(上接A22版)

| (27)中国银河证券股份有限公司 | |
|---|---|
| 注册地址:北京市西城区金融大街35号2-6层 | |
| 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:陈共炎 | 联系人:辛国政 |
| 电话:010-83574507 | 传真:010-83574807 |
| 客户服务电话:4008-888-888或95551 | 网址:www.chinastock.com.cn |

| (28)中信建投证券股份有限公司 | |
|---|---|
| 注册地址:北京市朝阳区安立路66号4号楼 | |
| 办公地址:北京市朝阳门内大街188号 | |
| 法定代表人:王常青 | 联系人:张颢 |
| 电话:010-85130588 | 传真:010-65182261 |
| 客户服务电话:400-8888-108 | 网址:www.csc108.com |

| (29)中信证券股份有限公司 | |
|---|---|
| 注册地址:广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座 | |
| 办公地址: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:侯艳红 |
| 电话:010-60838888 | 传真:010-60833739 |
| 客户服务电话:95558 | 网址:www.citics.com |

| (30)中山证券有限责任公司 | |
|---|---|
| 注册地址:深圳市福田区益田路6009号新世界中心29层 | |
| 办公地址:深圳市福田区莲花街道益田路6013号江苏大厦B座15楼 | |
| 法定代表人:吴永良 | 联系人:罗艺琳 |
| 电话:0755-83734659 | 传真:0755-82960582 |
| 客户服务电话:95329 | 网址:www.zszq.com.cn |

| (31)信达证券股份有限公司 | |
|---|---|
| 注册地址: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:张志刚 | 联系人:鹿馨方 |
| 电话:010-63081000 | 传真:010-63080978 |
| 客服热线:95321 | 网址:www.cindasc.com |

| (32)西南证券股份有限公司 | |
|---|---|
| 注册地址: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:廖庆轩 | 联系人:周青 |
| 电话:023-63786633 | 传真:023-67616310 |
| 客服热线:95355、4008096096 | 网址:www.swsc.com.cn |

| (33)蚂蚁(杭州)基金销售有限公司 | |
|---|---|
| 注册地址:浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路969号3幢5层599室 | |
| 办公地址:浙江省杭州市西湖区黄龙时代广场B座6楼 | |
| 法定代表人:祖国明 | 联系人:韩爱彬 |
| 电话:0571-81137494 | 传真:4000-766-123 |
| 客户服务电话:4000-766-123 | 网址:www.fund123.cn |

| (34)上海长量基金销售有限公司 | |
|---|---|
| 注册地址:上海市浦东新区高翔路526号2幢220室 | |
| 办公地址:上海市浦东新区东方路1267号11层 | |
| 法定代表人:张跃伟 | 联系人:马良婷 |
| 电话:021-20691832 | 传真:021-20691861 |
| 客户服务电话:400-820-2899 | 网址:www.erichfund.com |

| (35)诺亚正行基金销售有限公司 | |
|---|---|
| 注册地址:上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室 | |
| 办公地址:上海市杨浦区长阳路1687号2号楼 | |
| 法定代表人:汪静波 | 联系人:李娟 |
| 电话:021-38602377 | 传真:021-38509777 |
| 客户服务电话:400-821-5399 | 网址:www.noah-fund.com |

| (36)上海好买基金销售有限公司 | |
|---|---|
| 注册地址:上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室 | |
| 办公地址:上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903-906室 | |
| 法定代表人:杨文斌 | 联系人:徐超逸 |
| 电话:021-20613988 | 传真:021-68596916 |
| 客户服务电话:4007009665 | 网址:www.ehowbuy.com |

| (37)和讯信息科技有限公司 | |
|---|---|
| 注册地址:北京市朝阳区朝外大街22号1002室 | |
| 办公地址:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层 | |
| 法定代表人:王莉 | 联系人:陈慧慧 |
| 电话:010-85657353 | 传真:010-65884788 |
| 客户服务电话:400-920-0022 | 网址:www.licaike.hexun.com |

| (38)上海天天基金销售有限公司 | |
|---|---|
| 注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层 | |
| 办公地址:上海市徐汇区宛平南路88号东方财富大厦 | |
| 法定代表人:其实 | 联系人:朱钰 |
| 电话:021-54509998 | 传真:021-64385308 |
| 客户服务电话:400-1818-188 | 网址:fund.eastmoney.com |

| (39)上海汇付基金销售有限公司 | |
|---|---|
| 注册地址:上海市黄浦区黄河路333号201室A区056单元 | |
| 办公地址:上海市宜山路700号普天信息产业园2期C5栋 | |
| 法定代表人:金佶 | 联系人:甄宝林 |
| 电话:021-34013996-3011 | 传真: |
| 客户服务电话:021-34013999 | 网址:www.hotjijin.com |

| (40)上海陆金所基金销售有限公司 | |
|---|---|
| 注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元 | |
| 办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼 | |
| 法定代表人:郭坚 | 联系人:宁博宇 |
| 电话:021-20665952 | 传真:021-22066653 |
| 客户服务电话: 4008219031 | 网址:www.lufunds.com |

| (41)大泰金石基金销售有限公司 | |
|---|---|
| 注册地址:南京市建邺区江东中路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 | 联系人:朱真卿 |
| 电话:021-22267943 | 传真:021-22268089 |
| 客户服务电话:400-928-2266 | 网址:www.dtfunds.com |

| (42)上海联泰基金销售有限公司 | |
|---|---|
| 注册地址:中国(上海)自由贸易试验区富特北路277号3层310室 | |
| 办公地址:上海长宁区福泉北路518号8座3楼 | |
| 法定代表人:燕斌 | 联系人:陈东 |
| 电话:021-52822063 | 传真:021-52975270 |
| 客户服务电话:400-046-6788 | 网址: www.66zichan.com |

| (43)海银基金销售有限公司 | |
|---|---|
| 注册地址:中国(上海)自由贸易试验区银城中路8号402室 | |
| 办公地址:上海市浦东新区银城中路8号4楼 | |
| 法定代表人:惠晓川 | 联系人:毛林 |
| 电话:021-80133597 | 传真:021-80133413 |
| 客户服务电话:4008081016 | 网址: www.fundhaiyin.com |

