售有限公司、上海利得基金销售有限公司、上海联泰资产管理有限公司、上海天天基金销售有限公司、上海农村商业银行股份有限公司、上海银行股份有限公司、上海证券有限责任公司、申万宏源证券有限公司、深圳市新兰德证券投资咨询有限公司、深圳众禄基金销售有限公司、天相投资顾问有限公司、万银财富（北京）基金销售有限公司、信达证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、一路财富（北京）信息科技有限公司、阳光人寿保险股份有限公司、宜信普泽投资顾问（北京）有限公司、珠海盈米财富管理有限公司、中国邮政储蓄银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、招商证券股份有限公司、浙江金观诚财富管理有限公司、浙江同花顺基金销售有限公司、北京加和基金销售有限公司（原中经北证）、中信建投证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中信证券（浙江）有限责任公司、中信证券（山东）有限责任公司、平安证券有限责任公司、和耕传承基金销售有限公司、南京苏宁基金销售有限公司、上海万得基金销售有限公司、北京肯特瑞财富投资管理有限公司、东北证券股份有限公司、东兴证券股份有限公司、

---

上海基煜基金销售有限公司、中国工商银行股份有限公司、北京汇成基金销售有限公司相关营业网点办理光大保德信国企改革股票型证券投资基金的转换业务。

根据业务需要，本基金管理人还将会选择其他销售机构开办此业务并将按有关规定予以公告。

### 3、 基金转换办理时间

投资者可在基金开放日申请办理基金转换业务，具体办理时间与基金申购、赎回业务办理时间相同。

### 4、 基金转换费率

基金转换费用由转出和转入基金的申购费补差和转出基金的赎回费两部分构成，具体收取情况视每次转换时两只基金的申购费率和赎回费率的差异情况而定。基金转换费用由申请办理该项业务的基金投资者承担。具体公式如下：

(1). 转出金额：

转出金额=转出基金份额×转出基金当日基金单位资产净值

(2). 转换费用：

如果转入基金的申购费率≥转出基金的申购费率：

转换费用=转出金额×转出基金赎回费率+转出金额×(1-转出基金赎回费率)×转出基金与转入基金的申购费率差/(1+转出基金与转入基金的申购费率差)

如果转出基金的申购费率<转入基金的申购费率：

转换费用=转出金额×转出基金赎回费率

各基金在转换过程中转出金额对应的转出基金或转入基金申购费用为固定费用时，则该基金计算补差费率时的转出基金的原申购费率或转入基金申购费率视为0；

基金在完成转换后不连续计算持有期；

转出基金与转入基金的申购费率差为基金转换当日转出金额对应得转出基金和转入基金的申购费率之差。

具体赎回费率以及各基金申购费率差请参照相应的基金合同或相关公告。

(3). 转入金额与转入份额：

转入金额=转出金额-转换费用

转入份额=转入金额÷转入基金当日基金单位资产净值

---

## 5、 基金转换规则

基金转换只能在同一销售机构办理,且该销售机构须同时代理拟转出基金及拟转入基金的销售。

基金转换采取“未知价”法,即以申请受理当日各转出、转入基金的单位资产净值为基础进行计算。

基金转换遵循“份额转换”的原则,转换申请份额精确到小数点后两位,单笔转换申请份额不得低于100份,当单个交易账户的基金份额余额少于100份时,必须一次性申请转换。

基金转换费用由基金持有人承担。

## 6、 基金转换的注册登记

基金投资者提出的基金转换申请,在当日交易时间结束前可以撤销,交易时间结束后即不得撤销。

基金份额持有人提交基金转换交易申请后,基金注册登记机构在T+1工作日为基金份额持有人申请进行确认,确认成功后为基金持有人办理相关的注册登记手续。

本公司可在法律法规允许的范围内,对上述注册登记办理时间进行调整,并按规定予以公告。

## 7、 暂停基金转换的情形及处理

出现下列情况之一时,基金管理人可以暂停接受基金持有人的基金转换申请:  
不可抗力的原因导致基金无法正常工作;

证券交易场所在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;

因市场剧烈波动或其它原因而出现连续巨额赎回,基金管理人认为有必要暂停接受该基金份额的转出申请;

法律、法规、规章规定的其他情形或其他在基金合同、招募说明书已载明并获中国证监会批准的特殊情形。

发生上述情形之一的,基金管理人应立即向中国证监会备案并于规定期限内至少在一种中国证监会指定媒介上刊登暂停公告。重新开放基金转换时,基金管理人应按规定予以公告。

---

### （十三）基金份额的转让

在法律法规允许且条件具备的情况下，基金管理人可受理基金份额持有人通过中国证监会认可的交易场所或者交易方式进行份额转让的申请并由登记机构办理基金份额的过户登记。基金管理人拟受理基金份额转让业务的，将提前公告，基金份额持有人应根据基金管理人公告的业务规则办理基金份额转让业务。

### （十四）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。

### （十五）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。

### （十六）定期定额投资计划

#### 1、定期定额申购业务适用投资者范围

符合本基金基金合同规定的所有个人投资者和机构投资者。

#### 2、办理时间

定期定额申购业务的办理时间同基金日常交易时间。

#### 3、销售机构

投资者可通过安信证券股份有限公司、北京增财基金销售有限公司、北京展恒基金销售有限公司、财富证券有限责任公司、大泰金石基金销售有限公司、东

---

莞农村商业银行股份有限公司、深圳富济财富管理有限公司、中国光大银行股份有限公司、光大证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、广州证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、海银基金销售有限公司、蚂蚁（杭州）基金销售有限公司、和讯信息科技有限公司、华泰证券股份有限公司、上海汇付金融服务有限公司、北京虹点基金销售有限公司（原乐融多源）、中国建设银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、晋商银行股份有限公司、上海凯石财富基金销售有限公司、联讯证券股份有限公司、诺亚正行基金销售有限公司、平安银行股份有限公司、平安证券有限责任公司、中泰证券股份有限公司、北京钱景财富投资管理有限公司、山西证券股份有限公司、上海长量基金销售投资顾问有限公司、上海好买基金销售有限公司、上海利得基金销售有限公司、上海联泰资产管理有限公司、上海天天基金销售有限公司、上海农村商业银行股份有限公司、上海银行股份有限公司、上海证券有限责任公司、申万宏源证券有限公司、深圳市新兰德证券投资咨询有限公司、深圳众禄基金销售有限公司、天相投资顾问有限公司、万银财富（北京）基金销售有限公司、信达证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、一路财富（北京）信息科技有限公司、阳光人寿保险股份有限公司、宜信普泽投资顾问（北京）有限公司、珠海盈米财富管理有限公司、中国邮政储蓄银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、招商证券股份有限公司、浙江金观诚财富管理有限公司、浙江同花顺基金销售有限公司、北京加和基金销售有限公司（原中经北证）、中信建投证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中信证券（浙江）有限责任公司、中信证券（山东）有限责任公司、上海陆金所基金销售有限公司、和耕传承基金销售有限公司、上海万得基金销售有限公司、平安证券有限责任公司、东北证券股份有限公司、中国工商银行股份有限公司、北京汇成基金销售有限公司办理本基金的定期定额申购业务。

根据业务需要，本基金管理人还将会选择其他销售机构开办此业务并将按有关规定予以公告。

#### **4、办理方式**

(1). 申请办理定期定额申购业务的投资者须拥有本公司开放式基金账户，具体开户程序请遵循销售机构的规定；

---

(2). 投资者开立基金账户后携带本人有效身份证件和有关凭证到销售机构申请办理上述基金的定期定额申购业务,具体办理程序请遵循销售机构的有关规定。

### **5、扣款金额**

光大保德信国企改革主题股票型证券投资基金投资者可与代销机构约定每月固定扣款金额,每月最低扣款金额及相关规定以各销售机构规定为准。光大保德信国企改革主题股票型证券投资基金投资者可与本公司网上直销交易平台约定每月固定扣款金额,每月扣款金额不得低于人民币1元(含1元),不设金额级差。

### **6、扣款日期**

- (1) 投资者应遵循销售机构的规定并与销售机构约定每月固定扣款日期;
- (2) 如果在约定的扣款日前投资者开办定期定额业务的申请得到成功确认,则首次扣款日为当月,否则为次月。

