万家强化收益定期开放债券型证券投资基金上市交易公告书

基金管理人：万家基金管理有限公司
基金托管人：华夏银行股份有限公司
注册登记机构：中国证券登记结算有限责任公司
上市地点：深圳证券交易所
上市时间：２０１３年８月１日
公告日期：２０１３年７月２９日

一、重要声明与提示

《万家强化收益定期开放债券型证券投资基金上市交易公告书》（以下简称“本公告书”）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内容与格式准则第1号<上市交易公告书的内容与格式>》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，本基金管理人的董事会及董事保证本公告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本基金托管人保证本公告书中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。

凡本公告书未涉及的有关内容，请投资者详细查阅2013年4月2日登载于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和万家基金管理有限公司网站（www.wjasset.com）的本基金招募说明书。

二、基金概览

1、基金名称：万家强化收益定期开放债券型证券投资基金

2、基金类型：债券型

3、基金运作方式：契约型开放式

本基金自基金合同生效后，每三年开放一次申购和赎回，申购和赎回的开放起始日为基金合同生效日的年度对日（如该日为非工作日，则顺延至下一工作日），每次开放时间最长不超过20个工作日，最短不少于5个工作日。具体时间以基金管理人届时公告为准，且基金管理人最迟应于每个开放起始日前2日进行公告。如因不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放申购与赎回业务或开放期内无法办理申购与赎回业务，开放起始日或开放期相应顺延。

基金管理人在基金合同约定的开放期之外的日期不办理基金份额的申购、赎回业务。

4、基金份额总额：截至2013年7月25日，本基金的基金份额总额为250，635，902.00份。

5、基金份额净值：截至2013年7月25日，本基金的基金份额净值为1.0092元。

6、本次上市交易的基金份额交易代码：161911。

7、本次上市交易的基金份额简称：万家强债

8、本次上市交易的基金份额总额：34，737，114份（截至2013年7月25日）

9、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所

10、上市交易日期：2013年8月1日

11、基金管理人：万家基金管理有限公司

12、基金托管人：华夏银行股份有限公司

13、上市推荐人：无

14、本次上市交易的基金份额注册登记机构：中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司

三、基金的募集与上市交易

（一）本基金上市前基金募集情况：

1、基金募集申请的核准机构和核准文号：中国证监会2012年11月15日证监许可［2012］1518号文批准

2、基金运作方式：契约型开放式

本基金自基金合同生效后，每三年开放一次申购和赎回，申购和赎回的开放起始日为基金合同生效日的年度对日（如该日为非工作日，则顺延至下一工作日），每次开放时间最长不超过20个工作日，最短不少于5个工作日。具体时间以基金管理人届时公告为准，且基金管理人最迟应于每个开放起始日前2日进行公告。如因不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放申购与赎回业务或开放期内无法办理申购与赎回业务，开放起始日或开放期相应顺延。

基金管理人在基金合同约定的开放期之外的日期不办理基金份额的申购、赎回业务。

3、基金合同期限：不定期

4、发售日期：2013年 4月8日起至2013年4月26日

5、发售价格：1.00元人民币

6、发售方式：场内、场外两种方式公开发售

7、发售机构：

（1）场外发售机构

1）直销机构：万家基金管理有限公司

2）代销银行：华夏银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、平安银行股份有限公司、中国光大银行股份有限公司（排名不分先后）。

3）代销券商：齐鲁证券有限公司、光大证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、华宝证券有限责任公司、山西证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、中信建投证券有限公司、东吴证券股份有限公司、五矿证券有限公司、日信证券有限责任公司、中航证券有限公司、申银万国证券股份有限公司、江海证券有限公司、爱建证券有限责任公司、宏源证券股份有限公司、中银国际证券有限责任公司（排名不分先后）。

3）代销第三方金融机构：

天相投资顾问有限公司、中国国际金融有限公司、上海好买基金销售有限公司、杭州数米基金销售有限公司、长量基金销售投资顾问有限公司、上海天天基金销售有限公司、深圳众禄基金销售有限公司（排名不分先后）。

