

# 中欧基金管理有限公司

## 中欧纯债添利分级债券型证券投资基金 招募说明书

基金管理人：中欧基金管理有限公司

基金托管人：中国邮政储蓄银行股份有限公司

二零一三年十月

本基金经 2013 年 9 月 24 日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）下发的《关于核准中欧纯债添利分级债券型证券投资基金募集的批复》（证监许可[2013]1216 号文）核准，进行募集。

### 重要提示

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核准，但中国证监会对本基金募集的核准，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，但不保证投资本基金一定盈利，也不保证基金份额持有人的最低收益；因基金价格可升可跌，亦不保证基金份额持有人能全数取回其原本投资。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。

本基金投资于证券市场，基金资产净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资者在投资本基金前，需全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认（申）购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资者根据所持有份额享受基金的收益，但同时也需承担相应的投资风险。投资本基金可能遇到的风险包括：因政治、经济、社会等因素对证券价格波动产生影响而引发的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资者连续大量赎回基金份额产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金投资债券引发的信用风险，以及本基金投资策略所特有的风险等等。

本基金是债券型证券投资基金，属于具有中低预期风险、预期收益特征的基金品种，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金。

从投资者具体持有的基金份额来看，由于基金收益分配的安排，添利 A 将表现出低风险、收益稳定的明显特征，其预期收益和预期风险要低于普通的债券型基金份额；添利 B 则表现出高风险、高收益的显著特征，其预期收益和预期

风险要高于普通的债券型基金份额。

添利 A 场外认购的单笔最低认购金额为人民币 1,000 元；添利 B 场外认购的单笔最低认购金额为人民币 50,000 元，添利 B 场内认购的单笔最低认购份额为 50,000 份。

添利 A 与添利 B 两级基金的基金份额的初始配比原则上为 7:3。

添利 A 根据基金合同的规定获取约定收益，并在添利 B 的每个封闭运作期内每满半年开放一次，接受申购与赎回申请；在基金过渡期内，按照届时的情况，接受申购或赎回申请。本基金在扣除添利 A 的约定收益后的全部剩余收益归添利 B 享有，亏损以添利 B 的资产净值为限并由添利 B 承担；添利 B 根据基金合同的约定定期开放，接受申购与赎回申请，其余时间封闭运作。

添利 B 的每个封闭运作期内的添利 A 的每个赎回开放日，基金管理人将对添利 A 进行基金份额折算，添利 A 的基金份额参考净值调整为 1.000 元，基金份额持有人持有的添利 A 份额数按折算比例相应增减。添利 A 的基金份额折算基准日与赎回开放日为同一个工作日。

添利 A 约定收益率为一年期银行定期存款利率（税后）加利差。基金管理人并不承诺或保证每个开放日添利 A 份额持有人的约定应得收益，即如本基金资产出现极端损失，添利 A 仍可能面临无法取得约定应得收益乃至投资本金受损的风险。本基金净资产优先分配予添利 A 的本金及约定应得收益，剩余净资产分配予添利 B。

本基金可投资中小企业私募债券，中小企业私募债券是指中小微型企业在中国境内以非公开方式发行和转让，约定在一定期限还本付息的公司债券，其发行人是非上市中小微企业，发行方式为面向特定对象的私募发行。因此，中小企业私募债券较传统企业债的信用风险及流动性风险更大，从而增加了本基金整体的债券投资风险。

投资有风险，投资者在认（申）购本基金前应认真阅读本基金的《招募说明书》和《基金合同》。基金的过往业绩并不代表将来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。

## 目 录

第一部分 绪言.....	6
第二部分 释义.....	7
第三部分 基金管理人.....	12
第四部分 基金托管人.....	19
第五部分 相关服务机构.....	23
第六部分 基金份额的分级.....	37
第七部分 基金过渡期的安排.....	44
第八部分 基金的募集.....	51
第九部分 基金合同的生效.....	55
第十部分 基金份额的申购与赎回.....	56
第十一部分 基金份额的上市与交易.....	65
第十二部分 基金份额的登记.....	67
第十三部分 基金的投资.....	69
第十四部分 基金的财产.....	76
第十五部分 基金资产估值.....	77
第十六部分 基金费用与税收.....	82
第十七部分 基金的收益与分配.....	84
第十八部分 基金的会计与审计.....	85
第十九部分 基金的信息披露.....	86
第二十部分 风险揭示.....	92
第二十一部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算.....	98
第二十二部分 基金合同的内容摘要.....	100
第二十三部分 基金托管协议的内容摘要.....	101
第二十四部分 对基金份额持有人的服务.....	102
第二十五部分 其他应披露事项.....	103
第二十六部分 招募说明书的存放及查阅方式.....	104
第二十七部分 备查文件.....	105
附件一：基金合同摘要.....	106

附件二：基金托管协议摘要.....122

## 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》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《证券投资基金运作管理办法》（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》”）等有关法律法规及《中欧纯债添利分级债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

本招募说明书阐述了中欧纯债添利分级债券型证券投资基金（以下简称“本基金”或“基金”）的投资目标、策略、风险、费率等与投资者投资决策有关的全部必要事项，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

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

在本招募说明书中，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：指中欧纯债添利分级债券型证券投资基金
- 2、基金管理人：指中欧基金管理有限公司
- 3、基金托管人：指中国邮政储蓄银行股份有限公司
- 4、基金合同：指《中欧纯债添利分级债券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《中欧纯债添利分级债券型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
- 6、招募说明书或本招募说明书：指《中欧纯债添利分级债券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《中欧纯债添利分级债券型证券投资基金基金份额发售公告》
- 8、上市交易公告书：指《中欧纯债添利分级债券型证券投资基金之添利 B 份额上市交易公告书》
- 9、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
- 10、《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议第五次通过，自 2004 年 6 月 1 日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 11、《销售办法》：指中国证监会 2011 年 6 月 9 日颁布、同年 10 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
- 12、《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
- 13、《运作办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 29 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《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
- 14、中国证监会：指中国证券监督管理委员会
- 15、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会

会

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

17、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

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

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

20、投资人：指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称

21、基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人

22、基金份额分级：指自基金合同生效后，本基金通过基金收益分配的安排，将基金份额分成预期收益与预期风险不同的两个级别，即添利 A 和添利 B，两级份额的初始配比原则上为 7:3

23、添利 A：指中欧纯债添利分级债券型证券投资基金的 A 级份额。添利 A 根据基金合同的规定获取约定收益，并在添利 B 的每个封闭运作期内每满半年开放一次，接受申购与赎回申请；在基金过渡期内，按照届时的情况，接受申购或赎回申请

24、添利 B：指中欧纯债添利分级债券型证券投资基金的 B 级份额。本基金在扣除添利 A 的约定收益后的全部剩余收益归添利 B 享有，亏损以添利 B 的资产净值为限并由添利 B 承担；添利 B 根据基金合同的约定定期开放，接受申购与赎回申请，其余时间封闭运作

25、添利 A 的基金份额折算：指自基金合同生效之日每满半年的最后一个工作日，添利 A 的基金份额净值调整为 1.000 元，其基金份额数量按折算比例相应增加或减少的行为

26、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。



27、销售机构：指中欧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协议，代为办理基金销售业务的机构

28、场外：指通过深圳证券交易所外的销售机构办理基金份额认购、申购和赎回等业务的场所

29、场内：指通过深圳证券交易所内具有相应业务资格的会员单位办理基金份额认购、申购、赎回和上市交易的场所

30、上市交易：基金合同生效后投资者通过深圳证券交易所会员单位以集中竞价的方式买卖添利 B 份额的行为

31、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

32、登记机构：指办理登记业务的机构。基金的登记机构为中欧基金管理有限公司或接受中欧基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构

33、证券登记结算系统：指中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记结算系统

34、注册登记系统：指中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统

35、开放式基金账户：指投资者通过场外销售机构在中国证券登记结算有限责任公司注册的开放式基金账户，用于记录投资者持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况。投资者办理场外认购、场外申购和场外赎回等业务时需具有开放式基金账户。记录在该账户下的基金份额登记在登记机构的注册登记系统

36、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买卖基金的基金份额变动及结余情况的账户

37、深圳证券账户：指投资者在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开设的深圳证券交易所人民币普通股票账户或证券投资基金账户。投资者通过深圳证券交易所交易系统办理基金交易、场内认购、场内申购和场内赎回等业务时需持有深圳证券账户。记录在该账户下的基金份额登记在登记机构的证券登记结

算系统

38、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

39、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

40、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

41、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

42、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

43、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

44、T+n日：指自T日起第n个工作日(不包含T日)

45、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

46、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

47、《业务规则》：指深圳证券交易所发布实施的《深圳证券交易所上市开放式基金业务规则》、《深圳证券交易所开放式基金申购赎回业务实施细则》、《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》及对其不时做出的修订，中国证券登记结算有限责任公司发布实施的《中国证券登记结算有限责任公司上市开放式基金登记结算业务实施细则》、以及《中欧基金管理有限公司开放式基金业务规则》及其他销售机构业务规则等相关业务规则和实施细则及对其不时做出的修订

48、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

49、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

50、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转换为现金的行为

51、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

52、系统内转托管：指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（交易单元）之间进行转托管的操作

53、跨系统转托管：指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统间进行转登记的行为

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

55、巨额赎回：指添利 A 或添利 B 的开放日，添利 A 或添利 B 的净赎回申请金额超过本基金前一日基金资产净值 10% 时的情形

56、元：指人民币元

57、基金收益：指基金投资所得债券利息、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

58、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

59、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

60、基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

61、基金份额参考净值：在 T 日基金资产净值计算的基础上，采用“虚拟清算”原则，即假定 T 日本基金出现合同约定的终止事项，本基金按照基金合同约定的份额收益分配和资产分配规则进行资产分配从而计算得到 T 日本基金两级基金份额的估算价值。基金份额参考净值是对两类基金份额价值的一个估算，并不代表基金份额持有人可获得的实际价值

62、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

63、指定媒体：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体

64、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

- 1、名称：中欧基金管理有限公司
- 2、住所：上海市浦东新区花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 8 层
- 3、办公地址：上海市浦东新区花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 8 层
- 4、法定代表人：唐步
- 5、组织形式：有限责任公司
- 6、成立日期：2006 年 7 月 19 日
- 7、批准设立机关：中国证监会
- 8、批准设立文号：证监基金字[2006]102 号
- 9、存续期间：持续经营
- 10、电话：021-68609600
- 11、传真：021-33830351
- 12、联系人：吉亦超
- 13、客户服务热线：021-68609700，400-700-9700（免长途话费）
- 14、注册资本：1.88 亿元人民币
- 15、股权结构：

意大利意联银行股份合作公司（简称 UBI）出资 6,580 万元人民币，占公司注册资本的 35%；

国都证券有限责任公司出资 5,640 万元人民币，占公司注册资本的 30%；

北京百骏投资有限公司出资 5,640 万元人民币，占公司注册资本的 30%；

万盛基业投资有限责任公司出资 940 万元人民币，占公司注册资本的 5%；

上述四个股东共出资 18,800 万元人民币。

### 二、主要人员情况

#### 1、基金管理人董事会成员

**窦玉明先生**，清华大学经济管理学院本科、硕士，美国杜兰大学 MBA，中国籍。中欧基金管理有限公司拟任董事长。曾任职于君安证券有限公司、大成基金管理有限公司。历任嘉实基金管理有限公司投资总监、总经理助理、副总经理兼

基金经理，富国基金管理有限公司总经理。

**Marco D' Este 先生**，意大利籍。现任中欧基金管理有限公司副董事长，意大利意联银行股份合作公司（UBI）机构银行业务部总监。历任布雷西亚农业信贷银行（CAB）国际部总监，联合信贷银行（Unicredit）米兰总部客户业务部客户关系管理、跨国公司信用状况管理负责人，联合信贷银行东京分行资金部经理，并曾在 Credito Italiano（意大利信贷银行）圣雷莫分行、伦敦分行、纽约分行及米兰总部工作。

**卢树奇先生**，中国社会科学院货币银行学专业研究生，中国籍。现任国都景瑞投资有限公司业务总监。曾任职于中国民族国际信托投资公司，中煤信托投资有限责任公司。历任国都证券有限责任公司投资部项目经理、天津营业部总经理、经纪业务总部总经理助理、证券投资部总经理助理及副总经理。

**刘建平先生**，北京大学法学硕士，中国籍。现任中欧基金管理有限公司总经理（代行董事长职责）。历任北京大学助教、副科长，中国证券监督管理委员会基金监管部副处长，上投摩根基金管理有限公司督察长。

**David Youngson 先生**，英国籍。现任 IFM（亚洲）有限公司创办者及合伙人，英国公认会计师特许公会-资深会员及香港会计师公会会员。历任安永（中国香港特别行政区及英国伯明翰，伦敦）审计经理、副总监，赛贝斯股份有限公司亚洲区域财务总监。

**郭雳先生**，美国哈佛大学（Harvard）法学硕士（国际金融法），北京大学法学博士（国际经济法），美国南美以美大学（Southern Methodist）法学硕士（国际法/比较法），中国籍。现任北京大学法学院讲师、副教授、院聘教授、院长助理。历任美国康奈尔大学（Cornell）法学院客座教授。

**周皓先生**，美国杜克大学经济学博士，北京大学管理学硕士学位和经济学学士，美国籍。现任清华大学五道口金融学院教授。历任美国联邦储备委员会风险分析部高级经济学家，麻省理工学院斯隆管理学院和北京大学中国经济研究中心访问教授。

## 2、基金管理人监事会成员

**唐步先生**，中欧基金管理有限公司监事会主席，中国籍。历任上海证券中央登记结算公司副总经理，上海证券交易所会员部总监、监察部总监，大通证券股

份有限公司副总经理，国都证券有限责任公司副总经理、总经理，中欧基金管理有限公司董事长。

**廖海先生**，中欧基金管理有限公司监事，上海源泰律师事务所合伙人，中国籍。武汉大学法学博士、复旦大学金融研究院博士后。历任深圳市深华工贸总公司法律顾问，广东钧天律师事务所合伙人，美国纽约州 Schulte Roth & Zabel LLP 律师事务所律师，北京市中伦金通律师事务所上海分所合伙人。

**黎忆海女士**，中欧基金管理有限公司职工监事，监察稽核部总监，中国籍。南开大学会计学专业硕士。历任湖南省计算机高等专科学校教师，深圳世纪星源股份有限公司财务分析员，华富基金管理有限公司监察稽核员。

**黄峰先生**，中欧基金管理有限公司职工监事，总经理助理、运营副总监及信息技术部总监，中国籍。北京大学信息科学中心信号与信息处理专业硕士。历任中再资产管理有限公司信息技术部主管，海通证券股份有限公司项目经理，微软全球技术中心工程师。

### 3. 公司高级管理人员

**刘建平先生**，中欧基金管理有限公司总经理（代行董事长职责），中国籍。简历同上。

**周蔚文先生**，中欧基金管理有限公司分管投资副总经理，兼任中欧基金管理有限公司投资总监、中欧新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自 2011 年 5 月起至今）、中欧新趋势股票型证券投资基金（LOF）基金经理（自 2011 年 8 月起至今），中欧盛世成长分级股票型证券投资基金基金经理（自 2012 年 3 月起至今），中国籍。北京大学管理科学与工程专业硕士，14 年以上证券及基金从业经验。历任光大证券研究所研究员，富国基金管理有限公司研究员、高级研究员、富国天合稳健优选股票型证券投资基金基金经理（自 2006 年 11 月起至 2011 年 1 月），中欧基金管理有限公司研究部总监。

**黄桦先生**，中欧基金管理有限公司督察长，中国籍。复旦大学经济学硕士，22 年以上证券及基金从业经验。历任上海爱建信托公司场内交易员，上海万国证券公司部门经理助理、部门经理，申银万国证券股份有限公司研究发展中心部门经理，光大证券有限责任公司助理总经理，光大保德信基金管理有限公司信息技术部总监，信诚基金管理有限公司运营部、信息技术部总监，中欧基金管理有

限公司分管运营副总经理。

#### 4、本基金拟任基金经理

**姚文辉先生**，中国籍，西安交通大学应用经济学专业硕士，6年以上证券及基金从业经验。历任金元证券股份有限公司固定收益总部债券投资经理，中欧基金管理有限公司中欧稳健收益债券型证券投资基金基金经理助理、中欧信用增利分级债券型证券投资基金基金经理助理。现任中欧基金管理有限公司中欧稳健收益债券型证券投资基金基金经理（2012年6月13日起至今）、中欧信用增利分级债券型证券投资基金基金经理（2012年6月13日起至今）、中欧货币市场基金基金经理（2012年12月12日起至今）。

