（上接A21版）

（32） 大泰金石投资管理有限公司
注册地址:南京市建邺区江东中路359 号国睿大厦一号楼B 区4 楼A506 室
办公地址:上海市长宁区虹桥路1386 号文广大厦15 楼
法定代表人:袁顾明
客服电话:021-22267995
公司网站:www.dtfunds.com
（33） 北京乐融多源投资咨询有限公司
注册地址:北京市朝阳区西大望路1 号1 号楼1603
办公地址:北京市朝阳区西大望路1 号温特莱中心A 座16 层
法定代表人:董浩
客服电话:400-068-1176
公司网站:www.jimufund.com
（34） 珠海盈米财富管理有限公司
注册地址:珠海市横琴新区宝华路6 号105 室-3491
办公地址:广州市海珠区琶洲大道东1 号保利国际广场南塔12 楼B1201-1203
法定代表人:肖雯
客服电话:020-89629066
公司网站:www.yingmi.cn
（35） 深圳众禄金融控股股份有限公司
注册地址:深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8 楼
办公地址:深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8 楼
法定代表人:薛峰
客服电话:4006-788-887
公司网站:www.zlfund.cn www.jjmmw.com
（36） 深圳富济财富管理有限公司
注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1 号A 栋201 室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）
办公地址:深圳市南山区科苑南路高新南七道惠恒集团二期418 室
法定代表人:齐小贺
客服电话:0755-83999907
公司网站: www.jinqianwo.cn
（37） 奕丰金融服务（深圳）有限公司
注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1 号A 栋201 室（入住深圳市前海商务秘书有限公司）
办公地址:深圳市南山区海德三路海岸大厦东座1115 室,1116 室及1307 室
法定代表人:TAN YIK KUAN
客服电话: 400-684-0500
公司网站: www.ifastps.com.cn
（38） 和讯信息科技有限公司
办公地址:上海市浦东新区东方路18号保利大厦18楼
法定代表人:王莉
服务热线:400-920-0022
网址:licaike.hexun.com

2、场内代销机构

场内代销机构为具有基金代销资格的上海证券交易所会员单位,具体代销机构见《发售公告》。本基金募集结束前获得基金代销资格的上海证券交易所会员单位可新增为本基金的场内代销机构。

基金管理人可根据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》和《基金合同》等的规定,选择其他符合要求的机构代理销售本基金,并及时履行信息披露义务。

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:周明
联系人:崔巍
电话:（010）50938856
传真:（010）50938907

三、出具法律意见书的律师事务所和经办律师

名称: 国浩律师（上海）事务所
办公地址:上海市静安区北京西路968号嘉地中心23-25层
负责人:黄宁宇
电话: 021-52341668
传真: 021-52341670
联系人:孙芳尘
经办律师:宣伟华、孙芳尘

四、审计基金财产的会计师事务所和经办注册会计师

名称:普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
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:上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
法定代表人:杨绍信
电话:（021）23238888
联系人:黄靖婷
经办注册会计师:薛竞、黄靖婷

五、其他服务机构及委托办理业务的有关情况

公司信息技术系统由信息技术系统基础设施系统以及有关业务应用系统构成。信息技术系统基础设施系统包括机房工程系统、网络集成系统,这些系统在公司筹建之初由专业的系统集成公司负责建成,之后日常的维护管理由公司负责,但与第三方服务公司签订有技术服务合同,由其提供定期的巡检及特殊情况下的技术支持。公司业务应用系统主要包括开放式基金登记过户子系统、直销系统、资金清算系统、投资交易系统、估值核算系统、网上交易系统、呼叫中心系统、外服系统、营销数据中心系统等。这些系统也主要是在公司筹建之初采购专业系统提供商的产品建设而成,建成之后在业务运作过程中根据公司业务的需要进行了相关的系统功能升级,升级由系统提供商负责完成,升级后的系统也均是系统提供商对外提供的通用系统。业务应用系统日常的维护管理由公司负责,但与系统提供商签订有技术服务合同,由其提供定期的巡检及特殊情况下的技术支持。除上述情况外,公司未委托服务机构代为办理重要的、特定的信息技术系统开发、维护事项。