（2）场内发售机构

爱建证券、安信证券、渤海证券、财达证券、财富证券、财富里昂、财通证券、长城证券、长江证券、大通证券、大同证券、德邦证券、第一创业、东北证券、东方证券、东海证券、东莞证券、东吴证券、东兴证券、高华证券、方正证券、光大证券、广发证券、广州证券、国都证券、国海证券、国金证券、国开证券、国联证券、国盛证券、国泰君安、国信证券、国元证券、海通证券、恒泰长财、恒泰证券、红塔证券、宏源证券、华安证券、华宝证券、华创证券、华福证券、华林证券、华龙证券、华融证券、华泰联合、华泰证券、华西证券、华鑫证券、江海证券、金元证券、开源证券、联讯证券、民生证券、民族证券、南京证券、平安证券、齐鲁证券、日信证券、瑞银证券、山西证券、上海证券、申银万国、世纪证券、首创证券、天风证券、天源证券、万和证券、万联证券、西部证券、西藏同信、西南证券、厦门证券、湘财证券、新时代证券、信达证券、兴业证券、银河证券、银泰证券、英大证券、招商证券、浙商证券、中航证券、中金公司、中山证券、中投证券、中天证券、中信建投、中信浙江、中信万通、中信证券、中银证券、中邮证券、中原证券（排名不分先后）。具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员单位的最新名单可在深交所网站查询。

8、验资机构名称：安永华明会计师事务所有限公司

9、募集资金总额及入账情况：经安永华明会计师事务所验资，本次募集的有效净认购金额为250，540，304.84元人民币，该资金已于2013年5月7日全额划入本基金在基金托管人华夏银行股份有限公司开立的万家强化收益定期开放债券型证券投资基金托管专户。

本次募集有效认购总户数1，677户，按照每份基金份额1.00元人民币计算，本次基金募集期间所募集本金产生的有效份额为250，540，304.84份，有效认购款项在基金验资确认日之前产生的利息共计95，657.25元人民币，结转为95，597.16份基金份额，两项合计共250，635，902.00份基金份额。已全部记入基金份额持有人账户，归基金份额持有人所有。本基金管理人的基金从业人员认购持有的基金份额总额为9，951.61份（含利息结转份额），占本基金总份额的比例为0.00%。

10、基金备案情况：本基金于2013年5月7日验资完毕，当日向中国证监会提交了验资报告，办理基金备案手续，并于2013年5月7日获书面确认，本基金合同自该日起正式生效。

11、基金合同生效日：2013年5月7日

12、基金合同生效日的基金份额总额：250，635，902.00份。

（二）本基金上市交易的主要内容：

1、基金上市交易的核准机构和核准文号：深圳证券交易所深证上［2013］252号

2、上市交易日期：2013年8月1日

3、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所。投资者在深圳证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金交易。

4、本次上市交易的基金份额场内简称：万家强债

5、本次上市交易的基金份额交易代码：161911

6、本次上市交易的基金份额总额：34，737，114份（截至2013年7月25日）

7、基金净值的披露：

基金管理人每日对基金资产估值。用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人于每个估值日将经过基金托管人复核的基金净值传给深交所，由深交所于下一个交易日通过行情系统揭示前一估值日的基金份额参考净值。根据《基金法》，开放式基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此基金管理人对公布的基金净值负责。

8、未上市交易份额的流通规定：未上市交易的份额托管在场外，基金份额持有人将其跨系统转托管至深圳证券交易所场内后即可上市流通。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

（一）场内基金份额持有情况（截至2013年7月25日）

截至2013年7月25日，持有人户数为1，677户，平均每户持有的基金份额为149，454.92份。

份额单位：份

场内份额持有人户数（户）	场内份额户均持有的基金份额	场内份额持有人机构			
		机构投资者		个人持有者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
125	277，896.91	21，001，098	60.46%	13，736，016	39.54%

（二）基金场内份额前十名持有人情况（截至2013年7月25日）

序号	持有人名称（全称）	证券帐户号	持有基金份额	占场内基金份额的比例	占基金总份额比例
1	华鑫证券有限责任公司	0899034767	20，000，972.00	57.58%	7.98%
2	陈锡媚	0154914693	1，988，096.00	5.72%	0.79%
3	上海光华会计师事务所有限公司	0800138598	1，000，126.00	2.88%	0.40%
4	朱敏	0030596211	1，000，048.00	2.88%	0.40%
5	陈艳	0108714097	800，093.00	2.30%	0.32%
6	顾刚平	0015228582	626，030.00	1.80%	0.25%
7	吴丽丽	0015332432	546，026.00	1.57%	0.22%
8	俞滢滢	0015309322	500，053.00	1.44%	0.20%
9	汪庆旗	0106344508	500，053.00	1.44%	0.20%
10	王付清	0511899444	500，024.00	1.44%	0.20%
11	林聪	0101755591	500，024.00	1.44%	0.20%
12	许佳飞	0123582309	500，024.00	1.44%	0.20%
合计			28，461，569.00	81.93%	11.36%