### **7、扣款方式**

- (1) 销售机构将按照投资者申请时所约定的每月固定扣款日和扣款金额进行自动扣款,若遇非基金开放日则顺延到下一基金开放日;
- (2) 投资者须指定一个销售机构认可的资金账户作为每月固定扣款账户;
- (3) 投资者账户余额不足则不扣款,请投资者于每月扣款日前在账户内按约定存足资金,以保证业务申请的成功受理。

### **8、申购费率**

本基金的定期定额申购费率及计费方式如无另行公告等同于一般的申购业务。

### **9、交易确认**

每月实际扣款日与基金申购申请日为同一日,以该日(T日)的基金单位资产净值为基准计算申购份额,申购份额将在T+1工作日确认成功后直接计入投资者的基金账户。投资者可自T+2工作日起查询定期定额申购成交情况。

### **10、变更与解约**

如果投资者想变更每月扣款金额和扣款日期,可提出变更申请;如果投资者想终止定期定额申购业务,可提出解除申请,具体办理程序请遵循相关销售机构的规定。

---

### **（十七）基金的冻结、解冻与质押**

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。基金账户或基金份额被冻结的，被冻结基金份额所产生的权益一并冻结，被冻结部分份额仍然参与收益分配，法律法规另有规定的除外。

如相关法律法规允许基金管理人办理基金份额的质押业务或其他基金业务，基金管理人将制定和实施相应的业务规则。



---

## 九、基金的投资

### （一）基金的投资

#### （一）投资目标

本基金将精选受益于国企改革的相关证券，在有效控制风险前提下，力求超越业绩比较基准的投资回报，争取实现基金资产的长期稳健增值。

#### （二）投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、固定收益类金融工具、货币市场工具、权证、股指期货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（但须符合中国证监会相关规定）。其中固定收益类金融工具包括国债、金融债、公司债、企业债、地方政府债、次级债、中小企业私募债券、可转换公司债券（含可分离交易可转债）、短期融资券、中期票据、资产支持证券、债券回购、央行票据、银行存款等。

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：股票资产占基金资产的比例为 80%-95%，其中投资于国企改革主题的上市公司股票的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%；其中，基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金以后，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。前述现金资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或中国证监会变更上述投资品种的比例限制，以变更后的比例为准，本基金的投资比例会做相应调整。

#### （三）投资策略

##### 1、资产配置策略

本基金将通过对宏观经济基本面及证券市场双层面的数据进行研究，并通过定性定量分析、风险测算及组合优化，最终形成大类资产配置决策。

首先，建立宏观指标监测体系。

本基金将严密跟踪分析反映宏观经济及证券市场运行的指标，以求把握整个宏观经济形势的未来走向和节奏，进而为本基金的资产配置决策提供支持。

具体来说，宏观经济运行指标主要包括：

（1）宏观经济先行指标，如狭义货币供应量（M1）、广义货币供应量（M2）、财政预算、制造业采购经理指数（PMI）、大宗商品库存及价格变化等；

---

(2) 宏观经济状态指标，如 GDP、CPI、PPI、规模以上工业企业增加值及利润和失业率等。

证券市场指标主要包括：

(1) 股票市场：估值水平及历史估值波动区间、资金供求状况、成交量及换手率等、投资者结构数据及其变化等；

(2) 债券市场：债券收益率水平、收益率曲线历史变动、流动性和资金供求状况等。

其次，对上述数据与大类资产收益率数据进行分析研究，把握其联系及规律。

在确立上述宏观经济指标和证券市场指标对各类资产预期收益率的影响模式后，再结合对上述宏观指标的分析预测，最终确定各大类资产的配置比例。

## 2、股票投资策略

本基金认为当前受益于国企改革的上市公司股票涉及多个行业，本基金将通过自下而上研究入库的方式，对各个行业中受益于国企改革主题的上市公司进行深入研究，并将这些股票组成本基金的核心股票库。对国企改革主题的上市公司界定如下：

I、受益于制度改革的国有企业，包括通过国资监管体制改革、产权制度改革（如兼并重组、整合上市、混合所有制改革等）以及国企管理制度改革（如经营机制、激励机制改革等）等多种方式，提高运营效率和竞争力的国有上市公司；

II、通过国企改革，一些行业的垄断格局被打破，因此激发出更多活力的部分民营上市公司。

未来若出现其他受益于国企改革进程的上市公司，本基金也应在深入研究的基础上，将其列入核心股票库。本基金将在核心股票库的基础上，以定性和定量相结合的方式、从价值和成长等因素对个股进行选择，精选估值合理且成长性良好的上市公司进行投资。

### (1) 定量分析

本基金结合盈利增长指标、现金流量指标、负债比率指标、估值指标、盈利质量指标等与上市公司经营有关的重要定量指标，对目标上市公司的价值进行深入研究，并对上市公司的盈利能力、财务质量和经营效率进行评析，为个股选择提供依据。

### (2) 定性分析

本基金认为股票价格的合理区间并非完全由其财务数据决定，还必须结合企业学习与创新能力、企业发展战略、技术专利优势、市场拓展能力、公司治理结构和管理水平、公司的行业地位、公司增长的可持续性 etc 等定性因素，给予股票一定的折溢价水平，并最终决定股票合理的价格区间。根据上述定性定量分析的结果，本基金进一步从价值和成长两个纬度对备选股票进行评估。对于价值被低估且成长性良好的股票，本基金将重点关注；对于价值被高估但成长性良好，或价

---

值被低估但成长性较差的股票，本基金将通过升入的调研和缜密的分析，有选择地进行投资；对于价值被高估且成长性较差的股票，本基金不予考虑投资。

### 3、固定收益类品种投资策略

本基金投资于固定收益类品种的目的是在保证基金资产流动性的基础上，使基金资产得到更加合理有效的利用，从而提高投资组合收益。为此，本基金固定收益类资产的投资将在限定的投资范围内，根据国家货币政策和财政政策实施情况、市场收益率曲线变动情况、市场流动性情况来预测债券市场整体利率趋势，同时结合各具体品种的供需情况、流动性、信用状况和利率敏感度等因素进行综合分析，在严格控制风险的前提下，构建和调整债券投资组合。在确定固定收益投资组合的具体品种时，本基金将根据市场对于个券的市场成交情况，对各个目标投资对象进行利差分析，包括信用利差，流动性利差，期权调整利差（OAS），并利用利率模型对利率进行模拟预测，选出定价合理或被低估，到期期限符合组合构建要求的固定收益品种。

### 4、股指期货投资策略

本基金将在风险可控的前提下，以套期保值为目的，根据对现货和期货市场的分析，充分考虑股指期货的风险收益特征，通过多头或空头的套期保值策略，以改善投资组合的投资效果，实现股票组合的超额收益。

### 5、中小企业私募债

与传统的信用债相比，中小企业私募债券采取非公开方式发行和交易，整体流动性相对较差，而且受到发债主体资产规模较小、经营波动性较高、信用基本面稳定性较差的影响，整体的信用风险相对较高。因此，对于中小企业私募债券的投资应采取更为谨慎的投资策略。本基金认为，投资该类债券的核心要点是对个券信用资质进行详尽的分析，并综合考虑发行人的企业性质、所处行业、资产负债状况、盈利能力、现金流、经营稳定性等关键因素，确定最终的投资决策。

### 6、权证及其他品种投资策略

本基金在权证投资中将对权证标的证券的基本面进行研究，结合期权定价量化模型估算权证价值，主要考虑运用的策略有：价值挖掘策略、杠杆策略、双向权证策略、获利保护策略和套利策略等。

同时，法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，本基金若认为有助于基金进行风险管理和组合优化的，可依据法律法规的规定履行适当程序后，运用金融衍生产品进行投资风险管理。

## （四）投资限制

### 1. 组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

- 
- (1) 本基金股票资产占基金资产的比例范围为 80%-95%，其中投资于国企改革主题的上市公司股票的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%；
- (2) 每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金以后，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。前述现金资产不包括结算备付金、存出保证金、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) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；
- (6) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；
- (7) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；
- (8) 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%；
- (9) 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%；
- (10) 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%；
- (11) 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%；
- (12) 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；
- (13) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；
- (14) 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；
- (15) 基金总资产不得超过基金净资产的百分之一百四十；
- (16) 在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；
- (17) 在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

---

(18) 在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；

(19) 在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一个交易日基金资产净值的 20%；

(20) 基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关规定；

(21) 本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；

(22) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合本款所规定比例限制的，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(23) 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；