#### 5、基金管理人投资决策委员会成员

基金管理人投资决策委员会的成员为：副总经理兼投资总监周蔚文先生、总经理刘建平先生、总经理助理兼权益投资部总监苟开红女士、固定收益部总监聂曙光先生、研究部副总监杨坤女士、专户理财部副总监沈洋先生、基金经理王海先生。其中副总经理兼投资总监周蔚文先生任投资决策委员会主席。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

### 三、基金管理人的职责

- 1、依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
- 2、办理基金备案手续；
- 3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；
- 4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；
- 5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- 6、编制季度、半年度和年度基金报告；
- 7、计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；
- 8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；
- 9、召集基金份额持有人大会；
- 10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- 11、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实

施其他法律行为；

12、 有关法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他职责。

#### 四、基金管理人的承诺

1、基金管理人承诺不从事违反《证券法》的行为，并承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反《证券法》行为的发生。

2、基金管理人承诺不从事违反《基金法》的行为，并承诺建立健全内部风险控制制度，采取有效措施，防止下列行为的发生：

- (1) 将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
- (2) 不公平地对待管理的不同基金财产；
- (3) 利用基金财产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) 依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他行为。

3、基金管理人承诺严格遵守基金合同，并承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反基金合同行为的发生。

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

5、基金管理人承诺不从事其他法规规定禁止从事的行为。

#### 6、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及其代理人、受雇人或任何第三人谋取利益；

(3) 不违反现行有效的有关法律法规、基金合同和中国证监会的有关规定，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) 不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

#### 五、基金管理人的内部控制制度

##### 1、内部控制的原则

(1) 健全性原则。内部控制应当包括公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员，并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个环节。



(2) 有效性原则。通过科学的内控手段和方法，建立合理的内控程序，维护内控制度的有效执行。

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

(4) 相互制约原则。公司内部部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡。

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

## 2、内部控制的体系结构

公司的内部控制体系结构是一个分工明确、相互牵制的组织结构，各个业务部门负责本部门的风险评估和监控，监察稽核部负责监察公司的风险管理措施的执行。具体而言，包括如下组成部分：

(1) 董事会：负责制定公司的内部控制政策，对内部控制负完全的和最终的责任。

(2) 监事会：对公司的经营情况进行检查，并对董事会和管理层履行职责的情况进行监督。

(3) 督察长：独立行使督察权利，直接对董事会负责；就内部控制制度和执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能；向董事会和中国证监会进行定期、不定期报告。

(4) 投资决策委员会：负责指导基金财产的运作，对基金投资的所有重大问题进行决策。

(5) 风险控制委员会：协助确立公司风险控制的原则、目标和策略，并就风险控制重要事项进行讨论和决策。

(6) 监察稽核部：独立于其他部门和业务活动，对内部控制制度的执行情况进行全面及专项检查 and 反馈，使公司在良好的内部控制环境中实现业务目标。

(7) 业务部门：具体执行公司各项内部控制制度及政策，确保各项业务活动合法、合规进行。

## 3、内部控制的措施

(1) 部门及岗位设置体现了职责明确、相互制约原则。

各部门及岗位均设立明确的授权分工及工作职责，并编制详细的岗位说明书和业务流程；建立重要凭据传递及信息沟通制度，实现相关部门、相关岗位之间的监督制衡。

(2) 严格授权控制。

授权控制贯穿于公司经营活动的始终。公司建立了合理的授权标准和流程，确保授权制度的贯彻执行。重大业务的授权应采取书面形式，明确授权内容和实效，对已获授权的部门和人员应建立有效的评价和反馈机制。

(3) 实行恰当的岗位分离。

建立科学的岗位分离制度，各业务部门在适当授权的基础上实行恰当的岗位分离。重要业务和岗位进行物理隔离，投资与交易、交易与清算、基金会计与公司会计等重要岗位不得有人员重叠。

(4) 建立完善的资产分离制度。

建立完善的资产分离制度，基金资产与公司资产、不同基金的资产和其他委托资产实行独立运作，分别核算。

(5) 建立严密有效的风险管理系统。

风险管理系统包括两方面：一是公司主要业务的风险评估和检测办法、重要部门风险指标考核体系以及业务人员道德风险防范体系等；二是公司灵活有效的应急、应变措施和危机处理机制。通过严密有效的风险管理系统，对公司内外部风险进行识别、评估和分析，及时防范和化解风险。

(6) 建立完整的信息资料保全系统。

真实、全面、及时、准确地记载每一笔业务，及时准确地进行会计核算和业务记录，完整妥善地保管好会计、统计和各项业务资料档案，确保原始记录、合同契约、各种信息资料数据真实完整。

#### 4、基金管理人关于内部控制制度的声明书

基金管理人确知建立内部控制系统、维持其有效性以及有效执行内部控制制度是基金管理人董事会及管理层的责任，董事会承担最终责任；本基金管理人特别声明以上关于内部控制制度和风险管理的披露真实、准确，并承诺根据市场的变化和基金管理人的发展不断完善风险管理和内部控制制度。

## 第四部分 基金托管人

### 一、基金托管人的情况

#### (一) 基金托管人的基本情况

名称：中国邮政储蓄银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街3号

办公地址：北京市西城区金融街3号A座

邮政编码：100808

法定代表人：李国华

成立时间：2007年3月6日

批准设立机关及批准设立文号：中国银监会银监复【2006】484号

组织形式：股份有限公司

注册资金：450亿元人民币

存续期间：持续经营

基金托管业务批准文号：证监许可【2009】673号

联系人：王瑛

联系电话：010-68858126

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑和贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱服务；经中国银行业监督管理委员会等监管部门批准的其他业务。

经国务院同意并经中国银行业监督管理委员会批准，中国邮政储蓄银行有限责任公司（成立于2007年3月6日）于2012年1月21日依法整体变更为中国邮政储蓄银行股份有限公司。中国邮政储蓄银行股份有限公司依法承继原中国邮政储蓄银行有限责任公司全部资产、负债、机构、业务和人员，依法承担和履行原中国邮政储蓄银行有限责任公司在有关具有法律效力的合同或协议中的权利、义务，以及相应的债权债务关系和法律责任。中国邮政储蓄银行股份有限公司坚持服务“三农”、服务中小企业、服务城乡居民的大型零售商业银行定位，发挥

邮政网络优势，强化内部控制，合规稳健经营，为广大城乡居民及企业提供优质金融服务，实现股东价值最大化，支持国民经济发展和社会进步。

## （二）主要人员情况

中国邮政储蓄银行股份有限公司总行设托管业务部，下设市场处、内控稽核处、运营处等处室。共有员工 20 人，100%员工拥有大学本科以上学历及三年以上基金从业经历，全部人员具有基金从业资格，具有丰富的托管服务经验。

## （三）基金托管业务经营情况

2009年7月23日，中国邮政储蓄银行经中国证券监督管理委员会和中国银行业监督管理委员会联合批准，获得证券投资基金托管资格，是我国第16家托管银行。中国邮政储蓄银行坚持以客户为中心、以服务为基础的经营理念，依托专业的托管团队、灵活的托管业务系统、规范的托管管理制度、健全的内控体系、运作高效的业务处理模式，为广大基金份额持有人和众多资产管理机构提供安全、高效、专业、全面的托管服务，并获得了合作伙伴一致好评。

截至 2013 年 6 月 30 日，中国邮政储蓄银行托管的证券投资基金共 18 只，包括中欧中小盘股票型证券投资基金（LOF）（166006）、长信中短债证券投资基金（519985）、东方保本混合型开放式证券投资基金（400013）、万家添利分级债券型证券投资基金（161908）、长信利鑫分级债券型证券投资基金（163003）、天弘丰利分级债券型证券投资基金（164208）、鹏华丰泽分级债券型证券投资基金（160618）、东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金（400015）、长安宏观策略股票型证券投资基金（740001）、金鹰持久回报分级债券型证券投资基金（162105）、中欧信用增利分级债券型证券投资基金（166012）、农银汇理消费主题股票型证券投资基金（660012）、浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资基金（519117）、天弘现金管家货币市场基金（420006）、汇丰晋信恒生 A 股行业龙头指数证券投资基金（540012）、华安安心收益债券型证券投资基金（040036）、东方强化收益债券型证券投资基金（400016）、中欧纯债分级债券型证券投资基金（166016）。托管的特定客户资产管理计划共 17 只，其中 10 只已到期，包括南方-灵活配置之出口复苏 1 号资产管理计划、景顺长城基金-邮储银行-稳健配置型特定多个客户资产管理计划、银华灵活精选资产管理计划、长盛灵活配置资产管理计划、富国基金-邮储银行-绝对回报策略混合型资产管理计划、光大保德

信-邮储银行-灵活配置 1 号客户资产管理计划、大成-邮储银行-灵活配置 1 号特定多个客户资产管理计划、银华灵活配置资产管理计划、长盛-邮储-灵活配置 2 号资产管理计划、南方灵活配置 2 号资产管理计划、鹏华基金鹏诚理财高息债分级 2 号资产管理计划、华安基金-增益分级债券型特定多个客户资产管理计划、农银汇理-邮储-国投信托雨燕 1 号悦达债券 1 号资产管理计划等。至今，中国邮政储蓄银行已形成涵盖证券投资基金、基金公司特定客户资产管理计划、信托计划、银行理财产品（本外币）、私募基金、证券公司定向资产管理计划、保险资金等多种资产类型的托管产品体系，托管规模达 3,723.16 亿元。

## 二、基金托管人的内部控制制度

### 1、内部控制目标

作为基金托管人，中国邮政储蓄银行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，保证基金财产的安全完整，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。

### 2、内部控制组织结构

中国邮政储蓄银行设有风险与内控管理委员会，负责全行风险管理与内部控制工作，对托管业务风险控制工作进行检查指导。托管业务部专门设置内部风险控制组，配备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的工作职权和能力。

### 3、内部控制制度及措施

托管业务部具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理严格实行复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

## 三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

### 1、监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督，并定期编写基金投资运作监督报告，报送中国证监会。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

## 2、监督流程

(1) 每工作日按时通过基金监督子系统，对各基金投资运作比例控制指标进行例行监控，发现投资比例超标等异常情况，向基金管理人发出书面通知，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，并及时报告中国证监会。

(2) 收到基金管理人的划款指令后，对涉及各基金的投资范围、投资对象及交易对手等内容进行合法合规性监督。

(3) 通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求管理人进行解释或举证，要求限期纠正，并及时报告中国证监会。

## 第五部分 相关服务机构

### 一、基金份额发售机构

#### (一) 直销机构:

##### 1、中欧基金管理有限公司上海直销中心

办公地址: 上海市浦东新区花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 8 层

联系人: 王李李

电话: 021-68609602

传真: 021-68609601

客服热线: 021-68609700, 400-700-9700 (免长途话费)

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

##### 2、中欧基金管理有限公司网上交易系统

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

#### (二) 其他销售机构 (排名不分先后)

##### 1、中国邮政储蓄银行股份有限公司

住所: 北京市西城区金融大街 3 号

办公地址: 北京市西城区金融大街 3 号金鼎大厦 A 座 6 层

法定代表人: 李国华

传真: 010-68858117

联系人: 文彦娜

客服热线: 95580

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

##### 2、招商银行股份有限公司

住所: 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址: 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人: 傅育宁

联系人: 邓炯鹏

电话: 0755-83198888

传真: 0755-83195109

客服热线：95555

网址：www.cmbchina.com

### 3、交通银行股份有限公司

住所：上海市银城中路 188 号

办公地址：上海市银城中路 188 号

法定代表人：牛锡明

联系人：曹榕

电话：021-58781234

传真：021-58408483

客户热线：95559

网址：www.bankcomm.com

### 4、中信银行股份有限公司

住所：北京市东城区朝阳门北大街富华大厦 C 座

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街富华大厦 C 座

法定代表人：田国立

联系人：赵树林

电话：010-65556960

传真：010-65550828

客服热线：95558

网址：bank.ecitic.com

### 5、平安银行股份有限公司

住所：深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦

办公地址：深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行 27F

法定代表人：孙建一

联系人：张莉

电话：021-38637673

传真：021-50979507

客服热线：95511-3

网址：bank.pingan.com



6、杭州银行股份有限公司

住所：杭州庆春路 46 号

办公地址：杭州庆春路 46 号

法定代表人：吴太普

联系人：严俊

客服热线：4008888508

网址：www.hzbank.com.cn

7、招商证券股份有限公司

住所：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层

法定代表人：宫少林

联系人：林生迎

电话：0755-82943666

传真：0755-82943636

客服热线：95565、4008888111

网址：www.newone.com.cn

8、华泰证券股份有限公司

住所：南京市中山东路 90 号

办公地址：南京市中山东路 90 号

法定代表人：吴万善

联系人：万鸣

电话：025-83290979

传真：025-51863323

客服热线：95597

网址：www.htsc.com.cn

9、中信建投证券股份有限公司

住所：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：王常青

联系人：权唐

电话：4008888108

传真：010-65182261

客服热线：4008888108

网址：www.csc108.com

10、国都证券有限责任公司

住所：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层

办公地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层

法定代表人：常喆

联系人：黄静

电话：010-84183333

传真：010-84183311-3389

客服热线：400-818-8118

网址：www.guodu.com

11、兴业证券股份有限公司

住所：福州市湖东路268号

办公地址：上海浦东新区民生路1199弄正大五道口广场1号楼22层

法定代表人：兰荣

联系人：黄英

电话：0591-38162212

传真：0591-38507538

客服热线：95562

网址：www.xyzq.com.cn

12、天相投资顾问有限公司

住所：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701

办公地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座4层

法定代表人：林义相

联系人：林爽

电话：010-66045608

传真：010-66045521

客服热线：010-66045678

网址：[www.txsec.com](http://www.txsec.com)、[www.jjm.com.cn](http://www.jjm.com.cn)

