安信宝利债券型证券投资基金（LOF）上市交易公告书

基金管理人：安信基金管理有限责任公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司
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：2015年8月7日
公告日期：2015年8月4日

一、重要声明与提示

《安信宝利债券型证券投资基金（LOF）上市交易公告书》（以下简称“本公告”）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，安信基金管理有限责任公司（以下简称“本基金管理人”）的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，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。本基金托管人中国工商银行股份有限公司保证本报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、深圳证券交易所对安信宝利债券型证券投资基金（LOF）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。凡本上市交易公告书未涉及的有关内容，请投资者详细查阅刊登在2013年6月19日《中国证券报》和《上海证券报》以及安信基金管理有限责任公司网站（http://www.essencefund.com）上的《安信宝利分级债券型证券投资基金招募说明书》。

二、基金概览

1、基金名称：安信宝利债券型证券投资基金（LOF）
2、基金简称：安信宝利
3、基金代码：167501
4、基金类别：债券型
5、基金运作方式：契约型开放式
6、基金存续期限：不定期。
7、基金份额总额：截至2015年7月31日，本基金的基金份额总额为1,615,044,299.75份
8、基金份额净值：截至2015年7月31日，安信宝利基金的基金份额净值为1.004元
9、本次上市交易的基金份额总额：657,302,696.00份。
10、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所
11、上市交易日期：2015年8月7日
12、基金管理人：安信基金管理有限责任公司
13、基金托管人：中国工商银行股份有限公司
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、基金的历史、转型及折算后结果、上市交易和跨系统转托管

（一）本基金的历史

安信宝利债券型证券投资基金（LOF）由安信宝利分级债券型证券投资基金分级运作期届满转型而成。

安信宝利分级债券型证券投资基金经中国证监会许可【2013】673号文核准募集。

安信宝利分级债券型证券投资基金基金管理人为安信基金管理有限责任公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。基金管理人于2013年7月24日获得中国证监会书面确认，《安信宝利分级债券型证券投资基金基金合同》生效，基金募集规模2,923,915,682.14份。

（二）本基金的转型

根据《安信宝利分级债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金《基金合同》生效后分级运作2年期届满，本基金无需召开基金份额持有人大会，因转换为上市开放式基金（LOF），基金名称变更为“安信宝利债券型证券投资基金（LOF）”，基金管理人于2015年7月21日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、深圳证券交易所网站及本基金管理人网站上披露了《安信宝利分级债券型证券投资基金2年期届满转型后基金名称变更及转换基准日等事项的公告》、《安信宝利分级债券型证券投资基金之宝利A份额第四次开放赎回业务的公告》、《安信宝利分级债券型证券投资基金分级运作期届满日之宝利A、宝利B份额折算方案的公告》、《安信宝利分级债券型证券投资基金之宝利A份额开放赎回期间宝利B份额（150137）的风险提示公告》及《安信宝利分级债券型证券投资基金之宝利B终止上市的公告》，《安信宝利分级债券型证券投资基金宝利A开放赎回日之宝利A份额折算的公告》。

本基金管理人于2015年7月24日对安信宝利分级债券型证券投资基金进行了2年期分级运作届满到期后的基金转型工作。经本基金基金管理人计算并经本基金基金托管人中国工商银行股份有限公司确认，基金份额转换基准日（2015年7月24日）转型前安信宝利分级债券型证券投资基金之宝利A份额（以下简称“宝利A”）的基金份额净值为1.000142466元，本基金管理人按照1.000142466：1的转换比例进行了折算，折算后基金份额净值为1.000元，折算前，宝利A的基金份额总额为651,050,253.71份；转型前安信宝利分级债券型证券投资基金之宝利B份额（以下简称“宝利B”）的基金份额净值为1.264009622元，本基金管理人按照1.264009622：1的转换比例进行了折算，折算后基金份额净值为1.000元，折算前，宝利B的基金份额总额为1,000,147,732.94份。折算后，安信宝利总份额为1,915,339,243.45。基金份额总额与持有人持有的基金份额数额将发生调整，份额折算对持有人的权益无实质性影响。本基金管理人已向中国证券登记结算有限责任公司提交份额变更登记申请并于2015年7月28日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、基金管理人网站及深圳证券交易所网站发布了《安信宝利分级债券型证券投资基金分级运作期届满基金份额折算和转换结果的公告》。