另外,本公司可以根据自身发展战略的需要,委托资质良好的基金服务机构代为办理基金份额登记、估值核算等业务。

## 第六部分 基金的募集

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》、《基金合同》及其他有关规定募集。

本基金经中国证监会证监许可【2016】482号文注册募集。

一、基金类型、运作方式和存续期限

1、基金类型:债券型证券投资基金
2、基金运作方式:契约型开放式
3、基金存续期限:不定期

4、本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取前端认购/申购费用,但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为A类基金份额;在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为C类基金份额。

本基金A类和C类基金份额分别设置基金代码。由于基金费用的不同,本基金A类和C类基金份额将分别计算基金份额净值并单独公告

投资人可自行选择认购/申购的基金份额类别。本基金不同类别基金份额之间不得互相转换。

二、基金的募集期限

募集期限自基金份额发售之日起不超过3个月,募集时间详见发售公告。

基金管理人有权根据基金募集的实际情况按照相关程序延长或缩短募集期,此类变更适用于所有销售机构。基金募集期若经延长,最长不得超过前述募集期限。

三、基金份额的发售时间、发售方式、发售对象

1、发售时间

自基金份额发售之日起最长不得超过3个月,具体发售时间见基金份额发售公告。

2、发售方式

通过各销售机构的基金销售网点公开发售,各销售机构的具体名单见基金份额发售公告以及基金管理人届时发布的调整销售机构的相关公告。

3、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。

四、基金份额认购原则及持有限额

1、基金投资者认购前,需按销售机构规定的方式全额缴款。

2、基金投资者在基金募集期内可以多次认购基金份额,认购申请一经受理不得撤销。

3、本基金在场外代销网点、电子直销渠道认购以金额申请,单笔最低认购金额为1,000元（含认购费）,最低追加认购金额为1,000元,累计认购金额不设上限。在直销机构（柜台方式）首次认购的最低金额为1万元（含认购费）,追加认购的最低金额为1000元,累计认购金额不设上限。本基金场内单笔最低认购金额为1,000元,最低追加认购金额为1,000元,同时每笔认购金额必须是100元的整数倍,单笔认购最高不超过99,999,900元。

4、基金管理人可根据有关法律法规的规定和市场情况,调整认购的数额限制,并最迟于调整前依照《信息披露办法》的有关规定在中国证监会指定媒介上予以公告。

对于T日交易时间内受理的认购申请,登记机构将在T+1日就申请的有效性进行确认。但对申请有效性的确认仅代表确实接受了投资者的认购申请,认购申请的成功确认应以登记机构在本基金募集结束后的登记确认结果为准。投资者可以在基金合同生效后到各销售网点或以其规定的其他合法方式查询最终确认情况。投资者本人应主动查询认购申请的确认结果。

五、基金份额初始面值、认购价格、认购费用及计算公式

(一)初始面值及认购价格:

本基金每份基金份额的初始面值为人民币1.00元。基金份额的认购价格为1.00元/份。

（二）认购费率:

募集期投资人可以多次认购本基金,认购费用按每笔认购申请单独计算。基金投资人认购A类基金份额收取认购费用,即在认购时支付认购费用。基金投资人认购C类基金份额不收取认购费用,而是从该类别基金资产中计提销售服务费。

本基金A类和C类基金份额的认购费率如下:

| 认购金额（M） | A类基金份额认购费率 | C类基金份额认购费率 |
|---|---|---|
| M＜100万 | 0.60% | 0 |
| 100万≤M＜300万 | 0.30% | |
| 300万≤M＜500万元 | 0.10% | |
| 500万≤M | 每笔交易1,000元 | |

注:M 为认购金额

投资人重复认购,须按每次认购所对应的费率档次分别计费。本基金A类份额的认购费由A类基金份额的认购人承担,不列入基金财产。认购费用主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等募集期间发生的各项费用。

基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划,针对投资人定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间,按相关监管部门要求履行必要手续后,基金管理人可以适当调低基金认购费率或免除上述费用。