13、光大证券股份有限公司

住所：上海市静安区新闸路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闸路 1508 号

法定代表人：徐浩明

联系人：刘晨

电话：021-22169999

传真：021-22169134

客服热线：95525，4008888788，10108998

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

14、华福证券有限责任公司

住所：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层

办公地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7 至 10 层

法定代表人：黄金琳

联系人：张腾

电话：0591-87383623

传真：0591-87383610

客服热线：0591-96326

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

15、宏源证券股份有限公司

住所：新疆乌鲁木齐市文艺路 233 号

办公地址：北京西城区太平桥大街 19 号

法定代表人：冯戎

联系人：李巍

电话：010-88085201

传真：010-88085195

客服热线：4008-000-562

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

16、中国银河证券股份有限公司

住所：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

联系人：田薇

电话：010-66568888

传真：010-66568990

客服热线：4008-888-888

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

17、齐鲁证券有限公司

住所：济南市经七路 86 号

办公地址：济南市经七路 86 号 23 层

法定代表人：李玮

联系人：吴阳

电话：0531-68889155

传真：0531-68889185

客服热线：95538

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

18、申银万国证券股份有限公司

住所：上海市常熟路 171 号

办公地址：上海市常熟路 171 号

法定代表人：储晓明

联系人：李清怡

电话：021-33389888 或 21-54033888

传真：021-54038844

客服电话：95523 或 4008895523

电话委托：021-962505

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

19、平安证券有限责任公司

住所：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场裙楼 8 楼

办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场裙楼 8 楼

法定代表人：杨宇翔

联系人：郑舒丽

电话：0755-22626391

传真：0755-82400862

客服热线：95511-8

网址：www.pingan.com

20、国泰君安证券股份有限公司

住所：上海浦东新区商城路 618 号

办公地址：上海市银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼

法定代表人：万建华

联系人：吴倩

电话：021-38676666

传真：021-38670666

客服热线：4008888666

网址：www.gtja.com

21、安信证券股份有限公司

住所：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02

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

深圳市福田区深南大道 2008 号中国凤凰大厦 1 栋 9 层

法定代表人：牛冠兴

联系人：陈剑虹

电话：0755-82558305

传真：0755-82558355

客服热线：4008-001-001

网址：www.essences.com.cn

22、信达证券股份有限公司

住所：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人：高冠江

联系人：唐静

电话：010-63081000

传真：010-63080978

客服热线：400-800-8899

网址：www.cindasc.com

### 23、德邦证券有限责任公司

住所：上海市普陀区曹杨路 510 号南半幢 9 楼

办公地址：上海市浦东区福山路 500 号城建国际中心 26 楼

法定代表人：姚文平

联系人：叶蕾

电话：021-68761616

传真：021-68767880

客服热线：400-8888-128

网址：www.tebon.com.cn

### 24、中信证券股份有限公司

住所：广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦第 A 层

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人：王东明

联系人：陈忠

电话：010-60838888

传真：010-60833739

客服热线：95558

网址：www.citics.com

### 25、金元证券股份有限公司

住所：海口市南宝路 36 号证券大厦 4 楼

办公地址：深圳市深南大道 4001 号时代金融中心大厦 17 楼

法定代表人：陆涛

联系人：马贤清

电话：0755-83025022

客服热线：4008-888-228

网址：www.jyzq.cn

26、中信万通证券有限责任公司

住所：青岛市崂山区苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15 层（1507-1510 室）

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层

法定代表人：杨宝林

电话：0532-85022326

传真：0532-85022605

客服热线：0532-96577

网址：www.zxwt.com.cn

27、西南证券股份有限公司

住所：重庆市江北区桥北苑 8 号

办公地址：重庆市江北区桥北苑 8 号西南证券大厦

法定代表人：余维佳

联系人：张煜

电话：023-63786141

传真：023-63786212

网址：www.swsc.com.cn

28、中信证券（浙江）有限责任公司

住所：中国浙江省杭州市江南大道 588 号 恒鑫大厦 19、20 楼

办公地址：中国浙江省杭州市江南大道 588 号 恒鑫大厦 19、20 楼

法定代表人：沈强

联系人：周妍

电话：0571-86078823

客服热线：0571-96598

网址：www.bigsun.com.cn

29、华龙证券有限责任公司

住所：甘肃省兰州市东岗西路 638 号财富大厦 21 楼

办公地址：甘肃省兰州市东岗西路 638 号财富大厦 21 楼

法定代表人：李晓安

联系人：李昕田

电话：0931-4890619

客服热线：0931-4890100、0931-4890619、0931-4890618

网址：www.hlzqgs.com

30、国联证券股份有限公司

注册地址：江苏省无锡市县前东街 168 号

办公地址：江苏省无锡市滨湖区太湖新城金融一街 8 号

法定代表人：雷建辉

联系人：沈刚

电话：0510-82831662

传真：0510-82830162

客服热线：95570

网址：www.glsc.com.cn

31、东吴证券股份有限公司

住所：苏州市工业园区星阳街 5 号

办公地址：苏州工业园区星阳街 5 号

法定代表人：吴永敏

联系人：方晓丹

电话：0512-65581136

传真：0512-65588021

客服热线：4008601555

网址：www.dwzq.com.cn

32、华融证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 8 号

办公地址：北京市西城区金融大街 8 号 A 座 3 层、5 层



法定代表人： 宋德清

联系人： 黄恒

电话： 010-58568235

传真： 010-58568062

客服热线： 010-58568118

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

### 33、民族证券股份有限公司

住所： 北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 A 座 6-9 层

法定代表人： 赵大建

联系人： 李微

电话： 010-59355588

客服热线： 400-889-5618

网址： [www.e5618.com](http://www.e5618.com)

### 34、深圳众禄基金销售有限公司

住所： 深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

办公地址： 深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

法定代表人： 薛峰

客服热线： 4006-788-887

传真： 0755-82080798

联系电话： 0755-33227953

众禄基金销售网： [www.zlfund.cn](http://www.zlfund.cn)

基金买卖网： [www.jjmmw.com](http://www.jjmmw.com)

### 35、杭州数米基金销售有限公司

住所： 杭州市余杭区仓前街道海曙路东 2 号

办公地址： 浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼

法定代表人： 陈柏青

客服热线： 4000-766-123

传真： 0571-26698533

联系电话： 0571-28829790

网址: [www.fund123.cn](http://www.fund123.cn)

36、上海长量基金销售投资顾问有限公司

住所: 上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址: 上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层

法定代表人: 张跃伟

客服热线: 400-089-1289

传真: 021-58787698

联系电话: 021-58788678

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

37、上海天天基金销售有限公司

办公地址: 上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 9 楼

法定代表人: 其实

客服热线: 400-1818-188

传真: 021-64385308

联系电话: 021-54509998-7019

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

38、上海好买基金销售有限公司

住所: 上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室

办公地址: 上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 9 楼

法定代表人: 杨文斌

客服热线: 400-700-9665

传真: 021-68596916

联系电话: 021-58870011

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

39、和讯信息科技有限公司

住所: 北京市朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

办公地址: 上海市浦东新区陆家嘴东路 166 号中国保险大厦 25 楼 C 区

法定代表人: 王莉

电话: 021-68419822

传真：021-68419822-8566

客服热线：400-920-0022

网址：licaike.hexun.com

40、北京展恒基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区德胜门外华严北里2号民建大厦6层

办公地址：北京市朝阳区德胜门外华严北里2号民建大厦6层

法定代表人：闫振杰

电话：010—62020088

传真：010—62020088-8802

客服热线：400-888-6661

网址：www.myfp.cn

注：以上场外代销机构未特别注明的，仅代理销售添利A份额。

基金管理人可以根据情况变化、增加或者减少销售机构，并另行公告。销售机构可以根据情况变化、增加或者减少其销售城市、网点，并另行公告。各销售机构提供的基金销售服务可能有所差异，具体请咨询各销售机构。

## 二、登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街17号

办公地址：北京市西城区太平桥大街17号

法定代表人：金颖

联系人：朱立元

电话：010-59378839

传真：010-59378907

## 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

住所：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

办公地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

负责人：韩炯

经办律师：吕红、黎明

电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：黎明

#### 四、审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所有限公司

住所：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：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

法定代表人：杨绍信

电话：021-23238888

传真：021-23238800

联系人：张振波

经办会计师：单峰 张振波

## 第六部分 基金份额的分级

### 一、概要

本基金通过基金收益分配的安排，将基金份额分成预期收益与风险不同的两个级别，即添利 A 基金份额（基金份额简称“中欧添 A”）和添利 B 基金份额（基金份额简称“中欧添 B”）。除收益分配、基金合同终止时的基金清算财产分配外，每份添利 A 和每份添利 B 享有同等的权利和义务。此外，关于基金份额的占比的计算，包括但不限于认购或持有基金份额的上限、参加基金份额持有人大会各种表决计票等，两级基金的基金份额应单独进行计算，且两级基金在各自级别基金中的基金份额占比均满足条件方为有效。

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

添利 A 根据基金合同的规定获取约定收益，并在添利 B 的每个封闭运作期内每满半年开放一次，接受申购与赎回申请。本基金在扣除添利 A 的约定收益后的全部剩余收益归添利 B 享有，亏损以添利 B 的资产净值为限并由添利 B 承担；添利 B 根据基金合同的约定定期开放，接受申购与赎回申请，其余时间封闭运作。

本基金在添利 B 的两个封闭运作期之间设置过渡期，办理添利 A 与添利 B 的赎回、折算以及申购等事宜。本基金在过渡期内的运作方式与在添利 B 封闭运作期内的运作方式可能存在差异，具体以基金合同第五部分“基金过渡期的安排”和届时发布的相关公告为准。

### 二、基金份额的配比

添利 A 与添利 B 两级基金的基金份额的份额配比原则上不超过 7:3，具体控制措施详见基金份额发售公告以及基金管理人届时发布的相关公告。

### 三、添利 A 的运作

#### 1、约定收益

添利 A 根据基金合同的规定获取约定收益，年约定收益率将在每个赎回开放日设定，并在添利 A 的赎回开放日公告，计算公式如下：

添利 A 的年约定收益率（单利）= 一年期银行定期存款利率（税后）+ 利差

其中计算添利 A 首个约定年收益率的一年期银行定期存款利率指基金合同生效之日中国人民银行公布并执行的金融机构人民币一年期定期存款基准利率；其后添利 A 每个赎回开放日，基金管理人将根据该日中国人民银行公布并执行的金融机构人民币一年期定期存款基准利率重新调整添利 A 的约定年收益率，添利 A 的约定收益采用单利计算，添利 A 的年收益率计算按照四舍五入的方法保留到小数点后第 2 位。

视国内利率市场变化，基金管理人应最迟于每个过渡期开始之前 2 个工作日，设定并公告添利 B 下一个封闭运作期内适用的、计算添利 A 约定收益的利差值。利差的取值范围从 0%（含）到 2.5%（含）。

基金合同生效后，添利 B 首个封闭运作期内适用的、添利 A 的约定收益的利差值由基金管理人在基金份额发售前设定，并在本基金的《基金份额发售公告》中公告。

添利 A 的年约定收益率计算按照四舍五入的方法保留到小数点后 2 位，并在赎回开放日公告。

基金管理人并不承诺或保证添利 A 的约定收益，在基金资产出现极端损失的情况下，添利 A 的基金份额持有人可能会面临无法取得约定收益甚至损失本金的风险。

## 2、开放日

添利 A 在添利 B 的封闭运作期内每满半年开放一次，接受投资人的申购与赎回。添利 A 的赎回开放日为自添利 B 当前封闭运作期起始日起每满半年的最后一个工作日；添利 A 的申购开放日为自添利 B 当前封闭运作期起始日起每满半年的最后一个工作日（与赎回开放日相同）及下一个工作日，一共开放申购 2 日。

因不可抗力致使基金无法按时开放申购与赎回的，开放日为不可抗力影响因素消除之日的下一个工作日。

添利 A 的第一次赎回开放日为添利 B 的首个封闭运作期起始日至满半年的日期，如该日为非工作日，则为该日之前的最后一个工作日；第二次赎回开放日为添利 B 的首个封闭运作期起始之日至满 1 年的日期，如该日为非工作日，则为该日之前的最后一个工作日；以此类推。

例如，如果本基金基金合同于 2013 年 8 月 1 日生效，且添利 B 的首个封闭运作期长度为 3 年，起始日为 2013 年 8 月 1 日，终止日为 2016 年 7 月 31 日；则添利 B 首个封闭运作期起始日起满半年、满 1 年、满 1 年半的日期分别为 2014 年 1 月 31 日、2014 年 7 月 31 日、2015 年 1 月 31 日，以此类推。则添利 A 的赎回开放日分别为 2014 年 1 月 31 日、2014 年 7 月 31 日、2015 年 1 月 31 日；添利 A 的申购开放日分别为 2014 年 1 月 31 日、2014 年 2 月 1 日、2014 年 7 月 31 日、2014 年 8 月 1 日、2015 年 1 月 31 日、2015 年 2 月 1 日，以此类推。

假设 2014 年 1 月 31 日为非工作日，在其之前的最后一个工作日为 2014 年 1 月 30 日，则第一次赎回开放日为 2014 年 1 月 30 日。

添利 A 在添利 B 的每个封闭运作期终止日当天开放一次，接受投资人的赎回，但不接受投资人的申购。添利 B 的每个封闭运作期终止日之后的一个工作日起，进入过渡期，直到添利 B 的下一个封闭运作期起始日之前的一个工作日止，过渡期结束。过渡期内添利 A 的申购和赎回开放日安排以基金合同第五部分“基金过渡期的安排”和届时发布的相关公告为准。

假定添利 B 的首个封闭运作期至 2016 年 7 月 31 日终止；则添利 A 在 2016 年 7 月 31 日当天开放一次，接受投资人的赎回，但不接受投资人的申购。

假定 2016 年 8 月 1 日至 2016 年 8 月 5 日为过渡期；添利 B 的第二个封闭运作期长度为 3 年，起始日为 2016 年 8 月 6 日，终止日为 2019 年 8 月 5 日；添利 A 在添利 B 第二个封闭运作期内仍然每满半年开放一次，接受投资人的申购与赎回；具体的日期分别为 2017 年 2 月 5 日、2017 年 8 月 5 日、2018 年 2 月 5 日，以此类推；如 2017 年 2 月 5 日为非工作日，则开放日为该日之前的最后一个工作日，即为 2017 年 2 月 4 日。

假定添利 B 的第二个封闭运作期至 2019 年 8 月 5 日终止；则添利 A 在 2019 年 8 月 5 日当天开放一次，接受投资人的赎回，但不接受投资人的申购。

其他各个开放日的计算类同。

### 3、基金份额折算

添利 B 的封闭运作期内，添利 A 将按以下规则进行基金份额折算。

#### (1) 折算基准日

添利 A 的基金份额折算基准日为自添利 B 当前封闭运作期起始日起每满半

年的最后一个工作日。

添利 A 的基金份额折算基准日与其赎回开放日为同一天工作日。基金份额折算基准日的具体计算见基金合同第四部分“添利 A 的运作”关于开放日计算的相关内容。

#### (2) 折算对象

基金份额折算基准日登记在册的添利 A 所有份额。

#### (3) 折算频率

自添利 B 当前封闭运作期起始日起每满半年折算一次。

#### (4) 折算方式

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

添利 A 的基金份额折算公式如下：

添利 A 的折算比例 = 折算日折算前添利 A 的基金份额参考净值 / 1.000

添利 A 经折算后的份额数 = 折算前添利 A 的份额数 × 添利 A 的折算比例

添利 A 经折算后的份额数采用四舍五入的方式保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产。

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

#### (5) 基金份额折算期间的基金业务办理

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

#### (6) 基金份额折算的公告

1) 基金份额折算方案须最迟于实施日前 2 日在指定媒体公告，并报中国证监会备案。

2) 基金份额折算结束后，基金管理人应在 2 日内在指定媒体公告，并报中国证监会备案。

### 四、添利 B 的运作

#### 1、封闭运作期



添利 B 在基金合同生效后定期开放，接受投资者的申购与赎回，其余时间封闭运作。本基金在添利 B 的两个封闭运作期之间设置过渡期，办理添利 A 与添利 B 的赎回、折算以及申购等事宜。

#### (1) 添利 B 的封闭运作期

添利 B 的每一封闭运作期长度为 3 年。

过渡期末，若添利 B 的基金资产净值等于或小于 1500 万元，经基金管理人与基金托管人协商一致，无须召开基金份额持有人大会，基金管理人有权决定终止本基金的运作，不再进入下一个的添利 B 封闭运作期，并根据基金合同第二十二部分的约定进行基金财产清算。

添利 B 封闭运作期的终止日为该封闭运作期起始日起，累计运作时长达到该封闭期长度的对应日期。如该日为非工作日，则为该日之前的最后一个工作日。

例如，如果本基金基金合同于 2013 年 8 月 1 日生效，且添利 B 的首个封闭运作期长度为 3 年，则添利 B 首个封闭运作期的起始日为 2013 年 8 月 1 日，终止日为 2016 年 7 月 31 日。

假定添利 B 首个封闭运作期到期后，2016 年 8 月 1 日至 2016 年 8 月 5 日为过渡期；添利 B 的第二个封闭运作期长度为 3 年，则添利 B 第二个封闭运作期的起始日为 2016 年 8 月 6 日，终止日为 2019 年 8 月 5 日。假设 2019 年 8 月 5 日为非工作日，在其之前的最后一个工作日为 2019 年 8 月 4 日，则该封闭运作期的终止日为 2019 年 8 月 4 日。

添利 B 自每个封闭运作期起始日（含）起，自该封闭运作期终止日（不含）止，不接受投资人的申购与赎回。

添利 B 在每个封闭运作期终止日当天开放一次，接受投资人的申购与赎回。

2、基金管理人可以根据有关规定，在符合基金上市交易条件下，添利 B 将申请在深圳证券交易所上市交易。

3、本基金在扣除添利 A 的应计收益后的全部剩余收益归添利 B 享有，亏损以添利 B 的资产净值为限并由添利 B 承担。

#### 五、本基金基金份额净值的计算

$T$  日基金份额净值 =  $T$  日闭市后的基金资产净值 /  $T$  日基金份额的余额数量

$T$  日基金份额的余额数量为添利 A 和添利 B 的份额总额。基金份额净值的

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

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

#### 六、添利 A 和添利 B 的基金份额参考净值的计算

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

添利 A 和添利 B 的基金份额参考净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内与本基金基金份额净值一同公告。如遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

设第 T 日为基金份额参考净值计算日， $T_a$  为自添利 A 上一次赎回开放日（若之前尚未进行开放，则为基金成立日；若上一次赎回开放日位于过渡期内，则为当前添利 B 封闭运作期内首日）至 T 日的运作天数，NVT 为 T 日闭市后的基金资产净值， $F_a$  为 T 日添利 A 的份额余额， $F_b$  为 T 日添利 B 的份额余额，NAV<sub>a</sub> 为第 T 日添利 A 的基金份额参考净值，NAV<sub>b</sub> 为第 T 日添利 B 的基金份额参考净值，添利 A 的约定年收益率  $R_a$ ，运作当年实际天数设定为 Y，基金管理人可根据基金运作的实际情况对用于添利 A 和添利 B 的基金份额参考净值计算的 actual 运作天数进行调整，如调整，届时可参见更新的基金招募说明书及基金管理人公告。