| (44)上海凯石财富基金销售有限公司 | |
|---|---|
| 注册地址:上海市黄浦区西藏南路765号602-115室 | |
| 办公地址:上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦4楼 | |
| 法定代表人:陈继武 | 联系人:葛佳蕊 |
| 电话:021-80365020 | 传真:021-63332523 |
| 客户服务电话:4006433389 | 网址:www.vstonewealth.com |

| (45)上海利得基金销售有限公司 | |
|---|---|
| 注册地址:上海市宝山区蕴川路5475号1033室 | |
| 办公地址:上海浦东新区峨山路91弄61号10号楼12楼 | |
| 法定代表人:李兴春 | 联系人:徐鹏 |
| 电话:86-021-50583533 | 传真:86-021-50583633 |
| 客户服务电话:400-921-7755 | 网站:http://a.leadfund.com.cn/ |

| (46)珠海盈米基金销售有限公司 | |
|---|---|
| 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 | 联系人:邱湘湘 |
| 电话:020-89629099 | 传真:020-89629011 |
| 客户服务电话:020-89629066 | 网站:www.yingmi.cn |

| (47)北京汇成基金销售有限公司 | |
|---|---|
| 注册地址:北京市海淀区中关村大街11号E世界财富中心A座11层1108号 | |
| 办公地址:北京市海淀区中关村大街11号E世界财富中心A座11层 | |
| 法定代表人:王伟刚 | 联系人:丁向坤 |
| 电话:010-56282140 | 传真:010-62680827 |
| 客户服务电话:400-619-9059 | 网址:www.hcjijin.com |

| (48)深圳前海微众银行股份有限公司 | |
|---|---|
| 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:广东省深圳市南山区田厦金牛广场A座36楼、37楼 | |
| 法定代表人:顾敏 | 联系人:罗曦 |
| 电话:0755-89462447 | 传真:0755-86700688 |
| 客户服务电话:400-999-8877 | 网址:www.webank.com |

| (49)上海华夏财富投资管理有限公司 | |
|---|---|
| 注册地址:上海市虹口区东大名路687号1幢2楼268室 | |
| 办公地址:北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层 | |
| 法定代表人:李一梅 | 联系人:仲秋玥 |
| 电话:010-88066632 | 传真:010-88066552 |
| 客户服务电话:4008175666 | 网址:www.amcfortune.com |

| (50)和谐保险销售有限公司 | |
|---|---|
| 注册地址:北京市朝阳区东三环中路55号楼20层2302 | |
| 办公地址:北京市朝阳区建国门外大街6号安邦金融中心 | |
| 法定代表人:蒋洪 | 联系人:张楠 |
| 电话:010-85256214 | |
| 客户服务电话:4008195569 | 网站:www.hx-sales.com |

| (51)一路财富(北京)基金销售股份有限公司 | |
|---|---|
| 注册地址:北京市西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座2208 | |
| 办公地址:北京市西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座2208 | |
| 法定代表人:吴雪秀 | 联系人:徐越 |
| 电话:010-88312877-8032 | 传真:010-88312099 |
| 客户服务电话:400-001-1566 | 网址:www.yilucaifu.com |

| (52)嘉实财富管理有限公司 | |
|---|---|
| 注册地址:上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心办公楼二期53层5312-15单元 | |
| 办公地址:北京市朝阳区建国路91号金地中心A座6层 | |
| 法定代表人:赵学军 | 联系人:王宫 |
| 电话:021-38789658 | 传真:021-68880023 |
| 客户服务电话:400-600-8800 | 网址:www.jsfund.cn |

| (53)北京蛋卷基金销售有限公司 | |
|---|---|
| 注册地址:北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507 | |
| 办公地址:北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507 | |
| 法定代表人:钟斐斐 | 联系人:侯芳芳 |
| 电话:010-61840688 | 传真:010-61840699 |
| 客户服务电话:400-1599-288 | 网址:www.danjuanapp.com |

| (54)上海基煜基金销售有限公司 | |
|---|---|
| 注册地址:上海市崇明县长兴镇潘园公路1800号2号楼6153室(上海泰和经济发展区) | |
| 办公地址:上海市浦东新区银城中路488号太平金融大厦1503室 | |
| 法定代表人:王翔 | 联系人:张巍婧 |
| 电话:021-65370077-255 | 传真:021-55085991 |
| 客户服务电话:400-820-5369 | 网址:www.jiyufund.com.cn |

| (55)开源证券股份有限公司 | |
|---|---|
| 注册地址:西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层 | |
| 办公地址:西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层 | |
| 法定代表人:李刚 | 联系人:袁伟涛 |
| 电话:029-88447611 | 传真:029-88447611 |
| 客户服务电话:95325或400-860-8866 | 网址:www.kysec.cn |

| (56)华鑫证券有限责任公司 | |
|---|---|
| 注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01(b)单元 | |
| 办公地址:上海市徐汇区宛平南路8号 | |
| 法定代表人:俞洋 | 联系人:杨莉娟 |
| 电话:021-54967552 | 传真:021-54967293 |
| 客户服务电话:95323 | 网址:www.cfsc.com.cn |

| 3、场内销售机构 |
|---|
| 场内代销机构是指有基金代销资格的上海证券交易所会员,名单详见上海证券交易所网站:http://www.sse.com.cn |

基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其他符合要求的机构代理销售本基金,并及时公告。
(二)其他相关机构

| 信息类型 | 注册登记机构 | 律师事务所 | 会计师事务所 |
|---|---|---|---|
| 名称 | 中国证券登记结算有限责任公司 | 上海源泰律师事务所 | 德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙) |
| 注册地址 | 北京市西城区太平桥大街17号 | 上海市浦东南路256号华夏银行大厦1405室 | 上海市黄浦区延安东路222号30楼 |
| 办公地址 | 北京市西城区太平桥大街17号 | 上海市浦东南路256号华夏银行大厦1405室 | 上海市黄浦区延安东路222号30楼 |
| 法定代表人 | 周明 | 廖海(负责人) | 曾顺福 |
| 联系电话 | 010-59378856 | 021-51150298 | 021-61418888 |
| 传真 | 010-59378907 | 021-51150398 | 021-61411909 |
| 联系人 | 崔巍 | 廖海、刘佳 | 曾浩(曾浩、吴凌志为经办注册会计师) |

