

富兰克林国海新收益灵活配置混合型  
证券投资基金  
更新招募说明书  
(2017年第2号)

基金管理人：国海富兰克林基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

## 重要提示

本基金的募集申请于2015年7月10日经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）【2015】1587号文注册，本基金的基金合同于2016年8月31日生效。

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申请的注册，并不表明其对本基金的价值和收益做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。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者根据所持有份额享受基金的收益，但同时也要承担相应的投资风险。基金投资中的风险包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险；个别证券特有的非系统性风险；由于基金份额持有人连续大量赎回基金产生的流动性风险；基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险；某一基金的特定风险等。

本基金的投资范围包括中小企业私募债券，中小企业私募债券的规模一般小额零散，主要通过固定收益证券综合电子平台、综合协议交易平台或证券公司进行转让，难以进行更广泛估值和询价，因此中小企业私募债券的估值价格可能与实际变现的市场价格有一定的偏差而对本基金资产净值产生影响。同时中小企业私募债券流动性可能比较匮乏，因此可能面临较高的流动性风险，以及由流动性较差变现成本较高而使基金净值受损的风险。

基金分为股票型基金、混合型基金、债券型基金、货币市场基金等不同类型，投资者投资不同类型的基金将获得不同的收益预期，也将承担不同程度的风险。一般来说，基金的收益预期越高，投资者承担的风险也越大。本基金为混合型基金，基金的预期风险与预期收益水平高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险收益特征的投资品种。

投资有风险，投资者在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的招募说明书及基金合同。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本招募说明书中基金投资组合报告和基金业绩中的数据已经本基金托管人复核。

本招募说明书（更新）所载内容截止日为2017年8月31日，有关财务数据和净值表现截止日为2017年6月30日（财务数据未经审计）。

## 目录

第一部分 绪言.....	1
第二部分 释义.....	2
第三部分 基金管理人.....	7
第四部分 基金托管人.....	21
第五部分 相关服务机构.....	25
第六部分 基金的募集.....	37
第七部分 基金合同的生效.....	38
第八部分 基金份额的申购与赎回.....	39
第九部分 基金份额的登记.....	50
第十部分 基金的投资.....	52
第十一部分 基金的财产.....	66
第十二部分 基金资产的估值.....	68
第十三部分 基金的收益与分配.....	72
第十四部分 基金费用与税收.....	75
第十五部分 基金的会计与审计.....	78
第十六部分 基金的信息披露.....	79
第十七部分 风险揭示.....	86
第十八部分 基金合同的变更、终止与基金财产清算.....	90
第十九部分 基金合同摘要.....	92
第二十部分 托管协议摘要.....	117
第二十一部分 对基金份额持有人的服务.....	135
第二十二部分 招募说明书的存放及查阅方式.....	138
第二十三部分 备查文件.....	141

## 第一部分 绪言

本招募说明书依据《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》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）和其他有关法律法规的规定，以及《富兰克林国海新收益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

本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。本招募说明书由本基金管理人解释。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，或对本招募说明书做出任何解释或者说明。

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。基金投资者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。基金投资者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。

## 第二部分 释义

本招募说明书中除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

- 1、基金或本基金：指富兰克林国海新收益灵活配置混合型证券投资基金
- 2、基金管理人：指国海富兰克林基金管理有限公司
- 3、基金托管人：指兴业银行股份有限公司
- 4、基金合同：指《富兰克林国海新收益灵活配置混合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《富兰克林国海新收益灵活配置混合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：指《富兰克林国海新收益灵活配置混合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《富兰克林国海新收益灵活配置混合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，并经2015年4月24日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修改的《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、中国证监会：指中国证券监督管理委员会
- 14、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会
- 15、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
- 16、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
- 17、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
- 18、合格境外机构投资者：指符合现行法律法规规定可以投资于中国境内证券市场的中国境外的机构投资者
- 19、人民币合格境外机构投资者：指符合现行法律法规规定，运用来自境外的人民币资金进行境内证券投资的境外法人
- 20、投资人：指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和人民币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：指国海富兰克林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。基金的登记机构为国海富兰克林基金管理有限公司或接受国海富兰克林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、转托管及定期定额投资等业务而引起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)

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《国海富兰克林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，由基金管理人和投资人共同遵守

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、销售服务费：指从基金资产中计提的，用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务的费用



42、**基金份额类别**：指本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别，各基金份额类别分别设置代码，分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值

43、**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

44、**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

45、**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、申购金额及扣款方式，由销售机构于每期约定申购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

46、**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%

47、**元**：指人民币元

48、**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

49、**基金资产总值**：指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和

50、**基金资产净值**：指基金资产总值减去基金负债后的价值

51、**基金份额净值**：指计算日各类基金份额的各自基金资产净值除以计算日各自类别的基金份额总数

52、**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

53、**A类基金份额**：指在投资者认购/申购时收取前端认购/申购费，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额

54、**C类基金份额**：指在投资者认购/申购时不收取前后端认购/申购费，而从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额

55、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

56、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

### 第三部分 基金管理人

#### 一、基金管理人概况

名称：国海富兰克林基金管理有限公司

注册地址：广西南宁市西乡塘区总部路1号中国—东盟科技企业孵化基地一期C-6栋二层

办公地址：上海浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期9层

法定代表人：吴显玲

成立日期：2004年11月15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]145号

组织形式：有限责任公司

注册资本：2.2亿元人民币

存续期限：50年

联系人：施颖楠

联系电话：021-3855 5555

股权结构：国海证券股份有限公司（原名“国海证券有限责任公司”）持有51%股权，邓普顿国际股份有限公司持有49%股权

#### 二、主要人员情况

##### （一）董事会成员

董事长吴显玲女士，中共党员，管理学硕士，经济师。历任中国人民银行广西壮族自治区金融管理处主任科员，广西证券交易中心副总经理（主持全面工作），广西证券登记有限责任公司法定代表人、总经理，广西证券有限责任公司副总裁、国海证券有限责任公司副总裁、国海富兰克林基金管理有限公司督察长、董事长、国海富兰克林资产管理（上海）有限公司董事长、国海富兰克林基金管理有限公司副董事长兼总经理。现任国海富兰克林基金管理有限公司董事长，兼任国海富兰克林资产管理（上海）有限公司董事长、代为履行总经理职责，同时兼任国海富兰克林投资管理（上海）有限公司执行董事兼总经理。

副董事长麦敬恩（Gregory E. McGowan）先生，文学学士，硕士学位以及法学博士学位。在加入富兰克林邓普顿投资集团之前，麦敬恩先生是美国证券交易委员会的资深律师。麦敬恩先生于1986年加入富兰克林邓普顿投资集团，担任Templeton Worldwide Inc. 执行副总裁、董事和法律总顾问。曾任多个富兰克林邓普顿公司董事，包括但不限于Franklin Templeton Management Luxembourg S.A.（卢森堡），富兰克林邓普顿投资（亚洲）有限公司（香港），Templeton Asset Management Ltd.（新加坡），Franklin Templeton Holding Limited（毛里求斯），Franklin Templeton Services Limited（爱尔兰），国海富兰克林基金管理有限公司董事长。现任富兰克林邓普顿投资集团高级战略顾问，Templeton International Inc.执行副总裁及法律总顾问，Franklin Templeton France S.A和Franklin Templeton Strategic Investments, Ltd.董事，Templeton Investment Counsel, LLC执行副总裁，Franklin Templeton Investment Services GmbH咨询委员会委员，Brinker Destinations Trust独立董事，中国人寿富兰克林资产管理有限公司股东代表，国海富兰克林基金管理有限公司股东代表、副董事长，国海富兰克林资产管理（上海）有限公司董事。董事何春梅女士，中共党员，工程硕士。历任广西壮族自治区政府办公厅第五秘书处科员、副主任科员，广西开发投资有限责任公司融资部副经理、财务部副经理、经理、总经理，广西投资集团有限公司总裁助理兼办公室主任，国海证券有限责任公司监事，广西壮族自治区金融工作办公室副主任、党组成员、机关党委书记，广西北部湾股权交易所股份有限公司董事。现任广西投资集团有限公司党委副书记，国海证券股份有限公司董事长、党委书记，国海良时期货有限公司董事，国海创新资本投资管理有限公司董事，国海富兰克林基金管理有限公司董事。

董事梁葆玲（Linda Liang）女士，CPA，加利福尼亚执照，经济学文学学士。历任毕马威会计师事务所加利福尼亚旧金山办事处税务监督高级专员，安永会计师事务所加利福尼亚圣何塞和帕洛阿尔托办事处税务顾问高级经理。梁葆玲女士于2005年加入富兰克林邓普顿投资集团，历任富兰克林邓普顿投资总部美国公司税及全球税总监，富兰克林邓普顿资本控股私人有限公司（新加坡）亚洲规划与策略总监。现任邓普顿资产管理有限公司首席执行官，国海富兰克林基金管理有限公司董事，国海富兰克林资产管理（上海）有限公司董

事。

董事胡德忠先生，中共党员，管理学博士，经济师。历任广西区人民银行计划处科员，广西证券公司国债交易部办事员，广西证券有限责任公司深圳深南中路证券营业部出市代表、清算部经理、交易部经理、总经理助理、副总经理、总经理，广西证券（2011年10月增资扩股并更名为国海证券）有限责任公司公司总裁助理兼经纪业务部总经理，国海证券有限责任公司副总裁兼经纪业务部总经理，国海富兰克林基金管理有限公司副总经理，上海凯石投资管理有限公司董事副总经理，国海证券有限责任公司经纪业务事业总部总经理、常务副总裁，广西北部湾股权交易所股份有限公司董事长，国海创新资本投资管理有限公司董事，国海证券股份有限公司常务副总裁。现任广西北部湾股权交易所股份有限公司董事，国海富兰克林基金管理有限公司董事，同时兼任国海富兰克林资产管理（上海）有限公司董事。

董事燕文波先生，中共党员，工商管理硕士。历任君安证券有限责任公司人力资源部职员、资产管理部职员，上海浦东科创有限公司投资部经理，民生证券有限责任公司人力资源部总经理，联合证券有限责任公司人力资源部总经理、机构客户部总经理，国海证券有限责任公司总裁助理（并先后兼任总裁办公室主任和资产管理部、资本市场部、北京管理总部总经理等职务）、副总裁兼北京分公司总经理，国海证券有限责任公司副总裁兼资本市场部总经理、北京分公司总经理。现任国海证券股份有限公司副总裁兼北京分公司总经理，国海富兰克林基金管理有限公司董事。

董事张伟先生，硕士研究生学历。历任澳纽银行集团（悉尼）企业银行主任，香港上海汇丰银行国际信托有限公司副总裁，银行家信托有限公司（英国）联席董事，德意志信托（香港）有限公司董事。2000年7月加入富兰克林邓普顿投资，先后担任机构业务拓展董事、香港区销售及市场业务拓展主管、香港区总监。现任富兰克林邓普顿投资（亚洲）有限公司大中华区总监及董事，国海富兰克林基金管理有限公司董事。

独立董事张忠国先生，中共党员，硕士研究生学历，高级会计师。历任广西柳州地区财政局副局长，广西鹿寨县人民政府副县长，柳州地区行署副秘书长、财办主任，广西财政厅预算处处长，广西财政厅总会计师、副厅长（享受正厅级待遇），现已退休。现任国海富兰克林基金管理有限公司独立董事。

独立董事洪荣光先生，MBA商学硕士。历任台湾亚洲证券股份有限公司董事长及第一大股东（后与元大京华证券股份有限公司合并），H&Q（Hambrecht & Quist Group）汉茂风险投资公司董事，越南国家投资基金公司董事，邓普顿新兴市场信托股份有限公司董事，邓普顿开发中国投资信托基金（卢森堡）董事，台股指数基金公司（英国）董事，菲律宾信安银行董事，富兰克林邓普顿国际基金董事，益民基金管理有限公司独立董事。现任兴亚置业集团（中国）董事长，亚洲环球证券公司（香港）董事长，菲律宾信安银行独立董事，国海富兰克林基金管理有限公司独立董事。

独立董事徐同女士，复旦大学经济学硕士，曾任上海普陀区政协委员。历任深圳特区证券公司交易部经理、办公室主任、深圳上证总经理，国泰证券公司总经理助理，北京证券公司副总经理，北京华远集团总经济师，国都证券公司总经济师。现任三亚财经论坛发展有限公司董事，国海富兰克林基金管理有限公司独立董事。

独立董事刘戎戎女士，MBA商学硕士。历任麦肯锡公司商业分析员，昆仲亚洲基金合伙人，Vision Investment Management(Asia) Limited董事总经理，博信资本业务合伙人。现任得仕股份有限公司董事及副总经理，联新国际医疗集团投资管理委员会首席顾问，国海富兰克林基金管理有限公司独立董事。

管理层董事林勇先生，工商管理硕士。历任江西省人民银行调查统计处调查分析员，江西省资金融通中心融资部交易员，招商银行总行计划资金部资金交易中心经理，嘉实基金管理有限公司投资管理部基金经理，国泰基金管理有限公司固定收益部总监助理、基金经理，平安银行股份有限公司资金交易部总经理、金融市场事业部副总裁兼资产管理中心、投资交易中心总经理，资产管理事业部副总裁，平安磐海资本有限公司董事长兼总经理，平安证券股份有限公司资产管理事业部总经理。现任国海富兰克林基金管理有限公司总经理、管理层董事。

## （二）监事会成员

监事会主席余天丽女士，经济学学士。历任富达基金（香港）有限公司投资服务代表，Asiabondportal.com营销助理，富达基金（香港）有限公司亚洲区项目经理，英国保诚资产管理（新加坡）有限公司亚洲区战略及产品发展部副

董事，瑞士信贷资产管理（新加坡）有限公司亚洲区产品发展部总监，工银瑞信基金管理有限公司专户投资部产品负责人。现任富兰克林邓普顿资本控股有限公司（富兰克林邓普顿投资集团全资子公司）亚洲区产品策略部董事，国海富兰克林基金管理有限公司监事会主席。

监事梁江波先生，研究生班学历，中共党员，经济师、会计师。历任广西信托投资公司计划财务部核算一科副科长，太平洋保险公司（寿险）南宁分公司财务部会计，国海证券有限责任公司计划财务部会计核算部经理，国海良时期货有限公司财务总监兼财务部总经理，国海证券股份有限公司财务管理部副总经理（主持工作）。现任国海证券股份有限公司财务管理部总经理、国海富兰克林基金管理有限公司监事。