第 T 日，添利 A 和添利 B 的基金份额参考净值计算公式如下：

（1）当  $NVT < F_a \times 1.00 \times (1 + R_a \times T_a / Y)$  时，则添利 A 与添利 B 在第 T 日的基金份额参考净值为：

$$NAV_a = NVT / F_a;$$

$$NAV_b = 0;$$

（2）当  $F_a \times 1.00 \times (1 + R_a \times T_a / Y) \leq NVT$  时，则添利 A 与添利 B 在第 T 日基金份额参考净值为：

$$NAV_a = 1.00 \times (1 + R_a \times T_a / Y);$$

$$NAV_b = (NVT - NAV_a \times F_a) / F_b;$$

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

## 第七部分 基金过渡期的安排

添利 B 根据基金合同的约定定期开放，其余时间封闭运作。本基金在添利 B 的两个封闭运作期之间设置过渡期，办理添利 A 与添利 B 的赎回、折算以及申购等事宜。

过渡期的长度一般不超过 5 个工作日，添利 B 的每个封闭运作期终止日之后的一个工作日起，进入过渡期，直到添利 B 的下一个封闭运作期起始日之前的一个工作日止，过渡期结束。添利 A 与添利 B 的赎回、折算以及申购的具体安排由基金管理人届时公告。

如无特别说明，本部分内容仅适用于添利 B 封闭运作期终止日当天及过渡期内的运作安排。

### 一、过渡期内添利 A、添利 B 的份额配比

在办理过渡期申购时，基金管理人有权根据基金份额上限和两类份额配比进行规模控制；其中，过渡期内添利 A、添利 B 基金份额配比不超过 7：3，两级基金份额上限详见相关公告，规模控制的具体方式包括但不限于比例确认、不进行或提前终止某一类份额的过渡期申购、减少某一类份额持有人所持份额等；详见届时发布的相关公告。

### 二、过渡期基金份额的申购与赎回

自添利 B 封闭运作期终止日起至过渡期终止日止，基金管理人将办理添利 A 的申购与赎回、添利 B 的申购与赎回，基金管理人有权根据规模控制的要求决定不办理添利 A 的申购，但应根据相关法律法规在指定媒体上公告。

#### 1、添利 A、添利 B 申购与赎回的原则：

(1) 基金份额赎回、申购均采用“未知价”原则，即赎回、申购价格以申请当日收市后计算的对应基金份额参考净值为基准进行计算；

(2) 基金份额根据“金额申购、份额赎回”的原则，申购以金额申请，赎回以份额申请；

(3) 基金份额的当日的场外申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销，在当日的开放时间结束后不得撤销。基金管理人、基金登记结算机构或证券交易所另有规定的，从其规定；

(4) 添利 A 和添利 B 将分别通过各自销售机构的销售网点独立进行过渡期申购。添利 A 的最低申购金额为 1000 元；添利 B 的单笔最低申购金额为 5 万元。在过渡期内，基金投资者可对基金份额进行多次申购；

(5) 投资人通过深圳证券交易所交易系统办理基金份额的场内申购、赎回业务时，需遵守深圳证券交易所的相关业务规则；若相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对申购、赎回业务等规则有新的规定，按新规定执行。

添利 A 和添利 B 的销售机构可能不同，具体销售方式和销售机构详见本基金定期更新的招募说明书和届时相关公告。

基金管理人可根据基金运作的实际情况并不影响基金份额持有人实质利益的前提下调整上述原则。基金管理人必须在新规则开始实施前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体公告并报中国证监会备案。

### 三、过渡期申购的销售对象

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

### 四、过渡期申购与赎回的费用

在添利 B 封闭运作期终止日当天及过渡期内选择赎回的添利 A 与添利 B 的投资者，赎回费率如下：

持有时间	收费标准
持有时间 < 30 天	0.5%
持有时间 ≥ 30 天	0

为了满足添利 A、添利 B 的份额配比要求而强制赎回的基金份额不收取赎回费。

在添利 B 封闭运作期终止日当天及过渡期内申购的投资者的申购费用如下：

#### 1、过渡期内添利 A 的申购费率如下表：

单笔金额 (M)	收费标准
M < 1000 万元	0.35%
M ≥ 1000 万元	每笔 1000 元

#### 2、过渡期内添利 B 的申购费率如下表：

单笔金额 (M)	收费标准
M < 500 万元	0.30%

M≥500万元	每笔1000元
---------	---------

基金的申购费用由投资人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

## 五、申购与赎回的程序

### 1、申购和赎回的申请方式

在过渡期内，基金投资者必须在添利 A、添利 B 的赎回开放日的业务办理时间提出赎回申请，必须在添利 A、添利 B 的申购开放日的业务办理时间提出申购申请。

投资者在申购时须按销售机构规定的方式备足申购资金，投资者在提交赎回申请时，必须有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回申请无效而不予成交。

### 2、申购和赎回申请的确认时间

过渡期内，在每一个交易日（T 日）的下一个工作日（T+1 日），由基金登记机构对投资者的申购与赎回申请进行有效性确认和成交确认。在 T+2 日后（包括该日）投资者应及时向销售机构或以销售机构规定的方式查询申购与赎回的成交情况。

销售机构对申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。申请的确认以登记机构或基金管理人的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资者应及时查询，否则如因申请未得到登记机构或基金管理人的确认而产生的后果，由投资人自行承担。

### 3、申购和赎回申请的成交确认原则

在添利 A 和添利 B 开放赎回期间内，对于添利 A、添利 B 赎回申请，在每一个交易日，所有经确认有效的赎回申请全部予以成交确认。

在添利 B 开放申购期间内，对于添利 B 申购申请，在每一个交易日，如果对添利 B 的全部有效申购申请进行确认后，添利 B 的份额余额大于添利 B 的份额上限，则在经确认后的添利 B 份额余额不超过其份额上限的范围内，对当日全部有效申购申请按比例进行成交确认；如果对添利 B 的全部有效申购申请进行确认后，添利 B 的份额余额小于或等于其份额上限，则对申购申请全部予以成交确认。

过渡期添利 A 申购期间内，对于添利 A 申购申请，本基金以添利 B 的份额余额的 7/3 倍为基准，在不超过添利 B 的份额余额范围内对添利 A 的申购进行份额

限制。在每一个交易日，如果对添利 A 的全部有效申购申请进行确认后，添利 A 的份额余额大于添利 B 的份额余额的 7/3 倍，则按添利 A 和添利 B 两级份额配比不超过 7: 3 的原则，对当日全部有效申购申请按比例进行成交确认；如果对添利 A 的全部有效申购申请进行确认后，添利 A 的份额余额小于或等于添利 B 的份额余额的 7/3 倍，则对当日申购申请全部予以成交确认。

如果在添利 A 申购期开始前，添利 A 的份额余额已经大于或等于添利 B 申购期末的份额余额的 7/3 倍，则不再开放添利 A 的过渡期申购，并按添利 A 和添利 B 两级份额配比不超过 7: 3 的原则，对全部添利 A 份额按比例进行确认，超出部分以现金形式返还投资者。

## 六、申购份额与赎回金额的计算

### 1、添利 A 和添利 B 的申购份额的计算

添利 A、添利 B 申购份额的计算公式为：

申购费用= 申购金额×申购费率/（1+申购费率），或，申购费用=固定费用

净申购金额= 申购金额-申购费用

申购份额=净申购金额 / 份额参考净值

通过场外方式进行申购的，基金份额的计算，采取四舍五入的方式保留到小数点后第 2 位，由此产生的误差计入基金财产；通过场内方式申购的，申购份额计算结果保留到整数位，计算所得整数位后小数部分的份额对应的资金返还至投资者资金账户。

例：在添利 A 的开放日，某投资者投资 30 万元申购添利 A，假设该笔申购按照 100%的比例确认，其对应申购费率为 0.35%，申购当日添利 A 份额参考净值为 1.000 元，则其可得到的申购份额为：

净申购金额=300,000.00/（1+0.35%）=298,953.66 元

申购费用=1,046.34 元

申购份额=298,953.66/1.000=298,953.66 份

即：投资者投资 30 万元申购添利 A，可得到 298,953.66 份基金份额。

又例：在添利 B 的开放日，某投资者投资 1,000 万元申购添利 B，则其对应申购费用为 1000 元，申购当日添利 B 份额参考净值为 1.000 元，则其可得到的申购份额为：

申购份额 =  $(10,000,000 - 1000) / 1.000 = 9,999,000$  份

即：投资者投资 1,000 万元申购添利 B，可得到 9,999,000 份基金份额。

## 2、添利 A、添利 B 赎回金额的计算

添利 A、添利 B 赎回金额的计算公式为：

赎回金额 = 赎回份额 × 份额参考净值

赎回金额计算结果采取四舍五入的方式保留至小数点后第 2 位，由此产生的误差计入基金财产。

例：在添利 A 的开放日，某投资者赎回 10,000 份添利 A，赎回当日添利 A 份额参考净值为 1.025 元，则其可得到的赎回金额计算如下：

赎回金额 =  $10,000 \times 1.025 = 10,250$  元

又例：在添利 B 的开放日，某投资者赎回 1000 万份添利 B，赎回当日添利 B 份额参考净值为 1.050 元，则其可得到的赎回金额计算如下：

赎回金额 =  $1,000 \text{ 万} \times 1.050 = 1,050$  万元

## 3、本基金基金份额参考净值的计算

设第 T 日为基金份额参考净值计算日，Ta 为自过渡期起始日（若之前进行了份额折算，则为基金折算基准日）至 T 日的运作天数，NVt 为 T 日闭市后的基金资产净值，Fa 为 T 日添利 A 的份额余额，Fb 为 T 日添利 B 的份额余额，NAV<sub>a</sub> 为第 T 日添利 A 的基金份额参考净值，NAV<sub>b</sub> 为第 T 日添利 B 的基金份额参考净值，添利 A 的约定年收益率 Ra，运作当年实际天数设定为 Y，基金管理人可根据基金运作的实际情况对用于添利 A 和添利 B 的基金份额参考净值计算的实际运作天数进行调整，如调整，届时可参见更新的基金招募说明书及基金管理人公告。

其中，Ra 为添利 A 在过渡期内的约定收益率，以过渡期起始日中国人民银行公布并执行的金融机构人民币活期存款基准利率确定。

第 T 日，添利 A、添利 B 的基金份额参考净值计算公式如下：

(1) 当  $NV_t < F_a \times 1.00 \times (1 + R_a \times T_a / Y)$  时，则添利 A 与添利 B 在第 T 日的基金份额参考净值为：

$NAV_a = NV_t / F_a$ ;

$NAV_b = 0$ ;



(2) 当  $Fa \times 1.00 \times (1 + Ra \times Ta/Y) \leq NV_t$  时, 则添利 A 与添利 B 在第 T 日基金份额参考净值为:

$$NAV_a = 1.00 \times (1 + Ra \times Ta/Y);$$

$$NAV_b = (NV_t - NAV_a \times Fa) / F_b;$$

## 七、巨额赎回的情形及处理方式

### 1、巨额赎回的认定

添利 A 或添利 B 的开放日, 添利 A 或添利 B 的净赎回申请金额超过本基金前一日基金资产净值 10%, 或者添利 A 及添利 B 同时开放的, 添利 A 及添利 B 的净赎回申请金额超过本基金前一日基金资产净值 10%, 即认为发生了巨额赎回。

### 2、巨额赎回的处理方式

当添利 A 出现巨额赎回时, 对于场外赎回申请, 基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额场外赎回或延缓支付部分赎回款项。1) 全额赎回: 当基金管理人认为有能力支付投资者的全部赎回申请时, 按正常赎回程序执行。2) 延缓支付部分赎回款项: 当基金管理人认为支付投资者的赎回申请有困难或认为支付投资者的赎回申请可能会对基金的资产净值造成较大波动时, 基金管理人在当日接受赎回的净赎回金额比例不低于上一日基金资产净值的 10% 的前提下, 对其余已经接受的有效赎回申请可以延缓支付赎回款项, 但不得超过 20 个工作日, 并应当在指定媒体上公告。

### 3、巨额赎回的公告

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

4、对于场内赎回部分, 按照深圳证券交易所、登记机构的有关规定办理

## 八、过渡期基金份额折算

过渡期基金份额折算业务安排详见基金管理人发布的相关公告。

## 九、基金运作安排

1、过渡期内, 基金管理人停收管理费, 基金托管人停收托管费;

2、过渡期结束后的下一工作日为添利 A 约定年化收益率起算日, 即添利 B

新的封闭运作期起始日；

3、添利 B 自封闭运作期终止日起开始停牌，并在添利 B 新的封闭运作期开始后 1 个月内申请在深圳证券交易所复牌。

#### 十、过渡期的公告

过渡期内，基金管理人须最迟于过渡期开始前 2 日公告添利 A 与添利 B 的赎回、折算以及申购的具体安排。

## 第八部分 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》、基金合同及其他有关规定，并经中国证监会 2013 年 9 月 24 日证监许可[2013 ]1216 号文批准募集。

### 一、募集期

自基金份额发售之日起不超过 3 个月，具体发售时间安排参见基金份额发售公告。

基金管理人可根据基金销售情况在募集期限内适当延长或缩短添利 A 或添利 B 的发售时间，并及时公告。

### 二、发售对象

符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。

### 三、募集目标

本基金的最低募集份额总额为 2 亿份。

本基金的发售规模上限为 30 亿元（不含认购资金在募集期产生的利息，下同）。其中，添利 A 的发售规模上限为 21 亿元，添利 B 的发售规模上限为 9 亿元。

基金发售规模控制方法详见基金份额发售公告。

### 四、发售方式和销售渠道

添利 A 通过场外发售机构公开发售，添利 B 通过场内、场外发售机构进行公开发售。场外发售机构为基金管理人的直销网点和场外销售机构的网点（具体名单参见基金份额发售公告）；场内发售机构为通过深圳证券交易所内具有相应业务资格并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的会员单位发售（具体名单见基金份额发售公告）。通过场外认购的基金份额登记在注册登记系统基金份额持有人开放式基金账户下；通过场内认购的基金份额登记在证券登记结算系统基金份额持有人深圳证券账户下。基金份额持有人可通过办理跨系统转托管业务实现基金份额在两个登记系统之间的转换。

本基金认购采取全额缴款认购的方式。基金投资者在募集期内可多次认购，认购一经受理不得撤销。

基金发售机构认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表发售机构确实接收到认购申请。认购的确认以登记机构或基金管理人的确认结果为准。

## 五、认购费用

### 1、添利 A 的认购费率如下表：

单笔金额 (M)	收费标准
M < 1000 万元	0.35%
M ≥ 1000 万元	每笔 1000 元

### 2、添利 B 的场外认购费率如下表：

单笔金额 (M)	收费标准
M < 100 万元	0.30%
M ≥ 100 万元	每笔 100 元

深圳证券交易所会员单位应按照本基金招募说明书约定的场外认购费率设定投资者的场内认购费率或佣金比率。基金认购费用不列入基金财产，主要用于基金的市场推广、销售、注册登记等募集期间发生的各项费用。

## 六、募集期利息的处理方式

有效认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有，场外认购利息折算的基金份额精确到小数点后 2 位，小数点 2 位以后部分四舍五入，由此产生的收益或损失由基金资产承担；场内认购利息折算的基金份额精确到整数位，小数点后部分截位，截位部分计入基金财产。若场内认购提前结束，场内有效认购款项产生的利息折算成基金份额归基金份额持有人所有。其中利息以登记机构的记录为准。

本基金添利 A、添利 B 独立发售，两者的募集截止时间可能不同。

## 七、基金认购份额的计算

### 1、场外认购份额的计算

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

$$\text{净认购金额} = \text{认购金额} / (1 + \text{认购费率})$$

认购费用=认购金额-净认购金额，或，认购费用=固定费用

认购份额=（净认购金额+认购利息）/基金份额初始面值

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

例：某投资者投资 30 万元认购添利 A，假设该笔认购按照 100%的比例确认，且其认购资金的利息为 30 元，其对应认购费率为 0.35%，则其可得到的认购份额为：