## 六、基金的历史沿革

长信富安纯债一年定期开放债券型证券投资基金经中国证监会证监许可[2015]2310号文注册公开发行。基金管理人为长信基金管理有限责任公司,基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

长信富安纯债一年定期开放债券型证券投资基金自2015年11月3日至2015年11月18日进行公开募集,募集结束后基金管理人向中国证监会办理备案手续。长信富安纯债一年定期开放债券型证券投资基金首次设立募集规模为1,482,871,919.06份基金份额(含利息转份额301,959.62份),有效认购户数为9,322户。经中国证监会书面确认,本基金于2015年11月23日正式成立,《长信富安纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》于2015年11月23日生效。

2019年4月11日至2019年5月7日期间长信富安纯债一年定期开放债券型证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会,会议审议通过了《关于长信富安纯债一年定期开放债券型证券投资基金变更注册的议案》,内容包括长信富安纯债一年定期开放债券型证券投资基金修改基金名称、基金运作方式、投资比例、业绩比较基准、基金费率等,基金名称由"长信富安纯债一年定期开放债券型证券投资基金"变更为"长信富安纯债半年定期开放债券型证券投资基金"。根据上述基金份额持有人大会决议,变更注册后的《长信富安纯债半年定期开放债券型证券投资基金基金合同》于2019年6月10日生效,《长信富安纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》自同一日起失效。

## 七、基金的存续

《基金合同》生效后,连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的,基金管理人应当在定期报告中予以披露;连续60个工作日出现前述情形的,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。

法律法规或监管部门另有规定时,从其规定。

## 八、基金份额的封闭期与开放期

(一)基金的封闭期

本基金在存续期内,除开放期外,均为封闭期。本基金封闭期内不办理申购与赎回业务,也不上市交易。

(二)基金的开放期

本基金第一个开放期的首日为本基金基金合同生效日的6个月后的月度对日(如该对应日为非工作日或不存在对应日期的,则顺延至下一工作日,下同),第二个开放期的首日为本基金基金合同生效日的12个月后的月度对日,第三个开放期的首日为本基金基金合同生效日的18个月后的月度对日,以此类推。

本基金每个开放期最长不超过 15个工作日,开放期的具体时间以基金管理人届时公告为准。在开放期内,投资人可办理基金份额申购、赎回或其他业务。如原定开放期首日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的,开放期自不可抗力或其他情形的影响因素消除之日起的下一个工作日开始。如在开放期内发生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的,开放期时间中止计算,在不可抗力或其他情形影响因素消除之日下一个工作日起,继续计算该开放期时间。

(三)封闭期与开放期示例

假设本基金的基金合同于2019年11月15日生效,则本基金的第一个开放期的首日为基金合同生效日起6个月后的月度对日,即2020年5月15日,假设第一个开放期为15个工作日,则第一个开放期为自2020 年5月15日至2020年6月4日的15个工作日;本基金第一个封闭期为2019年11 月15日至2020年5月14日;第二个开放期的首日为基金合同生效日起12个月后的月度对日,即2020年11月16日(因2020年11月15日为非工作日,顺延至下一个工作日),则本基金第二个封闭期为2020年6 月5日至2020 年11月15日。以此类推。

## 九、基金份额的申购与赎回

(一)申购和赎回场所

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。具体的销售机构将由基金管理人在招募说明书或其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构,并予以公告。基金投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。

(二)申购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和赎回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公告暂停申购、赎回时除外。

基金合同生效后,若出现新的证券交易市场、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,自本基金进入首个开放期,开始办理申购和赎回等业务。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、赎回或者转换。在开放期内,投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的,其基金份额申购、赎回或转换价格为下一开放日基金份额申购、赎回或转换的价格;在开放期最后一个开放日交易时间结束后提出的申购、赎回或转换申请视为无效申请。

(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;
5、办理申购、赎回业务,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。投资人在申购本基金时须按销售机构规定的方式备足申购资金,投资人在提交赎回申请时,必须有足够的基金份额余额,否则所提交的申购、赎回的申请无效。

2、申购和赎回的款项支付

投资人申购基金份额时,必须全额交付申购款项,投资人交付申购款项,申购成立;登记机构确认基金份额时,申购生效。

基金份额持有人递交赎回申请,赎回成立;登记机构确认赎回时,赎回生效。

投资人赎回申请生效后,基金管理人将在T+7日(包括该日)内支付赎回款项。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。

遇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,则赎回款顺延至上述情形消除后的下一个工作日划往投资人银行账户。

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,投资人可在T+2日后(包括该日)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。若申购不成功或无效,则申购款项本金退还给投资人。

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购、赎回申请。申购、赎回的确认以登记机构或基金管理人的确认结果为准。对于申购、赎回申请及申购份额、赎回金额的确认情况,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、投资人通过场外办理本基金申购时,首次申购的单笔最低金额为人民币1元(含申购费,下同),追加申购的单笔最低金额为人民币1元;超过最低申购金额的部分不设金额级差。投资人通过本公司直销柜台及网上直销平台申购本基金遵循上述规则;各代销机构有不同规定的,投资人在该代销机构办理申购业务时,需同时遵循该代销机构的相关规定。

2、投资人通过上海证券交易所场内申购时,每笔申购金额最低为人民币100元,同时每笔申购必须是100元的整数倍。

3、投资人当期分配的基金收益转购基金份额时,不受最低申购金额的限制。基金管理人可根据市场情况,调整本基金首次申购的最低金额。

4、基金份额持有人在销售机构赎回本基金的单笔赎回申请不得低于1份基金份额,且通过场内单笔申请赎回的本基金基金份额必须是整数份;基金份额持有人赎回时或赎回后在销售机构(网点)单个交易账户保留的基金份额余额不足1份的,余额部分基金份额在赎回时需同时全部赎回。