职工监事张志强先生，CFA，纽约州立大学（布法罗）计算机科学硕士，中国科学技术大学数学专业硕士。历任美国Enreach Technology Inc.软件工程师，海通证券股份有限公司研究所高级研究员，友邦华泰基金管理有限公司高级数量分析师，国海富兰克林基金管理有限公司首席数量分析师、风险控制部总经理、业务发展部总经理。现任国海富兰克林基金管理有限公司量化与指数投资总监、金融工程部总经理、国富沪深300指数增强基金和国富中证100指数增强分级基金基金经理、职工监事。

职工监事赵晓东先生，香港大学MBA。历任淄博矿业集团项目经理，浙江证券分析员，上海交大高新技术股份有限公司高级投资经理，国海证券有限责任公司行业研究员，国海富兰克林基金管理有限公司研究员、高级研究员、国富弹性市值混合基金和国富潜力组合混合基金的基金经理助理，国富沪深300指数增强基金基金经理。现任国海富兰克林基金管理有限公司权益投资总监、QDII投资总监，国富中小盘股票基金、国富焦点驱动混合基金、国富弹性市值混合基金和国富恒瑞债券基金基金经理、职工监事。

### （三）经营管理层人员

总经理林勇先生，工商管理硕士。历任江西省人民银行调查统计处调查分析员，江西省资金融通中心融资部交易员，招商银行总行计划资金部资金交易中心经理，嘉实基金管理有限公司投资管理部基金经理，国泰基金管理有限公司固定收益部总监助理、基金经理，平安银行股份有限公司资金交易部总经

理、金融市场事业部副总裁兼资产管理中心、投资交易中心总经理、资产管理事业部副总裁，平安磐海资本有限公司董事长兼总经理，平安证券股份有限公司资产管理事业部总经理。现任国海富兰克林基金管理有限公司总经理、管理层董事。

副总经理徐荔蓉先生，CFA，CPA（非执业），律师（非执业），中央财经大学经济学硕士。历任中国技术进出口总公司金融部副总经理，融通基金管理有限公司基金经理，申万巴黎基金管理有限公司（现“申万菱信基金管理有限公司”）基金经理，国海富兰克林基金管理有限公司高级顾问、资产管理部总经理兼投资经理、管理层董事。现任国海富兰克林基金管理有限公司副总经理、投资总监、研究分析部总经理，国富中国收益混合基金、国富潜力组合混合基金和国富研究精选混合基金基金经理。

副总经理王雷先生，硕士研究生。历任华东计算技术研究所技术安全部职员，平安证券有限责任公司成都及上海地区营业部总经理、南京北门桥路证券营业部总经理、经纪业务事业部执行总经理，招商基金管理有限公司华东机构理财中心副总监、机构理财部负责人。现任国海富兰克林基金管理有限公司副总经理。

副总经理胡昕彦女士，工商管理硕士。历任中国银行上海市分行会计科科员，汇丰数据处理（上海）有限公司共同基金部高级专员，2004年加入国海富兰克林基金管理有限公司，先后担任基金事务部副总经理、行政管理部副总经理、行政管理部总经理、总经理助理。现任国海富兰克林基金管理有限公司副总经理。

#### （四）督察长

督察长储丽莉女士，中共党员，律师（非执业），英国伦敦大学亚非学院法律硕士。历任上海物资贸易中心股份有限公司法律顾问、投资经营部副总经理，李宁体育（上海）有限公司法律顾问。2005年加入国海富兰克林基金管理有限公司，先后担任公司法律顾问、高级法律顾问、监察稽核部副总经理、监察稽核部总经理、管理层董事，国海富兰克林资产管理（上海）有限公司董事会秘书。自2006年起，还同时兼任公司董事会秘书。现任国海富兰克林基金管理有限公司督察长兼董事会秘书、高级法律顾问。



### （五）基金经理

吴西燕女士，上海财经大学硕士，历任中国建设银行深圳分行会计，国海富兰克林基金管理有限公司研究助理、研究员、高级研究员、国富弹性市值混合基金及国富深化价值混合基金的基金经理助理。截至本报告期末任国海富兰克林基金管理有限公司行业研究主管，国富中国收益混合基金、国富金融地产混合基金、国富新机遇混合基金、国富新增长混合基金、国富新价值混合基金、国富新收益混合基金及国富新活力混合基金的基金经理。

邓钟锋先生，厦门大学金融学硕士。历任深发展银行北京分行公司产品研发及审查、中信银行厦门分行公司信贷审查、上海新世纪信用评级公司债券分析员、农银汇理基金管理有限公司研究员及国海富兰克林基金管理有限公司投资经理。截至本报告期末任国海富兰克林基金管理有限公司国富金融地产混合基金、国富新机遇混合基金、国富新增长混合基金、国富新价值混合基金、国富新收益混合基金、国富新活力混合基金、国富恒通纯债债券基金及国富恒丰定期债券基金的基金经理。

#### 历任基金经理

2016年8月31日至2017年8月31日由胡永燕女士担任本基金基金经理，其中2016年8月31日至2016年9月29日与现任基金经理吴西燕女士共同管理该基金，2016年9月30日至2017年8月31日与现任基金经理吴西燕女士及邓钟锋先生共同管理该基金。

### （六）投资决策委员会成员

本基金采取集体投资决策制度。

投资决策委员会由下述委员组成：林勇先生（公司总经理）；徐荔蓉先生（公司副总经理、投资总监、研究分析部总经理、基金经理）；张志强先生（量化与指数投资总监、金融工程部总经理、基金经理、职工监事）；赵晓东先生（权益投资总监、QDII投资总监、基金经理、职工监事）；刘怡敏女士（固定收益投资总监、基金经理）；叶斐先生（风险控制部总经理助理）。

储丽莉女士（督察长）有权列席投资决策委员会的任何会议。

（七）上述人员之间不存在近亲属关系。

期后事项：

经公司股东会 2017 年第五次会议决议审议通过，自 2017 年 9 月 26 日起，胡德忠先生不再担任公司第五届董事会董事，由陆晓隽先生接替胡德忠先生担任公司第五届董事会董事。

### 三、基金管理人的职责

（一）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；

（二）办理基金备案手续；

（三）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；

（四）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；

（五）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

（六）编制季度、半年度和年度基金报告；

（七）计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；

（八）办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；

（九）召集基金份额持有人大会；

（十）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；

（十一）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；

（十二）有关法律法规和中国证监会规定的其他职责。

### 四、基金管理人的承诺

（一）基金管理人将遵守《证券法》、《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》等法律法规的相关规定，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违法违规行为的发生。

（二）基金管理人不得从事下列行为：

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、利用基金财产或职务便利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、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。

### （三）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、代表人、受雇人或任何其他第三人牟取不当利益；
- 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、基金管理人的风险管理和内部控制制度

### （一）风险管理体系

本基金在运作过程中面临的风险主要包括市场风险、信用风险、流动性风险、管理风险、操作或技术风险、合规性风险以及其他风险。

针对上述各种风险，本基金管理人建立了一套完整的风险管理体系，具体包括以下内容：

- 1、建立风险管理环境。具体包括制定风险管理战略、目标，设置相应的组织机构，配备相应的人力资源与技术系统，设定风险管理的时间范围与空间范围等内容。
- 2、识别风险。辨识组织系统与业务流程中存在的风险以及风险存在和发生的原因。
- 3、分析风险。检查存在的控制措施，分析风险发生的可能性及其引起的后果。

4、度量风险。评估风险水平的高低，既有定性的度量手段，也有定量的度量手段。定性的度量是把风险水平划分为若干级别，每一种风险按其发生的可能性与后果的严重程度分别进入相应的级别。定量的方法则是设计一定的风险指标，测量其数值的大小。

5、处理风险。将风险水平与既定的标准相对比，对级别较低的风险加以监控，对较为严重的风险实施一定的管理计划，对于后果极其严重的风险，则及时准备相应的应急处理措施。

6、监视与检查。对已有的风险管理系统要监视及评价其管理绩效，在必要时加以改变。

7、报告与咨询。建立风险管理的报告系统，使公司股东、公司董事会、公司高级管理人员及监管部门及时了解公司风险管理状况，并向其寻求咨询意见。

## （二）内部控制制度

### 1、内部控制的原则

（1）全面性原则。内部控制制度覆盖公司的各项业务、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。

（2）独立性原则。基金管理人设立独立的督察长与监察稽核部门，并使它们保持高度的独立性与权威性。

（3）相互制约原则。公司部门和岗位的设置权责分明、相互牵制，并通过切实可行的相互制衡措施来消除内部控制中的盲点。

（4）重要性原则。公司的发展必须建立在风险控制完善和稳固的基础上，内部风险控制与公司业务发展同等重要。

### 2、内部控制的主要内容

基金管理人内部控制的主要内容包括：业务控制、资金管理控制、会计系统控制、信息技术系统控制、信息披露控制、监察稽核控制、人事控制等。

#### （1）业务控制

业务控制包括市场开发业务控制、投资管理业务控制、开放式基金业务控制、金融创新业务控制等。

市场开发业务控制主要内容包括：针对市场开发的各项业务建立明确的职责分工，实行岗位分离制度，保证各项业务的有效性和可靠性，同时加强内部

牵制，防止错误及舞弊行为发生；制定基金销售的标准化流程，选用先进的电子销售系统，以不断提高基金销售的服务质量和避免差错事故的发生；制定统一的客户资料和销售资料管理制度，妥善保管各类资料；实施对客户的审查制度，对客户情况及资金情况进行严格的审查，事先明确双方的权利与义务，防范新的电子交易方式下的各种风险；本公司制作基金的宣传推介材料应符合《销售管理办法》、《基金宣传推介材料监管事项的补充规定》和《证券投资基金评价业务管理暂行办法》等相关法律法规的要求，公司和基金代销机构的基金宣传推介材料，事先均需经公司的督察长检查，出具合规意见书，公司负责基金营销业务的高级管理人员也应当对基金宣传推介材料的合规性进行复核并出具复核意见，报中国证监会备案；根据《证券投资基金销售适用性指导意见》的要求，公司及基金代销机构在销售基金和相关产品的过程中，将注重根据基金投资者的风险承受能力销售不同风险等级的产品，把合适的产品卖给合适的基金投资者。为此公司已建立基金销售适用性管理制度，对基金产品进行风险评价并定期更新，对基金投资者进行风险承受能力调查，同时做好销售人员的业务培训工作，加强对基金销售行为的管理，加大对基金投资者的风险提示，降低因销售过程中产品错配而导致的基金投资者投诉风险。

研究业务控制主要内容包括：研究工作保持独立、客观；建立了严密的研究工作业务流程，形成科学、有效的研究方法；建立了投资对象备选库制度，研究部门根据基金合同要求，在充分研究的基础上建立和维护备选库；建立了投资分析例会制度，沟通信息，交流经验，研究对策，提高投资决策的准确性和及时性；建立了研究报告质量评价体系。

投资决策业务控制主要内容包括：投资决策严格遵守法律法规的有关规定，符合基金合同所规定的投资目标、投资范围、投资策略、投资组合和投资限制等要求；明确界定投资权限，严格遵守投资限制，防止越权决策；建立了投资管理制度。

基金交易业务控制主要内容包括：基金交易实行集中交易制度，基金经理不直接向交易员下达投资指令或者直接进行交易；制定了基金投资交易业务的标准化流程并注意流程在各部门之间的衔接和监控，并有书面凭证；建立了完善的交易记录制度，每日投资组合列表等及时核对并存档保管。

## （2）资金管理控制

资金管理控制主要内容包括：基金资金独立于基金管理人的自有资金。基金管理人的自有资金与基金资金分开并互为封闭，不混合使用；坚持了资金营运安全性、流动性和效益性相统一的经营原则。资金的筹措和使用严格按照法律法规及基金管理人有关规定执行并统一管理，以提高资金使用效益，并注意其安全性和流动性。

### （3）会计系统控制

基金管理人采取了适当的会计控制措施，明确会计凭证、会计账簿和财务会计报告的处理程序，以确保基金管理人会计核算系统的正常运转。具体内容包括：

基金管理人建立了凭证制度，通过凭证设计、登录、传递、归档等一系列凭证管理制度，确保正确记载经济业务，明确经济责任；基金管理人建立了账务组织和账务处理体系，正确设置会计账簿，有效控制会计记账程序；基金管理人建立了复核制度，通过会计复核和业务复核防止会计差错的产生。

### （4）信息技术系统控制

信息技术系统的设计开发符合国家、金融行业软件工程标准的要求，编写了完整的技术资料；在实现业务电子化时，设置保密系统和相应控制机制，并保证了信息技术系统的可稽核性；信息技术系统投入运行前，已经过业务、运营、监察稽核等部门的联合验收。

### （5）信息披露控制

信息披露控制包括：基金管理人按照《中华人民共和国公司法》、《证券法》、《基金法》、《信息披露办法》及其配套的信息披露内容与格式准则和编报规则等法律法规和中国证监会有关规定，建立完善的信息披露制度，能够保证公开披露的信息真实、准确、完整、及时；基金管理人公开披露的信息包括：招募说明书、基金合同、托管协议、定期报告、临时报告、法律法规以及中国证监会规定应予披露的其他信息。基金管理人严格执行信息披露的作业流程，各部门各司其职，并承担其相应的责任。

### （6）监察稽核控制

监察稽核控制包括：基金管理人设立了督察长，全权负责基金管理人的监察稽核工作。督察长的任命符合中国证监会的任职条件，经董事会聘任，报中国证监会核准。督察长对董事会负责，任期由基金管理人章程规定；根据基金

管理人监察稽核工作的需要和董事会授权，督察长可以列席基金管理人相关会议，调阅基金管理人相关档案，就内部控制制度的执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能。督察长对于在稽核监察中所掌握的信息资料负有保密责任。督察长定期和不定期向董事会报告基金管理人内部控制执行情况，董事会会对督察长的报告进行审议；督察长独立出具监察季报、年报及其他报告，直接报送董事会和中国证监会，同时抄送总经理。如发现基金管理人重大违规行为，立即向基金管理人的董事会和中国证监会及相关派出机构报告。

#### （7）人力资源管理控制

人力资源管理控制包括：本基金管理人建立了合理的员工报酬体系，合理确定员工报酬水平。过低的报酬会影响人力资源的质量和运行效益，而过高的报酬会损害基金管理人的利益，所以确定工资制度时坚持了效益优先，兼顾公平的原则；基金管理人建立了管理人员的选聘和培养制度。制定科学的管理人员选聘政策和方法，使优秀人才脱颖而出；制定管理人员培养制度，不断提高其管理水平；制定了员工的业绩评价和激励方案，充分调动其积极性。