(24) 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。

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，除第(2)、(12)、(22)、(23)项外，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但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。期间，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，不需要经基金份额持有人大会审议。

## 2. 禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 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) 向其基金管理人、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、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

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重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合本基金的投资目标和投资策略，遵循持有人利益优先原则，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。

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。

#### (五) 业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：中证国有企业改革指数×80% +中证全债指数×20%。

本基金主要投资于国企改革主题的上市公司股票，中证国有企业改革指数能有效反映国企的投资价值，对国企改革主题的股票具有较强的代表性，适合作为本基金股票部分的业绩比较基准。固定收益部分的业绩比较基准则中证全债指数，该指数是中证指数公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数。基于本基金的投资范围和投资比例限制，选用上述业绩比较基准能够较好的反映本基金的风险收益特征。

如果上述基准指数停止计算编制或更改名称，或者今后法律法规发生变化，又或者市场推出更具权威、且更能够表征本基金风险收益特征的指数，则本基金管理人将视情况经与本基金托管人协商同意后，基金管理人可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告，但不需要召开基金份额持有人大会。

#### (六) 风险收益特征

本基金为股票型基金，其预期收益和风险高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

#### (七) 基金管理人代表基金行使相关权利的处理原则及方法

- 1、有利于基金资产的安全与增值；
- 2、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使相关权利，保护基金份额持有人的利益；
- 3、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

## （八）基金的融资融券

本基金可以根据届时有效的有关法律法规和政策的规定进行融资融券。

## （二）基金投资组合报告

本投资组合报告所载数据截止 2018 年 6 月 30 日。

### 1、报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额（元）            | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|------------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 1,048,479,383.39 | 88.87        |
|    | 其中：股票             | 1,048,479,383.39 | 88.87        |
| 2  | 固定收益投资            | -                | -            |
|    | 其中：债券             | -                | -            |
|    | 资产支持证券            | -                | -            |
| 3  | 贵金属投资             | -                | -            |
| 4  | 金融衍生品投资           | -                | -            |
| 5  | 买入返售金融资产          | -                | -            |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -                | -            |
| 6  | 银行存款和结算备付金合计      | 129,365,495.75   | 10.97        |
| 7  | 其他各项资产            | 1,946,021.85     | 0.16         |
| 8  | 合计                | 1,179,790,900.99 | 100.00       |

### 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）        | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|----------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | 23,235,000.00  | 2.03         |
| B  | 采矿业              | 69,980,000.00  | 6.12         |
| C  | 制造业              | 529,522,727.40 | 46.28        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 6,941,559.85   | 0.61         |
| E  | 建筑业              | -              | -            |
| F  | 批发和零售业           | 11,305,059.00  | 0.99         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 68,443,000.00  | 5.98         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -              | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | -              | -            |
| J  | 金融业              | 136,862,000.00 | 11.96        |
| K  | 房地产业             | 156,300,811.00 | 13.66        |

|   |               |                  |       |
|---|---------------|------------------|-------|
| L | 租赁和商务服务业      | 17,108,000.00    | 1.50  |
| M | 科学研究和技术服务业    | 28,700,000.00    | 2.51  |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 81,226.14        | 0.01  |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | -                | -     |
| P | 教育            | -                | -     |
| Q | 卫生和社会工作       | -                | -     |
| R | 文化、体育和娱乐业     | -                | -     |
| S | 综合            | -                | -     |
|   | 合计            | 1,048,479,383.39 | 91.64 |

### 3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量(股)         | 公允价值(元)       | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------------|---------------|--------------|
| 1  | 600048 | 保利地产 | 6,000,000.00  | 73,200,000.00 | 6.40         |
| 2  | 600282 | 南钢股份 | 12,000,000.00 | 53,040,000.00 | 4.64         |
| 3  | 001979 | 招商蛇口 | 2,300,000.00  | 43,815,000.00 | 3.83         |
| 4  | 601288 | 农业银行 | 12,000,000.00 | 41,280,000.00 | 3.61         |
| 5  | 600466 | 蓝光发展 | 6,292,240.00  | 39,011,888.00 | 3.41         |
| 6  | 000651 | 格力电器 | 800,000.00    | 37,720,000.00 | 3.30         |
| 7  | 600519 | 贵州茅台 | 50,000.00     | 36,573,000.00 | 3.20         |
| 8  | 000538 | 云南白药 | 330,000.00    | 35,296,800.00 | 3.09         |
| 9  | 600036 | 招商银行 | 1,300,000.00  | 34,372,000.00 | 3.00         |
| 10 | 600029 | 南方航空 | 4,000,000.00  | 33,800,000.00 | 2.95         |

### 4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

### 5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

### 6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明



### 9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

## 10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 10.1 本期国债期货投资政策

根据本基金合同，本基金不能投资于国债期货。

### 10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 11、投资组合报告附注

11.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到证监会、证券交易所公开谴责、处罚的情况。

11.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 11.3 其他各项资产构成

| 序号 | 名称      | 金额           |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | 1,173,409.78 |
| 2  | 应收证券清算款 | -            |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 24,358.91    |
| 5  | 应收申购款   | 748,253.16   |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 1,946,021.85 |

### 11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## 十、基金的业绩

(一) 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

| 阶段         | 净值增长率①  | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④   |
|------------|---------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 2015年      | 2.40%   | 2.95%     | 0.19%      | 2.48%         | 2.21%  | 0.47% |
| 2016年      | -7.42%  | 1.70%     | -11.89%    | 1.42%         | 4.47%  | 0.28% |
| 2017年      | 30.80%  | 0.82%     | 12.22%     | 0.55%         | 18.58% | 0.27% |
| 2018年      | -15.24% | 1.41%     | -10.91%    | 0.94%         | -4.33% | 0.47% |
| 自基金合同生效起至今 | 5.10%   | 1.86%     | -11.75%    | 1.51%         | 16.85% | 0.35% |

(二) 基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

光大保德信国企改革主题股票型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2015年3月25日至2018年6月30日)



注：本基金于2015年3月25日成立，根据基金合同的规定，本基金建仓期为2015年3月25日至2015年9月25日。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。

---

## 十一、基金的财产

### （一）基金资产总值

基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收款项以及其他资产的价值总和。

### （二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### （三）基金财产的账户

基金托管人根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立资金账户、证券账户以及投资所需的其他专用账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

### （四）基金财产的保管和处分

本基金财产独立于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人、基金登记机构和基金销售机构以其自有的财产承担其自身的法律责任，其债权人不得对本基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。除依法律法规和基金合同的规定处分外，基金财产不得被处分。

基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。基金管理人管理运作基金财产所产生的债权，不得与其固有资产产生的债务相互抵销；基金管理人管理运作不同基金的基金财产所产生的债权债务不得相互抵销。

---

## 十二、基金资产的估值

### （一）估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券、期货交易场所的交易日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非交易日。

### （二）估值对象

基金所拥有的股票、权证、债券、股指期货合约和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

### （三）估值方法

#### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

（1）交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

（2）交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

（3）交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

---

(4)交易所上市不存在活跃市场的有价证券,采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值。

2、处于未上市期间的有价证券应进行如下情况处理:

(1)送股、转增股、配股和公开增发的新股,按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值;该日无交易的,以最近一日的市价(收盘价)估值;

(2)首次公开发行未上市的股票、债券和权证,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值。

(3)首次公开发行有明确锁定期的股票,同一股票在交易所上市后,按交易所上市的同一股票的估值方法估值;非公开发行有明确锁定期的股票,按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种,采用估值技术确定公允价值。

4、本基金投资股指期货合约,一般以估值当日结算价进行估值,估值当日无结算价的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化的,采用最近交易日结算价估值。

5、本基金投资中小企业私募债,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值。

6、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的价格估值。

7、相关法律法规以及监管部门有强制规定的,从其规定。如有新增事项,按国家最新规定估值。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时,应立即通知对方,共同查明原因,双方协商解决。

根据有关法律法规,基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任,因此,就与本基金有关的会计问题,如经相关各方在平等基础上充分讨论后,仍无法达成一致的意见,按照基金管理人对于基金资产净值的计算结果对外予以公布。

---

8、自 2015 年 3 月 30 日起，本公司已公告对旗下证券投资基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外）的估值方法进行调整，采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

#### **（四）估值程序**

1、基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到 0.001 元，小数点后第 4 位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人于每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