5、基金管理人可以规定单个投资人累计持有的基金份额上限、单笔/单日申购金额上限、本基金总规模上限,具体规定请参见相关公告。

6、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时,基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施,切实保护存量基金份额持有人的合法权益,具体请参见相关公告。

7、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。基金管理人必须在调整前依照《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)申购与赎回的价格、费用及其用途

1、本基金将基金份额分为A类基金份额和C类基金份额两种。本基金的A类基金份额在申购时收取申购费,赎回时根据持有期限收取赎回费;C类基金份额不收取申购费,但从该类别基金资产中计提销售服务费。

2、申购费率

本基金A类基金份额采用前端收费模式收取基金申购费用;C类基金份额不收取申购费。本基金对通过直销中心申购的养老金客户与除此之外的其他投资者实施差别的申购费率。养老金客户包括基本养老基金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金等,具体包括:

(1)全国社会保障基金;
(2)可以投资基金的地方社会保障基金;
(3)企业年金单一计划以及集合计划;
(4)企业年金理事会委托的特定客户资产管理计划;
(5)企业年金养老金产品。

如将来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型,基金管理人可在招募说明书更新时或发布临时公告将其纳入养老金客户范围,并按规定向中国证监会备案。

通过基金管理人的直销中心申购基金份额的养老金客户及除养老金客户之外的其他投资者申购两类基金份额的申购费率如下(场内外申购费率相同):

| 基金份额类别 | 单笔申购金额(M,含申购费) | 申购费率 | 养老金客户申购费率 |
|---|---|---|---|
| A类基金份额 | M<100万元 | 0.6% | 0.03% |
| | 100万元≤M<500万元 | 0.3% | 0.015% |
| | M≥500万元 | 每笔1000元 | 每笔1000元 |
| C类基金份额 | 0 | | |

注:M为申购金额

投资本基金的养老金客户,在本公司直销中心办理账户认证手续后,即可享受上述特定费率。未在本公司直销中心办理账户认证手续的养老金客户,不享受上述特定费率。

投资者选择红利自动再投资所转成的份额不收取申购费用。

3、赎回费率

本基金基金份额的赎回费率随持有时间的增加而递减。两类基金的赎回费率如下(场内外赎回费率相同):

| 基金份额类别 | 持有期限(N) | 赎回费率 |
|---|---|---|
| A类/C类基金份额 | N<7日 | 1.50% |
| | 7日≤N<30日 | 0.5% |
| | N≥30日 | 0 |

注:N为持有期限

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担,对于持有期少于 7 日的基金份额所收取的赎回费,全额计入基金财产,对持有期不少于7 日的基金份额收取的赎回费总额的 25%应归基金财产,未归入基金财产的部分用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

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、基金销售机构可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划,定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间,按相关监管部门要求履行必要手续后,基金管理人可以适当调低基金销售费率。

6、本基金发生大额申购或赎回情形时,本基金管理人可以采用摆动定价机制,以确保基金估值的公平性,并履行相关信息披露义务。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。

(七)申购份额与赎回金额的计算

1、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,以申请当日基金份额净值为基准计算,四舍五入保留到小数点后两位,由此误差产生的收益或损失由基金财产承担;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,以申请当日基金份额净值为基准计算,保留到整数位,不足一份基金份额部分的申购资金零头由交易所会员单位返还给基金投资者。

2、赎回金额的处理方式:赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用,赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入方法,保留到小数点后2位,由此产生的收益或损失由基金财产承担。

3、申购份额的计算

基金的申购金额包括申购费用和净申购金额。本基金的申购份额计算公式为:
净申购金额=申购金额/(1+申购费率)
或,净申购金额=申购金额-固定申购费金额
申购费用=申购金额-净申购金额,或,固定申购费金额
申购份额=净申购金额/申购当日各类基金份额净值

例1:某投资者(非养老金客户)投资5万元申购本基金A类份额,假设申购当日A类份额净值为1.0520元,则可得到的申购份额为:
净申购金额=50000/(1+0.60%)=49701.79元
申购费用=50000-49701.79=298.21元
如果投资者(非养老金客户)是场外申购,可得到的A类份额为47245.05(=49701.79/1.0520)份;
如果投资者(非养老金客户)是场内申购,可得到的A类份额为47245份,剩余0.05份对应的申购资金零头返还给投资者。
即:投资者(非养老金客户)投资5万元申购本基金A类份额,对应的申购费率为0.6%,假设申购当日A类基金份额净值为1.0520元,则其如果是场外申购可得到47245.05份A类份额,如果是场内申购可得到47245份A类份额。

例2:某投资者(非养老金客户)投资5万元申购本基金C类份额,假设申购当日C类份额份额净值为1.0520元,则可得到的申购份额为:
净申购金额=50000/(1+0%)=50000元
申购费用=50000-50000=0元
如果投资者(非养老金客户)是场外申购,可得到的C类份额为47528.52(=50000/1.0520)份;
如果投资者(非养老金客户)是场内申购,可得到的C类份额为47528份,剩余0.52份对应的申购资金零头返还给投资者。
即:投资者(非养老金客户)投资5万元申购本基金 C类基金份额,对应的申购费率为0%,假设申购当日C类基金份额净值为1.0520元,则其如果是场外申购可得到47528.52份C类份额,如果是场内申购可得到47528份C类份额。

4、赎回金额的计算

(1)若投资者认/申购A类基金份额,则赎回金额的计算公式为:
赎回总额=赎回份额×赎回当日A类份额份额净值
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3:某投资者持有本基金10万份A类份额30天后赎回,赎回费率为0%,假设赎回当日A类份额份额净值是1.2000元,则其可得到的赎回金额为:
赎回总额=100,000×1.2000=120,000元
赎回费用=120,000×0=0元
赎回金额=120,000-0=120,000元
即投资者持有本基金10万份A类份额30天后赎回,假设赎回当日A类份额份额净值是1.2000元,则其可得到的赎回金额为120,000元。