#### （8）内幕交易、关联交易控制和公平交易管理

内幕交易和关联交易控制包括：严格规范和界定禁止员工从事的活动，并要求员工严格遵守；完善电脑监控系统，在线实时监控基金的投资、交易活动，防止利用基金财产对敲作价等操纵市场的行为，尤其注意观察大额买卖股票的现象；设置投资限制表。按关联交易的明确规定限制买卖的股票，对限制表中的股票严禁购买，监察稽核部门根据限制表监控基金投资；对员工行为进行监察，防止出现与基金从业人员操守不符的行为，以及有关法律法规禁止基金从业人员从事的行为；对员工加强职业道德教育。

公司实行集中交易制度、防火墙制度、信息控制制度，从制度上防止内幕交易的发生。公司严格执行关联交易和公平交易管理制度，对所管理的不同基金、专户分别管理，公平对待。

### 3、基金管理人关于内部控制的声明

（1）本公司确知建立、实施和维持内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任；

（2）上述关于内部控制的披露真实、准确；

（3）本公司承诺将根据市场环境变化及公司发展不断完善内部控制制度。





## 第四部分 基金托管人

### 一、基金托管人基本情况

#### 1、基本情况

名称：兴业银行股份有限公司（以下简称“兴业银行”）

注册地址：福州市湖东路154号

办公地址：上海市江宁路168号

法定代表人：高建平

成立时间：1988年8月22日

注册资本：207.74亿元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基金字[2005]74号

托管部门联系人：赵欣

电话：021-52629999

传真：021-62159217

#### 2、发展概况及财务状况

兴业银行成立于1988年8月，是经国务院、中国人民银行批准成立的首批股份制商业银行之一，总行设在福建省福州市，2007年2月5日正式在上海证券交易所挂牌上市（股票代码：601166），注册资本207.74亿元。

开业二十多年来，兴业银行始终坚持“真诚服务，相伴成长”的经营理念，致力于为客户提供全面、优质、高效的金融服务。截至2016年12月31日，兴业银行资产总额达6.09万亿元，实现营业收入1570.60亿元，全年实现归属于母公司股东的净利润538.50亿元。在2016年英国《银行家》杂志全球银行1000强排名中，兴业银行按总资产排名第33位，按一级资本排名第32位；在2016年《财富》世界500强中，兴业银行排名第195位；在2016年《福布斯》全球上市企业2000强排名中，兴业银行位居第59位，稳居全球银行50强、全球上市企业100强、世界企业500强。品牌价值同步提升，根据英国《银行家》杂志联合世界知名品牌评估机构Brand Finance发布的“2017全球银行品牌500强”榜单，兴业银行排名第21位，大幅上升15位，品牌价值突破百亿美元达105.67亿美元，同比

增长63.70%。在国内外权威机构组织的评奖中，兴业银行连续六年蝉联中国银行业“年度最具社会责任金融机构奖”，并先后获得“亚洲卓越商业银行”、“杰出中资银行奖”、“年度最佳股份制银行”、“卓越竞争力金融控股集团”、“卓越创新银行奖”、“年度优秀绿色金融机构”、“最佳责任企业”等多项殊荣。

## 二、托管业务部的部门设置及员工情况

兴业银行股份有限公司总行设资产托管部，下设综合管理处、市场处、委托资产管理处、科技支持处、稽核监察处、运营管理及产品研发处、养老金管理中心等处室，共有员工100余人，业务岗位人员均具有基金从业资格。

## 三、基金托管业务经营情况

兴业银行股份有限公司于2005年4月26日取得基金托管资格。基金托管业务批准文号：证监基金字[2005]74号。截止2017年6月30日，兴业银行已托管开放式基金183只，托管基金财产规模5741.64亿元。

## 四、基金托管人的内部风险控制制度说明

### （一）内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金资产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

### （二）内部控制组织架构

兴业银行基金托管业务内部风险控制组织结构由兴业银行审计部、资产托管部内设稽核监察处及资产托管部各业务处室共同组成。总行审计部对托管业务风险控制工作进行指导和监督；资产托管部内设独立、专职的稽核监察处，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，具有独立行使监督稽核工作职权和能力。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

### （三）内部风险控制原则

1、全面性原则：风险控制必须覆盖基金托管部的所有处室和岗位，渗透各项业务过程和业务环节；风险控制责任应落实到每一业务部门和业务岗位，每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责。

2、独立性原则：资产托管部设立独立的稽核监察处，该处室保持高度的独立性和权威性，负责对托管业务风险控制工作进行指导和监督。

3、相互制约原则：各处室在内部组织结构的设计上要形成一种相互制约的机制，建立不同岗位之间的制衡体系。

4、定性和定量相结合原则：建立完备的风险管理指标体系，使风险管理更具客观性和操作性。

5、防火墙原则：托管部自身财务与基金财务严格分开；托管业务日常操作部门与行政、研发和营销等部门严格分离。

6、有效性原则。内部控制体系同所处的环境相适应，以合理的成本实现内控目标，内部制度的制订应当具有前瞻性，并应当根据国家政策、法律及经营管理的需要，适时进行相应修改和完善；内部控制应当具有高度的权威性，任何人不得拥有不受内部控制约束的权力，内部控制存在的问题应当能够得到及时反馈和纠正；

7、审慎性原则。内控与风险管理必须以防范风险，审慎经营，保证托管资产的安全与完整为出发点；托管业务经营管理必须按照“内控优先”的原则，在新设机构或新增业务时，做到先期完成相关制度建设；

8、责任追究原则。各业务环节都应有明确的责任人，并按规定对违反制度的直接责任人以及对负有领导责任的主管领导进行问责。

## 五、内部控制制度及措施

（一）制度建设：建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度。

（二）建立健全的组织管理结构：前后台分离，不同部门、岗位相互牵制。

（三）风险识别与评估：稽核监察处指导业务处室进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施。

（四）相对独立的业务操作空间：业务操作区相对独立，实施门禁管理和音像监控。

（五）人员管理：进行定期的业务与职业道德培训，使员工树立风险防范与控制理念，并签订承诺书。

（六）应急预案：制定完备的《应急预案》，并组织员工定期演练；建立异地灾备中心，保证业务不中断。

## 六、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

基金托管人负有对基金管理人的投资运作行使监督权的职责。根据《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定，托管人对基金的投资对象和范围、投资组合比例、投资限制、费用的计提和支付方式、基金会计核算、基金资产估值和基金净值的计算、收益分配、申购赎回以及其他有关基金投资和运作的事项，对基金管理人进行业务监督、核查。

基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法律法规规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金托管人发出回函。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。基金管理人违反基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。基金托管人发现基金管理人重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时，通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

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投资指令违反法律、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。

## 第五部分 相关服务机构

### 一、基金份额发售机构

#### （一）直销机构

名称：国海富兰克林基金管理有限公司

注册地址：广西南宁市西乡塘区总部路1号中国—东盟科技企业孵化基地一期C-6栋二层

办公地址：上海浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期9层

法定代表人：吴显玲

联系人：王蓉婕

联系电话：021-3855 5678

传真：021-6887 0708

#### （二）代销机构

##### 1. 国海证券股份有限公司

注册地址：广西桂林市辅星路13号

办公地址：广西南宁市滨湖路46号国海大厦

法定代表人：何春梅

联系人：牛孟宇

电话：0755-83709350

传真：0755-83704850

客户服务电话：95563

公司网站：[www.ghzq.com.cn](http://www.ghzq.com.cn)

##### 2. 中泰证券股份有限公司

注册地址：山东省济南市经七路86号

办公地址：山东省济南市经七路86号

法定代表人：李玮

电话：0531-68889155

传真：0531-68889357

联系人：吴阳

客户服务电话：95538

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

### 3. 东海证券股份有限公司

注册地址：江苏省常州延陵西路23号投资广场18层

办公地址：上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦

法定代表人：赵俊

电话：021-20333333

传真：021-50498825

联系人：王一彦

客户服务电话：95531；400-888-8588

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

### 4. 安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元

办公地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元

法定代表人：牛冠兴

电话：0755-82558305

传真：0755-82558355

联系人：陈剑虹

客户服务电话：400-8001-001

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

### 5. 山西证券股份有限公司

注册地址：太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼

办公地址：太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼

法定代表人：侯巍

电话：0351-8686659

传真：0351-8686619

联系人：郭熠

客户服务电话：400-666-1618、95573

6. 中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座

办公地址：广东省深圳市福田区中心三路8号中信证券大厦

法定代表人：王东明

电话：010-60838696

传真：010-60833739

联系人：顾凌

客户服务电话：95548

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

7. 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

联系人：刘晨、李芳芳

客户服务电话：95525

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

8. 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

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20层

法定代表人：杨宝林

电话：0532-85022326

传真：0532-85022605

联系人：孙秋月

客户服务电话：95548

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

9. 中信期货有限公司

注册地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层

办公地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层

法定代表人：张皓

电话：0755-23953913

传真：0755-83217421

联系人：洪诚

公司网站：[www.citicsf.com](http://www.citicsf.com)

客服电话：400-990-8826

10. 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

电话：021-33389888

传真：021-33388224

联系人：黄莹

客户服务电话：95523、4008895523

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

11. 申万宏源西部证券有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室

办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室（邮编：830002）

法定代表人：许建平



电话：010-88085858

传真：010-88085195

联系人：李巍

客户服务电话：400-800-0562

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

#### 12. 长江证券股份有限公司

注册地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦

办公地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦

法定代表人：杨泽柱

电话：027-65799999

传真：027-85481900

联系人：奚博宇

客户服务电话：95579或4008-888-999

客户服务网站：[www.95579.com](http://www.95579.com)

#### 13. 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

电话：021-38676666

传真：021-38670666

联系人：朱雅崑

客户服务电话：400-8888-666 / 95521

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

#### 14. 上海证券有限责任公司

注册地址：上海市黄浦区四川中路213号7楼

办公地址：上海市黄浦区四川中路213号7楼

法定代表人：李俊杰

电话：021-53686888

传真：021-53686100-7008，021-53686200-7008

联系人：邵珍珍

客户服务电话：021-962518

公司网址：[www.962518.com](http://www.962518.com)

15. 中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

办公地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

法定代表人：陈有安

电话：010-66568450

传真：010-66568990

联系人：邓颜

客户服务电话：400-888-8888

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

16. 兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路268号

办公地址：上海浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼21层

法定代表人：兰荣

电话：021-38162212

联系人：黄英

客户服务电话：95562

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

17. 海通证券股份有限公司

注册地址：上海市广东路689号海通证券大厦

办公地址：上海市广东路689号海通证券大厦

法定代表人：王开国

电话：021-23219000

传真：021-23219100

联系人：李笑鸣

客户服务电话：95553或拨打各城市营业网点咨询电话

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

#### 18. 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层

办公地址：长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26层

法定代表人：蔡一兵

电话：0731-84403319

传真：0731-84403439

联系人：郭静

客户服务电话：400-88-35316

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

#### 19. 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222号南京奥体中心现代五项馆2105室

办公地址：上海市浦东新区峨山路505号东方纯一大厦15层

法定代表人：袁顾明

电话：021-20324155

传真：021-20324199

联系人：赵明

客户服务电话：4009282266

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

#### 20. 一路财富（北京）信息科技股份有限公司

注册地址：北京市西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座2208

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

电话：010-88312877

传真：+86(10)88312099

联系人：徐越

客户服务电话：4000011566

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

#### 21. 奕丰金融服务(深圳)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（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）

法定代表人：TAN YIK KUAN

联系人：叶健

电话：0755-8946 0500

传真：0755-21674453

客户服务电话：400-684-6500、400-684-0500

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

#### 北京晟视天下投资管理有限公司

注册地址：北京市怀柔区九渡河镇黄坎村735号03室

法定代表人：蒋煜

联系人：冯培勇

电话：010-58170950

传真：010-5817 0800

客户服务电话：400 818 8866

公司网址：[fund.shengshiview.com](http://fund.shengshiview.com)

#### 22. 上海景谷资产管理有限公司

注册地址：浦东新区泥城镇新城路2号24幢N3809室

法定代表人：苏凯

联系人：沙海靖

电话：021-61621602

传真：021-61621602-819

客户服务电话：021-61621602

公司网址：www.g-fund.com.cn

23. 上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层

办公地址：上海市徐汇区宛平南路88号26楼

法定代表人：其实

联系人：潘世友

电话：021-54509988

传真：021-64385308

客户服务电话：400-1818-188

公司网址：www.1234567.com.cn

24. 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文一西路1218号1栋202室

办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路18号黄龙时代广场B座6F

法定代表人：陈柏青

联系人：韩爱彬

电话：0571-26888888

传真：0571-26697013

客户服务电话：4000-766-123

公司网址：www.fund123.cn

25. 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号

办公地址：上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯大厦9楼

法定代表人：杨文斌

联系人：王诗屿

电话：021-20613643

传真：021-68596916

客户服务电话：400-700-9665

公司网址：www.ehowbuy.com

26. 深圳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楼10层1006号

办公地址：北京市西城区宣武门外大街28号富卓大厦A座7层

法定代表人：张彦

联系人：文雯

电话：010-83363101

传真：010-83363072

客服电话：4001661188

公司网址：www.jrj.com.cn

27. 浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：杭州市文二西路1号903室

办公地址：杭州市余杭区同顺街18号同花顺大楼4楼

法定代表人：凌顺平

联系人：费超超

电话：0571-88911818-8654

传真：0571-86800423

客户服务电话：4008-773-772

公司网址：[www.5ifund.com](http://www.5ifund.com)

28. 北京肯特瑞财富投资管理有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-06

办公地址：北京市亦庄经济开发区科创十一街18号院

法定代表人：江卉

联系人：徐伯宇

电话：4000988511/ 4000888816

传真：010-89188000

客户服务电话： 95118

公司网址： fund.jd.com

29. 武汉市伯嘉基金销售有限公司

注册地址： 湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际 SOHO 城（一期）第七幢 23 层 1 号 4 号

办公地址： 湖北省武汉市江汉区淮海路中央商务区泛海国际 SOHO 城 2301 室

法定代表人： 陶捷

联系人： 徐博

电话： 027-83863772

传真： 027-83862682

客户服务电话： 400-027-9899

公司网址： www.buyfunds.cn

二、注册登记机构

名称： 国海富兰克林基金管理有限公司

注册地址： 广西南宁市西乡塘区总部路1号中国—东盟科技企业孵化基地一期C-6栋二层

办公地址： 上海浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期9层

法定代表人： 吴显玲

电话： 021-38555511

传真： 021- 68880120

联系人： 胡昕彦

三、出具法律意见书的律师事务所

名称： 上海市通力律师事务所

注册地址： 上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心19层

办公地址： 上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心19层

负责人：俞卫锋

联系人：黎明

经办律师：黎明、孙睿

联系电话：021- 31358663

传真：021- 31358600

#### 四、审计基金财产的会计师事务所

机构名称：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

执行事务合伙人：李丹

经办注册会计师：单峰、曹阳

联系人：曹阳

联系电话：（021）23238888

传真：（021）23238800



## 第六部分 基金的募集

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》等有关法律法规及基金合同，于2015年7月10日经中国证监会【2015】1587号文件注册募集。