#### **（五）估值错误的处理**

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后 3 位以内（含第 3 位）发生估值错误时，视为基金份额净值错误。

基金合同的当事人应按照以下约定处理：

##### **1、估值错误类型**

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或登记机构、或销售机构、或投资人自身的过错造成估值错误，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该估值错误遭受损失当事人（“受损方”）的直接损失按下述“估值错误处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

上述估值错误的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等。

##### **2、估值错误处理原则**

（1）估值错误已发生，但尚未给当事人造成损失时，估值错误责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正估值错误发生的费用由估值错误责任方承担；

---

由于估值错误责任方未及时更正已产生的估值错误，给当事人造成损失的，由估值错误责任方对直接损失承担赔偿责任；若估值错误责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责任。估值错误责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保估值错误已得到更正。

(2) 估值错误的责任方对有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对估值错误的有关直接当事人负责，不对第三方负责。

(3) 因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但估值错误责任方仍应对估值错误负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失（“受损方”），则估值错误责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给估值错误责任方。

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

### 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

(1) 查明估值错误发生的原因，列明所有的当事人，并根据估值错误发生的原因确定估值错误的责任方；

(2) 根据估值错误处理原则或当事人协商的方法对因估值错误造成的损失进行评估；

(3) 根据估值错误处理原则或当事人协商的方法由估值错误的责任方进行更正和赔偿损失；

(4) 根据估值错误处理的方法，需要修改基金登记机构交易数据的，由基金登记机构进行更正，并就估值错误的更正向有关当事人进行确认。

### 4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

(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。

(3) 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。

#### **(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、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、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确认后，基金管理人应当暂停基金估值；

4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

#### **(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开放日交易结束后计算当日的基金资产净值和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予以公布。

#### **(八) 特殊情形的处理**

1、基金管理人、基金托管人按估值方法的第 6 项进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

2、由于证券、期货交易所及登记结算公司发送的数据错误，有关会计制度变化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。



---

## 十三、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收益后的余额。

### （二）基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

### （三）基金收益分配原则

1、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 10 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，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，投资者可选择现金红利或将现金红利按除权日除权后的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

4、每一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。

### （四）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截止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，在 2 个工作日内在指定媒介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者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足于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基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。

---

## 十四、基金的费用与税收

### （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、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、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；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券、期货交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、证券、期货账户开户费用和银行账户维护费；
- 9、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。

### （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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5%年费率计提。基金管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日支付。

#### 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 0.25%的年费率计提。基金托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日支付。

上述“（一）基金费用的种类中第 3—9 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）基金费用的调整**

在遵守相关的法律法规并履行了必要的程序的前提下，基金管理人和基金托管人协商一致后可酌情降低基金管理费、基金托管费。此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。基金管理人必须于新的费率实施日前按照《信息披露办法》的规定在指定媒介上刊登公告。

### **（五）基金税收**

本基金运作过程中涉及各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

---

## 十五、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；
- 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托管协议约定的方式确认。

### （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个工作日内在指定媒介公告并报中国证监会备案。

---

## 十六、基金的信息披露

### （一）信息披露要求

本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同及其他有关规定。相关法律法规关于信息披露的规定发生变化时，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和基金管理人、基金托管人的互联网网站（以下简称“网站”）等媒介披露，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）信息披露文本

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：

### 1、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。

### 2、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。

### 3、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。

### 4、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、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放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指定媒介上。

#### 5、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,并保证投资者能够在基金份额发售网点查阅或者复制前述信息资料。

#### 6、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。

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。

报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额 20%的情形,为保障其他投资者权益,基金管理人至少应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告文件中“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定风险,中国证监会认定的特殊情形除外。

#### 7、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 个工作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) 涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或者仲裁；
- (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) 基金管理费、基金托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- (17) 基金份额净值估值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) 本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请;
  - (25) 本基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回;
  - (26) 本基金增加份额类别设置;
  - (27) 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;
  - (28) 基金推出新业务或服务;
  - (29) 中国证监会规定的其他事项。

#### 8、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。

#### 9、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。

#### 10、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两个交易日内,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。基金管理人应当在本基金季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书(更新)等文件中披露中小企业私募债券的投资情况。

#### 11、投资股指期货的信息披露

基金管理人应在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书(更新)等文件中披露股指期货交易情况,包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等,并充分揭示股指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等。

#### 12、投资资产支持证券的信息披露

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。

---

13、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，并向基金管理人出具书面文件或者盖章或者以 XBRL 电子方式复核审查并确认。

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报刊。

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 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。

#### （八）暂停或延迟基金信息披露的情形

当出现下述情况时，基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金相关信息：

1、基金投资所涉及的证券、期货交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

---

2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、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确认后暂停基金估值时；

4、法律法规规定、中国证监会或基金合同认定的其他情形。

---

## 十七、风险揭示

### （一）投资于本基金的风险

#### 1、市场风险

本基金为证券投资基金，证券市场的变化将影响到基金的业绩。因此，宏观和微观经济因素、国家政策、市场变动、行业与个股业绩的变化、投资人风险收益偏好和市场流动程度等影响证券市场的各种因素将影响到本基金业绩，从而产生市场风险，这种风险主要包括：

##### （1）经济周期风险

随着经济运行的周期性变化，国家经济、微观经济、行业及上市公司的盈利水平也可能呈周期性变化，从而影响到证券市场及行业的走势。

##### （2）政策风险

因国家的各项政策，如财政政策、货币政策、产业政策、地区发展政策等发生变化，导致证券市场波动而影响基金投资收益，产生风险。

##### （3）利率风险

由于利率发生变化和波动使得证券价格和证券利息产生波动，从而影响到基金业绩。利率风险是债券投资所面临的主要风险。

##### （4）信用风险

当证券发行人不能够实现发行时所做出的承诺，按时足额还本付息的时候，就会产生信用风险。信用风险主要来自于发行人和担保人。一般认为：国债的信用风险可以视为零，而其他债券的信用风险可根据专业机构的信用评级确定。当证券的信用等级发生变化时，可能会产生证券的价格变动，从而影响到基金资产。

##### （5）再投资风险

再投资获得的收益又被称做利息的利息，这一收益取决于再投资时的市场利率水平和再投资的策略。未来市场利率的变化可能会引起再投资收益的不确定性并可能影响到基金投资策略的顺利实施。

##### （6）购买力风险

基金持有人收益将主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀因素而使其购买力下降。

##### （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，如经营决策、技术变革、新产品研发、竞争加剧等风险。如果基金所投资的上市公司基本面或发展前景产生变化，可能导致其股价的下跌，或者可分配利润的降低，使基金预期收益产生波动。虽然基金可以通过分散化投资来减少风险，但不能完全规避。

## 2、管理风险

### （1）管理风险

本基金可能因为基金管理人和基金托管人的管理水平、手段和技术等因素，而影响基金收益水平。这种风险可能表现在基金整体的投资组合管理上，例如资产配置、类属配置不能达到预期收益目标；也可能表现在个券个股的选择不能符合本基金的投资风格和投资目标等。

### （2）新产品创新带来的风险

随着中国证券市场不断发展，各种国外的投资工具也将被逐步引入，这些新的投资工具在为基金资产提供保值增值功能的同时，也会产生一些新的风险，例如利率期货带来的期货投资风险，期权产品带来的定价风险等。

## 3、流动性风险

本基金面临的流动性风险主要表现在几个方面：建仓成本控制不力，建仓时效不高；基金资产变现能力差，或变现成本高；在投资人大额赎回时缺乏应对手段；证券投资中个券和个股的流动性风险等。这些风险的主要形成原因是：

### （1）市场整体流动性问题。

证券市场的流动性受到价格、投资群体等诸多因素的影响，在不同状况下，其流动性表现是不均衡的，具体表现为：在某些时期成交活跃，流动性非常好，而在另一些时期，则可能成交稀少，流动性差。在市场流动性出现问题时，本基金的操作有可能发生建仓成本增加或变现困难的情况。这种风险在发生大额申购和大额赎回时表现尤为突出。

### （2）市场中流动性不均匀，存在个券流动性风险。

由于不同投资品种受到市场影响的程度不同，即使在整体市场流动性较好的情况下，一些单一投资品种仍可能出现流动性问题，这种情况的存在使得本基金在进行投资操作时，可能难以按计划买入或卖出相应数量的证券，或买入卖出行为对证券价格产生比较大的影响，增加基金投资成本。这种风险在出现个股和个券停牌和涨跌停板等情况时表现得尤为突出。