（三）认购份额的计算

1、投资人在认购本基金A 类基金份额时缴纳认购费用,认购份额的计算方法如下:

净认购金额=认购金额/（1+认购费率）

认购费用=认购金额-净认购金额

认购份额=（净认购金额+认购期利息）/基金份额初始面值

对于适用固定金额认购费的认购:

净认购金额=认购金额 - 认购费用

2、投资人认购本基金C 类基金份额不收取认购费用。

投资人的总认购份额的计算方式如下:

认购份额=（认购金额+认购期利息）/基金份额初始面值

3、上述认购费用以四舍五入的方法保留小数点后两位,由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

4、场外认购份额的计算保留到小数点后两位,小数点两位以后的部分四舍五入,由此误差产生的收益或损失由基金财产承担;场内认购份额计算结果保留到整数位,不足一份基金份额部分的认购资金零头返回投资者。

5、上述场外认购利息折算的基金份额精确到小数点后两位,小数点两位以后的部分截位,由此产生的收益由基金财产承担,其中有效认购资金的利息及利息折算的基金份额以登记机构的记录为准。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,由此产生的收益由基金财产承担,其中有效认购资金的利息及利息折算的基金份额以登记机构的记录为准。

例:某投资人投资10,000元认购本基金A类基金份额,该笔认购全部予以确认,如果认购期内认购利息为5.5元,则其可得到的A类基金份额计算如下:

净认购金额＝10,000／（1＋0.6%）＝9,940.36元
认购费用＝10,000－9,940.36＝59.64元
本金认购份额＝9,940.36/1.00＝9,940.36份
场外利息折算份额=5.5/1.00=5.5份
场内利息折算份额=5.00/1.00= 5.00份
场外认购份额=9,940.36+5.5=9,945.86份
场内认购份额=9,940.00+5.00=9,945.00份

即如果投资人投资10,000元认购本基金A类份额,通过场外认购可得到9,945.86份A类基金份额;通过场内认购可得到9,945.00份A类基金份额,其余0.36份对应的金额将返还给投资人。

例:某投资人投资10,000元认购本基金C类基金份额,该笔认购全部予以确认,如果认购期内认购利息为5.5元,则其可得到的C类基金份额计算如下:

认购费用＝0 元
本金认购份额＝10,000/1.00＝10,000.00份
场外利息折算份额=5.5/1.00=5.5份
场内利息折算份额=5.00/1.00= 5.00份
场外认购份额=10,000.00+5.5=10,005.5份
场内认购份额=10,000.00+5.00=10,005.00份

即如果投资人投资10,000元认购本基金C类份额,通过场外认购可得到10,005.5份C类基金份额;通过场内认购可得到10,005.00份C类基金份额。

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,其中利息转份额以基金登记机构的记录为准。

七、基金募集期间募集的资金存入专项账户,在基金募集行为结束前,任何人不得动用。

## 第七部分 基金合同的生效

一、基金备案的条件

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

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

二、基金合同不能生效时募集资金的处理方式

如果募集期限届满,未满足基金备案条件,基金管理人应当承担下列责任:

1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用;

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

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,连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于人民币5000万元情形的,基金管理人应当在定期报告中予以披露;连续60个工作日出现前述情形的,基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案,如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等,并召开基金份额持有人大会进行表决。

本基金自基金合同生效之日起,在任一开放期最后一个工作日日终（含当日申请数据）,出现下列情形之一的,基金管理人与基金托管人协商一致后,可以在履行监管报告和信息披露程序后,无需召开持有人大会,终止基金合同,并根据基金合同第十九部分的约定进行基金财产清算:

1、基金份额持有人数量不满200人;
2、基金资产净值低于5000万元。

法律法规或监管部门另有规定时,从其规定。

## 第八部分 基金份额的申购与赎回

一、申购和赎回场所

场内申购与赎回场所为上海证券交易所内具有基金代销业务资格的会员单位（具体名单见本基金份额发售公告）。场外申购与赎回场所包括基金管理人和基金管理人委托的场外代销机构（具体名单见本基金招募说明书和份额发售公告）。基金管理人可根据情况变更或增减代销机构,并予以公告。若基金管理人或其指定的代销机构开通电话、传真或网上等交易方式,投资人可以通过上述方式进行申购与赎回,具体办法由基金管理人或销售机构另行公告。