（三）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[2015]379号
2、上市交易日期：2015年8月7日
3、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所
4、基金简称：安信宝利（LOF）场内简称：安信宝利
5、交易代码：167501
6、本次上市交易份额：657,302,696.00份（截至2015年7月31日）
7、基金资产净值的披露：每个工作日的次日公布安信宝利债券型证券投资基金（LOF）的基金份额净值，并在深交所行情发布系统揭示。
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转托管至深圳证券交易所场内后即可上市流通。

（四）本基金转托管的主要内容：为了保证基金份额持有人的利益，本基金管理人向深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司提出申请，为基金份额持有人开通了转托管业务的办理平台。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

（一）基金份额持有情况

截至2015年7月31日，安信宝利债券基金(LOF)的持有人总户数为2242户，其中场内基金份额持有人户数为650户。
截至2015年7月31日，安信宝利债券基金(LOF)的基金总规模为1,615,044,299.75份。
场外投资者持有场外基金份额957,741,603.75份，其中机构投资者持有场外基金份额 733,571,421.72份，个人投资者持有场外基金份额 224,170,182.03 份。
场内投资者持有场内基金份额 657,302,696.00 份，平均每户持有的场内基金份额为1,011,234.92份。
机构投资者持有的场内基金份额及占场内基金份额比例：
场内机构持有484,371,178.00份，占场内基金总份额比例为73.69%。
个人投资者持有的场内基金份额及占场内基金总份额比例：
场内个人持有172,931,518.00份，占场内基金总份额比例为26.31%。
（二）场内前十名基金份额持有人的情况：
截至2015年7月31日，场内安信宝利基金份额前十名基金份额持有人情况

序号	基金持有人名称	持有基金份额（份）	占场内总份额比例（%）
1	全国社保基金一零零二组合	58,975,688.00	8.97%
2	全国社保基金二一零组合	33,611,172.00	5.11%
3	光大资管－光大银行－光大阳光北斗星集合资产管理计划	31,600,241.00	4.81%
4	全国社保基金一零零五组合	30,469,684.00	4.64%
5	全国社保基金一零零三组合	26,112,410.00	3.97%
6	全国社保基金二一一组合	24,085,387.00	3.66%
7	深圳市水务（集团）有限公司企业年金计划－招商银行股份有限公司	22,219,554.00	3.38%
8	光大证券－光大银行－光大阳光5号集合资产管理计划	21,235,362.00	3.23%
9	光大证券－光大－光大阳光避险增值集合资产管理计划	18,960,144.00	2.88%
10	全国社保基金二一四组合	17,369,297.00	2.64%
合计		284,638,939.00	43.29%

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人

1、基本情况
名称：安信基金管理有限责任公司
注册地址：深圳市福田区莲花街道益田路6009号新世界商务中心36层
办公地址：深圳市福田区莲花街道益田路6009号新世界商务中心36层
法定代表人：牛冠兴
总经理：刘入领
成立时间：2011年12月6日
批准设立机关：中国证监会
批准设立文号：中国证监会证监许可（2011）1895号
经营范围：基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务。
组织形式：有限责任公司
注册资本：35,000万元人民币
存续期间：永续经营
联系人：王阳
联系电话：0755-82509999
公司的股权结构如下：（截止于2015年7月31日）

股东名称	持股比例
1、五矿资本控股有限公司	38.72%
2、安信证券股份有限公司	33.00%
3、佛山市顺德区新君贸易有限公司	19.71%
4、中广核财务有限责任公司	8.57%