---

#### 4、股指期货的风险

(1) 杠杆风险：因股指期货采用保证金交易而存在杠杆，基金财产可能因此产生更大的收益波动。

(2) 基差风险：在利用股指期货对冲市场系统风险时，基金资产可能因为股指期货合约与标的指数价格变动方向不一致而承担基差风险。因存在基差风险，在股指期货合约展期操作时，基金资产可能因股指期货合约之间价差的异常变动而遭受展期风险。

(3) 股指期货展期时的流动性风险：本基金持有的股指期货头寸需要进行展期操作，平仓持有的股指期货合约，换成其它月份股指期货合约，当股指期货市场流动性不佳、交易量不足时，将会导致展期操作执行难度提高、交易成本增加，从而可能对基金资产造成不利的影响。

(4) 期货盯市结算制度带来的现金管理风险：股指期货采取保证金交易制度，保证金账户实行当日无负债结算制度，资金管理要求高。当市场持续向不利方向波动导致期货保证金不足，如果未能在规定的时间内补足保证金，按规定将被强制平仓，可能给基金资产带来超出预期的损失。

(5) 到期日风险：股指期货合约到期时，本基金的账户如仍持有未平仓合约，交易所将按照交割结算价将账户持有的合约进行现金交割，因此无法继续持有到期合约，具有到期日风险。

(6) 对手方风险：资产管理人运用基金资产投资于股指期货时，会尽力选择资信状况优良、风险控制能力强的期货公司作为经纪商，但不能杜绝在极端情况下，所选择的期货公司在交易过程中存在违法、违规经营行为或破产清算导致基金资产遭受损失。

(7) 连带风险：为基金资产进行结算的结算会员或该结算会员下的其他投资者出现保证金不足、又未能在规定的时间内补足，或因其他原因导致中金所对该结算会员下的经纪账户强行平仓时，基金资产可能因被连带强行平仓而遭受损失。

(8) 未平仓合约不能继续持有风险：由于国家法律、法规、政策的变化、中金所交易规则的修改、紧急措施的出台等原因，基金资产持有的未平仓合约可能无法继续持有，基金资产必须承担由此导致的损失。

#### 5、中小企业私募债的风险

---

本基金的投资范围包括中小企业私募债券，中小企业私募债是根据相关法律法规由非上市中小企业采用非公开方式发行的债券。中小企业私募债的风险主要包括信用风险、流动性风险、市场风险等。信用风险指发债主体违约的风险，是中小企业私募债最大的风险。流动性风险是由于中小企业私募债交投不活跃导致的投资者被迫持有到期的风险。市场风险是未来市场价格（利率、汇率、股票价格、商品价格等）的不确定性带来的风险，它影响债券的实际收益率。这些风险可能会给基金净值带来一定的负面影响和损失。

## 6、本基金的特定风险

本基金为股票型基金，投资者面临的特定风险主要为资产配置风险、股票投资风险以及其他证券投资风险。股票投资收益会受宏观经济、市场偏好、行业波动和公司自身经营状况等因素的影响，本基金所投资的股票可能在一定时期内表现与其他未投资的股票不同，造成本基金的收益低于其它基金；另外，由于本基金还可以投资债券等其它品种，这些品种的价格也可能因市场中的各类变化而出现一定幅度的波动，产生特定的风险，并影响到整体基金的投资收益。

## 7、其他风险

### （1）技术风险

当计算机、通讯系统、交易网络等技术保障系统或信息网络支持出现异常情况，可能导致基金日常的申购赎回无法按正常时限完成、登记系统瘫痪、核算系统无法按正常时限显示产生净值、基金的投资交易指令无法及时传输等风险。

### （2）资金前端控制风险

上海证券交易所、深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司对本基金租用的交易单元实施当日净买入申报金额总量前端控制制度。当相关交易单元买入申报金额不符合资金前端控制自设额度限制的、或因不可抗力等原因导致资金前端控制出现异常的，上海证券交易所、深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司将拒绝接受本基金的买入申报或申报受限限制，在该等情形下，本基金的投资可能受到不利影响。

### （3）大额申购/赎回风险

本基金是开放式基金，基金规模将随着投资人对基金单位的申购与赎回而不断变化，若是由于投资人的连续大量申购而导致基金管理人在短期内被迫持有大



---

量现金；或由于基金份额持有人的连续大量赎回而导致基金管理人被迫抛售所持有的证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响。

#### （4）顺延或暂停赎回风险

因为市场剧烈波动或其他原因而连续出现巨额赎回，并导致基金管理人的现金支付出现困难，基金份额持有人在赎回基金单位时，可能会遇到部分顺延赎回或暂停赎回等风险。

#### （5）其他风险

战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金资产有遭受损失的风险，以及证券市场、基金管理人及基金销售机构可能因不可抗力无法正常工作，从而产生影响基金的申购和赎回按正常时限完成的风险。

## （二）声明

1、本基金未经任何一级政府、机构及部门担保。投资人自愿投资于本基金，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，本基金还通过交通银行等销售机构办理销售，但是，基金并不是销售机构的存款或负债，也没有经销售机构担保或者背书，销售机构并不能保证其收益或本金安全。

---

## 十八、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。对于法律法规规定或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须报中国证监会备案，自表决通过之日起生效，并自决议生效后两个工作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，在履行相关程序后，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财产清算过程中发生的所有合理费用, 清算费用由基金财产清算小组优先从基金剩余财产中支付。

#### **(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有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

---

## 十九、基金合同的内容摘要

### （一）基金管理人、基金托管人和基金份额持有人的权利、义务

#### 1、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的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- 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、融券；
- 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业务规则；

17) 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前提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。

## 2、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、证券账户以及投资所需的其他账户, 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, 因审计、法律等外部专业顾问提供的情况除外;

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) 从基金管理人或其委托的登记机构处接收并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。

### 3、基金份额持有人的权利及义务

(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) 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未设立日常机构,如今后设立基金份额持有人大会的日常机构,按照相关法律法规的要求执行。

1、召开事由

(1) 除法律法规、中国证监会和基金合同另有规定之外,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) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准（根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外）;
  - 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百分之十以上（含百分之十）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实质性不利影响的其他事项;
  - 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) 调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用;
- 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、赎回费率或在现有的基金份额持有人利益无实质性影响的前提下，调整收费方式或者增设新的份额类别;
- 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) 基金管理人、登记机构、基金销售机构，在法律法规规定或中国证监会许可的范围内调整有关认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务规则;
- 7) 基金推出新业务或服务;

---

8) 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。

## 2、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开时，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六十日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合；

(4) 代表基金份额百分之十以上（含百分之十）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，代表基金份额百分之十以上（含百分之十）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) 代表基金份额百分之十以上（含百分之十）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百分之十以上（含百分之十）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。

## 3、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、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。

#### 4、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、通讯开会方式等基金合同约定的方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定，基金管理人、基金托管人须为基金份额持有人行使投票权提供便利。

(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)。

(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书面形式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式进行表决。

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)到指定地点对书面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;

3) 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);

4) 上述第 3) 项中直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人, 同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面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) 重新召集基金份额持有人大会的条件

若到会者在权益登记日所持有的有效基金份额低于本条第(1)款第 2) 项、第(2)款第 3) 项规定比例的, 召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内, 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, 到会者所持有的有效基金份额应不小于在权益登记日基金总份额的三分之一(含三分之一)。

(4) 在不与法律法规冲突的前提下, 基金份额持有人大会可通过网络、电话或其他方式召开, 基金份额持有人可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式进行表决, 具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。在会议召开方式上, 本基金亦可采用网络、电话、短信等其他非现场方式或者以非现场方式与现

---

场方式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。

(5) 基金份额持有人授权他人代为出席会议并表决的，授权方式可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式，具体方式在会议通知中列明。

## 5、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 7 点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。

---

## 6、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三分之二以上（含三分之二）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。除法律法规、中国证监会或本合同另有约定外，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、与其他基金合并应当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书面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，但应当计入出具书面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。

## 7、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书面表决意见的计票进行监督的,不影响计票和表决结果。

## 8、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个工作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。

9、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或监管规则的部分,如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的,基金管理人与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。