具体申购、赎回场所参见基金管理人关于本基金的相关公告。

二、申购和赎回的开放日及时间

1、开放日及开放时间

本基金办理基金份额的申购、赎回等业务的开放日为开放期内的每个工作日,具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间,但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定对前述开放日及开放时间进行调整。

基金合同生效后,若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况,基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整,但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

2、申购、赎回开始日及业务办理时间

除法律法规或基金合同另有约定外,自首个封闭期结束之后第一个工作日起,本基金进入首个开放期,开始办理申购、赎回等业务。本基金每个封闭期结束之后第一个工作日起进入下一个开放期。开放期以及开放期办理申购与赎回业务的具体事宜见招募说明书及基金管理人届时发布的相关公告。

基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告申购与赎回的开始时间。

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

三、申购与赎回的原则

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

2、"金额申购、份额赎回"原则,即申购以金额申请,赎回以份额申请;

3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销;

4、赎回遵循"先进先出"原则,即按照投资人认购、申购的先后次序进行顺序赎回。基金管理人对基金份额持有人的赎回申请进行处理时,将对认购、申购确认日期在先的基金份额先赎回,对认购、申购确认日期在后的基金份额后赎回,并以此确定所适用的赎回费率;

5、办理申购、赎回业务时,应当遵循基金份额持有人利益优先原则。

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

四、申购与赎回的程序

1、申购和赎回的申请方式

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

2、申购和赎回的款项支付

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

投资人递交赎回申请,赎回成立,本基金登记机构确认赎回时,赎回生效。投资人赎回申请生效后,基金管理人将在T＋7日(包括该日)内支付赎回款项。遇证券交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其它非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程时,赎回款项顺延至下一个工作日划出。

在发生巨额赎回或基金合同载明的其他暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形时,款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。

3、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T日),在正常情况下,本基金登记机构在T+1日内对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请,投资人应在T+2日后(包括该日）及时到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功,则申购款项退还给投资人。

基金销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表该申请一定成功,而仅代表销售机构确实接收到申请。申购、赎回的确认以基金登记机构或基金管理人的确认结果为准。对于申购申请及申购份额的确认情况,投资人应及时查询并妥善行使合法权利。因投资人怠于履行该项查询等各项义务,致使其相关权益受损的,基金管理人、基金托管人、销售机构不承担由此造成的损失或不利后果。

五、申购和赎回的数量限制

1、投资者场外申购时,每笔最低申购金额为1,000元,最低追加申购金额为1,000元或详见各代销机构网点公告。

2、投资者场内申购时,每笔最低申购金额为1,000元,最低追加申购金额为1,000元,同时每笔申购金额必须是100元的整数倍,且单笔申购最高不超过99,999,900 元。

3、直销机构（柜台方式）每笔最低申购金额为10,000元人民币,最低追加申购金额为1,000元。

4、通过基金管理人网上交易系统办理基金申购业务时,每笔最低申购金额为1,000元,最低追加申购金额为1,000元。

5、本基金单笔最低赎回份额为50份。

6、本基金单个交易账户最低持有份额余额下限为50份。

7、场内赎回份额必须是整数份额,并且每笔赎回最大不超过99,999,999 份基金份额。

8、基金管理人可在法律法规允许的情况下,调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制、投资人每个基金交易账户的最低基金份额余额、单个投资人累计持有的基金份额上限等。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法 》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。

六、申购费用和赎回费用

1、申购费用

投资人申购A类基金份额在申购时支付申购费用,申购C类基金份额不支付申购费用,而是从该类别基金资产中计提销售服务费。投资人可以多次申购本基金,申购费用按每笔申购申请单独计算。

本基金A类和C类基金份额的申购费率如下:

| 申购金额（M） | A类基金份额申购费率 | C类基金份额申购费率 |
|---|---|---|
| M＜100万元 | 0.60% | 0 |
| 100万元≤M＜300万元 | 0.30% | |
| 300万元≤M＜500万元 | 0.10% | |
| M≥500万元 | 按笔收取每笔1000元 | |