2、内部组织结构及职能：
基金投资部：负责进行基金投资的股票、债券等金融工具选择和组合管理。
量化投资部：负责量化投资产品或投资组合的投资管理。
固定收益部：负责固定收益类产品或投资组合的投资管理。
特定资产管理部：负责特定资产投资的金融工具选择与组合管理。
研究部：负责完成对宏观经济、行业、上市公司、固定收益和投资策略的研究。
北京分公司：负责公司产品在北方区域的销售及当地渠道、机构和客户的维护工作。
上海分公司：负责公司产品在华东区域的销售及当地渠道、机构和客户的维护工作。
华南营销中心：负责公司产品在华南区域的销售及当地渠道、机构和客户的维护工作。
机构创新部：负责创新型业务对机构客户的销售及拓展工作。
金融同业部：负责券商、银行、资产管理公司等广义金融机构客户的业务开发与拓展。
产品部：负责制定公司产品战略及各种产品的设计与开发工作。
市场部：负责营销策划、品牌推广、营销推动和公司机构客户的管理服务等。
电子商务部：负责公司直销柜台、客服中心及电子商务业务的拓展和营销推广。
运营部：负责基金会计和基金注册登记等业务，负责信息技术部负责信息系统开发、网络运行及维护、IT系统安全及数据备份等工作；运营部门下设交易室负责执行基金经理和投资经理的交易指令并进行交易分析和交易监督。
监察稽核部：负责组织建立和完善公司投资风险管理制度与流程，实施公司投资风险管理与绩效分析工作，并对公司投资决策、基金运作、内部管理、制度执行等方面进行监察和稽核，向公司管理层和有关机构提供独立、客观、公正的意见和建议，确保公司各类投资风险得到良好监督与控制。
综合管理部：负责人力资源规划、人员招聘、培训发展、薪酬福利、绩效管理、人力资源信息管理、行政后勤支持、档案管理、合同管理、董事会日常工作等。
财务部负责公司预算管理、财务核算、成本控制、财务分析等工作。
3、人员情况：
截至2015年7月30日，本公司现有员工106人，其中96人取得基金从业资格。
4、基金管理业务情况简介：
截止至2015年7月30日，本基金管理人共管理15只基金：安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金、安信目标收益债券型证券投资基金、安信平稳增长混合型发起式证券投资基金、安信现金管理货币基金、安信宝利债券型证券投资基金（LOF）、安信鑫发优选混合型证券投资基金、安信永利信用型债开放债券型证券投资基金、安信价值精选股票型证券投资基金、安信现金增利货币市场基金、安信消费医药主题股票型证券投资基金、安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金、安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金、安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金、安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金、安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金。

5、本基金经理
庄园女士，经济学硕士，10年证券从业经验。历任招商基金管理有限公司投资部交易员，工银瑞信基金管理有限公司投资部交易员、研究部研究员、中国国际金融有限公司资产管理部高级经理，安信证券股份有限公司证券投资部投资经理、资产管理部高级投资经理，现任安信基金管理有限责任公司固定收益部基金经理。

（二）基金托管人情况

1、基本情况
名称：中国工商银行股份有限公司
住所：北京市西城区复兴门内大街55号（100032）
办公地址：北京市西城区复兴门内大街55号（100032）
法定代表人：姜建清
成立日期：1984年1月1日
组织形式：股份有限公司
批准设立机关及批准设立文号：国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》（国发[1983]146号）
基金托管业务批准文号：中国证监会和中国人民银行证监基字【1998】3号
注册资本：人民币58.0814亿元
存续期间：持续经营
联系人：赵会军
联系电话：010-66105799
2、主要人员情况
截至2014年12月末，中国工商银行资产托管部共有员工207人，平均年龄30岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。
3、基金托管业务经营情况
作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、安心账户资金、企业年金基金、QFII资产、QDII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII专户资产、ESCROW等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。

截至2014年12月，中国工商银行共托管证券投资基金407只。自2003年以来，本行连续十年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的45项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

（三）基金验资机构
名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
住所：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
办公地址：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
执行事务合伙人：Ng Albert Kong Ping 吴港平
电话：（010）58153000、（0755）25028288
传真：（010）85188298、（0755）25026188
签章注册会计师：张小东、陈立群
联系人：李明轩
（四）注册登记人
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
联系电话：010-50938856
传真：010-50938907
联系人：崔巍
（五）上市推荐人
无。