## (三) 基金合同解除和终止的事由、程序

### 1、基金合同的终止事由

有下列情形之一的,在履行相关程序后,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。

## 2、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。

## 3、清算费用

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

## 4、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。

---

#### 5、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。

#### 6、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

#### （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，任何一方均有权将争议提交上海仲裁委员会，按照该会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为上海市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力，仲裁费、律师费用由败诉方承担。

争议处理期间，基金合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

基金合同受中国法律管辖。

#### （五）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，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。

---

## 二十、基金托管协议的内容摘要

### (一) 基金托管协议当事人

#### 1、基金管理人

名称：光大保德信基金管理有限公司

住所：上海市黄浦区中山东二路 558 号外滩金融中心 1 幢，6 层至 10 层（邮政编码：200010）

办公地址：上海市黄浦区中山东二路 558 号外滩金融中心 1 幢（北区 3 号楼）6 层至 10 层（邮政编码：200010）

法定代表人：林昌

成立时间：2004 年 4 月 22 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2004]42 号

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务（依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动）

注册资本：人民币 1.6 亿元

组织形式：有限责任公司

存续期间：持续经营

#### 2、基金托管人

名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）

住所：上海市浦东新区银城中路 188 号（邮政编码：200120）

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号（邮政编码：200120）

法定代表人：牛锡明

成立时间：1987 年 3 月 30 日

批准设立机关及批准设立文号：国务院国发(1986)字第 81 号文和中国人民银行银发 [1987] 40 号文

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字 [1998] 25 号

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；

---

提供信用证服务及担保；代理收付款项业务；提供保管箱服务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务；经营结汇、售汇业务。

注册资本：742.62 亿元人民币

组织形式：股份有限公司

存续期间：持续经营

## （二）基金托管人与基金管理人之间的业务监督、核查

### 1. 基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

#### （1）基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权

1) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同和托管协议的约定，对基金的投资范围、投资对象进行监督。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、固定收益类金融工具、货币市场工具、权证、股指期货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（但须符合中国证监会相关规定）。其中固定收益类金融工具包括国债、金融债、公司债、企业债、地方政府债、次级债、中小企业私募债券、可转换公司债券（含可分离交易可转债）、短期融资券、中期票据、资产支持证券、债券回购、央行票据、银行存款等。

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：股票资产占基金资产的比例为 80%-95%，其中投资于国企改革主题的上市公司股票的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%；其中，基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金以后，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。前述现金资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或中国证监会变更上述投资品种的比例限制，以变更后的比例为准，本基金的投资比例会做相应调整。

基金托管人对基金管理人业务进行监督和核查的义务自基金合同生效日起开始履行。

---

2) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同和托管协议的约定, 对基金投资、融资比例进行监督。

根据基金合同的约定, 本基金投资组合比例应符合以下规定:

a. 本基金股票资产占基金资产的比例范围为 80%-95%, 其中投资于国企改革主题的上市公司股票的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%;

b. 每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金以后, 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。前述现金资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;

c. 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%;

d. 本基金持有的全部权证, 其市值不得超过基金资产净值的 3%;

e. 本基金在任何交易日买入权证的总金额, 不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%;

f. 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%;

g. 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%;

h. 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%;

i. 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;

j. 基金财产参与股票发行申购, 本基金所申报的金额不超过本基金的总资产, 本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;

k. 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;

l. 基金总资产不得超过基金净资产的百分之一百四十;

m. 在任何交易日日终, 持有的买入股指期货合约价值, 不得超过基金资产净值的 10%;

n. 在任何交易日日终, 持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和, 不得超过基金资产净值的 95%; 其中, 有价证券指股票、债券(不含到期日在一年以

---

内的政府债券)、权证、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等;

o. 在任何交易日日终,持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%;

p. 在任何交易日内交易(不包括平仓)的股指期货合约的成交金额不得超过上一个交易日基金资产净值的 20%;

q. 基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值,合计(轧差计算)应当符合基金合同关于股票投资比例的有关规定;

r. 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%;因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合本款所规定比例限制的,本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;

s. 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;

t. 本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的 15%;本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的 30%;

u. 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。

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,除第 b、i、r、s 项外,基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整,但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约定。期间,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,不需要经基金份额持有人大会审议。

基金托管人依照上述规定对本基金的投资组合限制及调整期限进行监督。

---

3) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同和托管协议的约定, 对基金投资禁止行为进行监督。基金财产不得用于下列投资或者活动:

- a. 承销证券;
- b. 违反规定向他人贷款或者提供担保;
- c. 从事承担无限责任的投资;
- d. 买卖其他基金份额, 但是中国证监会另有规定的除外;
- e. 向其基金管理人、基金托管人出资;
- f. 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;
- g. 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

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重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券, 或者从事其他重大关联交易的, 应当符合本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。

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) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同和托管协议的约定, 对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。

a. 基金托管人依据有关法律法规的规定和基金合同的约定对于基金管理人参与银行间市场交易时面临的交易对手资信风险进行监督。

基金管理人向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的银行间市场交易对手的名单。基金托管人在收到名单后 2 个工作日内电话或回函确认收到该名单。基金管理人应定期和不定期对银行间市场现券及回购交易对手的名单进行更新。基金托管人在收到名单后 2 个工作日内电话或书面回函确认, 新名单自基金托管人确认当日生效。新名单生效前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易, 仍应按照协议进行结算。

b. 基金管理人参与银行间市场交易时, 有责任控制交易对手的资信风险, 由于交易对手资信风险引起的损失, 基金管理人应当负责向相关责任人追偿。

---

5) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同和托管协议的约定, 对基金管理人选择存款银行进行监督。

基金投资银行定期存款的, 基金管理人应根据法律法规的规定及基金合同的约定, 确定符合条件的所有存款银行的名单, 并及时提供给基金托管人, 基金托管人应据以对基金投资银行存款的交易对手是否符合有关规定进行监督。

本基金投资银行存款应符合如下规定:

a. 基金管理人、基金托管人应当与存款银行建立定期对账机制, 确保基金银行存款业务账目及核算的真实、准确。

b. 基金管理人与基金托管人应根据相关规定, 就本基金银行存款业务另行签订书面协议, 明确双方在相关协议签署、账户开设与管理、投资指令传达与执行、资金划拨、账目核对、到期兑付、文件保管以及存款证实书的开立、传递、保管等流程中的权利、义务和职责, 以确保基金财产的安全, 保护基金份额持有人的合法权益。

c. 基金托管人应加强对基金银行存款业务的监督与核查, 严格审查、复核相关协议、账户资料、投资指令、存款证实书等有关文件, 切实履行托管职责。

d. 基金管理人与基金托管人在开展基金存款业务时, 应严格遵守《基金法》、《运作办法》等有关法律法规, 以及国家有关账户管理、利率管理、支付结算等的各项规定。

6) 基金托管人对基金投资流通受限证券的监督

a. 基金投资流通受限证券, 应遵守《关于规范基金投资非公开发行证券行为的紧急通知》、《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。

b. 此处的流通受限证券与上文提及的流动性受限资产并不完全一致, 包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券, 不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。

c. 基金管理人应在基金首次投资流通受限证券前, 向基金托管人提供经基金管理人董事会批准的有关基金投资流通受限证券的投资决策流程、风险控制制度。基金投资非公开发行股票, 基金管理人还应提供基金管理人董事会批准的流动性



---

风险处置预案。上述资料应包括但不限于基金投资流通受限证券的投资额度和投资比例控制情况。基金管理人应至少于首次执行投资指令之前两个工作日将上述资料书面发至基金托管人,保证基金托管人有足够的时间进行审核。基金托管人应在收到上述资料后两个工作日内,以书面或其他双方认可的方式确认收到上述资料。

d. 基金投资流通受限证券前,基金管理人应向基金托管人提供符合法律法规要求的有关书面信息,包括但不限于拟发行证券主体的中国证监会批准文件、发行证券数量、发行价格、锁定期,基金拟认购的数量、价格、总成本、总成本占基金资产净值的比例、已持有流通受限证券市值占资产净值的比例、资金划付时间等。基金管理人应保证上述信息的真实、完整,并应至少于拟执行投资指令前两个工作日将上述信息书面发至基金托管人,保证基金托管人有足够的时间进行审核。

e. 基金托管人应对基金管理人提供的有关书面信息进行审核,基金托管人认为上述资料可能导致基金投资出现风险的,有权要求基金管理人在投资流通受限证券前就该风险的消除或防范措施进行补充书面说明,并保留查看基金管理人风险管理部门就基金投资流通受限证券出具的风险评估报告等备查资料的权利。否则,基金托管人有权拒绝执行有关指令。因拒绝执行该指令造成基金财产损失的,基金托管人不承担任何责任,并有权报告中国证监会。