(2)投资者认/申购C类基金份额,则赎回金额的计算公式为:
赎回总额=赎回份额×赎回当日C类份额份额净值
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4:某投资者赎回10万份C类份额持有30日后赎回,对应的赎回费率为0,假设赎回当日C类份额份额净值是1.2500元,则其可得到的赎回金额为:
赎回总额=100,000×1.2500=125,000元
赎回费用=125,000×0=0元
赎回金额=125,000-0=125,000元
即投资者持有本基金10万份C类份额30日后赎回,假设赎回当日C类份额份额净值是1.2500元,则投资者可得到的赎回金额为125,000元。

5、基金份额净值的计算公式为:
基金份额净值=基金资产净值总额/基金份额总数。

本基金分为A类和C类两类基金份额,两类基金份额单独设置基金代码,分别计算和公告基金份额净值。本基金两类基金份额净值的计算,均保留到小数点后4位,小数点后第5位四舍五入,由此产生的收益或损失由基金财产承担。在本基金的封闭期期间,基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在开放期首日披露本基金封闭期最后一个工作日的基金资产净值和基金份额净值。在本基金的开放期期间,基金管理人应当在每个交易日的次日,通过网站、基金份额销售网点以及其他媒介,披露交易日的基金份额净值和基金份额累计净值。遇特殊情况,经中国证监会同意,可以适当延迟计算或公告。

(八)拒绝或暂停申购的情形

在开放期内发生下列情况时,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。
3、证券、期货交易所交易时间非正常停市,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
4、接受某笔或某些申购申请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,从而损害现有基金份额持有人利益的情形。
6、接受某笔或者某些申购申请可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%,或者变相规避50%集中度的情形时。
7、当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时,经与基金托管人协商确认后,基金管理人应当暂停基金估值,并采取暂停接受基金申购申请的措施。
8、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、7、8项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停或拒绝基金投资者的申购申请时,基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝,被拒绝的申购款项本金将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时,基金管理人应及时恢复申购业务的办理,且开放期时间按暂停申购的期间相应延长。

(九)暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

在开放期内发生下列情形时,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。
3、证券、期货交易所交易时间非正常停市,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
4、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。
5、当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时,经与基金托管人协商确认后,基金管理人应当暂停基金估值,并采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施。
6、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接受基金投资者的赎回申请时,基金管理人应在当日报中国证监会备案,已确认的赎回申请,基金管理人应足额支付;如暂时不能足额支付,应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人,未支付部分可延期支付。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,且开放期时间按暂停赎回的期间相应延长。

(十)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、延缓支付赎回款项或部分延期赎回。

(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)部分延期赎回:本基金发生巨额赎回时,在单个基金份额持有人超过前一工作日基金总份额20%以上的赎回申请的情形下,基金管理人认为支付该基金份额持有人的全部赎回申请有困难或者因支付该基金份额持有人的全部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,在当日接受该基金份额持有人的全部赎回的比例不低于前一工作日基金总份额20%的前提下,其余赎回申请可以延期办理,但延期办理的期限不得超过20个工作日,如延期办理期限超过开放期的,则在开放期外继续办理,基金管理人仅为原开放期内因提交赎回申请超过上一工作日基金总份额 20%以上而被延期办理赎回的单个基金份额持有人办理赎回业务。但是,如该持有人在提交赎回申请时选择取消赎回,则其当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。

3、巨额赎回的公告

当发生上述巨额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。

(十一)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个开放日的各类基金份额净值。

3、如发生暂停的时间超过1日但少于2周(含2周),暂停结束,基金重新开放申购或赎回时,基金管理人应依照《信息披露管理办法》的有关规定,提前2日在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告,并公告最近1个开放日的各类基金份额净值。

4、如发生暂停的时间超过2周,暂停期间,基金管理人应每2周至少刊登暂停公告1次。当连续暂停时间超过2个月的,基金管理人可以调整刊登公告的频率。暂停结束,基金重新开放申购或赎回时,基金管理人应依照《信息披露管理办法》的有关规定,提前2日在指定媒介和基金管理人网站上刊登基金重新开放申购或赎回公告,并公告最近1个开放日的各类基金份额净值。

5、以上暂停及恢复基金申购与赎回的公告规定,不适用于基金合同约定的封闭期与开放期运作方式转换引起的暂停或恢复申购与赎回的情形。

(十二)基金转换

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

(十三)基金的非交易过户

基金的非交易过户是指基金登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。无论在上述何种情况下,接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资人,或者按照相关法律法规或国家有权机关要求的方式进行处理。

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。

(十四)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。

(十五)定期定额投资计划

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

(十六)基金的冻结、解冻和质押

基金登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻,以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。基金份额被冻结的,被冻结部分产生的权益一并冻结,被冻结部分份额仍然参与收益分配与支付。法律法规、中国证监会或法院判决、裁定另有规定的除外。

如相关法律法规允许基金管理人办理基金份额的质押业务或其他基金业务,基金管理人将制定和实施相应的业务规则。

## 十、基金的投资

(一)投资目标

本基金为纯债基金,以获取高于业绩比较基准的回报为目标。

(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,包括债券(国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、次级债券、可分离交易可转债的纯债部分)、债券回购、资产支持证券、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、国债期货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。

本基金不参与权证,股票等资产投资,可转债仅投资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,其投资比例遵循届时有效法律法规或相关规定。

本基金的投资组合比例为:投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%,但在每次开放期开始前15个工作日、开放期及开放期结束后15个工作日的期间内,基金投资不受上述比例限制。开放期内,每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金持有现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)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,本基金不受5%的比例限制,但每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)。

如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

(三)投资策略

本基金在封闭期与开放期采取不同的投资策略。

1、封闭期投资策略

(1)资产配置策略

本基金将在基金合同约定的投资范围内,通过对宏观经济运行状况、国家货币政策和财政政策、国家产业政策及资本市场资金环境的研究,积极把握宏观经济发展趋势、利率走势、债券市场相对收益率、券种的流动性以及信用水平,优化固定收益类金融工具的资产比例配置。在有效控制风险的基础上,适时调整组合久期,以获得基金资产的稳定增值,提高基金总体收益率。