注:M 为申购金额

本基金的申购费用应在投资人申购A类基金份额时收取,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。

2、赎回费用

本基金A类和C类基金份额仅对在同一开放期内申购后又赎回的份额,收取0.9%的赎回费,其他情况的赎回费率为0%。

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担。本基金的赎回费用在投资者赎回本基金份额时收取,扣除用于市场推广、注册登记费和其他手续费后的余额归基金财产,赎回费归入基金财产的比例不得低于赎回费总额的25%。

3、本基金的申购费率、赎回费率最高不得超过法律法规规定的限额。

4、基金管理人可以在《基金合同》约定的范围内调整费率或收费方式,并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法 》的有关规定在指定媒介上公告。

5、基金管理人可以在不违背法律法规规定及《基金合同》约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划,例如针对特定地域范围、特定行业、特定职业的投资者以及以特定交易方式（如网上交易、电话交易等）等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间,按相关监管部门要求履行相关手续后,基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

七、申购份额与赎回金额的计算

（一）本基金申购份额的计算

1、A类基金份额

申购本基金A类份额的申购费用采用前端收费模式（即申购基金时缴纳申购费）,投资人的申购金额包括申购费用和净申购金额。A类申购份额的计算方式如下:

当A 类基金份额的申购费用适用比例费率时:
净申购金额=申购金额/（1+申购费率）;
申购费用=申购金额-净申购金额;
申购份额=净申购金额/申购当日（T日）A类基金份额净值。

当A类基金份额的申购费用为固定金额时:
申购费用＝固定金额
净申购金额＝申购金额 - 申购费用
申购份额＝净申购金额/申购当日（T日）A类基金份额净值

2、C 类基金份额

如果投资人选择申购C类基金份额,则申购份额的计算方法如下:
申购份额=申购金额/申购当日（T日）C类基金份额净值

3、上述申购费用以四舍五入的方法保留小数点后两位,由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

4、上述场外申购份额的计算保留到小数点后两位,小数点两位以后的部分四舍五入,由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。场内申购份额计算结果保留到整数位,不足一份基金份额部分的认购资金零头返回投资人。

例:某投资人投资5万元申购本基金A类基金份额,对应费率为0.6%,假设申购当日本基金A类基金份额净值为1.05元,则可得到的申购份额为:

净申购金额＝50,000/（1＋0.6%）＝49,701.79元
申购费用＝50,000－49,701.79＝298.21元
申购份额＝49,701.79/1.05＝47,335.04份

即:如果投资人通过场外申购,则该投资人可获得申购份额为47,335.04份;如果投资人通过场内申购,则该投资人可获得申购份额为47,335.00份,其余0.04份对应金额将返回给投资人。

例:某投资人投资5万元申购本基金C类基金份额,假设申购当日本基金C 类基金份额净值为1.05元,则可得到的申购份额为:

申购费用＝0元
申购份额＝50,000/1.05＝47,619.05份

即:如果投资人通过场外申购,则该投资人可获得申购份额为47,619.05份;如果投资人通过场内申购,则该投资人可获得申购份额为47,619.00份,其余0.05份对应金额将返回给投资人。

（二）赎回金额的计算

基金份额持有人在赎回本基金时缴纳赎回费,基金份额持有人的赎回金额为赎回总额扣减赎回费用。

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

赎回总额 ＝ 赎回份额 × T日基金份额净值
赎回费用 ＝ 赎回总额 × 赎回费率
赎回金额 ＝ 赎回总额 － 赎回费用

例:某投资者赎回本基金1万份本基金份额,持有时间为一个封闭期,对应的赎回费率为0,假设赎回当日基金份额净值是1.12元,则其可得到的赎回金额为:

赎回总额＝10,000×1.12=11,200元
赎回费用＝11,200×0=0.00元
赎回金额＝11,200-0.00=11,200.00元

即:投资者赎回本基金1万份本基金份额,则其可得到的赎回金额为11,200.00元。

（三）本基金基金份额净值的计算

《基金合同》生效后,在封闭期内,基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和各类别基金份额净值。