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件

七、基金财务状况

（一）基金募集期间费用
本基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用，未从基金资产中支付。
（二）基金上市前重要财务事项
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。
（三）基金资产负债表
安信宝利债券型证券投资基金2015年7月31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	本报告期末 2015年7月31日
资 产：	
银行存款	245,536,414.50
结算备付金	147,552,181.25
存出保证金	25,127.14
交易性金融资产	2,768,933,661.40
其中：股票投资	
债券投资	2,768,933,661.40
资产支持证券投资	
衍生金融资产	
买入返售金融资产	
应收证券清算款	
应收利息	81,241,805.23
应收股利	
应收申购款	60,316,918.47
其他资产	
资产总计	3,303,606,107.99
负债和所有者权益	本报告期末 2015年7月31日
负 债：	
短期借款	
交易性金融负债	
衍生金融负债	
卖出回购金融资产款	1,600,000,000
应付证券清算款	36,579.95
应付赎回款	79,432,497.57
应付管理人报酬	1,518,108.60
应付托管费	433,745.3
应付销售服务费	1,084,363.30
应付交易费用	15,479.74
应交税费	
应付利息	
应付利润	
其他负债	243,254.24
负债合计	1,682,764,028.70
所有者权益：	
实收基金	1,377,948,415.70
未分配利润	242,893,663.59
所有者权益合计	1,620,842,079.29
负债和所有者权益总计	3,303,606,107.99

八、基金投资组合

截至2015年7月31日，安信宝利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

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资		
	其中：股票		
2	固定收益投资	2,768,933,661.40	83.82
	其中：债券	2,768,933,661.40	83.82
	资产支持证券	–	–
3	金融衍生品投资	–	–
4	买入返售金融资产	–	–
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	–	–
5	银行存款和结算备付金合计	393,088,595.75	11.90
6	其他各项资产	141,583,850.84	4.29
7	合计	3,303,606,107.99	100.00

（二）报告期末按行业分类的股票投资组合
1、报告期末权益投资按行业分类的股票投资组合
注：截至2015年7月31日，本基金未持有股票。
2、报告期末按数投资按行业分类的股票投资组合
注：截至2015年7月31日，本基金未持有股票。
（三）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细
注：截至2015年7月31日，本基金未持有股票。
（四）报告期末按债券品种分类的债券投资组合

债券品种	公允价值（元）	占净值比例
国家债券	–	0.00%
央行票据	–	0.00%
金融债券	272,555,000.00	16.82%
企业债券	2,122,715,661.40	130.96%
企业短期融资券	327,505,000.00	20.21%
中期票据	46,158,000.00	2.85%
可转债	–	0.00%
其他	–	0.00%
合计	2,768,933,661.40	170.83%

（五）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	150408	15农发08	2,500,000	252,475,000.00	15.5768%
2	122266	13中信03	1,252,810	128,275,215.90	7.9141%
3	122830	11沈国资	848,210	89,121,424.70	5.4985%
4	124408	13宿城投	800,000	84,984,000.00	5.2432%
5	124342	13黟南资	800,000	83,752,000.00	5.1672%

（六）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细
注：截至2015年7月31日，本基金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
注：截至2015年7月31日，本基金未持有权证。
（八）本基金投资的国债期货交易说明
1、本期国债期货投资政策
本基金基金合同约投资范围尚未包含国债期货投资。
2、报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。
3、本期国债期货投资评价
本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。
（九）投资组合报告附注
1、截至2015年7月31日，本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
2、截至2015年7月31日，本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。
3、其他各项资产构成如下：

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	25,127.14
2	应收证券清算款	
3	应收股利	
4	应收利息	81,241,805.23
5	应收申购款	60,316,918.47
6	其他应收款	
7	待摊费用	
8	其他	
9	合计	141,583,850.84

4、截至2015年7月31日，本基金持有的处于转股期的可转换债券明细。
截至2015年7月31日，本基金未持有处于转股期的可转换债券。
5、截至2015年7月31日，本基金前十名股票中存在流通受限情况的说明。
截至2015年7月31日，本基金未持有股票。
6、投资组合报告附注的其他文字描述部分
由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

九、市场、投资者和监管机构对本基金的关注事项

本基金自合同生效至本公告书公告前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

基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出以下承诺：
（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》及其他法律法规、《基金合同》的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则安全保管基金财产。
（二）根据《基金法》、《运作办法》、《基金合同》和有关法律法规的规定，对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金申购赎回对价的复核、基金管理人根据投资指令进行的资金划拨、基金管理人根据的计提和支付、基金费用的支付、基金申购与赎回过程中的组合证券交割、现金替代和现金差额的划付、基金收益分配、基金的融资条件等行为的合法性、合规性进行监督和核查。
基金托管人发现基金管理人的违反《基金法》、《基金合同》和有关法律法规规定的行为，将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后将及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人将报告中国证监会。
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。