注：由于四舍五入的原因，占场内总份额比例分项之和与合计可能有尾差。

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人

1、名称：万家基金管理有限公司

2、法定代表人：毕玉国

3、总经理：吕宜振

4、成立时间：2002年8月23日

5、注册资本：1亿元人民币

6、注册地址：上海市浦东新区浦电路360号8层（名义楼层9层）

7、设立批准文号：证监基金字［2002］44号

8、企业法人营业执照注册号：310115000700825

9、经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务。

10、存续期间：持续经营

11、股东及其出资比例：

齐鲁证券有限公司	49%
新疆国际实业股份有限公司	40%
山东省国有资产投资控股有限公司	11%

12、内部组织结构及职能：本基金管理人下设综合管理部、计划财务部、合规稽核部、权益投资部、固定收益部、量化投资部、研究部、交易部、信息技术部、基金运营部、产品开发部、渠道服务部、机构理财部、营销策划部、客户服务部。

量化投资部负责量化产品创新和管理、量化研究与支持。

权益投资部负责权益类产品的投资与管理。

固定收益部负责固定收益类产品的投资与管理、债券研究。

研究部负责宏观、策略、行业和公司研究。

交易部负责权益类交易、固定收益类交易、交易风险管理、头寸管理、新股认购、新债认购、交易席位管理。

产品开发部负责海内外资管行业研究、产品设计与开发公募及报批、制定公司战略规划等工作。

营销策划部负责品牌推广、产品营销、媒体公关、电子商务、市场营销战略战术研究。

合规稽核部负责对公司管理和基金运作合法合规性进行全方位的监察稽核。

信息技术部负责信息系统规划、IT基础设施建设及管理、应用系统建设及管理、信息安全管理等工作。

基金运营部负责公募基金及专户产品、专项资产计划的运营等工作。

渠道服务部负责基金销售和渠道服务维护工作。

机构理财部负责机构理财市场的分析以及机构客户、专户业务的开发、维护与管理等工作。

客户服务部负责公司客户维护、直销柜台、营销支持及投资顾问等工作。

综合管理部负责公司人力资源和行政等工作。

计划财务部负责公司财务等工作。

13、人员情况：

截至2013年6月30日，公司共有员工119人，其中63人具有硕士及以上学历，占员工总数的52.94%，拥有本科及以上学历的员工共112人，占员工总数的94.12%。

14、信息披露负责人及咨询电话：兰剑，021-38619810

15、基金管理业务情况：

截止2013年6月30日，本基金管理人目前管理十五只基金，分别为万家180指数证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、万家公用事业行业股票型证券投资基金（LOF）、万家货币市场证券投资基金、万家和谐增长混合型证券投资基金、万家双引擎灵活配置混合型证券基金、万家精选股票型证券投资基金、万家稳健增利债券型证券投资基金、万家中证红利指数证券投资基金（LOF）、万家添利分级债券型证券投资基金、万家中证创业成长指数分级证券投资基金、万家信用恒利债券型证券投资基金、万家14天理财债券型证券投资基金、万家岁得利定期开放债券型发起式证券投资基金和万家强化收益定期开放债券型证券投资基金。

16、本基金基金经理：

孙驰，固定收益部副总监。复旦大学经济学专业硕士。2007年7月至2010年9月，于中海信托股份有限公司资产管理部任债券投资经理。2010年4月加入万家基金管理有限公司。现任万家增强收益债券型证券投资基金、万家货币市场证券投资基金、和万家14天理财债券型证券投资基金基金经理。

苏谋东，复旦大学经济学硕士，CFA，2008年7月至2013年2月在宝钢集团财务有限公司从事固定收益投资研究工作，担任投资经理职务。2013年3月加入万家基金管理有限公司。现任万家强化收益定期开放债券基金基金经理。