在开放期内,基金管理人应当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,披露交易日的各类别基金份额净值和基金份额累计净值。

本基金的基金份额净值计算公式如下:

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

（四）申购份额、余额的处理方式

场外申购时,申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后,以申请当日的基金份额净值为基准计算,采用四舍五入的方法保留到小数点后两位,由此产生的收益或损失由基金财产承担。

场内申购时,申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后,以申请当日的基金份额净值为基准计算,有效份额的计算保留到整数位,不足一份基金份额部分的申购资金零头由会员单位返还给投资者。

（五）赎回金额的处理方式

赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以申请当日基金份额净值并扣除相应的费用,计算结果保留到小数点后两位,小数点后两位以后的部分四舍五入,由此产生的收益或损失由基金财产承担。

八、申购和赎回的注册登记

（一）投资人申购基金成功后,基金注册登记人在T＋1日为投资人增加权益并办理注册登记手续,投资人自T＋2日起有权赎回该部分基金份额。

（二）投资人赎回基金成功后,基金注册登记人在T＋1日为投资人扣除权益并办理相应的注册登记手续。

（三）基金管理人可在法律法规允许的范围内,对上述注册登记办理时间进行调整,并最迟于开始实施2日前在中国证监会指定媒介和基金管理人网站上予以公告。

九、拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时,基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请:

1、因不可抗力导致基金无法正常运作。

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

3、证券交易所交易时间非正常停市,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

4、基金管理人接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。

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

6、基金管理人、基金托管人、基金销售机构或登记机构因技术故障或异常情况导致基金销售系统或基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。

7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第1,2,3,5,6,7项之一且基金管理人决定暂停申购情形时,基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝,被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时,基金管理人应及时恢复申购业务的办理,且开放期间按暂停申购的期间相应延长。

十、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时,基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项:

1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。

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

3、证券交易所交易时间非正常停市,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

5、基金管理人、基金托管人、基金销售机构或登记机构因技术故障或异常情况导致基金销售系统或基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。

6、发生继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时,可暂停接受投资者的赎回申请。

7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时,基金管理人应及时报中国证监会备案,已确认的赎回申请,基金管理人应延缓支付;如暂时不能足额支付,应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人,未支付部分可延期支付,并以后续开放日的基金份额净值为依据计算赎回金额。若出现上述第4项所述情形,按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时,基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

十一、巨额赎回的情形及处理方式

1、巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过前一工作日的基金总份额的20%,即认为是发生了巨额赎回。

2、巨额赎回的处理方式

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

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

（2）延缓支付赎回款项:当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时,基金管理人应当接受并确认所有赎回申请,当日按比例办理的赎回份额不得低于基金总份额的20%,其余赎回申请可以延缓支付赎回款项,但最长不得超过20个工作日。

3、巨额赎回的公告

当发生上述延期赎回并延缓支付赎回款项时,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,同时在指定媒介上刊登公告。

十二、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,基金管理人应及时向中国证监会备案,并在规定期限内在指定媒介上刊登暂停公告。

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

3、如发生暂停的时间超过1日,基金管理人可以根据暂停申购或赎回的时间,依照《信息披露办法 》的有关规定,最迟于重新开放日在指定媒介上刊登重新开放申购或赎回的公告,并公布最近一个工作日各类别基金的基金份额净值;也可以根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间,届时不再另行发布重新开放的公告。