本基金募集期为2016年8月29日至2016年8月29日，本次募集的净销售额为424,250,591.66元人民币，认购款项在募集期间产生的银行利息共计0.00元人民币。

本次募集有效认购总户数为303户，按照每份基金份额1元人民币计算，本基金在募集期募集的有效认购份额为424,250,591.66份，利息结转的基金份额为0.00份，两项合计共424,250,591.66份基金份额，已全部计入投资者基金账户，归投资者所有。

## 第七部分 基金合同的生效

### 一、基金合同的生效

经中国证券监督管理委员会核准，本基金的基金合同于 2016 年 8 月 31 日生效。

### 二、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

《基金合同》生效后，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续60个工作日出现前述情形的，本基金将按照基金合同的约定进入清算程序并终止，无需召开基金份额持有人大会。

法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。

## 第八部分 基金份额的申购与赎回

### 一、申购与赎回的场所

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。具体的销售机构及网点将由基金管理人在招募说明书或其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，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。

### 二、申购与赎回的开放日及开放时间

#### （一）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/期货交易市场、证券/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。

#### （二）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个月开始办理申购赎回，具体业务办理时间在申购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、申购与赎回的原则

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

（二）“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；

（三）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；

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

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

#### 四、申购与赎回的程序

##### （一）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。

##### （二）申购和赎回的款项支付

投资人申购基金份额时，必须在规定时间内全额交付申购款项，投资人交付款项，申购成立；登记机构确认基金份额时，申购生效。若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成立，申购款项将退回投资人账户，基金管理人、基金托管人和销售机构等不承担由此产生的利息等任何损失。

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。

投资人赎回申请成功后，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。

##### （三）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（包括该日）对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请，投资人应在T+2日后

（包括该日）及时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。销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购、赎回的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资者应及时查询，若申购不成功或无效，则申购款项本金退还给投资人。

基金管理人可以在法律法规允许的范围内，依法对上述申购和赎回申请的确认时间进行调整，并必须在调整实施日前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。

## 五、申购与赎回的数额限制

（一）代销网点、直销网上交易以及直销电话交易基金投资者每次申购本基金的最低金额为10元（含申购费）。直销柜台基金投资者首次申购本基金的最低金额为100,000元（含申购费），追加申购的最低金额为500元（含申购费），已在直销柜台有该基金认购记录的投资者不受首次申购最低金额的限制。代销网点的基金投资者欲转入直销网点进行交易要受直销网点最低金额的限制。基金投资者当期分配的基金收益转购基金份额时，不受最低申购金额的限制。基金管理人可根据市场情况，调整本基金首次申购的最低金额。

（二）基金份额持有人在销售机构赎回A类基金份额或C类基金份额时，每次对本基金的赎回申请不得低于10份基金份额。基金份额持有人赎回时或赎回后在销售机构（网点）保留的基金份额余额不足10份的，在赎回时需一次全部赎回。

（三）基金管理人可根据市场情况，在法律法规允许的情况下，合理调整对申购金额和赎回份额的数量限制，基金管理人进行前述调整前依照有关规定在指定媒介和基金管理人网站上公告并报中国证监会备案。

## 六、申购费率、赎回费率

### （一）申购费率

本基金A类基金份额在申购时收取申购费用，C类基金份额不收取申购费用。

本基金A类基金份额的申购费率如下：

申购金额（含申购费）	申购费率
100万元以下	1.00%
100万元（含）以上，500万元以下	0.60%
500万元（含）以上	1000元/笔

（二）赎回费率

1、本基金A类基金份额的赎回费率如下：

持有时间	赎回费率
7日以下	1.50%
7日（含7日）至30日	0.75%
30日（含30日）至180日	0.50%
180日（含180日）以上	0

对于持续持有A类基金份额少于30日的投资人收取的赎回费，将全额计入基金财产；对持续持有A类基金份额长于或等于30日但少于3个月的投资人收取的赎回费的75%计入基金财产；对持续持有A类基金份额长于或等于3个月但少于6个月的投资人收取的赎回费的50%计入基金财产；对持续持有A类基金份额长于或等于6个月的投资人收取的赎回费的25%归入基金财产。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。（前述所指的1个月为30日）

2、本基金C类基金份额的赎回费率如下：

持有时间	赎回费率
30日以下	0.50%
30日（含30日）以上	0

对于持续持有C类基金份额少于30日的投资人收取的赎回费，将全额计入基金财产；对持续持有C类基金份额长于或等于30日的投资人收取的赎回费的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。

（三）基金申购份额的计算

本基金申购采用金额申购的方式。申购的有效份额为净申购金额除以当日的该类基金份额净值，有效份额单位为份，申购份额按四舍五入方法，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。

1、对于申购本基金A类基金份额的投资人，申购份额的计算公式为：

净申购金额=申购金额/（1+申购费率）

申购费用=申购金额-净申购金额

申购份数=净申购金额/申购当日A类基金份额净值

例：假定申购当日A类基金份额净值为1.2000元，两笔申购金额分别为1万元和200万元，则各笔申购负担的申购费用和获得的该基金份额计算如下：

	申购1	申购2
申购金额（元，A）	10,000	2,000,000
适用申购费率（B）	1.00%	0.60%
申购费（C=A-D）	99.01	11,928.43
净申购金额（D=A/（1+B））	9,900.99	1,988,071.57
申购份额（=D/1.2000）	8,250.83	1,656,726.31

2、对于申购本基金C类基金份额的投资人，申购份额的计算公式为：

申购份额=申购金额/申购当日C类基金份额净值

例：某投资者投资50,000申购本基金的C类基金份额，假设申购当日C类基金份额净值为1.0160元，则可得到的申购份额为：

申购份额=50,000/1.0160=49,212.60份

#### （四）基金赎回金额的计算

本基金采用“份额赎回”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来计算，赎回金额计算结果保留到小数点后2位，小数点后2位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

赎回总金额=赎回份数×T日基金份额净值

赎回费用=赎回总金额×赎回费率

赎回金额=赎回总金额-赎回费用

例：某投资者赎回本基金10,000份A类基金份额，持有时间为5天，适用的赎回费率为1.5%，假设赎回当日A类基金份额净值是1.0500元，则其可得到的赎回金额为：

赎回总金额=10,000×1.0500=10,500.00元

赎回费用=10,500.00×1.50%=157.50元

赎回金额=10,500.00-157.50=10,342.50元

即：投资者赎回本基金10,000份A类基金份额，持有时间为5天，假设赎回当日A类基金份额净值是1.0500元，则其可得到的赎回金额为10,342.50元。

例：某投资者赎回本基金10,000份C类基金份额，持有时间为20天，适用的赎回费率为0.50%，假设赎回当日C类基金份额净值是1.0500元，则其可得到的赎回金额为：

赎回总金额=10,000×1.0500=10,500元

赎回费用=10,500×0.50%=52.50元

赎回金额=10,500-52.50=10,447.50元

即：投资者赎回本基金10,000份C类基金份额，持有时间为20天，假设赎回当日C类基金份额净值是1.0500元，则其可得到的赎回金额为10,447.50元。

（五）本基金各个基金份额类别单独设置代码，各类份额分别计算和公告基金份额净值。本基金各类基金份额净值的计算，均保留到小数点后4位，小数点后第5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。

（六）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该类基金份额净值，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。

（七）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。

（八）本基金A类基金份额在申购时收取申购费用，C类基金份额不收取申购费用。A类基金份额申购费用由投资人承担，不列入基金财产。

（九）基金管理人可以在法律法规和基金合同规定范围内调整申购费率和赎回费率。费率如发生变更，基金管理人在调整实施前依照《信息披露办法》的规定在至少一种指定媒介上公告。

（十）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的各项销售费率。

## 七、申购和赎回的注册登记

（一）投资者T日申购基金成功后，正常情况下，基金登记机构在T+1日内为投资者增加权益并办理注册登记手续，投资者自T+2日起（含该日）有权赎回该部分基金份额。

（二）投资者T日赎回基金成功后，正常情况下，基金登记机构在T+1日内为投资者扣除权益并办理相应的注册登记手续。

（三）基金管理人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，并最迟于开始实施日前按照《信息披露办法》的规定在指定媒介上公告。

## 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：

（一）因不可抗力导致基金无法正常运作。

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

（三）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。

（四）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。

（五）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，或发生其他损害现有基金份额持有人利益的情形。

（六）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。

（七）法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第（一）、（二）、（三）、（五）、（六）、（七）项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在指

定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项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：

（一）因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。

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

（三）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。

（四）连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

（五）接受某笔或某些赎回申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益的情形时。

（六）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赎回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（四）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

##### （一）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。

## （二）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基金份额持有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基金份额持有人的赎回申请有困难或认为因支付基金份额持有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，基金份额持有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。如基金份额持有人在提交赎回申请时未作明确选择，基金份额持有人未能赎回部分作自动延期赎回处理。部分顺延赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

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。

## （三）巨额赎回的公告

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

## 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

（一）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。

（二）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。

（三）如发生暂停的时间超过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

基金管理人可以根据相关法律法规以及基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换业务，基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及基金合同的规定制定并公告，并提前告知基金托管人与相关机构。

## 十三、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。

如果出现基金管理人、登记机构、办理转托管的销售机构因技术系统性能限制或其它合理原因，可以暂停该业务或者拒绝基金份额持有人的转托管申请。

## 十五、定期定额投资计划

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

## 十六、基金份额的冻结、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。基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益一并冻结，被冻结部分份额仍然参与收益分配与支付。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。

## 十七、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。

## 第九部分 基金份额的登记

### 一、基金的份额登记业务

本基金的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。

### 二、基金登记业务办理机构

本基金的登记业务由基金管理人或基金管理人委托的其他符合条件的机构办理。基金管理人委托其他机构办理本基金登记业务的，应与代理人签订委托代理协议，以明确基金管理人和代理机构在投资者基金账户管理、基金份额登记、清算及基金交易确认、发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等事宜中的权利和义务，保护基金份额持有人的合法权益。

### 三、基金登记机构的权利

基金登记机构享有以下权利：

- （一）取得登记费；
- （二）建立和管理投资者基金账户；
- （三）保管基金份额持有人开户资料、交易资料、基金份额持有人名册等；
- （四）在法律法规允许的范围内，对登记业务的办理时间进行调整，并依照有关规定于开始实施前在指定媒介上公告；
- （五）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。

### 四、基金登记机构的义务

基金登记机构承担以下义务：

- （一）配备足够的专业人员办理本基金份额的登记业务；
- （二）严格按照法律法规和《基金合同》规定的条件办理本基金份额的登记业务；

（三）妥善保存登记数据，并将基金份额持有人名称、身份信息及基金份额明细等数据备份至中国证监会认定的机构。保存期限自基金账户销户之日起不得少于二十年；

（四）对基金份额持有人的基金账户信息负有保密义务，因违反该保密义务对投资者或基金带来的损失，须承担相应的赔偿责任，但司法强制检查情形及法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他情形除外；

（五）按《基金合同》及招募说明书规定为投资者办理非交易过户业务、提供其他必要的服务；

（六）接受基金管理人的监督；

（七）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。

## 第十部分 基金的投资

### 一、投资目标

在有效控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置和组合管理，力争获得超越业绩比较基准的投资收益。

### 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（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、中小企业私募债券、可转换债券（含可分离交易可转换债券）及其他经中国证监会允许投资的债券或票据）、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、国债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）。

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。如法律法规或中国证监会变更投资品种的比例限制，基金管理人可依据相关规定履行适当程序后相应调整本基金的投资比例限制规定。

基金的投资组合比例为：本基金股票占基金资产的比例为0% - 95%；每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的5%。

### 三、投资策略

#### （一）大类资产配置策略

本基金贯彻“自上而下”的资产配置策略，通过对宏观经济、国家/地区政策、证券市场流动性、大类资产相对收益特征等因素的综合分析，在遵守大类资产投资比例限制的前提下进行积极的资产配置，对基金组合中股票、债券、短期金融工具的配置比例进行调整和优化，平衡投资组合的风险与收益。



## （二）股票投资策略

本基金将采用“自下而上”精选个股策略，对受益于国家/地区产业政策及经济发展方向的相关上市公司进行深度挖掘，精选具有核心竞争优势和持续成长能力的优质上市公司。具体从以下几个方面对上市公司的投资价值进行评估：

### 1、行业地位评估

公司在所属行业中处于领先地位，并在短期内难以被行业内其他竞争对手超越；公司在未来的发展中，在行业或者细分行业中的地位预期会有较大的上升。

### 2、核心竞争力评估

考察一个公司是否具有核心竞争力，主要分析公司是否具有核心技术和创新能力（如专利、商标等知识产权），提供的产品（或服务）是否具有较高的技术壁垒，是否具有良好的销售网络、市场品牌或垄断资源等，是否具有领先的经营模式等。

### 3、盈利能力评估

结合公司所处行业的特点和发展趋势、公司背景，从财务结构、资产质量、业务增长、利润水平、现金流特征等方面考察公司的盈利能力，专注于具有行业领先优势、资产质量良好、盈利能力较强、盈利增长具有可持续性的上市公司。

### 4、公司治理水平评估

良好的公司治理是公司健康发展的基础。从股权结构的合理性、信息披露的质量、激励机制的有效性、关联交易的公允性、公司的管理层和股东的利益是否协调和平衡、公司是否具有清晰的发展战略等方面，对公司治理水平进行综合评估。

### 5、估值水平评估

本基金管理人将对股票进行估值水平的考察，通过评估公司相对市场和行业的相对投资价值，选择估值水平相对低估或估值合理的上市公司。

## （三）债券投资策略

本基金通过对宏观经济、货币政策、财政政策、资金流动性等影响市场利率的主要因素进行深入研究，结合新券发行情况，综合分析市场利率和信用利

差的变动趋势，采取久期调整、收益率曲线配置和券种配置等积极投资策略，把握债券市场投资机会，以获取稳健的投资收益。

#### 1、久期策略

本基金根据对市场利率的走势判断调整债券组合的久期，即预期利率将下降时，增加组合久期，以更多获取债券价格上升带来的组合收益；在预期利率将上升时，相应降低组合久期，以控制债券价格下降的风险。