（二）基金托管人

1、名称：华夏银行股份有限公司（简称：华夏银行）

2、注册地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

3、办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

4、法定代表人：吴建

5、成立时间：1992年10月14日

6、注册资本：68.5亿元人民币

7、信息披露负责人及联系电话：郑鹏（010）85238667

8、托管业务经营及主要人员情况：

华夏银行资产托管部内设市场综合室、交易管理室、风险管理室和销售管理室4个职能处室。资产托管部共有员工30人，高管人员拥有硕士以上学位或高级职称。

华夏银行于2005年2月23日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核准，获得证券投资基金托管资格，是《证券投资基金法》和《证券投资基金托管资格管理办法》实施后取得证券投资基金托管资格的第一家银行。自成立以来，华夏银行资产托管部本着“诚实信用、勤勉尽责”的行业精神，始终遵循“安全保管基金资产，提供优质托管服务”的原则，坚持以客户为中心的服务理念，依托严格的内控管理、先进的技术系统、优秀的业务团队、丰富的业务经验，严格履行法律和托管协议所规定的各项义务，为广大基金份额持有人和资产管理机构提供安全、高效、专业的托管服务，取得了优异业绩。截至2012年12月末，已托管长城货币市场证券投资基金、国联安德盛精选股票证券投资基金、万家货币市场证券投资基金、诺安优化收益债券型证券投资基金、益民红利成长混合型证券投资基金、东吴行业轮动股票型证券投资基金、申万菱信稳益宝债券型证券投资基金、诺德双翼分级债券型证券投资基金、浙商沪深300指数分级证券投资基金及其它受托资产产品，托管各类资产规模4566.19亿元。

（三）基金验资机构

1、名称：安永华明会计师事务所有限公司

2、注册地址：北京市东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼16层

3、办公地址：上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心50楼

4、经办注册会计师：徐艳，汤骏

5、联系人：徐艳

6、联系电话：021-22288888

六、基金合同摘要

一、基金合同当事人的的权利、义务

（一）基金份额持有人的权利与义务

每份基金份额具有同等的合法权益。

1.基金份额持有人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的权利为：

（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、基金份额发售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；

（9）法律法规和基金合同规定的其他权利。

2.基金份额持有人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的义务为：

（1）遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；

（2）交纳基金认购、申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用；

（3）在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；

（4）不从事任何有损基金及其他基金份额持有人合法权益的活动；

（5）执行生效的基金份额持有人大会决议；

（6）返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人及基金管理人的代理人、基金托管人、代销机构、其他基金份额持有人处获得的不当得利；

（7）法律法规和基金合同规定的其他义务。

（二）基金管理人的权利与义务

1.基金管理人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的权利为：

（1）自本基金合同生效之日起，依照有关法律法规和本基金合同的规定独立运用基金财产；

（2）依照基金合同获得基金管理费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；

（3）发售基金份额；

（4）依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

（5）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、非交易过户、转托管等业务的规则，在法律法规和本基金合同规定的范围内决定和调整基金的除调高托管费率和管理费率之外的相关费率结构和收费方式；

（6）根据本基金合同及有关规定监督基金托管人，对于基金托管人违反了本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；

（7）在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回申请；

（8）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；

（9）自行担任或选择、更换注册登记机构，获取基金份额持有人名册，并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查；

（10）选择、更换代销机构，并依据基金销售服务代理协议和有关法律法规，对其行为进行必要的监督和检查；

（11）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；

（12）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

（13）依法召集基金份额持有人大会；

（14）法律法规和基金合同规定的其他权利。

2.基金管理人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的义务为：

（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、勤勉尽责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）计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；

（9）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；

（10）按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

（11）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

（12）编制季度、半年度和年度基金报告；

（13）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；

（14）保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、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，不得向他人泄露；

（15）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；

（16）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；

（17）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；

（18）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；

（19）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；

（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，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

（21）基金托管人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托管人追偿；

（22）按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；

（23）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；

（24）执行生效的基金份额持有人大会决议；

（25）不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

（26）依照法律法规为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利，不谋求对上市公司的控股和直接管理；

（27）法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

（三）基金托管人的权利与义务

1.基金托管人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的权利为：

（1）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收入；

（2）监督基金管理人对本基金的投资运作；

（3）自本基金合同生效之日起，依法保管基金资产；

（4）在基金管理人更换时，提名新任基金管理人；

（5）根据本基金合同及有关规定监督基金管理人，对于基金管理人违反本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；

（6）依法召集基金份额持有人大会；

（7）按规定取得基金份额持有人名册资料；

（8）法律法规和基金合同规定的其他权利。

2.基金托管人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的义务为：

（1）安全保管基金财产；

（2）设立专门的基金托管部，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）对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立；

（4）除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得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；

（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应予保密，不得向他人泄露；

（8）对基金财务会计报告、中期和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人有未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

（9）保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

（10）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；

（11）办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

（12）复核、审查基金管理人计算的基金资产净值和基金份额申购、赎回价格；

（13）按照规定监督基金管理人的投资运作；

（14）按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

（15）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；

（16）按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；

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

（18）基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿；

（19）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；

（20）面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行业监督管理机构，并通知基金管理人；

（21）执行生效的基金份额持有人大会决议；

（22）不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

（23）建立并保存基金份额持有人名册；

（24）法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

（一）基金份额持有人大会由基金份额持有人组成。基金份额持有人持有的每一基金份额具有同等的投票权。

（二）召开事由

1. 当出现或需要决定下列事由之一的，经基金管理人、基金托管人或者单独或合并持有基金份额10%以上（含10%，下同）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）提议时，应当召开基金份额持有人大会：