净认购金额=300,000.00/（1+0.35%）=298,953.66 元

认购费用=300,000.00-298,953.66=1,046.34 元

认购份额=（298,953.66+30.00）/1.00=298,983.66 份

即：投资者投资 30 万元认购添利 A，可得到 298,983.66 份基金份额。

例：某投资者投资 1,000 万元认购添利 B，假设该笔认购按照 100%的比例确认，且其认购资金的利息为 30 元，其对应认购费用为 100 元，则其可得到的认购份额为：

认购份额=（10,000,000+30-100）/1.00=9,999,930.00 份

即：投资者投资 1,000 万元认购添利 B，可得到 9,999,930.00 份基金份额。

## 2、场内认购份额的计算

本基金场内认购采用份额认购方法，计算公式为：

认购金额=挂牌价格×（1+认购费率）×认购份额

认购费用=挂牌价格×认购份额×认购费率，或，认购费用=固定费用

净认购金额=挂牌价格×认购份额

其中，挂牌价格为基金份额初始面值。

场内认购份额按整数申报，认购金额的计算保留到小数点后两位，小数点两位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。利息折算的份额保留至整数位（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。

例：某投资者认购 30 万份添利 B，添利 B 认购价格 1.00 元，假设该笔认购按照 100%的比例确认，且其认购资金的利息为 31.0 元，若对应的认购费率为 0.30%，则其可得到的认购份额为：

认购金额=300,000.00×（1+0.30%）×1.00=300,900.00 元；

认购费用 =  $300,000.00 \times 0.30\% = 900.00$  元

净认购金额 =  $300,000.00 \times 1.00 = 300,000.00$  元

利息折算的份额 =  $31.0/1.00 = 31$  份

投资者实际认购份额 =  $300,000 + 31 = 300,031$  份

即：投资者认购 30 万份添利 B，认购金额为 300,900 元，实际可得到 300,031 份添利 B。

3、销售机构对投资者认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购申请的确认以基金登记机构的确认结果为准。

## 八、基金认购金额的限制

### 1、场外认购限制

添利 A 场外认购在基金销售机构的单笔最低认购金额为人民币 1,000 元；添利 B 场外认购在基金销售机构的单笔最低认购金额为人民币 50,000 元；具体认购金额以基金各销售机构公告的为准。基金管理人直销机构对添利 A 单笔最低认购金额为 10,000 元。各场外销售机构对最低认购限额及交易级差有其他规定的，以各销售机构的业务规定为准。

### 2、场内认购限制

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

3、基金管理人不对单个账户的认购和持有基金份额进行限制。

4、投资人在募集期内可以多次认购基金份额，但已受理的认购申请不允许撤销。

## 九、基金份额的比例确认

添利 A 与添利 B 两级基金的基金份额的初始配比原则上为 7:3，比例确认具体规则见相关的基金份额发售公告。

十、基金募集期间募集的资金存入专门帐户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。

## 第九部分 基金合同的生效

### 一、基金合同生效

本基金的募集期为自基金份额发售之日起 3 个月内，具体募集时间请参见基金份额发售公告。

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

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

### 二、基金募集失败

如果募集期限届满，未满足募集备案条件，则基金募集失败，基金管理人应当承担下列责任：

- 1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；
- 2、在基金募集期限届满后 30 日内退还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期存款利息；
- 3、如基金募集失败，基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和销售机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。

### 三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

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

法律法规另有规定时，从其规定。

## 第十部分 基金份额的申购与赎回

### 一、添利 A 的申购与赎回

#### 1、申购与赎回的开放日

添利 A 自添利 B 封闭运作期起始日起每满半年开放一次，接受投资者的申购与赎回。

添利 A 的赎回开放日为自添利 B 当前封闭运作期起始日起每满半年的最后一个工作日；添利 A 的申购开放日为自添利 B 当前封闭运作期起始日起每满半年的最后一个工作日（与赎回开放日相同）及下一个工作日，一共开放申购 2 日；开放日的具体计算见基金合同第四部分“添利 A 的运作”的相关内容。因不可抗力致使基金无法按时开放添利 A 的申购与赎回的，开放日为不可抗力影响因素消除之日的下一个工作日。

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

#### 2、申购与赎回的账户

投资者办理添利 A 的申购、赎回应使用经本基金登记机构及基金管理人认可的账户（账户开立、使用的具体事宜见相关业务公告）。

#### 3、申购与赎回场所

添利 A 的销售机构包括基金管理人和基金管理人委托的销售机构。

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

#### 4、申购与赎回的原则

（1）“未知价”原则，即添利 A 的赎回、申购价格以申请当日收市后计算的对应基金份额参考净值为基准进行计算；

（2）“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

（3）当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间内撤销；

（4）场外基金份额持有人在赎回基金份额时，遵循“先进先出”原则，即按照投资者认购、申购的先后次序进行顺序赎回；



(5) 基金管理人、基金登记机构可根据基金运作的实际情况并在不影响基金份额持有人实质利益的前提下调整上述原则。基金管理人必须在新规则开始实施前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告并报中国证监会备案。

## 5、申购与赎回的程序

### (1) 申购和赎回的申请方式

基金投资者必须根据基金销售机构规定的程序，在开放日的业务办理时间向基金销售机构提出申购或赎回的申请。

投资者在申购添利 A 时须按销售机构规定的方式备足申购资金，投资者在提交添利 A 的赎回申请时，必须有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回申请将被确认失败。

### (2) 申购和赎回申请的确认时间

在每一个开放日（T 日）的下一个工作日（T+1 日），添利 A 的基金登记机构对投资者的申购与赎回申请进行确认。在 T+2 日后（包括该日）投资者应及时向销售机构或以销售机构规定的方式查询申购与赎回的交易确认情况。

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体上公告并报中国证监会备案。

### (3) 申购和赎回申请的成交确认原则

在每一个开放日，所有经确认有效的添利 A 的赎回申请全部予以成交确认。

对于添利 A 的申购申请，如果对添利 A 的全部有效申购申请进行确认后，添利 A 与添利 B 的份额配比不高于 7:3，则所有经确认有效的添利 A 的申购申请全部予以成交确认；如果对添利 A 的全部有效申购申请进行确认后，添利 A 与添利 B 的份额配比超过 7:3，则在经确认后的添利 A 与添利 B 的份额配比不超过 7:3 的范围内，对全部有效申购申请按比例进行成交确认。

在添利 A 的连续 2 个申购开放日的前一日，如果出现对添利 A 的全部有效申购申请进行确认后，添利 A 与添利 B 的份额配比达到或超过 7:3 的比例，则后一个申购开放日添利 A 将不再开放申购。

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

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

#### (4) 申购和赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式,若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功,若申购不成功或无效,申购款项将退回投资者账户,由此产生的利息等损失由投资者自行承担。

投资者 T 日赎回申请成功后,基金管理人将通过基金登记机构及其相关基金销售机构在 T+7 日(包括该日)内将赎回款项划往基金份额持有人账户。

在发生巨额赎回的情形时,款项的支付办法参照基金合同的有关条款处理。

### 6、申购与赎回的数额限制

(1) 直销机构以外的销售机构每个账户单笔申购的最低金额为单笔 1,000 元。各直销机构以外的销售机构对本基金最低申购金额及交易级差有其他规定的,以直销机构以外的销售机构的业务规定为准。

直销机构每个账户首次申购的最低金额为 10,000 元,追加申购的最低金额为单笔 10,000 元;已在直销机构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。直销机构以外的销售机构的投资者欲转入直销机构进行交易要受直销机构最低金额的限制。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。通过基金管理人网上交易系统办理基金申购业务的不受直销机构单笔申购最低金额的限制,申购最低金额为单笔 1,000 元。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。

若发生比例确认,申购金额不受最低申购金额限制。

投资者可多次申购,对单个投资者的累计持有份额不设上限限制。

(2) 基金份额持有人在销售机构赎回时,每次对本基金的赎回申请不得低于 5 份基金份额。若某笔份额减少类业务导致单个交易账户的基金份额余额不足 5 份的,销售机构有权对该基金持有人持有的基金份额做全部赎回处理(份额减少类业务指赎回、转换转出、非交易过户、转托管等业务,具体种类以中国证券登记结算有限责任公司相关业务规则为准)。

(3) 基金管理人可根据市场情况,在法律法规允许的情况下,调整上述对

申购的金额和赎回的份额的数量限制，基金管理人必须在调整生效前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体公告并报中国证监会备案。

## 7、申购费用和赎回费用

(1) 添利 A 的申购费率如下表：

单笔金额 (M)	收费标准
M < 1000 万元	0.35%
M ≥ 1000 万元	每笔 1000 元

基金申购费用不列入基金财产，主要用于基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

(2) 在非过渡期内，添利 A 不收取赎回费。

添利 B 在过渡期内的申购赎回安排详见基金合同第五部分“基金过渡期的安排”和基金管理人届时发布的相关公告。

## 8、申购份额与赎回金额的计算

(1) 添利 A 申购份额的计算

添利 A 申购份额的计算方式：

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，或，申购费用 = 固定费用

申购份额 = 净申购金额 / 申购当日基金份额净值

例：在添利 A 的开放日，某投资者投资 30 万元申购添利 A，假设该笔申购按照 100% 的比例确认，其对应申购费率为 0.35%，假设申购当日基金份额参考净值为 1.000 元，则其可得到的申购份额为：

净申购金额 = 300,000.00 / (1 + 0.35%) = 298,953.66 元

申购费用 = 300,000.00 - 298,953.66 = 1,046.34 元

申购份额 = 298,953.66 / 1.000 = 298,953.66 份

即：投资者投资 30 万元申购添利 A，可得到 298,953.66 份基金份额。

(2) 添利 A 赎回金额的计算

采用“份额赎回”方式，赎回金额计算方式：

赎回金额 = 赎回份额 × T 日基金份额净值

例：在添利 A 的开放日，某投资者赎回 10,245 份添利 A，假设赎回当日添利 A 份额参考净值是 1.000 元，则其可得到的赎回金额计算如下：

赎回金额 = 10,245 × 1.00 = 10,245.00 元

### (3) 添利 A 基金份额参考净值计算

添利 A 基金份额参考净值的具体计算公式见招募说明书第六部分。

### (4) 申购份额、余额的处理方式

添利 A 的申购份额按实际确认的净申购金额除以 1.00 元确定。添利 A 的申购份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。

### (5) 赎回金额的处理方式

添利 A 的赎回金额按实际确认的有效赎回份额乘以 1.00 元为基准扣除相应费用。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。

## 9、申购和赎回的注册登记

添利 A 申购与赎回的注册登记业务，按照中国证券登记结算有限责任公司的有关规定办理。

投资者申购添利 A 成功后，基金登记机构在 T+1 日为投资者登记权益并办理注册登记手续。

投资者赎回添利 A 成功后，基金登记机构在 T+1 日为投资者办理扣除权益的注册登记手续。

中国证券登记结算有限责任公司可依法对上述相关规定予以调整，并最迟于开始实施前 3 个工作日在指定媒体上公告。

10、基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情况下根据市场情况制定基金促销计划，针对特定交易方式（如网上交易、电话交易等）开展基金促销活动。在基金促销活动期间，基金管理人可以按中国证监会要求履行必要手续后，对基金投资者适当调整基金申购费率、调低赎回费率。

## 11、拒绝或暂停申购的情形及处理方式

除非出现如下情形，基金管理人不得暂停或拒绝基金投资者对添利 A 的申购申请：

- (1) 不可抗力的原因导致基金无法正常运作；
- (2) 证券交易场所依法决定临时停市，导致当日基金资产净值无法计算；

(3) 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，或可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人的利益；

(4) 根据申购规则和程序导致部分或全部申购申请没有得到成交确认；

(5) 发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况；

(6) 法律法规规定或中国证监会认定的其他可暂停申购的情形；

(7) 基金管理人、基金托管人、基金销售机构或登记机构的技术保障不足等异常情况发生导致基金销售系统或基金登记系统或基金会计系统无法正常运行；

(8) 基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔申购。

发生上述情形之一的，申购款项将全额退还投资者。发生上述（1）到（7）项且基金管理人决定暂停申购情形时，基金管理人应当在指定媒体刊登暂停申购公告。

在上述情形消除时，基金管理人应及时恢复申购。

## 12、暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式

除非出现如下情形，基金管理人不得拒绝接受或暂停基金份额持有人对添利 A 的赎回申请或者延缓支付赎回款项：

(1) 不可抗力的原因导致基金管理人不能支付赎回款项；

(2) 证券交易场所依法决定临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；

(3) 添利 A 在单个开放日巨额赎回，导致本基金的现金支付出现困难；

(4) 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的，基金管理人应在当日立即向中国证监会备案。已确认成功的赎回申请，基金管理人将足额支付；如暂时不能足额支付的，可延期支付部分赎回款项，按每个赎回申请人已被接受的赎回申请量占已接受赎回申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分由基金管理人按照发生的情况制定相应的处理办法在后续工作日予以支付。

## 13、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

(1) 发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人当日应立即向中国证监

会备案，并在规定期限内指定媒体上刊登暂停公告。

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

(3) 若暂停时间超过 1 日，基金管理人根据《信息披露办法》进行公告。

#### 14、巨额赎回的情形及处理方式

##### (1) 巨额赎回的认定

添利 A 的单个开放日，经过申购与赎回申请的成交确认后，添利 A 的净赎回金额超过前一工作日基金资产净值的 10%，即认为发生了巨额赎回。

##### (2) 巨额赎回的处理方式

当添利 A 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场外赎回或延缓支付部分赎回款项。1) 全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资者的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。2) 延缓支付部分赎回款项：当基金管理人认为支付投资者的赎回申请有困难或认为支付投资者的赎回申请可能会对基金的资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回的净赎回金额比例不低于上一日基金资产净值的 10% 的前提下，对其余已经接受的有效赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒体上公告。

##### (3) 巨额赎回的公告

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

#### 二、添利 B 的申购与赎回

添利 B 在基金合同生效后定期开放，接受投资者的申购与赎回，其余时间封闭运作。本基金在添利 B 的两个封闭运作期之间设置过渡期，办理添利 A 与添利 B 的赎回、折算以及申购等事宜。

添利 B 在每个封闭运作期终止日当天开放一次，接受投资人的申购与赎回。

添利 B 的申购费率如下表：

单笔金额 (M)	收费标准
M < 500 万元	0.30%

M≥500 万元	每笔 1000 元
----------	-----------

基金的申购费用由投资人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

在每个封闭运作期终止日当天，添利 B 的赎回费率为 0。

添利 B 在过渡期内的申购赎回安排详见基金合同第五部分“基金过渡期的安排”和基金管理人届时发布的相关公告。

### 三、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。

### 四、基金的非交易过户

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

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

### 五、基金的转托管

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

### 六、系统内转托管

(1) 系统内转托管是指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（交易单元）之间进行转托管的行为。

(2) 基金份额登记在注册登记系统的基金份额持有人在变更办理场外基金赎回业务的销售机构（网点）时，可办理已持有基金份额的系统内转托管。

(3) 基金份额登记在证券登记结算系统的基金份额持有人在变更办理场内赎回业务的会员单位（交易单元）时，可办理已持有基金份额的系统内转托管。

具体办理方法参照《业务规则》的有关规定以及基金销售机构的业务规则。

## 七、跨系统转托管

跨系统转托管是指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统间进行转托管的行为。

本基金跨系统转托管的具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司的相关规定办理。

基金份额持有人办理上述业务时，基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。

## 八、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。

## 九、基金的冻结和解冻

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



## 第十一部分 基金份额的上市与交易

### （一）上市交易的基金份额

基金合同生效后，在本基金符合法律法规和深圳证券交易所规定的上市条件的情况下，本基金添利 B 份额申请上市与交易。

### （二）上市交易的地点

深圳证券交易所

### （三）上市交易的时间

基金管理人可以根据有关规定，在符合基金上市交易条件下，申请添利 B 份额在深圳证券交易所上市交易。

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

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

### （四）上市交易的规则

- 1、添利 B 上市首日的开盘参考价为前一交易日添利 B 的基金份额参考净值；
- 2、添利 B 实行价格涨跌幅限制，涨跌幅比例为 10%，自上市首日起实行；
- 3、添利 B 买入申报数量为 100 份或其整数倍；
- 4、添利 B 申报价格最小变动单位为 0.001 元人民币；
- 5、添利 B 上市交易遵循《深圳证券交易所交易规则》、《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》、《深圳证券交易所上市开放式基金业务规则》及其更新以及其他有关规定。