十二、备查文件目录

以下备查文件存放于基金管理人和基金托管人的办公场所，投资者可在办公时间免费查阅。
（一）中国证监会准予安信宝利分级债券型证券投资基金募集注册的文件
（二）《安信宝利分级债券型证券投资基金基金合同》
（三）《安信宝利分级债券型证券投资基金托管协议》
（四）关于申请募集注册安信宝利分级债券型证券投资基金之法律意见书
（五）基金管理人业务资格批件和营业执照
（六）基金托管人业务资格批件和营业执照
（七）注册登记协议
（八）中国证监会要求的其他文件

安信基金管理有限责任公司
2015年8月4日

附件：基金合同摘要

一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务
（一）基金份额持有人的权利与义务
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。
本基金基金合同生效之日起2年内，宝利A、宝利B的基金份额持有人持有的每一份基金份额按照基金合同约定在各自份额级别内具有同等的合法权益；本基金基金合同生效后2年期届满，基金转换为上市开放式基金（LOF）后，每份基金份额具有同等的合法权益。
1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：
（1）分享基金财产收益；
（2）参与分配清算后的剩余基金财产；
（3）依法申请赎回其持有的基金份额；
（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、基金销售机构按照其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；
（9）法律法规和基金合同规定的其他权利。
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、赎回款项及法律法规和基金合同所规定的费用；
（5）在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同约定的有限责任；
（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。
（二）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）依照基金合同及有关法律规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了基金合同及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
（7）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
（8）选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；
（9）担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得基金合同规定的费用；
（10）依据基金合同及有关法律规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）法律法规和基金合同规定的其他权利。
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）计提基金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）按基金合同约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人公布、计算并支付基金份额持有人的应得部分；
（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条件下得到有关资料的复印件；
（18）组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
（19）面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；
（20）因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
（21）监督基金托管人按法律法规和基金合同规定履行自己的义务，基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；
（22）当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；
（23）以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；
（24）基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，基金合同不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期存款利息在基金募集期结束后30日内退还基金认购人；
（25）执行生效的基金份额持有人大会的决议；
（26）建立并保存基金份额持有人名册；
（27）法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。
（三）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，如发现基金管理人有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）法律法规和基金合同规定的其他权利。
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；如果基金管理人有未按打算基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了追当的措施；
（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。
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。
1、本基金基金合同生效之日起2年内，基金份额持有人大会的审议事项应分别由宝利A、宝利B的基金份额持有人独立进行表决。宝利A、宝利B的基金份额持有人持有的每一份基金份额在各自份额级别内具有同等的投票权。
2、本基金基金合同生效后2年期届满，本基金无需召开基金份额持有人大会，自动转换为上市开放式基金（LOF）。基金份额持有人持有的每一基金份额具有平等的投票权。
（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，但本基金在基金合同生效后2年期届满转换为上市开放式基金（LOF）除外；
（5）提高基金管理人、基金托管人、销售服务费的报酬标准，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准和费用的除外；
（6）变更基金类别；
（7）本基金与其他基金的合并；
（8）变更基金投资目标、范围或策略（法律法规和中国证监会另有规定的除外）；
（9）变更基金份额持有人大会程序；
（10）基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
（11）单独或合计持有本基金总份额10%以上（含10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；
本基金基金合同生效之日起2年内，依据基金合同享有基金份额持有人大会召集提议权、自行召集权、提案权、会议表决权、新任基金管理人和基金托管人提名权的单独或合计持有本基金总份额10%以上（含10%）基金份额的基金份额持有人或类似表述均指“单独或合计持有宝利A、宝利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”或其类似表述。
（12）对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；
（13）法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。
2、以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：
（1）调低基金管理费、基金托管费和销售服务费；
（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；
（4）因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改；
（5）对基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生重大变化；
（6）按照法律法规和基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。
（二）会议召集人及召集方式
1、除法律法规规定或基金合同另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集；
2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集；
3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开；基金管理人决定不召集，