#### 2、收益率曲线策略

由于债券供求、投资者偏好和市场情绪等因素，不同期限债券的市场利率变动幅度往往不一致，收益率曲线表现出非平行移动的特点。通过对不同期限债券的利率变动趋势的比较分析，本基金将在确定组合久期的前提下，采取相应的债券期限配置，以从长期、中期和短期债券的利率变化差异中获取超额收益。

#### 3、券种配置策略

由于信用水平、债券供求和市场情绪等因素，不同市场和类型债券品种的利率与基准利率的利差不断变动。通过对影响各项利差的因素进行深入分析，评估各券种的相对投资价值，调高投资价值较高的券种的比重以获取超额收益。

#### （四）股票申购策略

本基金将深入研究首次发行(IPO)股票及增发新股的上市公司基本面，挖掘公司的内在价值，根据当时股票市场整体投资环境及定价水平，一、二级市场间资金供求关系，在有效控制风险的前提下制定相应的股票申购策略。对通过股票申购获得的股票，将根据其实际的投资价值确定持有或卖出。

#### （五）股指期货投资策略

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本。

#### （六）国债期货投资策略

本基金投资国债期货，将根据风险管理的原则，充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征，在风险可控的前提下，适度参与国债期货投资。

#### （七）资产支持证券投资策略

本基金通过对资产支持证券资产池结构和质量的跟踪考察、分析资产支持证券的发行条款、预估提前偿还率变化对资产支持证券未来现金流的影响，谨慎投资资产支持证券。

#### （八）中小企业私募债投资策略

与传统的信用债券相比，中小企业私募债券由于以非公开方式发行和转让，普遍具有高风险和高收益的显著特点。本基金将运用基本面研究，结合公司财务分析方法对债券发行人信用风险进行分析和度量，选择风险与收益相匹配的更优品种进行投资。具体为：①研究债券发行人的公司背景、产业发展趋势、行业政策、盈利状况、竞争地位、治理结构等基本面信息，分析企业的长期运作风险；②运用财务评价体系对债券发行人的资产流动性、盈利能力、偿债能力、成长能力、现金流水平等方面进行综合评价，评估发行人财务风险；③利用历史数据、市场价格以及资产质量等信息，估算私募债券发行人的违约率及违约损失率；④考察债券发行人的增信措施，如担保、抵押、质押、银行授信、偿债基金、有序偿债安排等；⑤综合上述分析结果，确定信用利差的合理水平，利用市场的相对失衡，选择具有投资价值的品种进行投资。

#### （九）权证投资策略

本基金的权证投资以控制风险和锁定收益为主要目的。在个券层面上，本基金通过对权证标的公司的基本面研究和未来走势预判，估算权证合理价值，同时还充分考虑个券的流动性，谨慎进行投资。

未来，根据市场情况，本基金可在遵守投资目标的前提下，相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新中公告。

### 四、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率\*50%+中债国债总指数收益率（全价）\*50%。

本基金采用沪深300指数作为股票投资部分的业绩比较基准主要是因为沪深300指数是沪深证券交易所第一次联合发布的反映A股市场整体走势的指数，在上海和深圳证券交易所中选取300只A股作为样本编制而成。该指数样本对沪深市场的覆盖度高，具有良好的市场代表性。此外，沪深300指数编制方法清晰透明，具有独立性和良好的市场流动性；与市场整体表现具有较高的相关度。沪

深300指数由中证指数有限公司编制和计算，中证指数有限公司将采取一切必要措施以确保指数的精确性。

中债国债总指数由中央国债登记结算有限责任公司编制。该指数同时覆盖了上海证券交易所、银行间以及银行柜台债券市场上的主要固定收益类证券，具有广泛的市场代表性，能够反映债券市场总体走势，适合作为本基金的债券投资业绩比较基准。

如果今后法律法规发生变化，或证券市场中有其他代表性更强或者更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。调整业绩比较基准应经基金托管人同意，并报中国证监会备案，而无需召开基金份额持有人大会。基金管理人应依照《信息披露办法》的规定在指定媒介上予以公告。

## 五、风险收益特征

本基金为混合型基金，基金的预期风险与预期收益水平高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险收益特征的投资品种。

## 六、投资决策依据

- （一）有关法律法规和基金合同等的相关规定。
- （二）宏观经济形势、财政政策与货币政策导向及市场环境。
- （三）投资对象收益和风险的配比关系，在充分权衡投资对象的收益和风险的前提下作出投资决策，是本基金维护投资者合法权益的重要保障。

## 七、投资决策流程

本基金通过对不同层次的决策主体明确授权范围，建立了完善的投资决策运作体系。

- （一）投资决策委员会会议：投资决策委员会为基金管理人的最高投资决策机构，由投资决策委员会主席主持，讨论与投资相关的事务，并对重大投资决策做出决议。

（二）基金经理根据投资决策委员会授权和会议决议，在研究分析部的研究支持下，根据市场情况，进行投资组合的构建或调整。在组合构建和调整的过程中，基金经理必须严格遵守有关法律法规、基金合同的投资限制及其他要求。

（三）中央交易室按照有关制度流程负责执行基金经理的投资指令，并担负一线风险监控职责。

（四）风险控制部按照有关法律法规、基金合同和公司制度流程，对基金的投资行为和投资组合进行持续监控，并定期进行风险分析和报告，确保基金投资承担的风险在适当的范围内。

## 八、投资限制

### （一）组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

- 1、本基金股票占基金资产的比例为0% - 95%；
- 2、每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，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；
- 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%，本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年，债券回购到期后不得展期；

15、本基金在任何交易日日终，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%；在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%；本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约定；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交易日基金资产净值的20%；

16、本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的15%；在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的30%；在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的30%。

17、在任何交易日日终，持有的买入国债期货和股指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、基金总资产不得超过基金净资产的140%

19、本基金投资于单只中小企业私募债券的市值，不得超过本基金资产净值的10%；

20、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、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整，但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，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。

法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准，无需召开基金份额持有人大会审议。

## （二）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、向其基金管理人、基金托管人出资；
- 5、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；
- 6、法律、行政法规和国务院证券监督管理机构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的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

如法律法规和监管部门取消上述禁止性规定，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金不受上述规定的限制。

## 九、基金管理人代表基金行使所投资证券项下权利的原则及方法

基金管理人将按照国家有关规定代表本基金独立行使所投资证券项下的权利，保护基金份额持有人的利益。基金管理人在代表基金行使所投资证券项下权利时应遵守以下原则：

- 1、不参与所投资公司的经营管理；
- 2、有利于基金财产的安全与增值，有利于保护基金份额持有人的合法权益。

## 十、基金投资组合报告

本基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本基金的托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同的规定，已于2017年7月18日复核了本投资组合报告的内容。

本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本投资组合报告所载数据截至2017年06月30日，本报告财务资料未经审计。

### 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	70,279,160.72	14.28
	其中：股票	70,279,160.72	14.28
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	381,651,600.00	77.54
	其中：债券	381,651,600.00	77.54
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金	12,248,494.23	2.49



	合计		
8	其他资产	27,994,897.21	5.69
9	合计	492,174,152.16	100.00

注：本基金未通过沪港通交易机制投资港股。

## 2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	158,674.12	0.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
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	70,120,486.60	17.34
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	70,279,160.72	17.38

### 2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金未通过沪港通交易机制投资港股。

### 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	601988	中国银行	8,788,414	32,517,131.80	8.04
2	601328	交通银行	5,122,555	31,554,938.80	7.81
3	601288	农业银行	1,718,300	6,048,416.00	1.50
4	603179	新泉股份	1,495	65,645.45	0.02
5	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.01
6	603536	惠发股份	1,008	24,141.60	0.01
7	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.00
8	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00

### 4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例
---	------	---------	-----------

号			(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	30,003,000.00	7.42
	其中：政策性金融债	30,003,000.00	7.42
4	企业债券	222,197,600.00	54.96
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	129,451,000.00	32.02
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	381,651,600.00	94.41

#### 5. 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	101660033	16 晋焦煤 MTN001	300,000	30,801,000.00	7.62
2	150417	15 农发 17	300,000	30,003,000.00	7.42
3	101754027	17 河钢集 MTN003	300,000	29,544,000.00	7.31
4	136235	16 晋然 01	300,000	29,133,000.00	7.21
5	112462	16 徐工 02	300,000	29,055,000.00	7.19

#### 6. 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

根据基金合同，本基金不投资贵金属。

## 8. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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

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

本基金本期末未持有国债期货。

## 11. 投资组合报告附注

**11.1** 本基金本期投资的前十名证券中，报告期内无发行主体被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到证监会、证券交易所公开谴责、处罚的证券。

**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 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	95,685.01
2	应收证券清算款	20,189,394.42
3	应收股利	-
4	应收利息	7,709,467.78
5	应收申购款	350.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	27,994,897.21

**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可转债。

**11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	603331	百达精工	9,620.37	0.00	新股未上市

## 第十一部分 基金的业绩

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

截至2017年6月30日基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较：

### （一）富兰克林国海新收益灵活配置混合型证券投资基金[A类]

阶段	基金净值收益率①	基金净值收益率标准差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
2016年8月31日—2016年12月31日	0.60%	0.09%	-0.99%	0.39%	1.59%	-0.30%
2017年1月1日—2017年6月30日	2.86%	0.11%	3.59%	0.30%	-0.73%	-0.19%
2016年8月31日—2017年6月30日	3.48%	0.10%	2.57%	0.34%	0.91%	-0.24%

### （二）富兰克林国海新收益灵活配置混合型证券投资基金[C类]

阶段	基金净值收益率①	基金净值收益率标准差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
2016年8月31日—2016年12月31日	0.50%	0.09%	-0.99%	0.39%	1.49%	-0.30%
2017年1月1日—2017年6月30日	2.75%	0.10%	3.59%	0.30%	-0.84%	-0.20%
2016年8月31日—2017年6月30日	3.26%	0.10%	2.57%	0.34%	0.69%	-0.24%

## 第十二部分 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、基金应收的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、期货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。

## 第十二部分 基金资产的估值

### 一、估值目的

基金资产的估值目的是客观、准确地反映基金相关金融资产的公允价值，并为基金份额提供计价依据。

### 二、估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券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。

### 三、估值对象

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

### 四、估值方法

#### （一）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、对在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（另有规定的除外），选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；

3、对在交易所市场上市交易的可转换债券，按估值日收盘价减去可转换债券收盘价中所含债券应收利息后得到的净价进行估值；

4、交易所市场挂牌转让的资产支持证券，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。

#### （二）处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：



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。

4、对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，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；

（三）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，采用第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值。

（四）同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

（五）本基金投资股指期货与国债期货合约，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。

（六）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。

（七）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。

（八）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。

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見，按照基金管理人對基金資產淨值的計算結果對外予以公布。

## 五、估值程序

（一）各類基金份額淨值是按照每個工作日閉市後，各類基金資產淨值除以當日基金份額的餘額數量計算，精確到0.0001元，小數點後第5位四舍五入。國家另有規定的，從其規定。本基金A類基金份額和C類基金份額將分別計算基金份額淨值。

基金管理人每個工作日計算基金資產淨值及各類基金份額淨值，並按規定公告。

（二）基金管理人應每個工作日對基金資產估值。但基金管理人根據法律法規或基金合同的規定暫停估值時除外。基金管理人每個工作日對基金資產估值後，將各類基金份額淨值結果發送基金託管人，經基金託管人復核無誤後，由基金管理人對外公布。

## 六、估值錯誤的處理

基金管理人和基金託管人將採取必要、適當、合理的措施確保基金資產估值的準確性、及時性。當基金份額淨值小數點後4位以內(含第4位)發生估值錯誤時，視為基金份額淨值錯誤。

基金合同的當事人應按照以下約定處理：

### （一）估值錯誤類型

本基金運作過程中，如果由於基金管理人或基金託管人、或登記機構、或銷售機構、或投資人自身的過錯造成估值錯誤，導致其他當事人遭受損失的，過錯的責任人應當對由於該估值錯誤遭受損失當事人（“受損方”）的直接損失按下述“估值錯誤處理原則”給予賠償，承擔賠償責任。

上述估值錯誤的主要類型包括但不限於：資料申報差錯、數據傳輸差錯、數據計算差錯、系統故障差錯、下達指令差錯等。

### （二）估值錯誤處理原則

1、估值錯誤已發生，但尚未給當事人造成損失時，估值錯誤責任方應及時協調各方，及時進行更正，因更正估值錯誤發生的費用由估值錯誤責任方承

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。

### （三）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。

### （四）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。

## 七、暂停估值的情形

（一）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；

（二）因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

（三）中国证监会和基金合同认定的其它情形。

## 八、基金净值的确认

用于基金信息披露的基金资产净值和各类基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的基金资产净值和各类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。

## 九、特殊情况的处理

（一）基金管理人或基金托管人按估值方法的第（八）项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

（二）由于不可抗力原因，或由于证券、期货交易所及登记结算公司发送的数据错误，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减轻或消除由此造成的影响。

## 第十四部分 基金的收益与分配

### 一、基金利润的构成

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

## 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

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

（二）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经除权后的基金份额净值自动转为相应类别的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；

（三）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；

（四）由于本基金A类基金份额不收取销售服务费，而C类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同，基金管理人可对各类别基金份额分别制定收益分配方案，本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

（五）法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

## 四、收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截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

若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的，当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。

## 第十五部分 基金费用与税收

### 一、基金费用的种类

- （一）基金管理人的管理费；
- （二）基金托管人的托管费；
- （三）基金销售服务费；
- （四）《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- （五）《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；
- （六）基金份额持有人大会费用（包括但不限于会计师费、律师费和公证费）；
- （七）基金的证券、期货交易费用；
- （八）基金的银行汇划费用；
- （九）基金的开户费用、账户维护费用；
- （十）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

#### （一）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0.70%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.70\% \div \text{当年天数}$$

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，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前2-5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### （二）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0.15%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前2-5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

### （三）基金销售服务费

本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年费率为0.30%。

销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值的0.30%年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月前10个工作日内从基金财产一次性支付给基金管理人，经基金管理人代付给各个基金销售机构。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类中第（四）—（十）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：

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

（二）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；

（三）《基金合同》生效前的相关费用；



（四）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、费用的调整

经基金管理人和基金托管人协商一致，基金管理人和基金托管人可协商酌情降低基金管理费和基金托管费，此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。基金管理人应依照《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的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## 第十六部分 基金的会计与审计