（1）终止基金合同（本基金合同另有规定的除外）；

（2）转换基金运作方式；

（3）变更基金类别；

（4）变更基金投资目标、投资范围或投资策略；

（5）变更基金份额持有人大会程序；

（6）更换基金管理人、基金托管人；

（7）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；

（8）本基金与其他基金的合并；

（9）对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；

（10）法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

2.出现以下情形之一的，可由基金管理人和基金托管人协商后修改基金合同，不需召开基金份额持有人大会：

（1）调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；

（2）在法律法规和本基金合同规定的范围内变更基金的申购费率、收费方式，或调低赎回费率；

（3）因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；

（4）对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生重大变化；

（5）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；

（6）按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

（三）召集人和召集方式

1.除法律法规或本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。基金管理人未按规定召集或者不能召集时，由基金托管人召集。

2.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，应当自行召集。

3.代表基金份额10%以上的基金份额持有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，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额10%以上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。

4.代表基金份额10%以上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，代表基金份额10%以上的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会，但应当至少提前30日向中国证监会备案。

5.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。

（四）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.基金份额持有人大会的召集人（以下简称“召集人”）负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。召开基金份额持有人大会，召集人必须于会议召开日前30日在指定媒体公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容：

（1）会议召开的时间、地点和出席方式；

（2）会议拟审议的主要事项；

（3）会议形式；

（4）议事程序；

（5）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人权益登记日；

（6）代理投票的授权委托书的内容要求（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；

（7）表决方式；

（8）会务常设联系人姓名、电话；

（9）出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；

（10）召集人需要通知的其他事项。

2.采用通讯方式开会并进行表决的情况下，由召集人决定通讯方式和书面表决方式，并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书面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书面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书面表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

（五）基金份额持有人出席会议的方式

1.会议方式

（1）基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会、通讯方式开会及法律法规、中国证监会允许的其他方式开会。

（2）现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席，如基金管理人或基金托管人拒不派代表出席的，不影响表决效力。

（3）通讯方式开会指按照本基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。

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

（5）会议的召开方式由召集人确定。

2.召开基金份额持有人大会的条件

（1）现场开会方式

在同时符合以下条件时，现场会议方可举行：

1）对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示，全部有效凭证所对应的基金份额应占权益登记日基金总份额的50%以上（含50%，下同）；

2）到会的基金份额持有人身份证明及持有基金份额的凭证、代理人身份证明、委托人持有基金份额的凭证及授权委托代理手续完备，到会者出具的相关文件符合有关法律法规和基金合同及会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的注册登记资料相符。

（2）通讯开会方式

在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

1）召集人按本基金合同规定公布会议通知后，在2个工作日内连续公布相关提示性公告；

2）召集人按基金合同规定通知基金托管人或/和基金管理人（分别或共同称为“监督人”）到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；

3）召集人在监督人和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的书面表决意见，如基金管理人或/和基金托管人经通知拒不到场监督的，不影响表决效力；

4）本人直接出具书面意见和授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的50%以上；

5）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提交的持有基金份额的凭证、授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与注册登记机构记录相符。

（六）议事内容与程序

1.议事内容及提案权

（1）议事内容为本基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容。

（2）基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日本基金总份额10%以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前就召开事由向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案。

（3）对于基金份额持有人提交的提案，大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

关联性。大会召集人对于基金份额持有人提案涉及事项与基金有直接关系，并且不超出法律法规和基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的，应提交大会审议；对于不符合上述要求的，不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会上进行解释和说明。

程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题做出决定。如将其提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会做出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

（4）单独或合并持有权益登记日基金总份额10%以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于6个月。法律法规另有规定的除外。

（5）基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后，如果需要对原有提案进行修改，应当在基金份额持有人大会召开前30日及时公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有30日的间隔期。

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规定程序宣布会议议事程序及注意事项，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，经合法执业的律师见证后形成大会决议。

大会由召集人授权代表主持。基金管理人为召集人的，其授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权代表主持；如果基金管理人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基金份额50%以上多数选举产生一名代表作为该次基金份额持有人大会的主持人。

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）、身份证号码、持有或代表有表决权的基金份额数量、委托人姓名（或单位名称）等事项。

（2）通讯方式开会

在通讯表决开会的方式下，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第2个工作日在公证机关及监督人的监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。如监督人经通知但拒绝到场监督，则在公证机关监督下形成的决议有效。