### （五）上市交易的费用

添利 B 上市交易的费用按照深圳证券交易所的有关规定办理。

### （六）上市交易的行情揭示

添利 B 在深圳证券交易所挂牌交易，交易行情通过行情发布系统揭示。行情发布系统同时揭示添利 B 前一交易日的基金份额参考净值。

### （七）上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市、终止上市

添利 B 的停复牌、暂停上市、恢复上市、终止上市按照深圳证券交易所的相关业务规则执行。

（八）相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所对基金上市交易的规则等相关规定内容进行调整的，基金合同相应予以修改，并按照新规定执行，且此项修改无须召开基金份额持有人大会。

（九）相关法律法规、中国证监会允许基金份额通过其他方式进行转让的，本基金的基金份额可以按照相关法律法规规定进行转让，具体以届时发布的相关公告为准。

## 第十二部分 基金份额的登记

### 一、基金份额的登记业务

本基金的登记业务指本指基金登记、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。

本基金的份额采用分系统登记的原则。场内认（申）购或上市交易买入的基金份额登记在证券登记结算系统基金份额持有人深圳证券账户下；场外认（申）购的基金份额登记在注册登记系统基金份额持有人基金账户下。

### 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：

- 1、取得登记费；
- 2、建立和管理投资者开放式基金账户、深圳证券账户；
- 3、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；
- 4、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体上公告；
- 5、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：

- 1、配备足够的专业人员办理本基金份额的登记业务；
- 2、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；
- 3、保持基金份额持有人名册及相关的认购、申购与赎回等业务记录 15 年以

上；

4、对基金份额持有人的开放式基金账户、深圳证券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；

5、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；

6、接受基金管理人的监督；

7、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。

## 第十三部分 基金的投资

### 一、投资目标

在严格控制风险的基础上，为投资者谋求稳健的投资收益。

### 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债券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)。

本基金主要投资于通知存款、银行定期存款、协议存款、短期融资券、中期票据、企业债、公司债、可转债、金融债、地方政府债、次级债、中小企业私募债、资产支持证券、国债、央行票据、债券回购等固定收益类资产。

本基金不直接从二级市场买入股票、权证，也不参与一级市场的新股申购或增发。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：

本基金投资于债券资产占基金资产的比例不低于 80%；在添利 A 的开放日及该日前 4 个工作日和添利 B 的赎回开放日及该日前 4 个工作日，本基金持有现金和到期日不超过一年的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

### 三、投资策略

本基金通过对宏观经济、利率走势、资金供求、信用风险状况、证券市场走势等方面的分析和预测，采取信用策略、久期策略、收益率曲线策略、收益率利差策略、息差策略、债券选择策略等，在严格的风险控制基础上，力求实现基金资产的稳定增值。

#### 1、信用策略

个券信用风险管理的主要依据为该证券的外、内部评级结果。信用评级包括主体信用评级、债项信用评级和评级展望，评级对象包括除国债、央行票据和政策性金融债之外的其他各类固定收益证券。

在内部评级过程中需要进行包括行业分析、企业分析、财务分析和增信措

施在内的综合分析，并运用信用评级方法，结合国内主要信用评级机构的评级结果，给出内部信用评估结果和建议，并经讨论后形成信用风险评级报告并审定，经内部审定后最终确定固定收益证券的内部信用评级。同时还将进行信用评级跟踪，及时、准确的修正评级结果；若发现重大信用风险，及时应对。

本基金在信用风险内部评估时，遵循以下原则：审慎评级原则，在对主体及债项进行信用风险评级过程中，应遵循审慎的原则评估其经营状况和财务风险；定性分析与定量分析相结合的原则，经营风险评估和财务风险评估是信用分析的两大主要内容，前者采用以定性为主、定量为辅的分析方法，后者采取以定量为主、定性为辅的分析方法，在对主体及债项进行信用风险评级过程中，需综合考虑两方面的因素，综合评定；历史考察和未来预测相统一的原则：债券评级的目的是预测发行主体未来的偿债能力和违约风险，在评级过程中，需要根据其历史经营业绩、竞争优势和劣势、发展规划以及管理层的经营能力，着重考察其未来经营和现金流状况，预测和评价发行主体的营运周期、未来资本运作以及其对未来财务状况的影响。

## 2、久期策略

本基金根据中期的宏观经济走势和经济周期波动趋势，判断债券市场的未来走势，并形成对未来市场利率变动方向的预期，动态调整组合的久期。当预期收益率曲线下移时，适当提高组合久期，以分享债券市场上涨的收益；当预期收益率曲线上移时，适当降低组合久期，以规避债券市场下跌的风险。本基金还通过市场上不同期限品种交易量的变化来分析市场在期限上的投资偏好，并结合对利率走势的判断选择合适久期的债券品种进行投资。

## 3、收益率曲线策略

在确定投资组合久期后，本基金根据对市场利率变化周期以及不同期限券种供求状况等的分析，预测未来收益率曲线形状的可能变化。并针对收益率曲线形态特征确定合理的组合期限结构，包括采用集中（子弹）策略、两端（哑铃）策略和梯形（阶梯）策略等，在短期债券间进行动态调整，从债券的相对价格变化中获利。

骑乘策略是指当收益率曲线相对陡峭时，买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券即收益率水平处于相对高位的债券，随着债券剩余期限缩短，债券的收益率水平将会较投资期初有所下降，对应的是债券价格走高，本基金通过骑乘策略获

得价差收益。

#### 4、息差策略

息差策略是指利用市场回购利率低于债券收益率的情形,通过正回购将所获得资金投资于债券的策略。市场回购利率往往低于债券的收益率,为息差交易提供了机会。本基金充分考虑市场回购资金利率与债券收益率之间的关系,选择适当的杠杆比率,谨慎实施息差策略,以提高投资组合收益水平。

#### 5、资产支持证券投资策略

资产支持证券是指由金融机构作为发起机构,将信贷资产信托给受托机构,由受托机构向投资机构发行,以该财产所产生的现金支付其收益的证券。本基金通过对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。

#### 6、流动性策略

本基金还将从市场环境,债券发行人特征和债券特征等方面充分考察固定收益类资产的流动性风险,具体包括个券的发行方式、发行规模、交易规模、交易方式、交易场所、交易成本、交易即时性、信用评级、剩余期限、债券票息、债券复杂性等方面,充分考察固定收益类资产的流动性风险,并确定该个券投资总量的上限。

#### 7、中小企业私募债投资策略

中小企业私募债票面利率较高、信用风险较大、二级市场流动性较差。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。

#### 四、投资限制

##### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

- (1) 本基金投资于债券资产占基金资产的比例不低于 80%；
  - (2) 在添利 A 的开放日及该日前 4 个工作日和添利 B 的赎回开放日及该日前 4 个工作日，本基金所持有现金和到期日不超过一年的政府债券不低于基金资产净值的 5%；
  - (3) 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%；
  - (4) 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%；
  - (5) 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%；
  - (6) 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%；
  - (7) 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%；
  - (8) 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；
  - (9) 本基金投资于单只中小企业私募债券的市值，不得超过该基金资产净值的 10%；
  - (10) 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；
  - (11) 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。
- 因证券市场波动、债券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日



内进行调整。法律法规另有规定的，从其规定。

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。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，或以变更的规定为准。

## 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) 向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- (6) 买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他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；
- (7) 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；
- (8) 依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

## 五、业绩比较基准

本基金业绩比较基准：中债综合（全价）指数收益率

中债综合（全价）指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制，是以 2001 年 12 月 31 日为基期，基点为 100 点，并于 2002 年 12 月 31 日起发布。中债综合（全价）指数的样本具有广泛的市场代表性，涵盖主要交易市场（银行间市场、交易所市场等）、不同发行主体（政府、企业等）和期限（长期、中期、短期等），能够很好地反映中国债券市场总体价格水平和变动趋势，适合作为本基金的业绩比较基准。

若未来市场发生变化导致此业绩比较基准不再适用或有更加适合的业绩比较基准，基金管理人有权根据市场发展状况及本基金的投资范围和投资策略，调整本基金的业绩比较基准。业绩基准的变更须经基金管理人和基金托管人协商一致，并在更新的招募说明书中列示，报中国证监会备案，而无需基金份额持有人大会审议。

## 六、风险收益特征

本基金是债券型证券投资基金，属于具有中低预期风险、预期收益特征的基金品种，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金。

从投资者具体持有的基金份额来看，由于基金收益分配的安排，添利 A 将表现出低风险、收益稳定的明显特征，其预期收益和预期风险要低于普通的债券型基金份额；添利 B 则表现出高风险、高收益的显著特征，其预期收益和预期风险要高于普通的债券型基金份额。

## 七、基金管理人代表基金行使债权人权利的处理原则及方法

1、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利，保护基金份额持有人的利益；

2、有利于基金财产的安全与增值；

3、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

## 八、基金的融资、融券

本基金可以按照国家的有关规定进行融资、融券。

## 九、投资决策流程

### 1、投资决策依据

投资决策依据包括：国家有关法律、法规、规章和基金合同的有关规定；宏观经济发展趋势、微观企业运行趋势；证券市场走势。

### 2、投资决策原则

合法合规、保密、忠于客户、资产分离、责任分离、谨慎投资、公平交易及严格控制。

### 3、投资决策机制

本基金投资的主要组织机构包括投资决策委员会、投资总监、基金经理、研究部和中央交易室，投资过程须接受监察稽核部的监督和运营部的技术支持。

其中，投资决策委员会作为公司基金投资决策的最高机构，主要负责评价并批准基金的资产配置提案；协同风险控制委员会，审查和监控公司所有管理资产的业绩和风险，并在必要时做出修改。

投资总监全面负责公司基金投资管理业务，协调所有基金的投资活动，并监控、审查基金资产的投资业绩和风险。

基金经理负责通过与研究部的通力合作，拟定资产配置提案提交投资决策委员会；并负责投资组合的构建和日常管理，向中央交易室下达投资指令并监控组合仓位。

#### 4、投资决策程序

本基金通过对不同层次的决策主体明确投资决策权限，建立完善的投资决策体系和投资运作流程：

（1）投资决策委员会会议：由投资决策委员会主席主持，对基金经理或其他投资决策委员会成员提交的基金投资策略、战略资产配置、投资范围和权限等重大投资决策事项进行深入分析、讨论并做出决议。

（2）在借助外部研究成果的基础上，研究部同时进行独立的内部研究。

（3）基金经理根据投资决策委员会授权和会议决议，在研究部的研究支持下，拟定投资计划，并进行投资组合构建或调整。在组合构建和调整的过程中，基金经理必须严格遵守基金合同的投资限制及其他要求。

（4）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。

## 第十四部分 基金的财产

### 一、基金资产总值

基金资产总值是指购买各类证券及票据价值、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和。

### 二、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### 三、基金财产的账户

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

### 四、基金财产的保管和处分

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

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

## 第十五部分 基金资产估值

### 一、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。

### 二、估值对象

本基金的估值对象为本基金所拥有的债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等金融资产及金融负债。

### 三、估值方法

#### 1、证券交易所上市的债券的估值

(1) 交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

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

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

2、首次公开发行未上市的债券，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，采用估值技术确定公允价值。

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

6、本基金持有的回购以成本列示，按合同利率在回购期间内逐日计提应收或应付利息。

7、本基金持有的银行存款和备付金余额以本金列示，按相应利率逐日计提利息。

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。

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

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

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

#### 四、估值程序

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

基金管理人在基金资产净值计算的基础上，按照基金合同的规定采用“虚拟清算”原则计算并公告添利A和添利B基金份额参考净值。基金份额参考净值是对两级基金份额价值的一个估算，并不代表基金份额持有人可获得的实际价值。添利A和添利B基金份额参考净值的计算，保留到小数点后3位，小数点后第4位四舍五入。

每个工作日计算基金份额净值及两级基金的基金份额参考净值，并按规定公

告。

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

#### 五、估值错误的处理

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

基金合同的当事人应按照以下约定处理：

##### 1、估值错误类型

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

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

##### 2、估值错误处理原则

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

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

(3) 因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但估值错误责任方仍应对估值错误负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还

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

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

### 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后,有关的当事人应当及时进行处理,处理的程序如下:

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

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

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

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

### 4、基金份额净值估值错误处理的方法如下:

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

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

(3) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的,从其规定处理。

## 六、暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券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、占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变,而基金管理人为保障基金份额持有人的利益,决定延迟估值;

4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。



## 七、基金净值的确认

用于基金信息披露的基金资产净值、基金份额净值、添利 A 和添利 B 基金份额参考净值、添利 A 和添利 B 开放日的添利 A 和添利 B 基金份额参考净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的净值计算结果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。

## 第十六部分 基金费用与税收

### 一、基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、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 0.60% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

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 3 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 3 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。

上述“一、基金费用的种类中第 3—8 项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

### 三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

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

### 四、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## 第十七部分 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

本基金（包括添利 A 份额与添利 B 份额）不进行收益分配。

法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

## 第十八部分 基金的会计与审计

### 一、基金会计政策

1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；

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

3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；

4、会计制度执行国家有关会计制度；

5、本基金独立建账、独立核算；

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

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

### 二、基金的年度审计

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

2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意。

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

## 第十九部分 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。

### 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全国性报刊（以下简称“指定报刊”）和基金管理人、基金托管人的互联网网站（以下简称“网站”）等媒介披露，并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

三、本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

- 1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；
- 2、对证券投资业绩进行预测；
- 3、违规承诺收益或者承担损失；
- 4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构；
- 5、登载任何自然人、法人或者其他组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；
- 6、中国证监会禁止的其他行为。

四、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报刊上；基金管理人在公告的 15 日前向主要办公场所所在地的中国证监会派出机构报送更新的招募说明书，并就有关更新内容提供书面说明。

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

基金募集申请经中国证监会核准后，基金管理人在基金份额发售的 3 日前，将基金招募说明书、《基金合同》摘要登载在指定报刊上；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报刊和网站上。

## （三）《基金合同》生效公告

基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日在指定报刊和网站上登载《基金合同》生效公告。

## （四）基金份额上市交易公告书

添利 B 份额获准在证券交易所上市交易的，基金管理人应当在基金份额上市交易的三个工作日前，将添利 B 份额上市交易公告书登载在指定报刊和网站上。

## （五）两级基金的基金份额配比

在基金定期报告中，基金管理人应当计算并公告两级基金的基金份额配比。

## （六）基金资产净值、基金份额净值、两级基金的基金份额参考净值公告

1、本基金的基金合同生效后，在添利 B 上市交易前，基金管理人将至少每周公告一次基金资产净值、基金份额净值和两级基金的基金份额参考净值；

2、在添利 B 上市交易后，基金管理人将在每个交易日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露基金份额净值和两级基金的基金份额参考净值；

3、基金管理人将公告半年度和年度最后一个市场交易日的基金资产净值、基金份额净值和两级基金的基金份额参考净值。基金管理人应当在上述市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和两级基金的基金份额参考净值登载在指定报刊网站上；

4、基金管理人在添利 A 的开放日披露前一日添利 A 的基金份额参考净值及其份额累计参考净值，在添利 B 的开放日披露前一日添利 B 的基金份额参考净值及其份额累计参考净值；

5、基金托管人对基金资产净值、基金份额净值、添利 A 和添利 B 的基金份额参考净值、添利 A 的每个开放日的基金份额参考净值和添利 B 的每个开放日的基金份额参考净值及其份额累计参考净值以及相关披露内容进行复核。

#### （七）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。

#### （八）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报刊上。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报刊上。

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报刊和网站上。

《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。

#### （九）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、管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- 17、基金份额净值、开放日添利 A 或添利 B 的申购与赎回价格计价错误达基金份额净值、开放日添利 A 或添利 B 的申购与赎回价格的 0.5%；
- 18、办理添利 A 及添利 B 申购、赎回的开放日；

- 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、添利 A 或添利 B 申购、赎回费率及其收费方式发生变更；
- 22、添利 A 及/或添利 B 发生巨额赎回并延缓支付；
- 23、添利 A 及/或添利 B 进行份额折算；
- 24、添利 A 或添利 B 暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；
- 25、本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；
- 26、添利 B 暂停上市、恢复上市或终止上市；
- 27、中国证监会规定的其他事项。

#### （十）澄清公告

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

#### （十一）基金份额持有人大会决议

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

#### （十二）投资中小企业私募债券相关公告

基金管理人应当在基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告等定期报告和招募说明书等文件中披露中小企业私募债券的投资情况。

#### （十三）中国证监会规定的其他信息。

### 六、信息披露事务管理

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

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

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回价格、

基金定期报告和定期更新的招募说明书等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人出具书面文件或者盖章确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定报刊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报刊和网站上披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒体披露信息，但是其他公共媒体不得早于指定报刊和网站披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