### 一、基金的会计政策

（一）基金管理人为本基金的基金会计责任方；

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

（三）基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；

（四）会计制度执行国家有关会计制度；

（五）本基金独立建账、独立核算；

（六）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；

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

### 二、基金的年度审计

（一）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。

（二）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。

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

## 第十七部分 基金的信息披露

一、本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《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：

- （一）虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；
- （二）对证券投资业绩进行预测；
- （三）违规承诺收益或者承担损失；
- （四）诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构；
- （五）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；
- （六）中国证监会禁止的其他行为。

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

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

## 五、公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

### （一）基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议

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

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

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

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

### （二）基金份额发售公告

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

### （三）《基金合同》生效公告

基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日（若遇法定节假日指定报刊休刊，则顺延至法定节假日后首个出报日。下同）在指定媒介上登载《基金合同》生效公告。

### （四）基金资产净值、各类基金份额净值

《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各类基金份额的基金份额净值。

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，披露开放日的各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值。

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

#### （五）基金份额申购、赎回价格

基金管理人应当在《基金合同》、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资者能够在基金份额发售网点查阅或者复制前述信息资料。

#### （六）基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告

基金管理人应当在每年结束之日起90日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定媒介上。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。

#### （七）临时报告

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

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

- 1、基金份额持有人大会的召开；
- 2、终止《基金合同》；
- 3、转换基金运作方式；
- 4、更换基金管理人、基金托管人；
- 5、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- 6、基金管理人股东及其出资比例发生变更；
- 7、基金募集期延长；
- 8、基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动；
- 9、基金管理人的董事在一年内变更超过百分之五十；
- 10、基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过百分之三十；
- 11、涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼；
- 12、基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查；
- 13、基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚，基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚；
- 14、重大关联交易事项；
- 15、基金收益分配事项；
- 16、基金管理费、基金托管费、销售服务费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- 17、基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；
- 18、基金改聘会计师事务所；
- 19、变更基金销售机构；
- 20、更换基金登记机构；
- 21、本基金开始办理申购、赎回；
- 22、本基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；
- 23、本基金发生巨额赎回并延期办理；
- 24、本基金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、调整本基金的基金份额设置；
- 27、中小企业私募债券的交易信息；
- 28、中国证监会或基金合同规定的其他事项。

#### （八）澄清公告

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

#### （九）基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

#### （十）基金投资中小企业私募债券的相关披露

1、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体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。

2、基金管理人应当在基金的季度报告、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。

#### （十一）股指期货交易情况的相关披露

基金在季度报告、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。

#### （十二）国债期货交易情况的相关披露

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

#### （十三）投资资产支持证券的相关披露

基金管理人应在本基金半年度报告及年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内所有的资产支持证券明细。

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

#### （十四）投资非公开发行股票的相关披露

基金管理人在本基金投资非公开发行股票后2个交易日内，在中国证监会指定媒介披露所投资非公开发行股票的名称、数量、总成本、账面价值，以及总成本和账面价值占基金资产净值的比例、锁定期等信息。

#### （十五）中国证监会规定的其他信息

### 六、信息披露事务管理

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

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

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、各类基金份额的基金份额净值、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10年。

### 七、信息披露文件的存放与查阅



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

- （一）不可抗力；
- （二）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；
- （三）法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的情况。

## 第十八部分 风险揭示

证券投资基金（以下简称“基金”）是一种长期投资工具，其主要功能是分散投资，降低投资单一证券所带来的个别风险。基金不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具，投资者购买基金，既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益，也可能承担基金投资所带来的损失。

基金在投资运作过程中可能面临各种风险，既包括市场风险，也包括基金自身的管理风险、技术风险和合规风险等。巨额赎回风险是开放式基金所特有的一种风险，即当单个交易日基金的净赎回申请超过基金总份额的百分之十时，投资者将可能无法及时赎回持有的全部基金份额。

基金分为股票型基金、混合型基金、债券型基金、货币市场基金等不同类型的基金，投资者投资不同类型的基金将获得不同的收益预期，也将承担不同程度的风险。一般来说，基金的收益预期越高，投资者承担的风险也越大。

投资者应当充分了解基金定期定额投资和零存整取等储蓄方式的区别。定期定额投资是引导投资者进行长期投资、平均投资成本的一种简单易行的投资方式。但是定期定额投资并不能规避基金投资所固有的风险，不能保证投资者获得收益，也不是替代储蓄的等效理财方式。

投资者应当认真阅读本基金基金合同、招募说明书等基金法律文件，了解本基金的风险收益特征，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资者的风险承受能力相适应。

投资者应当通过本基金管理人或代销机构购买和赎回基金，基金代销机构名单详见本基金的招募说明书以及相关公告。

本基金在募集期内按1.00元面值发售并不改变基金的风险收益特征。投资者按1.00元面值购买基金份额以后，有可能面临基金份额净值跌破1.00元、从而遭受损失的风险。

### 一、本基金面临的主要风险

本基金为混合型基金，基金的预期风险与预期收益水平高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险收益特征的投资品种。

### （一）市场风险

市场风险是指证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响而变化，导致收益水平存在的不确定性。市场风险主要包括：

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

2、经济周期风险。随经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化。基金投资于债券与上市公司的股票，收益水平也会随之变化，从而产生风险。

3、利率风险。金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着债券的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。基金投资于债券和股票，其收益水平会受到利率变化的影响。

4、上市公司经营风险。上市公司的经营好坏受多种因素影响，如管理能力、财务状况、市场前景、行业竞争、人员素质等，这些都会导致企业的盈利发生变化。如果基金所投资的上市公司经营不善，其股票价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，使基金投资收益下降。虽然基金可以通过投资多样化来分散这种非系统风险，但不能完全规避。

5、信用风险。主要是指债务人的违约风险，若债务人经营不善，资不抵债，债权人可能会损失掉大部分的投资，这主要体现在企业债中。

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

7、债券收益率曲线风险。债券收益率曲线风险是指与收益率曲线非平行移动有关的风险，单一的久期指标并不能充分反映这一风险的存在。

8、再投资风险。再投资风险反映了利率下降对固定收益证券利息收入再投资收益的影响，这与利率上升所带来的价格风险（即前面所提到的利率风险）互为消长。具体为当利率下降时，基金从投资的固定收益证券所得的利息收入进行再投资时，将获得比之前较少的收益率。

9、波动性风险。波动性风险主要存在于可转债的投资中，具体表现为可转债的价格受到其相对应股票价格波动的影响，同时可转债还有信用风险。转股

风险指相对应股票价格跌破转股价，不能获得转股收益，从而无法弥补当初付出的转股期权价值。

## （二）管理风险

在基金管理运作过程中，基金管理人的知识、技能、经验、判断等主观因素会影响其对相关信息和经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平。

## （三）流动性风险

流动性风险可视为一种综合性风险，它是其他风险在基金管理和公司整体经营方面的综合体现。中国的证券市场还处在初期发展阶段，在某些情况下某些投资品种的流动性不佳，由此可能影响到基金投资收益的实现。开放式基金要随时应对投资者的赎回，如果基金资产不能迅速转变成现金，或者变现为现金时使资金净值产生不利的影响，都会影响基金运作和收益水平。尤其是在发生巨额赎回时，如果基金资产变现能力差，可能会产生基金仓位调整的困难，导致流动性风险，可能影响基金份额净值。

## （四）本基金的特有风险

### 1、金融衍生品投资风险

本基金投资股指期货、国债期货等金融衍生品。金融衍生品是一种金融合约，其价值取决于一种或多种基础资产或指数，其评价主要源自于对挂钩资产的价格与价格波动的预期。投资于衍生品需承受市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险和法律风险等。由于衍生品通常具有杠杆效应，价格波动比标的工具更为剧烈，有时候比投资标的资产要承担更高的风险。并且由于衍生品定价相当复杂，不适当的估值有可能使基金资产面临损失风险。

### 2、中小企业私募债投资风险

本基金投资中小企业私募债，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。当发债主体信用质量恶化或者本基金需要被动卖出中小企业私募债时，受市场流动性

所限，本基金可能无法以较好的价格卖出所持有的中小企业私募债，由此可能给基金净值带来更大的负面影响。

#### （五）操作或技术风险

相关当事人在业务各环节操作过程中，因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险，例如，越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误、IT系统故障等风险。

在开放式基金的各种交易行为或者后台运作中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致基金份额持有人的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理公司、登记机构、代销机构、证券交易所、证券登记结算机构等。

#### （六）合规性风险

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

#### （七）其他风险

1、战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致基金资产的损失。

2、金融市场危机、行业竞争、代理商违约、托管行违约等超出基金管理人自身直接控制能力之外的风险，也可能导致基金或者基金份额持有人利益受损。

## 二、声明

本基金未经任何一级政府、机构及部门担保。基金投资者自愿投资于本基金，须自行承担投资风险。

除基金管理人直接办理本基金的销售外，本基金还通过基金代销机构代理销售，但是，基金资产并不是代销机构的存款或负债，也没有经基金代销机构担保收益，代销机构并不能保证其收益或本金安全。

## 第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产清算

### 一、基金合并

本基金与其他基金合并应当按照法律法规规定的程序执行。

### 二、《基金合同》的变更

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

（二）关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议经中国证监会备案，自决议生效后两日内在指定媒介公告。

### 三、《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

（一）基金份额持有人大会决定终止的；

（二）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；

（三）连续六十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元，基金合同自动终止（不需召开基金份额持有人大会审议）；

（四）《基金合同》约定的其他情形；

（五）相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### 四、基金财产的清算

（一）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。

（二）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。

（三）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。

（四）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。

（五）基金财产清算的期限为6个月。

## 五、清算费用

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

## 六、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。

## 七、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。

## 八、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。

## 第二十部分 基金合同摘要

### 一、基金合同当事人的权利义务

#### （一）基金管理人

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、法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人的利益；
- （7）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- （8）选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；
- （9）担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；
- （10）依据《基金合同》及有关法律、法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）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；
- （14）选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商、期货经纪机构或其他为基金提供服务的外部机构；



（15）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；

（16）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，法律法规另有规定的从其规定；

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

（18）组织并参加基金财产清算小组，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存款利息在基金募集期结束后30日内退还基金认购人；

（25）执行生效的基金份额持有人大会的决议；

（26）建立并保存基金份额持有人名册；

（27）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## （二）基金托管人

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，为基金开设资金账户、证券账户、期货账户等投资所需的账户，为基金办理证券、期货交易资金清算；

（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、期货账户等投资所需账户，按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

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

（8）复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、赎回价格；

（9）办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

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

### （三）基金份额持有人

基金投资人持有本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受，基金投资人自依据《基金合同》取得基金份额，即成为本基金份额持有人

和《基金合同》的当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为《基金合同》当事人并不以在《基金合同》上书面签章或签字为必要条件。

每份基金份额具有同等的合法权益。

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

- (1) 分享基金财产收益；
- (2) 参与分配清算后的剩余基金财产；
- (3) 依法申请赎回或转让其持有的基金份额；
- (4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会；
- (5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- (6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- (7) 监督基金管理人的投资运作；
- (8) 对基金管理人、基金托管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

- (1) 认真阅读并遵守《基金合同》、招募说明书等信息披露文件；
- (2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；
- (3) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；
- (4) 缴纳基金认购、申购、赎回款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；
- (5) 在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》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

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。

本基金未设立基金份额持有人大会日常机构，本基金可根据运作需要依据相关法律法规以及监管机构有关规定增设基金份额持有人大会日常机构。

### （一）召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会，法律法规、基金合同或中国证监会另有规定无需召开基金份额持有人大会的除外：

（1）终止《基金合同》；但如连续六十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元，本基金合同自动终止，不需召开基金份额持有人大会审议；

（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或销售服务费（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10%以上（含10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；

（12）对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

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

2、在不违背法律法规和基金合同的约定，以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，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、销售服务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）调整本基金的申购费率、调低赎回费率、变更收费方式、调整本基金的基金份额类别的设置；

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

（二）会议召集人及召集方式

1、除法律法规规定或《基金合同》另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集；

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集；

3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集，并自出具书面决定之日起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10%以上（含10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额10%以上（含10%）

的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合；

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

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

（三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

- （1）会议召开的时间、地点和会议形式；
- （2）会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；
- （3）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
- （4）授权委托证明的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；
- （5）会务常设联系人姓名及联系电话；
- （6）出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- （7）召集人需要通知的其他事项。

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

3、如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监



督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。

#### （四）基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式或法律法规及监管机关允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

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

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

（2）经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的50%（含50%）；

参加基金份额持有人大会的基金份额持有人的基金份额低于前述规定比例的，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应当有代表三分之一以上（含三分之一）基金份额的基金份额持有人或其代理人参加，方可召开。

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

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

（2）召集人按基金合同约定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取表决意见的，不影响表决效力；

（3）本人直接出具意见或授权他人代表出具意见的，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50%（含50%）；

参加基金份额持有人大会的基金份额持有人的基金份额低于前述规定比例的，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应当有代表三分之一以上（含三分之一）基金份额的基金份额持有人直接出具意见或授权他人代表出具意见；

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

3、在法律法规或监管机构允许的情况下，经会议通知载明，基金份额持有人也可以采用网络、电话或其他方式进行表决，或者采用网络、电话或其他方式授权他人代为出席会议并表决。

4、在会议召开方式上，本基金亦可采用其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开基金份额持有人大会，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行，具体方式由会议召集人在会议通知中列明。

#### （五）议事内容与程序

##### 1、议事内容及提案权

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

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

##### 2、议事程序

###### （1）现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决

议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的50%以上（含50%）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5个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

## （六）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1、一般决议，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的50%以上（含50%）通过方为有效；除下列第2项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

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

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时监督员及公证机关均认为有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具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。

#### （七）计票

##### 1、现场开会

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

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

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

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

##### 2、通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

#### （八）生效与公告

基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会备案。基金份额持有人大会决议自表决通过之日生效，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。

（九）本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规的部分，如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的，或法律法规增加新的持有人大会机制的，基金管理人提前公告后，可直接对本部分内容进行修改、调整或补充，无需召开基金份额持有人大会审议。

（十）法律法规或监管部门对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

### 三、基金收益与分配

#### （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，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利按除权日经除权后的基金份额净值自动转为相应类别的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、由于本基金A类基金份额不收取销售服务费，而C类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同，基金管理人可对各类别基金份额分别制定收益分配方案，本基金同一类别的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。

在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

#### （四）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截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

若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的，当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。

### 四、基金费用与税收

#### （一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金销售服务费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；

6、基金份额持有人大会费用（包括但不限于会计师费、律师费和公证费）；

7、基金的证券、期货交易费用；

8、基金的银行汇划费用；

9、基金的开户费用、账户维护费用；

10、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

## （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0.70%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.70\% \div \text{当年天数}$$