3.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。

（七）决议形成的条件、表决方式、程序

1.基金份额持有人所持每一基金份额享有平等的表决权。

2.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

一般决议须经出席会议的基金份额持有人（或其代理人）所持表决权的50%以上通过方为有效，除下列（2）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

特别决议须经出席会议的基金份额持有人（或其代理人）所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方为有效；涉及更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式、终止基金合同必须以特别决议通过方为有效。

3.基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会核准或者备案，并予以公告。

4.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，否则表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决，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。

5.基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

6.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。

（八）计票

1.现场开会

（1）如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，则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推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，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推举两名基金份额持有人代表与基金管理人、基金托管人授权的一名监督员共同担任监票人；但如果基金管理人和基金托管人的授权代表未出席，则大会主持人可自行选举三名基金份额持有人代表担任监票人。

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

（3）如大会主持人对于提交的表决结果有异议，可以对投票数进行重新清点；如大会主持人未进行重新清点，而出席大会的基金份额持有人或代理人对大会主持人宣布的表决结果有异议，其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点，大会主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

2.通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监票人在监督人派出的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；如监督人经通知但拒绝到场监督，则大会召集人可自行授权3名监票人进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

（九）基金份额持有人大会决议报中国证监会核准或备案后的公告时间、方式

1.基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议，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决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。关于本章第（二）条所规定的第（1）–（8）项召开事由的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准生效后方可执行，关于本章第（二）条所规定的第（9）、（10）项召开事由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。

2.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。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决议。

3.基金份额持有人大会决议应自生效之日起2日内在指定媒体公告。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。

（十）法律法规或监管部门对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

三、基金收益分配原则、执行方式

（一）收益分配原则

本基金收益分配应遵循下列原则：

1.本基金的每份基金份额享有同等分配权；

2.收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记机构可将投资人的现金红利按除权后的单位净值自动转为基金份额；

3. 基金收益每季度最少分配一次，每年最多分配12 次，每次基金收益分配比例不得低于收益分配基准日单位份额可供分配利润的50%；

4.若基金合同生效不满3个月则可不进行收益分配；

5.除本款第2项规定的情形外，本基金收益分配方式采用现金分红；

6.基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过15个工作日；

7.基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

8.法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

（二）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明收益分配基准日以及该日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式、支付方式等内容。

（三）收益分配的时间和程序

1.基金收益分配方案由基金管理人拟订，由基金托管人复核，依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告并报中国证监会备案；

2.在收益分配方案公布后，基金管理人依据具体方案的规定就支付的现金红利向基金托管人发送划款指令，基金托管人按照基金管理人的指令及时进行分红资金的划付。

四、与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例

（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.基金财产拨划支付的银行费用；

4.基金合同生效后的基金信息披露费用；

5.基金份额持有人大会费用；

6.基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；

7.基金的证券交易费用；

8.基金的开户费用、账户维护费用

9.基金的上市费用（包括上市初费和上市月费）；

10.依法可以在基金财产中列支的其他费用。

（二）上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，本基金合同已有规定的和法律法规另有规定时从其规定。

（三）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

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的0.70%年费率计提。计算方法如下：

H=E×年管理费率÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

2.基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的0.20%年费率计提。计算方法如下：

H=E×年托管费率÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

3.除管理费、托管费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

（四）不列入基金费用的项目

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，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

（五）基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调低基金管理费率、基金托管费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日2日前在指定媒体上刊登公告。

五、基金财产的投资范围和投资限制

（一）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、央行票据、地方政府债、次级债、金融债、公司债、企业债、中小企业私募债、可分离交易可转债的纯债部分、债券回购、短期融资券、资产支持证券、中期票据、银行存款、货币市场工具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的相关规定）。

本基金不投资股票，不直接从二级市场买入可转换债券、权证，但可以参与一级市场可转换债券（含可分离交易的可转换债券）的申购。

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。

本基金投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的80%，投资于主体信用评级在A（含）至AA（含）之间的信用债券的比例不低于债券类资产的80%，投资于中小企业私募债券的比例不高于债券类资产的20%；但在每次开放期前三个月、开放期及开放期结束后三个月的期间内，基金投资不受上述比例限制；在开放期内，本基金持有的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%。

（二）投资限制

1.组合限制

（1）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%；

（2）本基金持有的债券等固定收益类资产占基金资产的比例不低于80%，投资于主体信用评级在A（含）至AA（含）之间的信用债券的比例不低于债券类资产的80%，投资于中小企业私募债券的比例不高于债券类资产的20%，但在每次开放期前三个月、开放期及开放期结束后三个月的期间内，基金投资不受上述比例限制；本基金在开放期间，持有的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%；