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

#### 七、信息披露文件的存放与查阅

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

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

## 第二十章 风险揭示

### 一、市场风险与对策

由于经济和政治环境、产业和行业状况、公司基本面等方面的变化，可能导致基金投资组合中的证券市值发生不可预见的变动，进而影响基金份额净值。市场风险主要包括政策风险、经济周期风险、利率风险、公司经营风险、通货膨胀风险和财务风险等。其中，政策风险是指有关证券市场的政策发生重大变化或是有重要的法规、举措出台，引起证券市场的波动，从而给投资者带来风险；经济周期风险是指证券市场行情周期性变动而引起的风险，这种行情变动不是指证券价格的日常波动和中级波动，而是指证券行情长期趋势的改变；利率风险是指市场利率变动引起证券投资收益变动的可能性，市场利率的变化会引起证券价格变动，并进一步影响证券收益的确定性；公司经营风险是指公司的决策人员与管理层人员在经营管理过程中出现失误而导致公司盈利水平变化，从而使投资者预期收益下降的可能；通货膨胀风险是指由于通货膨胀、货币贬值给投资者带来实际收益水平下降的风险；财务风险是指公司财务结构不合理、融资不当而导致投资者预期收益下降的风险。

为控制此类风险，基金管理人将努力加强对宏观经济与国家政策的分析，研究并预测经济周期、利率走势和行业发展趋势，以此作为资产配置和证券选择的依据；基金管理人的风险控制系统实施对从个券到全部组合等风险源的全面风险管理，从而得以实时监控组合风险敞口，及时识别风险源并调整投资组合；本基金将通过构建多样化组合并限制单只证券过高持仓以避免个券过度风险；岗位风险管理职能方面：基金管理人的金融工程部自行开发风险管理系统并将定期出具业绩和风险评价报告，重点债券的剩余期限、久期、凸性等指标；基金经理和投资总监将负责实时监控组合风险头寸并决定是否调整投资组合。

### 二、流动性风险与对策

在本基金的申购和赎回开放日，基金管理人都有义务接受投资者的申购和赎回。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，进而影响基

金份额净值。

为控制此类风险，基金管理人的投资组合管理和交易系统设置了预警和自动控制功能，以便对基金交易中可能存在的流动性风险发出警报；基金运营部将与基金销售部、托管行保持高效沟通以及及时预测资金流动；基金经理将每日依据基金运营部提供的信息监控基金的净现金头寸和资金流入/流出情况；金融工程部定期计算流动性及可能存在的风险，并出具报告提交基金经理、投资总监和风险控制委员会。

另外，投资组合持有的证券由于外部环境影响或基本面重大变化而导致流动性降低，基金管理人难以在合理的时间内以公允价格将其变现而引起资产的损失或交易成本的不确定性，从而产生流动性风险。本基金将根据个别债券发行总量、流通量、上市时间等流动性指标，决定投资总量。

### 三、管理风险与对策

在基金管理运作过程中，基金管理人的知识、技能、经验及判断等主观因素会影响其对相关信息、经济形势及证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平。因此，基金管理人的管理水平、管理手段和管理技术等因素可能会影响本基金的收益水平。

为控制此类风险，基金管理人将充分发挥中外合资基金管理公司在国际化和本土化方面的双重优势，吸取国内外同行业在投资管理方面的经验教训，引进外资股东的先进管理经验和管理技术，建立优秀的管理团队和专业团队；同时，基金管理人实施积极的人才战略，通过外部引进、内部培训、科学考核、有效激励等多种方式不断提高团队的经营管理水平和投资研究能力，并根据实际情况引进新的管理技术和方法，努力为基金份额持有人带来更好的投资回报；投资决策委员会对基金经理助理、基金经理和投资总监等各级岗位的基金投资分别实施不同的投资交易限制以及重要交易的逐级授权制度，从而确保实现对于管理风险的有效监督和管理。

### 四、信用风险与对策

基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，都可能导致基金资产损失和收益变化，从而产生风险。

为控制此类风险，基金管理人将选择资信状况良好的机构作为本基金交易对手，投资于具备较高信用评级的债券并尽可能通过多样化持债回避信用风险。

## 五、其它风险

### 1、操作风险与对策

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、交易错误等风险。

为控制此类风险，基金管理人将在充分考虑内外部环境的基础上，建立科学、严密、高效的内部控制体系；投资组合管理和交易系统中设置了交易前的自动限制和控制功能，以防止主观和客观的错误交易和违规交易。同时，基金管理人注重提高员工专业水平，并加强员工职业道德教育，以促进合规文化的形成。

### 2、技术风险与对策

在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投资者的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理公司、注册登记机构、销售机构、证券交易所、证券登记结算机构等。

这类风险的控制和防范主要依赖于系统的可靠性以及完备的备份策略。

### 3、其它风险与对策

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

为控制这类风险，基金管理人建立了突发紧急事件处理制度以及完备的灾难恢复计划，以防范和控制不可抗力因素造成的风险。

### 4、基金运作的特有风险

添利 A 份额与添利 B 份额的运作有别于普通的开放式基金与封闭式基金，投资者投资于本基金还将面临以下特有风险。

#### (1) 基金份额的风险收益特征

本基金是债券型证券投资基金，属于具有中低预期风险、预期收益特征的基金品种，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金。

从投资者具体持有的基金份额来看，由于基金收益分配的安排，添利 A 将表现出低风险、收益稳定的明显特征，其预期收益和预期风险要低于普通的债券型基金份额；添利 B 则表现出高风险、高收益的显著特征，其预期收益和预期

风险要高于普通的债券型基金份额。

## (2) 添利 A 的特有风险

### 1) 流动性风险

添利 A 并非每日开放赎回申请,基金份额持有人只能在添利 A 的赎回开放日赎回添利 A;在非开放日,基金份额持有人将不能赎回添利 A 而出现流动性风险。另外,因不可抗力等原因,添利 A 的开放日可能延后,导致基金份额持有人不能按期赎回而出现风险。

### 2) 利率风险

在添利 A 的每次赎回开放日,本基金将根据一年期银行定期存款利率(税后)加利差设定添利 A 的年收益率。如果赎回开放日利率下调,添利 A 的年收益率将相应向下进行调整;如果在非赎回开放日出现利率上调,添利 A 的年收益率并不会立即进行相应调整,而是等到下一个赎回开放日再根据实际情况作出调整,从而出现利率风险。

### 3) 基金的折算风险

对于添利 A,在基金合同生效之日起每满半年的最后一个工作日,基金管理人将根据《基金合同》的约定对添利 A 实施基金份额折算。添利 A 进行基金份额折算后,如果出现新增份额的情形,投资者可通过赎回折算后新增份额的方式获取投资回报,但是,投资者通过赎回折算后的新增份额以获取投资回报的方式并不等同于基金收益分配,投资者可能须承担相应的交易成本。

### 4) 极端情形下的损失风险

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

### 5) 强制赎回风险

在办理过渡期申购时,基金管理人有权根据基金份额上限和两类份额配比进行规模控制;其中,过渡期内添利 A、添利 B 基金份额配比不超过 7:3,两级基金份额上限详见相关公告,规模控制的具体方式包括但不限于比例确认、不进行或提前终止某一类份额的过渡期申购、减少某一类份额持有人所持份额等。

## (3) 添利 B 的特有风险

### 1) 杠杆机制风险

本基金在扣除添利 A 的应计收益分配后的全部剩余收益将归添利 B 享有，亏损以添利 B 的资产净值为限由添利 B 承担，因此，添利 B 在可能获取放大的基金资产增值收益预期的同时，也将承担基金投资的全部亏损，极端情况下，添利 B 可能遭受全部的投资损失。

#### 2) 利率风险

在添利 A 的每次赎回开放日，本基金将根据一年期银行定期存款利率(税后)加利差重新设定添利 A 的年收益率，如果届时的利率上调，添利 A 的年收益率将相应向上作出调整，添利 B 的资产分配将减少，从而出现利率风险。

#### 3) 份额配比变化风险

添利 B 的份额数量在封闭运作期内保持不变，添利 A 则在基金合同生效后每满半年开放一次。由于添利 A 每次开放后的基金份额余额是不确定的，在添利 A 每次开放结束后，添利 A、添利 B 的份额配比可能发生变化。

两级份额配比的不确定性及其变化将引起添利 B 的杠杆率变化，出现份额配比变化风险。

#### 4) 杠杆率变动风险

添利 B 具有高风险、高收益的特性，由于添利 B 内含杠杆机制，基金资产净值的波动将以一定的杠杆倍数反映到添利 B 的基金份额参考净值波动上，但是，添利 B 的预期收益杠杆率并不是固定的，在两级份额配比保持不变的情况下，添利 B 的基金份额参考净值越高，杠杆率越低，收益放大效应越弱，从而产生杠杆率变动风险。

#### 5) 上市交易风险

添利 B 上市交易后可能因信息披露等原因导致基金停牌，投资者在停牌期间不能买卖添利 B，产生风险；添利 B 上市后也可能因交易对手不足产生流动性风险。

#### 6) 折/溢价交易风险

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

(4) 本基金投资的中小企业私募债是根据相关法律法规由以非公开方式发行的债券，不能公开交易，外部评级机构一般不对这类债券进行外部评级，可能会降低市场对该类债券的认可度，从而影响该类债券的市场流动性，具有潜在的



较大流动性风险。当发债主体信用质量恶化时，受市场流动性所限，本基金可能无法卖出所持有的相关私募债及非公开发行公司债，具有一定的信用风险，由此可能给份额净值带来更大的负面影响和损失。

## 第二十一部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### 一、《基金合同》的变更

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

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准或出具无异议意见后方可执行，并自决议生效后两日内在指定媒体公告。

### 二、《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- 3、《基金合同》约定的其他情形；
- 4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### 三、基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会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 3 个月。

#### 四、清算费用

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

#### 五、基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，根据基金合同“虚拟清算”的原则计算并确定添利 A 和添利 B 基金份额持有人分别应得的剩余资产比例，并据此比例对添利 A 和添利 B 的基金份额持有人进行剩余基金资产的分配。

#### 六、基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 2 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

#### 七、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 第二十二部分 基金合同的内容摘要

基金合同的内容摘要见附件一。

## 第二十三部分 基金托管协议的内容摘要

基金托管协议的内容摘要见附件二。

## 第二十四部分 对基金份额持有人的服务

本基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务。以下是主要的服务内容，基金管理人将根据基金份额持有人的需要和市场的变化，增加或变更服务项目。主要服务内容如下：

### 一、基金份额持有人交易资料的寄送服务

每次交易结束后，基金份额持有人应在 T+2 个工作日后及时通过销售机构的网点查询和打印确认单；在每季度结束后的 10 个工作日内，登记机构或基金管理人按基金份额持有人意愿，向有交易的基金份额持有人以书面或电子文件形式寄送季度对账单；在每年度结束后 15 个工作日内，登记机构或基金管理人按基金份额持有人意愿，对所有的基金份额持有人以书面或电子文件形式寄送年度对账单。

### 二、在线服务

基金份额持有人可以通过基金管理人的网站 [www.lcfunds.com](http://www.lcfunds.com) 订制基金信息资讯、并享受本基金管理人为基金份额持有人提供的投资报告服务。

### 三、查询与咨询服务

基金管理人客服中心为基金份额持有人提供 7×24 小时的电话语音服务，基金份额持有人可通过客服电话 021-68609700，400-700-9700（免长途话费）的语音系统或登录基金管理人网站 [www.lcfunds.com](http://www.lcfunds.com) 查询基金净值、基金账户信息、基金产品介绍等情况，人工座席在工作时间（周一至周五，9:00-17:00）还将为基金份额持有人提供周到的人工答疑服务。

### 四、投诉受理

基金份额持有人可拨打客服中心电话 021-68609700，400-700-9700（免长途话费）投诉直销机构和代销机构的人员及其服务。

## 第二十五部分 其他应披露事项

本基金的其他应披露事项将严格按照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》等相关法律法规规定的的内容与格式进行披露，并在指定媒体上公告。

## 第二十六部分 招募说明书的存放及查阅方式

本招募说明书存放在基金管理人、基金托管人所在地，投资者可在办公时间免费查阅；也可按工本费购买本招募说明书复印件，但应以正本为准。投资者也可以直接登录基金管理人的网站进行查阅。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。



## 第二十七部分 备查文件

### 一、备查文件包括：

- 1、中国证监会批准中欧纯债分级债券型证券投资基金募集的文件；
- 2、《中欧纯债添利分级债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《中欧纯债添利分级债券型证券投资基金注册与登记过户委托代理协议》；
- 4、《中欧纯债添利分级债券型证券投资基金托管协议》；
- 5、法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 8、中国证监会规定的其他文件。

### 二、备查文件的存放地点和投资者查阅方式：

以上备查文件存放在基金管理人的办公场所，在办公时间可供免费查阅。

中欧基金管理有限公司

2013年10月24日

## 附件一：基金合同摘要

### 一、基金管理人、基金托管人和基金份额持有人的权利义务

#### （一）基金管理人

名称：中欧基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 8 层

法定代表人：唐步

设立日期：2006 年 7 月 19 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2006]102 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：1.88 亿元人民币

存续期限：持续经营

联系电话：021-6860 9600

#### （二）基金托管人

名称：中国邮政储蓄银行股份有限公司（简称：中国邮储银行）

住所：北京市西城区金融大街 3 号

法定代表人：李国华

成立时间：2007 年 3 月 6 日

批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复[2006]484 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：450 亿元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：证监许可[2009]673 号

#### （三）基金份额持有人

基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受，基金投资者自依据《基金合同》取得的基金份额，即成为本基金份额持有人和《基金合同》的当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为《基金合同》当事人并不以在《基金合同》上书面签章或签字为必要条件。

同一类别每份基金份额具有同等的合法权益。

#### （四）基金管理人的权利与义务

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

- （1）依法募集基金；
- （2）自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
- （3）依照《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）召集基金份额持有人大会；
- （6）依据《基金合同》及有关法律规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- （7）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- （8）选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；
- （9）担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；
- （10）依据《基金合同》及有关法律规规定决定基金收益的分配方案；
- （11）在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；
- （12）依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- （13）在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资、融券；
- （14）以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- （15）选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；
- （16）在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换和非交易过户的业务规则；
- （17）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

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

(2) 办理基金备案手续；

(3) 自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；

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

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

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

(7) 依法接受基金托管人的监督；

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

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(10) 编制季度、半年度和年度基金报告；

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

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

(13) 按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；

(14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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

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

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

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

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

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

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

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

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

(24) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期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。

(五) 基金托管人的权利与义务

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

(1) 自《基金合同》生效之日起，依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产；

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

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

(4) 根据相关市场规则，为基金开设证券账户、为基金办理证券交易资金清算。

(5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

(6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

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

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

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

(5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

(6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户，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定；

(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。

(六) 基金份额持有人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金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) 依法申请赎回其持有的基金份额；
- (4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会；
- (5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- (6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- (7) 监督基金管理人的投资运作；
- (8) 对基金管理人、基金托管人、基金销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；
- (9) 法律法规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》；
- (2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自行承担投资风险；
- (3) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；
- (4) 缴纳基金认购、申购款项及法律法规和《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定；
- (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。
- (十) 基金合同当事各方的权利义务以本基金合同为依据

## 二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。

基金份额持有人大会的审议事项应分别由添利 A、添利 B 基金份额持有人独立进行表决。添利 A、添利 B 基金份额持有人持有的每一份基金份额在其份额类别内拥有同等的投票权。



(一) 召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

- (1) 终止《基金合同》；
- (2) 更换基金管理人；
- (3) 更换基金托管人；
- (4) 转换基金运作方式；
- (5) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但法律法规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) 终止添利 B 上市，但因添利 B 不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市的除外；
- (9) 变更基金投资目标、范围或策略；
- (10) 变更基金份额持有人大会程序；
- (11) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- (12) 单独或合计持有添利 A 和添利 B 各自的基金总份额 10% 以上(含 10%) 基金份额的基金份额持有人(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；
- (13) 对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；
- (14) 法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

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

- (1) 调低基金管理费、基金托管费；
- (2) 法律法规要求增加的基金费用的收取；
- (3) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率、变更收费方式；
- (4) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；
- (5) 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生变化；
- (6) 按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的以

外的其他情形。

## （二）会议召集人及召集方式

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

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。

4、代表单独或合计持有添利 A 和添利 B 各自的基金总份额 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，代表单独或合计持有添利 A 和添利 B 各自的基金总份额 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。

5、代表单独或合计持有添利 A 和添利 B 各自的基金总份额 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，单独或合计持有添利 A 和添利 B 各自的基金总份额 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，在指定媒体公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