(2)类属配置策略

对于债券资产而言,是信用债、金融债和国债之间的比例配置。当宏观经济运行向衰退周期,企业信用风险普遍提高,此时降低信用债投资比例,降低概率应该结合利差预期上升幅度和持有期收益分析结果来进行确定。相反,当宏观经济转向复苏,企业信用风险普遍下降,此时应该提高信用债投资比例,提高概率应该结合利差预期下降幅度和持有期收益分析结果来进行确定。此外,还将考察一些特殊因素对于信用债配置产生影响,其中包括供给的节奏,主要投资主体的投资习惯,以及替代资产的冲击等均对信用利差产生影响,因此,在中国市场分析信用债投资机会,不仅需要分析信用风险趋势,还需要分析供需和替代资产的冲击等因素,最后,在预期的利差变动范围内,进行持有期收益分析,以确定最佳的信用债投资比例和最佳的信用债持有结构。

(3)个券选择策略

本基金主要根据各品种的收益率、流动性和信用风险等指标,挑选被市场低估的品种。在严控风险的前提下,获取稳定的收益。在确定债券组合久期之后,本基金将通过对不同信用类别债券的收益率基差分析,结合税收差异、信用风险分析、期权定价分析、利差分析以及交易所流动性分析,判断个券的投资价值,以挑选风险收益相匹配的券种,建立具体的个券组合。

(4)骑乘策略

骑乘策略是指当收益率曲线比较陡峭时,也即相邻期限利差较大时,可以买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券,也即收益率水平处于相对高位的债券,随着持有期限的延长,债券的剩余期限将会缩短,从而此时债券的收益率水平将会较投资期初有所下降,通过债券的收益率的下滑,进而获得资本利得收益。骑乘策略的关键影响因素是收益率曲线的陡峭程度。若收益率曲线较为陡峭,则随着债券剩余期限的缩短,债券的收益率水平将会有较大下滑,进而获得较高的资本利得。

(5)息差策略

息差策略是指利用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。息差策略实际上也就是杠杆放大策略,进行放大策略时,必须考虑回购资金成本与债券收益率之间的关系,只有当债券收益率高于回购资金成本(即回购利率)时,息差策略才能取得正的收益。

(6)利差策略

利差策略是指对两个期限相近的债券的利差进行分析,从而对利差水平的未来走势做出判断,进而相应地进行债券置换。影响两期限相近债券的利差水平的因素主要有息票因素、流动性因素及信用评级因素等。当预期利差水平缩小时,可以买入收益率高的债券同时卖出收益率低的债券,通过两债券利差的缩小获得投资收益;当预期利差水平扩大时,可以买入收益率低的债券同时卖出收益率高的债券,通过两债券利差的扩大获得投资收益。

(7)资产支持证券的投资策略

资产支持证券是将缺乏流动性但能够产生稳定现金流的资产,通过一定的结构性安排,对资产中的风险与收益进行分离组合,进而转换成可以出售、流通,并带有固定收入的证券的过程。资产支持证券的定价受市场利率、发行条款、标的资产的构成及质量、提前偿还率等多种因素影响。本基金将在基本面分析和债券市场宏观分析的基础上,对资产支持证券的交易结构风险、信用风险、提前偿还风险和利率风险等进行分析,采取包括收益率曲线策略、信用利差曲线策略、预期利率波动率策略等积极主动的投资策略,投资于资产支持证券。

(8)国债期货的投资策略

本基金通过对基本面和资金面的分析,对国债市场走势做出判断,以作为确定国债期货的头寸方向和额度的依据。当中长期经济高速增长,通货膨胀压力浮现,央行政策趋于紧缩时,本基金建立国债期货空单进行套期保值,以规避利率风险,减少利率上升带来的亏损;反之,在经济增长趋于回落,通货膨胀率下降,甚至通货紧缩出现时,本基金通过建立国债期货多单,以获取更高的收益。

2、开放期投资策略

开放期内,本基金为保持较高的组合流动性,方便投资人安排投资,在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下,将主要投资于高流动性的投资品种,减小基金净值的波动。

(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的比例不低于基金资产的80%,但在每次开放期开始前15个工作日、开放期及开放期结束后15个工作日的期间内,基金投资不受上述比例限制;
(2)开放期内,每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%,在封闭期,本基金不受5%的比例限制,但每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等);
(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%;本基金持有一家公司发行的证券,其市值不超过基金资产净值的10%;
(4)本基金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)在任何交易日日终,持有的买入国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的15%,持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的30%;
(10)在任何交易日内交易(不包括平仓)的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的30%;
(11)本基金所持有的债券(不含到期日在一年以内的政府债券)市值和买入、卖出国债期货合约价值,合计(轧差计算)不低于基金资产的80%;
(12)本基金在封闭期内,基金的总资产不得超过基金净资产的200%;在开放期内,基金的总资产不得超过基金净资产的140%;
(13)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%,债券回购最长期限为1年,债券回购到期后不得展期;
(14)开放期内,本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%;封闭期内不受此限。因证券市场波动、证券停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合本款所规定比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;
(15)本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的,可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致;
(16)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。

除上述第(2)、(8)、(14)、(15)项外,因证券市场波动、期货市场波动、证券发行人合并、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。法律法规或监管机构另有规定的,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。期间,基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

如果法律法规对上述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,但需提前公告,不需要再经基金份额持有人大会审议。

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或者活动:
(1)承销证券;
(2)违反规定向他人贷款或者提供担保;
(3)从事承担无限责任的投资;
(4)向其基金管理人、基金托管人出资;
(5)从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;
(6)法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券,或者从事其他重大关联交易的,应当符合基金的投资目标和投资策略,遵循基金份额持有人利益优先的原则,防范利益冲突,建立健全内部审批机制和评估机制,按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意,并履行信息披露义务。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议,并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会至少每半年对关联交易事项进行审查。

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

本基金的业绩比较基准:中债综合指数收益率

中债综合指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制的中国全市场债券指数,是目前市场上专业、权威和稳定的,且能够较好地反映债券市场整体状况的债券指数。根据本基金的投资范围和投资比例,选用上述业绩比较基准能够客观、合理地反映本基金的风险收益特征。