如基金管理人和基金托管人无法达成一致,应及时上报中国证监会请求解决。如果基金托管人切实履行监督职责,则不承担任何责任。

7) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同和托管协议的约定,对基金管理人投资中期票据进行监督。

a. 基金投资中期票据应遵守《关于证券投资基金投资中期票据有关问题的通知》等有关法律法规的规定,并与基金托管人签订《基金投资中期票据风险控制补充协议》。

b. 如果基金管理人确定基金投资中期票据,应向基金托管人提供本基金拟购买中期票据的数量和价格、应划付的金额等执行指令所需相关信息,并保证上述信息的真实、准确、完整。

基金托管人应对基金管理人提供的有关书面信息进行审核,如果基金托管人认为上述资料可能导致基金投资出现风险,有权要求基金管理人在投资中期票据

---

前就该风险的消除或防范措施进行补充书面说明,并保留查看基金管理人风险管理部门就基金投资中期票据出具的风险评估报告等备查资料的权利。否则,基金托管人有权拒绝执行有关指令。因拒绝执行该指令造成基金财产损失的,基金托管人不承担任何责任,并有权报告中国证监会。

如基金管理人和基金托管人无法达成一致,应及时上报中国证监会请求解决。如果基金托管人切实履行监督职责,则不承担任何责任。

8) 基金托管人根据法律法规的规定及基金合同和托管协议的约定,对基金投资其他方面进行监督。

(2) 基金托管人应根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确认、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。如果基金管理人未经基金托管人的审核擅自将不实的业绩表现数据印制在宣传推介材料上,则基金托管人对此不承担任何责任,并有权在发现后报告中国证监会。

(3) 基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查,在规定时间内答复并改正,就基金托管人的疑义进行解释或举证。对基金托管人按照法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的,基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

基金托管人发现基金管理人的投资指令或实际投资运作违反《基金法》及其他有关法规、基金合同和托管协议规定的行为,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,并以电话或书面形式向基金托管人反馈,说明违规原因及纠正期限,并保证在规定期限内及时改正。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,基金托管人有权报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为,应立即报告中国证监会,同时通知基金管理人在限期内纠正。

基金托管人发现基金管理人的指令违反法律、行政法规和其他有关规定,或者违反基金合同约定的,应当拒绝执行,立即通知基金管理人,并及时向中国证监会报告。

---

基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。

## 2. 基金管理人

根据《基金法》及其他有关法规、基金合同和托管协议规定，基金管理人

基金管理人定期和不定期地对基金托管人保管的基金资产进行核查。基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复并改正。

基金管理人发现基金托管人未对基金资产实行分账管理、擅自挪用基金资产、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、基金合同、托管协议及其他有关规定的，应及时以书面形式通知基金托管人在限期内纠正，基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金管理人发出回函。在限期内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应报告中国证监会。对基金管理人按照法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的，基金托管人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

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

### (三) 基金财产的保管

#### 1、基金财产保管的原则

(1) 基金托管人应安全保管基金财产，未经基金管理人的指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何资产。

(2) 基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。

---

(3) 基金托管人按照规定开立基金财产的资金账户、证券账户和债券托管账户等投资所需的账户。

(4) 基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，与基金托管人的其他业务和其他基金的托管业务实行严格的分账管理，确保基金财产的完整和独立。

(5) 对于因为基金投资产生的应收资产和基金申购过程中产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金资产没有到达基金银行存款账户的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失。基金托管人对此不承担任何责任。

(6) 除依据法律法规和基金合同的规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

## 2、基金募集资产的验证

基金募集期满或基金提前结束募集之日起 10 日内，由基金管理人聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的 2 名以上（含 2 名）中国注册会计师签字有效。验资完成，基金管理人应将募集到的全部资金存入基金托管人为基金开立的基金银行存款账户中，基金托管人在收到资金当日出具相关证明文件。若基金募集期限届满，未能达到基金备案条件，由基金管理人按规定办理退款等事宜，基金托管人应提供充分协助。

## 3、基金的银行存款账户的开立和管理

(1) 基金托管人应负责本基金银行存款账户的开立和管理。

(2) 基金托管人以本基金的名义在其营业机构开立基金的银行存款账户，并根据中国人民银行规定计息。本基金的银行预留印鉴由基金托管人制作、保管和使用。本基金的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益，均需通过本基金的银行存款账户进行。

(3) 本基金银行存款账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立其他任何银行存款账户；亦不得使用基金的任何银行存款账户进行本基金业务以外的活动。

---

(4) 基金托管人可以通过申请开通本基金银行存款账户的企业网上银行业务进行资金支付, 并使用交通银行企业网上银行(简称“交通银行网银”)办理托管资产的资金结算汇划业务。

(5) 基金银行存款账户的管理应符合《中华人民共和国票据法》、《人民币银行账户结算管理办法》、《现金管理暂行条例实施细则》、《人民币利率管理规定》、《支付结算办法》以及银行业监督管理机构的其他规定。

#### 4、基金证券交收账户、资金交收账户的开立和管理

基金托管人以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司开立证券账户。

基金证券账户的开立和使用, 限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借和未经对方同意擅自转让基金的任何证券账户; 亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

基金管理人不得对基金证券交收账户、资金交收账户进行证券的超卖或超买。

基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户即资金交收账户, 用于证券交易资金的结算。基金托管人以本基金的名义在托管人处开立基金的证券交易资金结算的二级结算备付金账户。

#### 5、债券托管账户的开立和管理

(1) 基金合同生效后, 基金托管人负责向人民银行进行报备, 并在备案通过后在中央国债登记结算有限责任公司以本基金的名义开立债券托管账户, 并由基金托管人负责基金的债券及资金的清算。基金管理人负责申请基金进入全国银行间同业拆借市场进行交易, 由基金管理人在中国外汇交易中心开设同业拆借市场交易账户。

(2) 基金管理人代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议, 协议正本由基金管理人保存。

#### 6、其他账户的开设和管理

若中国证监会或其他监管机构在本托管协议订立日之后允许基金从事其他投资品种的投资业务, 涉及相关账户的开立、使用的, 由基金管理人协助基金托管人根据有关法律法规的规定和基金合同的约定, 开立有关账户。该账户按有关规则使用并管理。

#### 7、基金财产投资的有关实物证券、银行存款定期存单等有价凭证的保管

---

实物证券由基金托管人存放于基金托管人的保管库；其中实物证券也可存入中央国债登记结算有限责任公司或银行间市场清算所股份有限公司或中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司或票据营业中心的代保管库。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。基金托管人对由基金托管人以外机构实际有效控制的本基金资产不承担保管责任。

银行存款定期存单等有价凭证由基金托管人负责保管。

#### 8、与基金财产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同的原件分别由基金托管人、基金管理人保管，相关业务程序另有限制除外。除托管协议另有规定外，基金管理人在代基金签署与基金有关的重大合同时应尽可能保证持有二份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件，基金管理人应及时将正本送达基金托管人处。合同的保管期限按照国家有关规定执行。

对于无法取得二份以上的正本的，基金管理人应向基金托管人提供加盖授权业务章的合同传真件，未经双方协商或未在合同约定范围内，合同原件不得转移。

#### **（四）基金资产净值计算与复核**

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

基金管理人应每个工作日对基金资产估值。估值原则应符合基金合同及有关法律、法规的规定。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。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，以约定方式发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核后，将复核结果反馈给基金管理人，由基金管理人就基金份额净值予以公布。

#### **（五）基金份额持有人名册的登记与保管**

基金管理人可委托基金登记机构登记和保管基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容包括但不限于基金份额持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册，包括基金募集期结束时的基金份额持有人名册、基金权益登记日的基金份额持有人名册、基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册、每年最后一个交易日的基金份额持有人名册，由基金登记机构负责编制和保管，并对基金份额持有人名册的真实性、完整性和准确性负责。