十三、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。

十四、基金的非交易过户

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

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

十五、基金的转托管

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

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

十六、定期定额投资计划

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

十七、基金的冻结和解冻

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

基金份额被冻结的,被冻结部分产生的权益一并冻结,被冻结部分份额仍然参与收益分配与支付。法律法规另有规定的除外。

十八、其他业务

如相关法律规允许基金管理人办理基金份额的质押业务或其他基金业务,基金管理人可制定相应的业务规则并开展相关业务,并依照《信息披露办法》的有关规定进行公告。

## 第九部分 基金的投资

一、投资目标

在严格控制投资风险的前提下,追求超过业绩比较基准的当期收入和投资总回报。

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国债、金融债、企业债、公司债（包含非公开发行公司债）,次级债、中央银行票据,地方政府债、城投债、中小企业私募债券、短期融资券、超级短期融资券、中期票据、资产支持证券、可分离交易可转债的纯债部分、债券回购、银行存款、同业存单等金融工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益证券品种（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金不从二级市场买入股票、权证等权益类资产,也不参与一级市场新股申购和新股增发。可转换债券仅投资于二级市场可分离交易可转债的纯债部分。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,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:本基金投资于债券的比例不低于基金资产的80%。应开放期流动性需要,为保护基金份额持有人利益,开放期开始前三个月、开放期以及开放期结束后的三个月内,本基金债券资产的投资比例不受上述比例限制;开放期内,本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,在封闭期内,本基金不受上述5%的限制。

三、投资策略

本基金一方面按照自上而下的方法对基金的资产配置、久期管理、类属配置进行动态管理,寻找各类资产的潜在良好投资机会,一方面在个券选择上采用自下而上的方法,通过流动性考察和信用分析策略进行筛选。整体投资通过对风险的严格控制,运用多种积极的资产管理增值策略,实现本基金的投资目标。

（一）资产配置策略

本基金将自上而下地实施整体资产配置策略,通过对宏观经济运行状况、货币政策变化、市场利率走势、市场资金供求情况、经济周期等要素的定性与定量的考察,预测各大类资产未来收益率变化情况,在不同的大类资产之间进行动态调整和优化,以规避市场风险,提高基金收益率。

（二）固定收益类证券投资策略

1、流动性管理策略

为合理控制本基金开放期的流动性风险,并满足每次开放期的流动性需求,本基金在投资管理中将持有债券的组合久期与封闭期进行适当的匹配。

2、久期与期限结构管理策略

利率风险是债券投资最主要的风险来源和收益来源之一,衡量债券利率风险的核心指标是久期。本基金通过对宏观经济状况和货币政策的分析,对债券市场走势作出判断,并形成对未来市场利率变动方向的预期,动态调整债券组合的久期。在久期确定的基础上,根据对收益率曲线形状变化情景的分析,分别采用子弹型策略、哑铃型策略或梯形策略,进一步组合的期限结构,使本基金获得较好的收益。

3、类属配置策略

在保证流动性的基础上,本基金将通过国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、短期融资券、可分离债券、资产支持证券、回购和银行存款等资产的合理组合实现稳定的投资收益。

类属配置主要策略包括研究国债与金融债之间的利差、交易所与银行间的市场利差、企业债与国债的信用利差等,寻找价值相对低估的投资品种。

4、个券选择策略

（1）流动性策略

在封闭期间,本基金对个券的流动性要求不高,在开放期间,将通过对各类流动性指标的设置与监控,管理由于基金的申购、赎回或个券的交易难易程度而引致的潜在损失风险。

（2）信用分析策略

为了确保本金安全的基础上获得稳定的收益,本基金对企业债、公司债、金融债、短期融资券等信用债券进行信用分析。此分析主要通过三个角度完成:①独立第三方的外部评级结果;②第三方担保情况;③基于基金管理人自有的数量化公司财务研究模型的内部评价。该模型在信用评价方面的主要作用在于通过对部分关键的财务指标分析判断债券发行企业未来出现偿债风险的可能性,从而确定该企业发行债券的信用等级与利率水平。主要关键的指标包括:NET DEBT/EBITDA、EBIT/I、资产负债率、流动资产/流动负债、经营活动现金流/总负债。其中资产负债率、流动资产/流动负债主要分析企业债务水平与结构,其他的指标主要分析企业经营效益对未来偿债能力的支持能力。

5、回购策略

该策略在本基金封闭期内是风险较低的投资策略。即在基础组合的基础上,使用基础组合持有的债券进行回购融入短期资金滚动操作,投资于收益率高于融资成本的其它获利机会,从而获得杠杆放大收益。

6、资产支持证券投资策略