（3）本基金投资于中小企业私募债券的剩余期限，不得超过本基金的剩余封闭运作期；

（4）本基金持有单只中小企业私募债券，其市值不得超过基金资产净值的10%；

（5）本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的10%；

（6）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的20%；

（7）本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的10%；

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

（9）本基金投资的资产支持证券信用级别评级为BBB 级以上（含BBB级）或相当于BBB 级，在本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（法律法规或中国证监会规定的特殊品种除外）；

（10）相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

如果法律法规对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价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。

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自本基金合同生效之日起开始。

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；

（9）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。

六、基金资产净值的计算方法和公告方式

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款以及其他资产的价值总和。

本基金的估值日为本基金相关的证券交易场所的正常营业日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非营业日。

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、其它投资等资产。

（一）估值方法

1.证券交易所上市的有价证券的估值

（1）交易所上市的有价证券（包括权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

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

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

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

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

3.中小企业私募债券、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.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。

6.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，按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。

（二）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0.0001元，小数点后第五位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

2.基金管理人应每个工作日对基金资产估值。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。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

七、基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

（一）基金合同的变更

1.基金合同变更内容对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的，应召开基金份额持有人大会，基金合同变更的内容应经基金份额持有人大会决议同意。

（1）转换基金运作方式；

（2）变更基金类别；

（3）变更基金投资目标、投资范围或投资策略；

（4）变更基金份额持有人大会程序；

（5）更换基金管理人、基金托管人；

（6）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准。但根据适用的相关规定提高该等报酬标准的除外；

（7）本基金与其他基金的合并；

（8）对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；

（9）法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

但出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会决议，由基金管理人和基金托管人同意变更后公布，并报中国证监会备案：

（1）调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；

（2）在法律法规和本基金合同规定的范围内变更基金的申购费率、收费方式，或调低赎回费率；

（3）因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；

（4）对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生重大变化；

（5）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；

（6）按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

2.关于变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案，并于中国证监会核准或出具无异议意见后生效执行，并自生效之日起2日内在至少一种指定媒体公告。

（二）本基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同经中国证监会核准或备案后将终止：

1.基金份额持有人大会决定终止的；

2.基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在6个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务；

3.基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而在6个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务；

4.在开放期最后一开放日日终，本基金的份额持有人数量不满200 人，或者基金资产净值加上当日有效申购申请金额及基金转换中转入申请金额减去当日有效赎回申请金额及基金转换中转出申请金额后的余额低于2亿元；

5.在开放期，基金发生大规模净赎回申请（赎回申请总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额），且申请确认后因交易成本等因素该等申请将明显损害剩余持有人的利益；

6.中国证监会规定的其他情况。

（三）基金财产的清算

1.基金财产清算组

（1）基金合同终止时，成立基金财产清算组，基金财产清算组在中国证监会的监督下进行基金清算。

（2）基金财产清算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。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

（3）基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算组可以依法进行必要的民事活动。

2.基金财产清算程序

基金合同终止，应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。基金财产清算程序主要包括：

（1）基金合同终止后，发布基金财产清算公告；

（2）基金合同终止时，由基金财产清算组统一接管基金财产；

（3）对基金财产和基金的债权债务进行清理和确认；

（4）对基金财产进行估价和变现；

（5）制作清算报告；

（6）聘请会计师事务所对清算报告进行审计；

（7）聘请律师事务所出具法律意见书；

（8）将基金财产清算结果报告中国证监会；

（9）公布基金财产清算结果；

（10）对基金剩余财产进行分配。

3.清算费用

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

4.基金财产按下列顺序清偿：

（1）支付清算费用；

（2）交纳所欠税款；

（3）清偿基金债务；

（4）按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款（1）–（3）项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

5.基金财产清算的公告

基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算组公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算结果经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，由基金财产清算组报中国证监会备案并公告。

6.基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。

八、争议解决方式

对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，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，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。