如果上述基准指数停止计算编制或更改名称,或者今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩比较基准时,本基金管理人在与基金托管人协商一致,并履行适当程序后调整或变更业绩比较基准并及时公告,而无须召开基金份额持有人大会。

(六)风险收益特征

本基金为债券型基金,其预期风险与收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。

(七)基金管理人代表基金行使相关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相关权利,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。

## 十一、基金的财产

(一)基金资产总值

基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收款项以及其他资产的价值总和。

(二)基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

(三)基金财产的账户

基金托管人根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立资金账户、证券账户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。

## 十二、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/期货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

基金所拥有的债券和银行存款本息、国债期货、应收款项、其它投资等资产及负债。

(三)估值方法

1、交易所市场交易的固定收益品种的估值

(1)对在交易所市场上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种(另有规定的除外),选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值;
(2)对在交易所市场上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种(另有规定的除外),选取第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价进行估值;
(3)对在交易所市场上市交易的可转换债券,选取每日收盘价作为估值全价;
(4)对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券,鉴于目前尚不存在活跃市场而采用估值技术确定其公允价值。如成本能够近似体现公允价值,按成本估值。基金管理人应持续评估上述做法的适当性,并在情况发生改变时做出适当调整;
(5)对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值。

2、银行间市场交易的固定收益品种的估值

(1)对银行间市场上不含权的固定收益品种,选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值;
(2)银行间市场上含权的固定收益品种,选取第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价进行估值。对于含投资人回售权的固定收益品种,回售登记期截止日(含当日)后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值;
(3)银行间市场未上市,且第三方估值机构未提供估值价格的债券,在发行利率与二级市场利率不存在明显差异、未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下,按成本估值。

3、国债期货合约一般以估值当日结算价进行估值,估值当日无结算价的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化的,采用最近交易日结算价估值。

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。

当本基金发生大额申购或赎回情形时,基金管理人可以对本基金采用摆动定价机制,以确保基金估值的公平性。

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。

(四)估值程序

1、两类基金份额净值是按照每个工作日闭市后,该类基金资产净值除以当日该类基金份额的余额数量计算,A类和C类基金份额净值均精确到0.0001元,小数点后第5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。

基金管理人每个工作日计算基金资产净值及两类基金份额净值,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。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,将两类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,由基金管理人按规定对外公布。

(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。当某一类基金份额净值小数点后4位以内(含第4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)错误偏差达到该类基金份额净值的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;错误偏差达到该类基金份额净值的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、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;
2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时;
3、当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时,经与基金托管人协商确认后,基金管理人应当暂停基金估值;
4、法律法规、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和基金份额净值由基金管理人负责计算,基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的基金资产净值和基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人,由基金管理人对基金净值予以公布。

(八)特殊情形的处理

1、基金管理人按估值方法的第5项进行估值时,所造成的误差不作为基金资产估值错误处理;
2、由于证券、期货交易所及其登记结算公司发送的数据错误,或由于不可抗力等原因,基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查,但是未能发现该错误的,由此造成的基金资产估值错误,基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

## 十三、基金费用与税收

(一)基金费用的种类

1、基金管理人的管理费;
2、基金托管人的托管费;
3、基金销售服务费;
4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;
5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费;
6、基金份额持有人大会费用;
7、基金的证券、期货交易费用;
8、基金的银行汇划费用;
9、证券账户开户费用、银行账户维护费用;
10、按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

(二)基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.5%年费率计提。基金管理费的计算方法如下:
H=E×0.5%÷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

基金管理费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人于次月首日起2个工作日内向基金托管人发送基金管理费划款指令,经基金托管人复核无误后于2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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至最近可支付日支付。

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0.1%的年费率计提。基金托管费的计算方法如下:
H=E×0.1%÷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

基金托管费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人于次月首日起2个工作日内向基金托管人发送基金托管费划款指令,经基金托管人复核无误后于2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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至最近可支付日支付。

3、基金销售服务费

本基金A类基金份额不收取销售服务费,C类基金份额的销售服务费年费率为0.4%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务。销售服务费按前一日C类基金份额基金资产净值的0.4%年费率计提。计算方法如下:
H=E×0.4%÷当年天数
H为C类基金份额每日应计提的销售服务费
E为C类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付。由基金管理人于次月首日起2个工作日内向基金托管人发送销售服务费划付指令,基金托管人复核无误后于2个工作日内从基金财产中支付到指定账户。基金销售服务费由登记机构代收,登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构等。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至最近可支付日支付。

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

(三)不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:
1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;
2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;
3、《基金合同》生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他相关费用;
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。

## 十四、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

1、在符合有关基金分红条件的前提下,本基金在每个封闭期内收益至少分配1次,每份基金份额每次收益分配比例原则上为收益分配基准日(即可供分配利润计算截止日)每份基金份额可供分配利润的100%;
2、由于本基金A类基金份额不收取销售服务费,而C类基金份额收取销售服务费,各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权;
3、本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;
4、基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值;即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去该类每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;
5、法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

(四)收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

(五)收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定,并由基金托管人复核,在2个工作日内在指定媒介公告并报中国证监会备案。

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

(六)基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额,不足于支付银行转账或其他手续费用时,基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为相应类别的基金份额。红利再投资的计算方法,依照《业务规则》执行。

## 十五、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;
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个工作日内在指定媒介公告并报中国证监会备案。

## 十六、基金的信息披露

(一)本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《基金合同》及其他有关规定。相关法律法规关于信息披露的规定发生变化时,本基金从其最新规定。

(二)信息披露义务人

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和其他组织。

本基金信息披露义务人按照法律法规和中国证监会的规定披露基金信息,并保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内,将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的媒介和基金管理人、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:

1、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,说明基金申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。《基金合同》生效后,基金管理人在每6个月结束之日起45日内,更新招募说明书并登载在网站上,将更新后的招募说明书摘要登载在指定媒介上;基金管理人在公告的15日前向主要办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。