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

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

3、如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对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书委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，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书符合法律法规、《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，有效的添利 A、添利 B 份额不少于在权益登记日添利 A、添利 B 各自基金总份额的 50%（含 50%）。

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式在表决截至日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

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

(3) 本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的添利 A、添利 B 份额不少于在权益登记日添利 A、添利 B 各自基金总份额的 50%（含 50%）；

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

3、在法律法规和监管机关允许的情况下，本基金亦可采用网络、电话等其他非现场方式或者以非现场方式与现场方式结合的方式召开基金份额持有人大会，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，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。

(五) 议事内容与程序

1、议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如《基金合同》的重大修

改、决定终止《基金合同》、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及《基金合同》规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

## 2、议事程序

### (1) 现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人以所代表的添利 A、添利 B 各自基金份额 50% 以上（含 50%）多数选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名（或单位名称）、身份证明文件号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）和联系方式等事项。

### (2) 通讯开会

在通讯开会的情况下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后 2 个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

### (六) 表决

基金份额持有人大会的审议事项应分别由添利 A、添利 B 基金份额持有人独立进行表决，且添利 A、添利 B 基金份额持有人持有的每一份基金份额在其份额类别内拥有同等的投票权。

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添利 A、添利 B 各自的基金份额持有人（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添利 A、添利 B 各自的基金份额持有人（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》以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

## （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书面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 日内报中国证监会核准或者备案。

基金份额持有人大会的决议自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 日内在指定媒体上公告。如果采用通讯方式进行表决,在公告基金份额持有人大会决议时,必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决议。生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。

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

## 三、基金合同解除和终止的事由、程序

### (一) 基金合同的终止

有下列情形之一的,基金合同将终止:

1、基金份额持有人大会决定终止的;

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

3、《基金合同》约定的其他情形；

4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

## （二）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 3 个月。

## （三）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。

## （四）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，根据基金合同“虚拟清算”的



原则计算并确定添利 A 和添利 B 基金份额持有人分别应得的剩余资产比例，并据此比例对添利 A 和添利 B 的基金份额持有人进行剩余基金资产的分配。

#### （五）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 2 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

#### （六）基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

### 四、争议的解决方式

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

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

《基金合同》受中国法律管辖。

### 五、基金合同存放地和投资人取得基金合同的方式

基金合同可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅，但其效力应以基金合同正本为准。

## 附件二：基金托管协议摘要

### 一、托管协议当事人

#### （一）基金管理人

名称：中欧基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 8 层

办公地址：上海市浦东新区花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 8 层

邮政编码：200120

法定代表人：唐步

成立时间：2006 年 7 月 19 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：证监基金字[2006]102 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：1.88 亿元人民币

存续期间：持续经营

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和经中国证监会许可的其他业务。

#### （二）基金托管人

名称：中国邮政储蓄银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 3 号

办公地址：北京市西城区金融大街 3 号 A 座

邮政编码：100808

法定代表人：李国华

成立时间：2007 年 3 月 6 日

批准设立机关及批准设立文号：中国银监会银监复[2006]484 号

基金托管业务批准文号：证监许可[2009]673 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：450 亿元人民币

存续期间：持续经营

经营范围：吸收本外币储蓄存款；办理汇兑；从事银行卡（借记卡）业务；

代理收付款项，包括代发工资和社会保障基金、代理各项公用事业收费和代收税款等；代理发行、兑付政府债券；代理买卖外汇；代理政策性银行、商业银行及其他金融机构特定业务；办理政策性银行、中资商业银行和农村信用社大额协议存款；买卖政府债券、金融债券和中央银行票据；承销政府债券和政策性金融债券；提供个人存款证明服务；提供保险箱服务；办理网上银行业务；以非牵头行身份参与政策性银行、国有商业银行及股份制商业银行牵头组织的银团贷款业务；邮政储蓄定期存单小额质押贷款业务；开放式证券投资基金代销业务；吸收对公存款；办理国内外结算；办理票据贴现；发行金融债券；从事同行业拆借；买卖、代理买卖外汇；经银监会批准的其他业务。

## 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。基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合基金合同的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。

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债券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)。

本基金主要投资于通知存款、银行定期存款、协议存款、短期融资券、中期票据、企业债、公司债、可转债、金融债、地方政府债、次级债、中小企业私募债、资产支持证券、国债、央行票据、债券回购等固定收益类资产。

本基金不直接从二级市场买入股票、权证，也不参与一级市场的新股申购或增发。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：

本基金投资于债券资产占基金资产的比例不低于 80%；在添利 A 的开放日及该日前 4 个工作日和添利 B 的赎回开放日及该日前 4 个工作日，本基金持有现金和到期日不超过一年的政府债券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、融券比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督：

- 1、本基金投资于债券资产占基金资产的比例不低于 80%；
  - 2、在添利 A 的开放日及该日前 4 个工作日和添利 B 的赎回开放日及该日前 4 个工作日，本基金所持有现金和到期日不超过一年的政府债券不低于基金资产净值的 5%；
  - 3、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%；
  - 4、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%；
  - 5、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%；
  - 6、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%；
  - 7、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%；
  - 8、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；
  - 9、本基金投资于单只中小企业私募债券的市值，不得超过该基金资产净值的 10%；
  - 10、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；
  - 11、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。
- 基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。在符合相关法律法规规定的前提下，因证券市场波动、债券发行人合并、基金规模变动等非本基金管理人的因素致使基金的投资组合不符合上述规定的投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规另有规定的，从其规定。

如果法律法规及监管政策等对基金合同约定的投资禁止行为和投资组合比

例限制进行变更的，本基金可相应调整禁止行为和投资比例限制规定，不需经基金份额持有人大会审议。《基金法》及其他有关法律法规或监管部门取消或变更上述限制的，履行适当程序后，基金不受上述限制，或以变更的规定为准。

基金托管人对基金投资的监督和检查自基金合同生效之日起开始。基金托管人严格依照法律法规规定及基金合同、托管协议约定的监督程序对基金投资、融资、融券比例进行监督，基金管理人仍违反法律法规规定或基金合同约定的投资、融资、融券比例限制造成基金财产损失的，由基金管理人承担责任，基金托管人不承担任何责任。

(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下述基金投资禁止行为进行监督。

根据法律法规的规定及基金合同的约定，基金财产不得用于下列投资或者活动：

1. 承销证券；
2. 向他人贷款或者提供担保；
3. 从事承担无限责任的投资；
4. 买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
5. 向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
6. 买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他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；
7. 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；
8. 依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

基金托管人依照相关法律法规、基金合同及托管协议约定履行了监督职责，基金管理人仍违反法律法规规定或基金合同约定的投资禁止行为而造成基金财产损失的，由基金管理人承担责任，基金托管人不承担任何责任。

(四)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关联

投资限制进行监督。

根据法律法规有关基金禁止从事的关联交易的规定，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公司名单及其更新，并确保所提供的关联交易名单的真实性、完整性、全面性。基金管理人有责任保管真实、完整、全面的关联交易名单，并负责及时更新该名单。名单变更后基金管理人应及时发送基金托管人，基金托管人于2个工作日内进行向基金管理人电话确认已知名单的变更。如果基金托管人在运作中严格依照相关法律法规、基金合同及托管协议约定遵循了监督流程，基金管理人仍违规进行关联交易，并造成基金资产损失的，由基金管理人承担责任，基金托管人不承担任何责任。

若基金托管人发现基金管理人与关联交易名单中列示的关联方进行法律法规禁止基金从事的关联交易时，基金托管人应及时提醒并协助基金管理人采取必要措施阻止该关联交易的发生，若基金托管人采取必要措施后仍无法阻止关联交易发生时，基金托管人有权向中国证监会报告。对于交易所场内已成交的违规关联交易，基金托管人应按相关法律法规和交易所规则的规定进行结算，同时向中国证监会报告。

(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。

基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供经慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手名单，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个工作日内电话确认收到该名单。基金托管人监督基金管理人是否按事前提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易。基金管理人可以定期对银行间债券市场交易对手名单进行更新，如基金管理人根据市场情况需要临时调整银行间债券市场交易对手名单，应向基金托管人说明理由，在与交易对手发生交易前2个工作日内与基金托管人确认，基金托管人于1个工作日内向基金管理人电话确认，新名单自基金托管人确认当日生效。新名单生效前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的

交易，仍应按照协议进行结算。

如果基金托管人发现基金管理人与不在名单内的银行间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资产损失的，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市场交易的交易方式的控制

基金管理人负责对交易对手的资信控制和交易方式进行控制，按银行间债券市场的交易规则进行交易，基金托管人则根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督。如基金托管人发现基金管理人没有按照事先约定的交易对手或交易方式进行交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人撤销交易，基金管理人仍不撤销的，基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任，法律法规另有规定的除外。因交易对手不履行合同造成的基金财产的损失，基金托管人不承担责任，但有权报告中国证监会，法律法规另有规定的除外。

基金管理人在银行间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。基金管理人仍不重新确定交易方式的，基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任，法律法规另有规定的除外。

(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。

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

本基金投资银行存款应符合如下规定：

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

2. 基金管理人与基金托管人应根据相关规定，就本基金银行存款业务另行签订书面协议，明确双方在相关协议签署、账户开设与管理、投资指令传达与执

行、资金划拨、账目核对、到期兑付、文件保管以及存款证实书的开立、传递、保管等流程中的权利、义务和职责，以确保基金财产的安全，保护基金份额持有人的合法权益。

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

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

基金托管人发现基金管理人在选择存款银行时有违反有关法律法规的规定及基金合同的约定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人在 10 个工作日内纠正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在 10 个工作日内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。基金托管人发现基金管理人有关重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人在 10 个工作日内纠正或拒绝结算，若基金管理人拒不执行造成基金财产的损失，基金托管人不承担任何责任。

(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，对基金资产净值计算、基金份额净值计算、两级基金的基金份额参考净值计算、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。

如果基金管理人未经基金托管人的审核擅自将不实的业绩表现数据印制在宣传推介材料上，则基金托管人对此不承担任何责任，并将在发现后立即报告中国证监会。

(八) 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中违反法律法规、基金合同和本托管协议的规定，应及时以书面形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。基金管理人收到通知后应在下一工作日前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。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在上述规定期限内纠正的，基金托管人有权报告中国证监会。



基金托管人发现基金管理人的指令违反法律、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及时改正。如基金管理人拒绝改正的，基金托管人有权报告中国证监会

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

（九）对基金托管人按照法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

（十）基金托管人发现基金管理人存在重大违法、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。

### 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，核查事项包括但不限于基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、及时、准确复核基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值、两级基金的基金份额参考净值，根据基金管理人指令办理清算交收且如遇到问题应及时反馈、相关信息披露和监督基金投资运作是否对非公开信息保密等行为。

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

（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在下一工作日前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，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等。基金管理人有权要求基金托管人赔偿基金因此所遭受的损失。

（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和银行业监督管理机构，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. 基金托管人应安全保管基金财产。未经基金管理人的正当指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。如果基金财产（包括实物证券）在基金托管人保管期间损坏、灭失的，应由该基金托管人承担赔偿责任。
3. 基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户、证券账户和债券托管账户。
4. 基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，与基金托管人的其他业务和其他基金的托管业务实行严格的分账管理，确保基金财产的完整与独立。
5. 基金托管人根据基金管理人的指令，按照法律法规的规定、基金合同和本协议的约定保管基金财产。
6. 对于因为基金投资产生的应收资产和基金认购、申购过程中产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金账户的，基金托管人应及时通知并有义务配合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的损失，基金托管人对此不承担任何责任。
7. 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. 本基金募集期届满之日前，投资者的认购款项只能存入本基金在中国证券登记结算有限责任公司开立的开放式基金结算备付金账户中，任何人不得动用。有效认购款项在基金募集期内产生的利息将按照中国证券登记结算有限责任公司的规定折合成基金份额归基金份额持有人所有或计入基金财产。若场内认购提前结束，认购截止日前（含该日）场内认购款项产生的利息折算成基金份额归基金份额持有人所有；该截止日次日至基金募集结束期间产生的利息计入基金财产。基金募集期产生的利息以登记机构（即中国证券登记结算有限责任公司）的记录为准。

2. 基金募集期满或基金提前结束募集时，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》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为本基金开立的基金银行账户，基金托管人在收到资金当日出具相关证明文件，基金管理人在规定时间内，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，基金托管人应提供充分协助。

## （三）基金银行账户的开立和管理

1. 基金托管人应负责本基金的银行账户的开设和管理。

2. 基金托管人可以本基金的名义在其营业机构开设本基金的银行账户，并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。本基金的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益、收取申购款，均需通过本基金的银行账户进行。

3. 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。

4. 基金银行账户的开立和管理应符合相关法律法规的有关规定。

## （四）基金证券交收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本基金联名的证券账户。

2. 基金证券账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借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. 基金托管人以自身法人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，以本基金的名义在基金托管人托管系统中开立二级结算备付金账户，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。结算备付金的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

4. 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。

5. 若中国证监会或其他监管机构在本托管协议生效日之后允许基金从事其他投资品种的投资业务，涉及相关账户的开设、使用的，按有关规定开设、使用并管理；若无相关规定，则基金托管人应当比照并遵守上述关于账户开设、使用的规定。

#### （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，在中央国债登记结算有限责任公司开立债券托管与结算账户并报中国人民银行备案，并代表基金进行银行间市场债券的结算。基金管理人和基金托管人同时代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议，协议正本由基金托管人保管，协议副本由基金管理人保存。

#### （六）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，在基金管理人和基金托管人商议后由基金托管人负责开立。新账户按有关规则使用并管理。

2. 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，从其规定办理。

#### （七）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负责妥善保管，保管

凭证由基金托管人持有，其中实物证券由基金托管人存放于托管银行的保管库，应与非本基金的其他实物证券分开保管；也可存入登记结算机构的代保管库。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。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。

#### （八）与基金财产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的、与基金有关的重大合同的原件分别由基金管理人、基金托管人保管，相关业务程序另有限制除外。除协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时，应保证基金一方持有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人应在重大合同签署后及时以加密方式将重大合同传真给基金托管人，并在 10 个工作日内将正本送达基金托管人处。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、基金资产净值计算与复核

#### （一）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的金额。

基金份额净值是指计算日基金资产净值除以该计算日基金份额余额后的数值。在计算得出基金份额净值后，根据本基金基金合同约定的计算公式，计算两级基金的基金份额参考净值。

基金份额净值的计算，精确到 0.001 元，小数点后第四位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。国家另有规定的，从其规定。

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

基金管理人每工作日计算基金份额净值、两级基金的基金份额参考净值，经基金托管人复核无误后，按规定公告。

#### （二）复核程序

基金管理人每工作日对基金资产进行估值后，将基金份额净值、两级基金的

基金份额参考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。

(三) 根据有关法律法规，基金资产净值、两级基金的基金份额参考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，按照基金管理人的计算结果对外予以公布。

## 六、基金份额持有人名册的登记与保管

本基金的基金管理人和基金托管人须分别妥善保管的基金份额持有人名册，包括基金合同生效日、基金合同终止日、基金权益登记日、基金份额持有人大会权益登记日、每年 6 月 30 日、12 月 31 日的基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容至少应包括持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册由登记机构编制，由基金管理人审核并提交基金托管人保管。基金托管人有权要求基金管理人提供基金份额持有人名册，基金管理人应及时提供，不得拖延或拒绝提供。

基金管理人应及时向基金托管人提交基金份额持有人名册。每年 6 月 30 日和 12 月 31 日的基金份额持有人名册应于下月前十个工作日内提交；基金合同生效日、基金合同终止日、基金权益登记日、基金份额持有人大会权益登记日等涉及到基金重要事项日期的基金份额持有人名册应于发生日后十个工作日内提交。

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

## 七、争议解决方式

因本协议产生或与之相关的争议，双方当事人应通过协商、调解解决，协商、调解不能解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，仲裁地点为北京市，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。

争议处理期间，双方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责，各自继续

忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和本托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本协议适用中华人民共和国法律并从其解释。

## 八、托管协议的变更和终止

### （一）托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行修改。修改后的新协议，其内容不得与基金合同的规定有任何冲突。基金托管协议的变更报中国证监会核准或备案后生效。

### （二）基金托管协议终止的情形

1. 基金合同终止；
2. 基金托管人解散、依法被撤销、破产或由其他基金托管人接管基金资产；
3. 基金管理人解散、依法被撤销、破产或由其他基金管理人接管基金管理权；
4. 发生法律法规或基金合同规定的终止事项。