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，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前2-5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

### 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0.15%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前2-5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

### 3、基金销售服务费

本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年费率为0.30%。

销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值的0.30%年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月前10个工作日内从基金财产一次性支付给基金管理人，经基金管理人代付给各个基金销售机构。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

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

### （三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

### （四）基金管理费和基金托管费的调整

经基金管理人和基金托管人协商一致，基金管理人和基金托管人可协商酌情降低基金管理费和基金托管费，此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。基金管理人应依照《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的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## 五、基金财产的投资方向和投资限制

### （一）投资目标



在有效控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置和组合管理，力争获得超越业绩比较基准的投资收益。

## （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（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、中小企业私募债券、可转换债券（含可分离交易可转换债券）及其他经中国证监会允许投资的债券或票据）、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、国债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）。

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。如法律法规或中国证监会变更投资品种的比例限制，基金管理人可依据相关规定履行适当程序后相应调整本基金的投资比例限制规定。

基金的投资组合比例为：本基金股票占基金资产的比例为0% - 95%；每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的5%。

## （三）投资限制

### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

- （1）本基金股票占基金资产的比例为0% - 95%；
- （2）每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，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；
- （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%，本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年，债券回购到期后不得展期；

（15）本基金在任何交易日日终，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%；在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%；本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约定；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交易日基金资产净值的20%；

（16）本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的15%；在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不

得超过基金持有的债券总市值的30%；在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的30%。

（17）在任何交易日日终，持有的买入国债期货和股指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）基金总资产不得超过基金净资产的140%

（19）本基金投资于单只中小企业私募债券的市值，不得超过本基金资产净值的10%；

（20）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、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整，但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，基金的投资范围、投资策略应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本基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准，无需召开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）向其基金管理人、基金托管人出资；
- （5）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；
- （6）法律、行政法规和国务院证券监督管理机构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的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

如法律法规和监管部门取消上述禁止性规定，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金不受上述规定的限制。

## 六、基金资产净值的计算方法和公告方式

### （一）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。

### （二）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）对在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（另有规定的除外），选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；

（3）对在交易所市场上市交易的可转换债券，按估值日收盘价减去可转换债券收盘价中所含债券应收利息后得到的净价进行估值；

（4）交易所市场挂牌转让的资产支持证券，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区分如下情况处理：

（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。

（4）对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，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；

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，采用第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值。

4、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

5、本基金投资股指期货与国债期货合约，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。

6、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。

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。

8、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。

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見，按照基金管理人對基金資產淨值的計算結果對外予以公布。

### （三）基金資產淨值、各類基金份額淨值

《基金合同》生效後，在開始辦理基金份額申購或者贖回前，基金管理人應當至少每周公告一次基金資產淨值和各類基金份額的基金份額淨值。

在開始辦理基金份額申購或者贖回後，基金管理人應當在每個開放日的次日，通過網站、基金份額發售網點以及其他媒介，披露開放日的各類基金份額的基金份額淨值和基金份額累計淨值。

基金管理人應當公告半年度和年度最後一個市場交易日基金資產淨值和各類基金份額的基金份額淨值。基金管理人應當在前款規定的市場交易日的次日，將基金資產淨值、各類基金份額的基金份額淨值和各類基金份額累計淨值登載在指定媒介上。

## 七、基金合同的变更、终止与基金资产的清算

### （一）基金合并

本基金与其他基金合并应当按照法律法规规定的程序执行。

### （二）《基金合同》的变更

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

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议应当报中国证监会备案，且自决议生效后两日內在指定媒介公告。

### （三）《基金合同》的终止事由

有下列情形之一，《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、连续六十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金資產淨值低於五千萬圓，基金合同自动终止（不需召开基金份额持有人大会审议）；

- 4、《基金合同》约定的其他情形；
- 5、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

#### （四）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。

#### （五）清算费用

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

#### （六）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。

#### （七）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。

（八）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。

八、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国际经济贸易仲裁委员会（上海国际仲裁中心），根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为上海。仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力。除非仲裁裁决另有规定，仲裁费用由败诉方承担。

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

《基金合同》受中国法律（为本基金合同之目的，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区法律）管辖。

九、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

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



## 第二十一部分 托管协议摘要

### 一、托管协议当事人

#### （一）基金管理人

名称：国海富兰克林基金管理有限公司

注册地址：广西南宁市西乡塘区总部路1号中国—东盟科技企业孵化基地一期C-6栋二层

办公地址：上海市浦东新区世纪大道8号国金中心二期9层

邮政编码：200120

法定代表人：吴显玲

成立时间：2004年11月15日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监基金字[2004]145号

组织形式：有限责任公司

注册资本：2.2亿元人民币

存续期间：50年

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它业务。

#### （二）基金托管人

名称：兴业银行股份有限公司

注册地址：福州市湖东路154号

办公地址：上海市江宁路168号

法定代表人：高建平

成立日期：1988年8月26日

基金托管业务批准文号：证监基金字[2005]74号

组织形式：股份有限公司

注册资本：190.52亿元人民币

存续期间：持续经营

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；代理发行股票以外的有价证券；买卖、代理买卖股票以外的有价证券；资产托管业务；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；结汇、售汇业务；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱服务；财务顾问、资信调查、咨询、见证业务；经中国银行业监督管理委员会批准的其他业务（以上范围凡涉及国家专项专营规定的从其规定）。

## 二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

（一）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、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（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、中小企业私募债券、可转换债券（含可分离交易可转换债券）及其他经中国证监会允许投资的债券或票据）、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、国债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）。

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。如法律法规或中国证监会变更投资品种的比例限制，基金管理人可依据相关规定履行适当程序后相应调整本基金的投资比例限制规定。

基金托管人系统暂不支持国债期货实物交割，待基金托管人系统实现功能后，基金管理人再行办理国债期货实物交割业务。

基金的投资组合比例为：本基金股票占基金资产的比例为0% - 95%；每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的5%。

（二）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督：

- 1、本基金股票占基金资产的比例为0% - 95%；
- 2、每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，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；
- 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%；本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年，债券回购到期后不得展期；

15、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%；本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约定；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交易日基金资产净值的20%；；

16、本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的15%；持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的30%；；本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的30%；

17、在任何交易日日终，持有的买入国债期货和股指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、基金总资产不得超过基金净资产的140%

19、本基金投资于单只中小企业私募债券的市值，不得超过本基金资产净值的10%；

20、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、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整，但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，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。

法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准，无需召开基金份额持有人大会审议。

（三）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对本托管协议第十五章第（九）条规定的基金投资禁止行为进行监督。基金托管人通过事后监督方式对基金管理人基金投资禁止行为进行监督。

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

1、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债券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、本基金适用的银行间债券市场交易对手的名单，并按照审慎的风险控制原则在该名单中约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金托管人在收到名单后2个工作日内回函确认收到该名单。基金管理人应定期或不定期对银行间债券市场现券及回购交易对手的名单进行更新，名单中增加或减少银行间债券市场交易对手时须向基金托管人提出书面申请，基金托管人于2个工作日内回函确认收到后，对名单进行更新。基金管理人收到基金托管人书面确认后，被确认调整的名单开始生效，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。

如果基金托管人发现基金管理人与不在名单内的银行间债券市场交易对手进行交易，应及时提醒基金管理人撤销交易，经提醒后基金管理人仍执行交易并造成基金财产损失的，由基金管理人承担相应责任，基金托管人不承担责任，发生此种情形时，基金托管人有权报告中国证监会。

2、基金托管人对于基金管理人参与银行间债券市场交易的交易方式的控制

基金管理人在银行间债券市场进行现券买卖和回购交易时，需按交易对手名单中约定的该交易对手所适用的交易结算方式进行交易。如果基金托管人发现基金管理人没有按照事先约定的有利于信用风险控制的方式进行交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人与交易对手重新确定交易方式，经提醒后仍未改正时造成基金财产损失的，由基金管理人承担相应责任，基金托管人不承担责任，法律法规另有规定的除外。

3、基金管理人向基金托管人提供银行间债券市场交易对手名单。基金管理人有责任控制交易对手的资信风险，在与银行间债券市场交易对手名单以外的交易对手进行交易时，由于交易对手资信风险引起的损失先由基金管理人承担，其后有权要求相关责任人进行赔偿，如果基金托管人在运作中严格遵循了上述监督流程，则对于由于交易对手资信风险引起的损失，不承担赔偿责任。在基金管理人与银行间债券市场交易对手名单中的交易对手，以约定适用的交

易方式进行交易的情况下，由于交易对手资信风险引起的损失，基金管理人不承担责任，但基金管理人有权要求相关责任人进行赔偿。

（五）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资流通受限证券进行监督。

1、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。

2、流通受限证券，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。

3、在首次投资流通受限证券之前，基金管理人应当制定相关投资决策流程、风险控制等规章制度并提供给基金托管人。基金管理人应当根据基金的投资风格和流动性的需要合理安排流通受限证券的投资比例，并在相关制度中明确具体比例，避免基金出现流动性风险。基金投资非公开发行股票，基金管理人还应提供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。

4、在投资流通受限证券之前，基金管理人应至少提前一个交易日向基金托管人提供有关流通受限证券的相关信息，具体应当包括但不限于如下文件(如有)：

拟发行数量、定价依据、监管机构的批准证明文件复印件、基金管理人与承销商签订的销售协议复印件、缴款通知书、基金拟认购的数量、价格、总成本、划款账号、划款金额、划款时间文件等。基金管理人应保证上述信息的真实、完整。

5、基金管理人应在本基金投资非公开发行股票后两个交易日内，在中国证监会指定媒介披露所投资非公开发行股票的名称、数量、总成本、账面价值，以及总成本和账面价值占基金资产净值的比例、锁定期等信息。

6、基金托管人应对基金管理人是否遵守法律法规进行监督，并审核基金管理人提供的有关书面信息。基金托管人认为上述资料可能导致基金出现风险的，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。如果基金托管人没有切实履行监督职责，导致基金出现风险，基金托管人应承担连带责任。

7、相关法律法规对基金投资流通受限证券有新规定的，从其规定。

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

本基金投资银行存款的信用风险主要包括存款银行的信用等级、存款银行的支付能力等涉及到存款银行选择方面的风险。基金管理人向基金托管人提供存款银行名单，本基金投资除存款银行名单以外的银行存款出现由于存款银行信用风险而造成的损失时，先由基金管理人负责赔偿，之后有权要求相关责任人进行赔偿，如果基金托管人在运作过程中遵循上述监督流程，则对于由于存款银行信用风险引起的损失，不承担赔偿责任。基金管理人与基金托管人协商一致后，可以根据当时的市场情况对存款银行名单进行调整。

（七）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资中期票据和中小企业私募债进行监督

1、基金管理人管理的基金在投资中期票据和中小企业私募债前，基金管理人应根据审慎原则，制定严格的关于投资中期票据和中小企业私募债的风险控制制度、流动性风险和信用风险处置预案，并书面提供给基金托管人，基金托管人依据上述文件对基金管理人投资中期票据和中小企业私募债的额度和比例进行监督。

2、如未来有关监管部门发布的法律法规对证券投资基金投资中期票据和中小企业私募债另有规定的，从其规定。

3、基金托管人有权监督基金管理人在相关基金投资中期票据和中小企业私募债时的法律法规遵守情况，有关制度、信用风险、流动性风险处置预案的完善情况，有关额度、比例限制的执行情况。基金托管人发现基金管理人的上述事项违反法律法规和基金合同以及本托管协议的规定，应及时以书面形式通知基金管理人纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人应按相关托管协议要求向基金托管人及时发出回函，并及时改正。基金托管人有权随时对所通知事项进行复查，督促基金管理人改正。如果基金管理人违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

（八）基金托管人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、各类基金份额的基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查。

（九）基金托管人发现基金管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作违反法律法规、基金合同和本托管协议的规定，应及时以电话提醒或书面提示等方式通知基金管理人限期纠正。

基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到书面通知后应及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函，就基金托管人的疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，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。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

（十）基金管理人应积极配合和协助基金托管人依照法律法规、基金合同和本托管协议对基金业务执行核查。

对基金托管人发出的书面提示，基金管理人应在规定时间内答复并改正，或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律法规、基金合同和本托管协议的要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

（十一）若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。



（十二）基金托管人发现基金管理人有关违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本托管协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的，基金托管人应报告中国证监会。

（十三）基金托管人依据有关法律法规的规定、基金合同和本托管协议的约定对于基金关联交易进行监督。

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，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先的原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

为履行上述信息披露义务，基金管理人和基金托管人应事先相互提供与本机构有控股关系的股东或与本机构有其他重大利害关系的关联方名单及其更新，加盖公章并书面提交，并确保所提供的关联方名单的真实性、完整性、全面性。名单变更后基金管理人或基金托管人应及时发送对方，基金管理人或基金托管人于2个工作日内电话或回函确认已知名单的变更。

### 三、基金管理人对基金托管人的业务核查

（一）基金管理人对基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户、证券账户、期货账户等投资所需账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和各类基金份额的基金份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

（二）基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、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、本托管协议及其他有关规定时，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正。

基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式给基金管理人发出回函，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，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，在规定时间内答复基金管理人并改正。

（三）基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金托管人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

基金托管人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本托管协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经基金管理人提出警告仍不改正的，基金管理人应报告中国证监会。

#### 四、基金财产的保管

##### （一）基金财产保管的原则

- 1、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产；
- 2、基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户、证券账户和期货账户等投资所需账户；
- 3、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与独立；
- 4、基金托管人按照基金合同和本托管协议的约定保管基金财产，如有特殊情况双方可另行协商解决；
- 5、对于因为基金投资产生的应收资产，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，到账日基金财产没有到达基金账户的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金财产造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金财产的损失，基金托管人应予以必要的协助与配合，但对此不承担任何责任；

6、基金托管人应安全、完整地保管基金资产；未经基金管理人的正当指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何资产。不属于基金托管人实际有效控制下的实物证券的损坏、灭失，基金托管人不承担责任。

7、基金托管人对因为基金管理人投资产生的存放或存管在基金托管人以外机构的基金财产，由于该等机构或该等机构会员单位等本托管协议当事人外第三方的欺诈、疏忽、过失或破产等原因给基金财产造成的损失等不承担责任。

8、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。

## （二）基金募集期间及募集资金的验资

1、基金募集期间募集的资金应存于基金管理人在具有托管资格的商业银行开立的“基金募集专户”。该账户由基金管理人开立并管理。

2、基金募集期满或基金停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》、基金合同等有关规定后，基金管理人应将属于基金财产的全部资金划入基金托管人开立的基金银行账户，同时在规定时间内，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。出具的验资报告由参加验资的2名或2名以上中国注册会计师签字方为有效。