本基金合同受中国法律管辖。

九、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

本基金合同正本一式八份，除中国证监会和银行业监督管理机构各持两份外，基金管理人和基金托管人各持有两份。每份均具有同等的法律效力。

本基金合同可印制成册，供投资人在基金管理人、基金托管人、代销机构和注册登记机构办公场所查阅，但其效力应以基金合同正本为准。

七、基金财务状况

深圳证券交易所在本基金募集期间至上市交易公告书公告前未收取任何费用，其他各基金销售机构根据本基金《招募说明书》设定的认购费用收取认购费。

本基金募集期间的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用，不从基金财产中列支。

本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

万家强化收益定期开放债券型证券投资基金截止2013年7月25日资产负债表如下：

	（除特别注明外，金额单位为人民币元）
资产	
银行存款	51，094，365.97
结算备付金	1，911，946.30
存出保证金	1，002.44
交易性金融资产	168，137，570.14
其中：股票投资	–
债券投资	168，137，570.14
资产支持证券投资	–
基金投资	–
衍生金融资产	–
买入返售金融资产	69，200，343.80
应收证券清算款	38，327，001.95
应收利息	2，502，993.46
应收股利	–
应收申购款	–
其他资产	–
资产总计	331，175，224.06
负债及所有者权益	
负债	
应付证券清算款	–
应付管理人报酬	121，358.96
应付托管费	34，673.99
应付销售服务费	–
应付交易费用	1，650.00
应付税费	–
应付赎回款	–
卖出回购金融资产款	77，999，686.40
应付利息	5，867.75
其他负债	70，293.60
负债合计	78，233，530.70
所有者权益	
实收基金	250，635，902.00
未分配利润	2，305，791.36
所有者权益合计	252，941，693.36
负债及所有者权益总计	331，175，224.06

八、基金投资组合

截至2013年7月25日万家强化收益定期开放债券型证券投资基金的投资组合如下：

（一）期末基金资产组合情况

资产项目	期末市值（元）	市值占基金总资产比例（%）
权益投资	–	–
其中：股票	–	–
固定收益投资	168，137，570.14	50.77
其中：债券	168，137，570.14	50.77
资产支持证券	–	–
金融衍生品投资	–	–
买入返售金融资产	69，200，343.80	20.90
其中：买断式回购的买入返售金融资产	–	–
银行存款和结算备付金合计	53，006，312.27	16.01
其他资产	40，830，997.85	12.33
合计	331，175，224.06	100.00

注：由于四舍五入的原因，“占基金总资产的比例”分项之和与合计可能有尾差。

（二）期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

（三）期末股票投资前十名明细

本基金本报告期末未持有股票。

（四）按券种分类的债券投资组合

债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
国家债券	–	–
央行票据	–	–
金融债券	–	–
其中：政策性金融债	–	–
企业债券	58，589，570.14	23.16
企业短期融资券	99，574，000.00	39.37
中期票据	9，974，000.00	3.94
可转债	–	–
其他	–	–
合计	168，137，570.14	66.47

（五）债券投资前五名明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	041352023	13恒力集CP001	200，000	19，864，000.00	7.85
2	041361027	13浙商集CP001	200，000	19，854，000.00	7.85
3	112172	13普邦债	200，000	19，640，000.00	7.76
4	122257	12岳纸01	190，000	18，996，200.00	7.51
5	112119	12恒邦债	107，000	10，248，460.00	4.05

（六）按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

（七）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

（八）投资组合报告附注

1、截至公告前两个工作日即2013年7月25日，本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查的，在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

2、本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

3、截至2013年7月25日其他资产构成

序号	项目	金额（元）
1	存出保证金	1，002.44
2	应收证券清算款	38，327，001.95
3	应收股利	–
4	应收利息	2，502，993.46
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
	合计	40，830，997.85

4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

九、重大事件揭示

本基金自合同生效至上市交易期间未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

十、基金管理人承诺

本基金管理人就本基金上市交易之后履行管理人职责做出如下承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规、基金合同的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

（二）真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件，披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息，并接受中国证监会、证券交易所的监督管理。

（三）在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后，将及时予以公开澄清。

十一、基金托管人承诺

基金托管人就本基金上市交易后履行托管人职责做出如下承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，设立专门的基金托管部，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。

（二）根据《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付等行为进行监督和核查。

（三）基金托管人发现基金管理人的行为违反《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，并在限期内，随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。

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

十二、基金上市推荐人意见

本基金无上市推荐人。

十三、备查文件目录

本基金备查文件包括下列文件：

（一）中国证监会批准万家强化收益定期开放债券型证券投资基金募集的文件
（二）《万家强化收益定期开放债券型证券投资基金基金合同》
（三）《万家强化收益定期开放债券型证券投资基金托管协议》
（四）《万家强化收益定期开放债券型证券投资基金招募说明书》
（五）关于申请募集万家强化收益定期开放债券型证券投资基金之法律意见书
（六）基金管理人业务资格批件、营业执照
（七）基金托管人业务资格批件、营业执照
（八）中国证监会要求的其他文件

以上备查文件存放在基金管理人和基金托管人的办公场所，在办公时间可供免费查阅。

万家基金管理有限公司
２０１３年７月２９日