---

基金管理人应根据基金托管人的要求定期和不定期向基金托管人提供基金份额持有人名册。

1. 基金管理人于基金合同生效日及基金合同终止日后 10 个工作日内向基金托管人提供由登记机构编制的基金份额持有人名册；

2. 基金管理人于基金份额持有人大会权益登记日后 5 个工作日内向基金托管人提供由登记机构编制的基金份额持有人名册；

3. 基金管理人于每年最后一个交易日后 10 个工作日内向基金托管人提供由登记机构编制的基金份额持有人名册；

4. 除上述约定时间外，如果确因业务需要，基金托管人与基金管理人商议一致后，由基金管理人向基金托管人提供由登记机构编制的基金份额持有人名册。

基金托管人以电子版形式妥善保管基金份额持有人名册，并定期刻成光盘备份，保存期限为 15 年。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。若基金管理人或基金托管人由于自身原因无法妥善保管基金份额持有人名册，应按有关法规规定各自承担相应的责任。

#### **（六）争议解决方式**

相关各方当事人同意，因托管协议而产生的或与托管协议有关的一切争议，应通过友好协商或者调解解决。托管协议当事人不愿通过协商、调解解决或者协商、调解不成的，任何一方当事人均有权将争议提交上海仲裁委员会，根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点在上海市，仲裁裁决是终局的，并对相关各方当事人均有约束力。仲裁费用、律师费用由败诉方承担。

争议处理期间，相关各方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

托管协议受中华人民共和国法律管辖。

#### **（七）托管协议的修改与终止**

1. 基金托管协议的变更

---

托管协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行修改。修改后的新协议，其内容不得与基金合同的规定有任何冲突。修改后的新协议，应报中国证监会备案。

## 2. 基金托管协议的终止

(1) 基金合同终止；

(2) 基金托管人解散、依法被撤销、破产，被依法取消基金托管资格或因其他事由造成其他基金托管人接管基金财产；

(3) 基金管理人解散、依法被撤销、破产，被依法取消基金管理资格或因其他事由造成其他基金管理人接管基金管理权。

(4) 发生《基金法》、《销售办法》、《运作办法》或其他法律法规规定的终止事项。



---

## 二十一、对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务。以下是主要的服务内容，基金管理人根据基金份额持有人的需要和市场的变化，有权增加、修改这些服务项目：

### 1、资讯服务

基金管理人通过客服热线、在线客服、公司网站、电话语音等方式为投资者提供信息资讯服务，投资人如果了解申购和赎回等交易情况、基金账户余额、基金产品与服务等信息，可拨打基金管理人客户服务电话或登录公司网站、公司移动端平台进行咨询、查询。

#### (1) 客户服务电话

全国统一客户服务号码：4008-202-888

传真：（021）80262468

#### (2) 官方网站

公司网址：www.epf.com.cn

电子信箱：epfservice@epf.com.cn

#### (3) 官方移动端平台

微信服务号：

APP：

### 2、资料发送服务

#### (1) 投资人电子对账单服务

基金份额持有人可通过公司网站、在线客服、客服电话等方式向本基金管理人定制电子对账单。基金管理人根据基金份额持有人的对账单定制情况，向账单期内发生交易或账单期末仍持有本公司旗下基金份额的持有人发送电子对账单，但由于基金份额持有人未详实填写或未及时更新相关信息（包括手机号码、电子邮箱等）导致基金管理人无法送达的除外。

电子对账单形式及服务方式具体如下：

1) 月度电子邮件对账单：每月结束后 10 个工作日内，本公司将以电子邮件方式，向当月进行基金交易或当月最后一个交易日仍持有基金份额，并成功定制

---

电子对账单的投资者发送月度电子对账单。内容包括：截至月度末的基金份额持有概况及当月交易明细。

2) 月度短信对账单：每月度结束后 10 个工作日内，本公司将以手机短信方式，向当月最后一个交易日仍持有基金份额，并成功定制手机短信对账单的投资者发送月度短信对账单。内容包括：截至月度末的基金份额持有概况及参考市值。

3) 基金份额持有人可登录本公司网站（www.epf.com.cn）账户查询系统查阅对账单。

4) 基金份额持有人也可拨打基金管理人客服热线索取订阅电子、短信账单，亦可通过销售机构网点进行查询。

#### (2) 其他相关的信息资料

指以不定期的方式向投资者发送的基金资讯材料，如基金新产品或新服务的相关材料、开放式基金运作情况回顾、客户服务问答等。

### 3、在线服务

通过本公司官网及移动端平台，投资者可获得如下服务：

(1) 投资者可登录本公司网站账户及移动端平台查询系统，查询基金账户情况、交易明细情况、更改个人信息、订制邮件短信发送等服务。

(2) 投资者可通过“在线客服”功能，进行咨询或留言。

(3) 投资者可通过本公司网站及移动端平台获取基金和基金管理人各类信息，包括基金法律文件、基金管理人最新动态、基金产品净值、热点问题等。

公司网址：www.epf.com.cn

电子信箱：epfservice@epf.com.cn

官方移动端平台：

微信服务号：

APP：

### 4、网上交易

基金管理人已经开通快速便捷的网上交易，投资者可以通过本公司官网及移动端平台的网上交易系统进行基金开户、认购、申购、赎回、基金转换、信息查询等各项业务。具体业务办理情况及业务规则请登录本公司网站查询。

### 5、投诉处理服务

---

投资者可以通过基金管理人提供的客服电话人工服务、客服电话语音留言、在线客服、书信、电子邮件、传真等渠道对基金管理人和销售机构所提供的服务进行投诉或提出建议。

如本招募说明书存在任何您/贵机构无法理解的内容，请通过上述方式联系基金管理人。请确保投资前，您/贵机构已经全面理解了本招募说明书。

## 二十二、其他应披露事项

(一) 2018年3月25日至2018年9月24日未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

(二) 2018年3月25日至2018年9月24日基金管理人、托管人及其高级管理人员未有受监管部门稽查或处罚的情形发生。

(三) 2018年3月25日至2018年9月24日相关公告事宜列示如下，下列公告刊登在上海证券报、中国证券报、证券时报及光大保德信基金管理有限公司网站上。

| 披露时间       | 公告内容                                                    |
|------------|---------------------------------------------------------|
| 2018-03-27 | 光大保德信国企改革主题股票型证券投资基金 2017 年年度报告                         |
| 2018-03-27 | 光大保德信国企改革主题股票型证券投资基金 2017 年年度报告摘要                       |
| 2018-03-31 | 光大保德信基金管理有限公司旗下部分基金参与交通银行手机银行基金申购及定期定额投资手续费优惠活动的公告      |
| 2018-03-31 | 光大保德信基金管理有限公司关于光大保德信国企改革主题股票型证券投资基金修改基金合同部分条款的公告        |
| 2018-04-20 | 光大保德信国企改革主题股票型证券投资基金 2018 年第 1 季度报告                     |
| 2018-04-21 | 光大保德信基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京汇成基金销售有限公司为代销机构并参与其交易费率优惠活动的公告 |
| 2018-05-08 | 光大保德信国企改革主题股票型证券投资基金招募说明书（更新）                           |
| 2018-05-08 | 光大保德信国企改革主题股票型证券投资基金招募说明书摘要（更新）                         |
| 2018-06-30 | 光大保德信基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行开展的基金申购及定期定额投资手续费优惠活动的公告     |
| 2018-06-30 | 光大保德信基金管理有限公司关于部分基金在宜信普泽投资顾问（北京）有限公司开通转换业务并参加其交易费率优惠的公告 |

---

|            |                                         |
|------------|-----------------------------------------|
| 2018-07-02 | 光大保德信基金管理有限公司旗下基金 2018 年 6 月 30 日资产净值公告 |
| 2018-07-20 | 光大保德信国企改革主题股票型证券投资基金 2018 年第 2 季度报告     |
| 2018-08-25 | 光大保德信国企改革主题股票型证券投资基金 2018 年半年度报告摘要      |
| 2018-08-25 | 光大保德信国企改革主题股票型证券投资基金 2018 年半年度报告        |

---

### 二十三、招募说明书的存放及查阅方式

本招募说明书可印制成册，存放在基金管理人、基金托管人等机构的办公场所和营业场所，供投资人查阅；投资人也可按工本费购买本招募说明书印制件或复制件。

---

## 二十四、备查文件

本基金备查文件包括以下文件：

- （一）中国证监会注册基金募集的文件
- （二）基金合同
- （三）托管协议
- （四）法律意见书
- （五）基金管理人业务资格批件和营业执照
- （六）基金托管人业务资格批件和营业执照
- （七）中国证监会要求的其他文件