3、若基金募集期限届满，未能达到基金合同生效的条件，由基金管理人按规定办理退款等事宜，基金托管人应给予充分的协助与配合。

## （三）基金银行账户（“基金托管专户”）的开立和管理

1、基金托管人以托管人的名义开设基金托管专户，保管基金财产的银行存款。该基金托管专户同时也是基金托管人在法人集中清算模式下，代表所托管的包括本基金财产在内的所有托管资产与中国证券登记结算有限责任公司进行一级结算的专用账户。该账户的开设和管理由基金托管人承担。本基金的一切货币收支活动，均需通过基金托管人的基金托管专户进行。基金托管人可根据实际情况需要，为本基金开立资金清算辅助账户，以办理相关的资金汇划业务。基金管理人应当在开户过程中给予必要的配合，并提供所需资料。

2、基金银行账户的开立和使用，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任何其他银行账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

3、基金银行账户的开立和管理应符合《人民币银行结算账户管理办法》、《现金管理暂行条例》、《人民币利率管理规定》、《利率管理暂行规定》、《支付结算办法》以及银行业监督管理机构的有关规定。

（四）基金证券账户和结算备付金账户的开立和管理

1、基金托管人在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司为基金开立基金托管人与基金联名的证券账户。

2、基金证券账户的开立和使用，仅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或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。

3、基金证券账户的开立和证券账户卡的保管由基金托管人负责，账户资产的管理和运用由基金管理人负责。

4、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，并代表所托管的基金完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级法人清算工作，基金管理人应予以积极协助。结算备付金、结算互保基金、交收价差资金等的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

5、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，若无相关规定，则基金托管人比照上述关于账户开立、使用的规定执行。

（五）债券托管专户的开设和管理

基金合同生效后，基金托管人根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司的有关规定，以本基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司与银行间市场清算所股份有限公司开立债券托管账户，并代表基金进行银行间市场债券的结算。

（六）股指期货、国债期货的相关账户的开立和管理

基金管理人、基金托管人应当按照相关规定开立期货结算账户、期货资金账户，在中国金融期货交易所获取交易编码。期货结算账户名称、期货资金账户名称及交易编码对应名称应按照规定设立。

（七）其他账户的开立和管理

1、因业务发展需要而开立的其他账户，可以根据法律法规和基金合同的规定，由基金托管人负责开立。新账户按有关规定使用并管理。

2、基金托管人可根据实际情况需要，为本基金开立资金清算辅助账户，以办理相关的资金汇划业务。基金管理人应当在开户过程中给予必要的配合，并提供所需资料。

3、法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定。

#### （八）基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的有关实物证券等有价凭证由基金托管人存放于基金托管人的保管库，也可存入中央国债登记结算有限责任公司、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，保管凭证由基金托管人持有。实物证券等有价凭证的购买和转让，由基金管理人和基金托管人共同办理。属于基金托管人实际有效控制下的实物证券在基金托管人保管期间的损坏、灭失，由此产生的责任应由基金托管人承担。基金托管人对由基金托管人以外机构实际有效控制的证券不承担保管责任。

#### （九）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、与基金财产有关的重大合同的原件分别由基金管理人、基金托管人保管。除本托管协议另有规定外，基金管理人代表基金签署与基金财产有关的重大合同时应保证基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人应在重大合同签署后及时将重大合同传真给基金托管人，并及时将正本送达基金托管人处。因基金管理人发送的合同传真件与事后送达的合同原件不一致所造成的后果，由基金管理人负责。重大合同的保管期限为基金合同终止后15年。

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。

### 五、基金资产净值计算和会计核算

#### （一）基金资产净值的计算、复核与完成的时间及程序

##### 1、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。

基金份额净值是指按照每个交易日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到0.0001元，小数点后第5位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人每个交易日计算基金资产净值及各类基金份额的基金份额净值，经基金托管人复核无误后，按规定公告。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。

## 2、复核程序

基金管理人每个交易日对基金资产进行估值后，将各类基金份额的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。

3、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，仍无法达成一致意见的，按照基金管理人计算的结果对外予以公布。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。

## （二）基金资产估值方法和特殊情形的处理

### 1、估值对象

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

### 2、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的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) 对在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（另有规定的除外），选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；

3) 对在交易所市场上市交易的可转换债券，按估值日收盘价减去可转换债券收盘价中所含债券应收利息后得到的净价进行估值；

4) 交易所市场挂牌转让的资产支持证券和中小企业私募债，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。

(2) 处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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。

4) 对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，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。

(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，采用第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值。

(4) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

(5) 本基金投资股指期货与国债期货合约，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。

(6) 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。

(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。

(8) 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。

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。

### 3、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（8）项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

（2）由于证券、期货交易所及登记机构发送的数据错误，有关会计制度变化或者由于其他不可抗力等，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、基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

#### （三）基金份额净值错误的处理方式

1、当基金份额净值小数点后4位以内（含第4位）发生差错时，视为基金份额净值错误；基金份额净值出现错误时，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；错误偏差达到或超过基金份额净值的0.25%时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到基金份额净值的0.5%时，基金管理人应当公告，并报中国证监会备案；当发生基金份额净值计算错误时，由基金管理人负责处理，由此给基金份额持有人和基金造成的直接损失，应由基金管理人先行赔付，基金管理人按差错情形，有权向其他当事人追偿。

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

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

（2）若基金管理人计算的基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告，而且基金托管人未对计算过程提出疑义或要求基金管理人书面说明，基金份额净值出错且造成基金份额持有人的损失，应根据法律法规的规定对基金份额持



有人或基金支付赔偿金，就实际向基金份额持有人或基金支付的赔偿金额，基金管理人及基金托管人按照管理费和托管费的比例各自承担相应的责任。

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

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

3、基金管理人和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差，以基金管理人计算结果为准。

4、前述内容如法律法规或者监管部门另有规定的，从其规定。如果行业另有通行做法，双方当事人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商。

#### （四）暂停估值与公告基金份额净值的情形

1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

3、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

#### （五）基金会计制度

按国家有关部门规定的会计制度执行。

#### （六）基金账册的建立

基金管理人进行基金会计核算并编制基金财务会计报告。基金管理人、基金托管人分别独立地设置、记录和保管本基金的全套账册。若基金管理人和基金托管人对会计处理方法存在分歧，应以基金管理人的处理方法为准。若当日核对不符，暂时无法查找到错账的原因而影响到基金资产净值的计算和公告的，以基金管理人的账册为准。

#### （七）基金财务报表与报告的编制和复核

1、财务报表的编制

基金财务报表由基金管理人编制，基金托管人复核。

## 2、报表复核

基金托管人在收到基金管理人编制的基金财务报表后，进行独立的复核。核对不符时，应及时通知基金管理人共同查出原因，进行调整，直至双方数据完全一致。

## 3、财务报表的编制与复核时间安排

### （1）报表的编制

基金管理人应当在每月结束后5个工作日内完成月度报表的编制；在每个季度结束之日起15个工作日内完成基金季度报告的编制；在上半年结束之日起60日内完成基金半年度报告的编制；在每年结束之日起90日内完成基金年度报告的编制。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。基金合同生效不足两个月的，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。

### （2）报表的复核

基金管理人在月度报表完成当日，将报表盖章后提供给基金托管人复核；基金托管人在收到后应在3日内进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在季度报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后5个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在半年度报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后15日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在年度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人应在收到后20日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人和基金托管人之间的上述文件往来均以传真或双方商定的其他方式进行。

基金托管人在复核过程中，发现双方的报表存在不符时，基金管理人和基金托管人应共同查明原因，进行调整，调整以国家有关规定为准。核对无误后，基金托管人在基金管理人提供的报告上加盖业务印鉴或者出具加盖托管业务部门公章的复核意见书，双方各自留存一份。如果基金管理人与基金托管人不能于应当发布公告之日之前就相关报表达成一致，基金管理人有权按照其编制的报表对外发布公告，基金托管人有权就相关情况报中国证监会备案。

基金托管人在对财务会计报告、半年报告或年度报告复核完毕后，需盖章确认或出具相应的复核确认书，以备有权机关对相关文件审核时提示。

## 第二十二部分 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，并将根据基金份额持有人的需要和市场的变化增加、修改这些服务项目。主要的服务项目如下：

### 一、基金份额注册登记服务

本基金管理人同时兼任本基金的登记机构，在公司内部设立了专门的运营部门负责基金份额持有人的注册与过户登记业务，配备先进、高效的电脑系统及通讯系统，准确、及时地为基金份额持有人办理基金账户业务、汇总和储存并管理基金的所有认购、申购和赎回信息，确保基金份额持有人的注册与过户登记工作的准确和顺利进行。

### 二、资料寄送

1、每次申购交易结束后，投资者可在 T+2 个工作日后通过销售机构的网点查询和打印交易确认单；

2、每次认购交易结束后，投资者可在 T+2 个工作日后通过销售机构的网点查询交易情况，最终确认份额以基金成立后的确认份额为准。

3、本公司默认的对账单方式为月度电子邮件形式对账单，投资者也可选择月度短信对账单。我司将在每月结束后的 5 个工作日内向投资者发送基金账户对账单。本公司提示，凡无法接收电子邮件对账单的投资者，须在开户成功后与本公司客户服务中心联系（4007004518（免长途费）、95105680（免长途费）和021-38789555），我们在核对投资者联系方式完整无误后，可为基金投资者提供上述对账单服务。

### 三、红利再投资

本基金收益分配时，基金份额持有人可以选择将所获红利再投资于本基金，注册登记机构将其所获红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额。红利再投资免收申购费用。基金份额持有人可以随时选择更改基金分红方式。

### 四、定期定额投资

本基金将通过销售机构为基金份额持有人提供定期定额投资的服务，即基

金份额持有人可通过固定的渠道，采用定期定额的方式申购基金份额。定期定额投资不受最低申购金额限制，具体实施时间和业务规则详见相关公告。

## 五、资讯服务

### 1、手机短信提醒服务

投资者在申请开立本公司基金账户时可预留手机号码，由此可获得本公司手机短信提醒服务。内容包括基金新产品、基金新服务、基金资讯信息及交易确认情况等。

### 2、电子邮件服务

投资者可以在本基金管理人网站注册，登录定制所需要的各类公开信息。如果留下个人邮箱，将会收到定制的信息。

## 六、客户服务中心

### 1、客户服务电话

呼叫中心自动语音系统提供每周7天、每天24小时的自助语音服务和查询服务，客户可通过电话收听最新公告信息、基金份额净值、自助查询基金账户余额信息、交易确认情况等。同时，呼叫中心在工作时间提供人工应答服务。

### 2、网上客户服务中心

网上“基金账户查询”功能为基金份额持有人提供查询、资讯服务以及相互交流的平台。注册登录后，基金份额持有人可以查询个人账户资料，包括基金持有情况、基金交易明细、基金分红实施情况等；此外，还可以修改个人账户资料，查询热点问题及其解答，查阅投资刊物，或提交投诉和建议等。

公司网址：[WWW.FTSFUND.COM](http://WWW.FTSFUND.COM)

电子信箱：[SERVICE@FTSFUND.COM](mailto:SERVICE@FTSFUND.COM)

## 七、客户投诉处理

基金份额持有人可以通过基金管理人提供的网上投诉栏目、呼叫中心自动语音留言、呼叫中心人工坐席、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。基金份额持有人还可以通过代销机构的服务电话对该代销机构提供的服务进行投诉。

## 八、服务渠道

1、咨询电话：4007004518（免长途费）、95105680（免长途费）和 021-3878 9555

2、网站及在线客服：WWW.FTSFUND.COM

3、传真：021-6887 0708

4、电邮：SERVICE@FTSFUND.COM

5、其他，如邮寄等

## 第二十三部分 其他应披露事项

1、2017年3月28日，富兰克林国海新收益灵活配置混合型证券投资基金2016年年度报告；

2、2017年4月21日，富兰克林国海新收益灵活配置混合型证券投资基金2017年第1季度报告；

3、2017年5月5日，关于增加同花顺基金为国海富兰克林基金旗下基金代销机构并开通转换业务、定期定额投资业务及参加费率优惠活动的公告；

4、2017年5月18日，关于增加肯特瑞为国海富兰克林基金旗下基金代销机构并开通转换业务、定期定额投资业务及参加费率优惠活动的公告；

5、2017年6月10日，国海富兰克林基金管理有限公司关于富兰克林国海新收益灵活配置混合型证券投资基金基金份额净值计算位数变更及修改基金合同和托管协议的公告；

6、2017年6月24日，国海富兰克林基金管理有限公司高级管理人员变更公告2则；

7、2017年7月7日，关于增加一路财富（北京）信息科技股份有限公司为国海富兰克林基金旗下部分基金代销机构并开通转换业务、定期定额投资业务及相关费率优惠活动的公告；

8、2017年7月19日，富兰克林国海新收益灵活配置混合型证券投资基金2017年第2季度报告；

9、2017年8月4日，国海富兰克林基金管理有限公司关于网上直销平台开通中国银行企业理财直付通业务的公告；

10、2017年8月21日，关于新增珠海盈米财富管理有限公司为国海富兰克林基金旗下部分基金代销机构并开通转换业务、定期定额投资业务及开展相关费率优惠活动的公告；

11、2017年8月25日，国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金参加中泰证券股份有限公司网上渠道基金申购及定期定额投资手续费费率优惠活动的公告；

12、2017年8月25日，关于增加平安证券股份有限公司为国海富兰克林基金旗下部分基金代销机构并开通转换业务、定期定额投资业务及相关费率优惠活动的公告；

13、2017年8月31日，富兰克林国海新收益灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告。

## 第二十四部分 招募说明书的存放及查阅方式

招募说明书在编制完成后，将存放于基金管理人的住所、基金托管人的住所、有关销售机构及其网点，供公众查阅。投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。投资者也可在基金管理人指定的网站上进行查阅。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与公告的内容完全一致。



## 第二十五部分 备查文件

备查文件等文本存放在基金管理人、基金托管人和销售机构的办公场所和营业场所，在办公时间内可供免费查阅。

（一）中国证监会接受富兰克林国海新收益灵活配置混合型证券投资基金募集的注册文件

（二）《富兰克林国海新收益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

（三）《富兰克林国海新收益灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

（四）关于申请募集富兰克林国海新收益灵活配置混合型证券投资基金之法律意见书

（五）基金管理人业务资格批件、营业执照

（六）基金托管人业务资格批件、营业执照

（七）中国证监会要求的其他文件

国海富兰克林基金管理有限公司

2017年10月12日