基金管理人应按规定将基金招募说明书、《基金合同》摘要登载在指定媒介上;基金管理人、基金托管人应当将《基金合同》、基金托管协议登载在网站上。

2、基金份额发售公告

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

3、《基金合同》生效公告

基金管理人应当在指定媒介上登载《基金合同》生效公告。

4、基金资产净值、各类基金份额净值

《基金合同》生效后,在本基金的封闭期期间,基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和两类基金份额净值。基金管理人应当在开放期首日披露本基金封闭期最后一个工作日的基金资产净值和两类基金份额净值。在本基金的开放期期间,基金管理人应当在每个交易日的次日,通过网站、基金份额销售网点以及其他媒介,披露交易日的两类基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和两类基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日,将基金资产净值、两类基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定媒介上。

5、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销售网点查阅或者复制前述信息资料。

6、基金定期报告,包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告

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

基金管理人应当在上半年结束之日起60日内,编制完成基金半年度报告,并将半年度报告正文登载在网站上,将半年度报告摘要登载在指定媒介上。

基金管理人应当在每个季度结束之日起15个工作日内,编制完成基金季度报告,并将季度报告登载在指定媒介上。

基金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。

基金管理人应当在基金年度报告和半年度报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。

报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额20%的情形,为保障其他投资者的权益,基金管理人至少应当在基金定期报告"影响投资者决策的其他重要信息"项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及产品的特有风险,中国证监会认定的特殊情形除外。

7、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个工作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(不包括本基金开放期与封闭期运作方式的转换);
(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)涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼或者仲裁;
(12)基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查;
(13)基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚,基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚;
(14)重大关联交易事项;
(15)基金收益分配事项;
(16)基金管理费、基金托管费、基金销售服务费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更;
(17)基金份额净值估值错误达该类基金份额净值百分之零点五;
(18)基金改聘会计师事务所;
(19)变更基金销售机构;
(20)更换基金登记机构;
(21)本基金进入开放期开始办理申购、赎回;
(22)本基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更;
(23)本基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回;
(24)调整本基金份额类别设置;
(25)本基金推出新业务或服务;
(26)本基金发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项;
(27)基金管理人采用摆动定价机制进行估值;
(28)中国证监会规定的其他事项。

8、澄清公告

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

9、基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项,应当依法报中国证监会备案,并予以公告。召开基金份额持有人大会的,召集人应当至少提前30日公告基金份额持有人大会的召开时间、会议形式、审议事项、议事程序和表决方式等事项。

基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会,基金管理人、基金托管人对基金份额持有人大会决定的事项不依法履行信息披露义务的,召集人应当履行相关信息披露义务。

10、基金投资资产支持证券信息披露

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

11、基金投资国债期货信息披露

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

12、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、两类基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告和定期更新的招募说明书等公开披露的相关基金信息进行复核、审查,并向基金管理人出具书面文件或者盖章确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定媒介中选择披露信息的报刊。

基金管理人、基金托管人除依法在指定媒介上披露信息外,还可以根据需要在其他公共媒介披露信息,但是其他公共媒介不得早于指定媒介披露信息,并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

为基金信息披露义务人公开披露的基金信息出具审计报告、法律意见书的专业机构,应当制作工作底稿,并将相关档案至少保存到《基金合同》终止后10年。

(七)信息披露文件的存放与查阅

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

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

(八)暂停或延迟信息披露的情形

1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;
2、不可抗力;
3、法律法规规定、中国证监会或《基金合同》认定的其他情形。

## 十七、风险揭示

(一)本基金特有的风险

1、本基金为纯债基金,对债券资产的投资比例不低于基金资产的80%,因此,本基金除承担由于市场利率波动造成的利率风险外还要承担如企业债、公司债等信用品种的发债主体信用恶化造成的信用风险。

2、本基金以定期开放方式运作,本基金在存续期内,除开放期外,均为封闭期。投资者需在开放期提出申购赎回申请,在封闭期内将无法按照基金合同约定进行申购和赎回。基金份额持有人面临封闭期内无法赎回的风险。

3、本基金开放期可能出现巨额赎回,导致基金资产变现困难,进而出现延缓支付赎回款项的风险。

4、国债期货的投资风险

国债期货的投资可能面临市场风险、基差风险、流动性风险。市场风险是因期货市场价格波动使所持有的期货合约价值发生变化的风险。基差风险是期货市场的特有风险之一,是指由于期货与现货间的价差的波动,影响套期保值或套利效果,使之发生意外损益的风险。流动性风险可分为两类:一类为流通量风险,是指期货合约无法及时以所希望的价格建立或了结头寸的风险,此类风险往往是由市场缺乏广度或深度导致的;另一类为资金量风险,是指资金量无法满足保证金要求,使得所持有的头寸面临被强制平仓的风险。

(二)投资组合的风险

投资组合的风险主要包括市场风险、信用风险及流动性风险。

1、市场风险

证券市场价格因受经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响而引起的波动,将对本基金资产产生潜在风险,主要包括:

(1)政策风险

货币政策、财政政策、产业政策等国家宏观经济政策的变化导致证券市场价格波动,影响基金收益而产生风险。

(2)经济周期风险

经济运行具有周期性的特点,证券市场的收益水平受到宏观经济运行状况的影响,也呈现周期性变化,基金投资于上市公司的股票与债券,其收益水平也会随之发生变化,从而产生风险。

(3)利率风险

金融市场利率的波动会导致股票市场及债券市场的价格和收益率的变动,同时直接影响企业的融资成本和利润水平。基金投资于股票与债券,其收益水平会受到利率变化的影响,从而产生风险。

(4)通货膨胀风险

基金持有人的收益将主要通过现金形式来分配,如果发生通货膨胀,现金的购买力会下降,从而影响基金的实际收益。

(5)债券收益率曲线变动的风险

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

(6)再投资风险

市场利率下降将影响固定收益类证券利息收入的再投资收益率,这与利率上升所带来的价格风险互为消长。

2、信用风险

债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息,或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下降的风险,信用风险也包括证券交易对手因违约而产生的证券交割风险。

3、流动性风险

因市场交易量不足,导致证券不能迅速、低成本地转变为现金的风险。流动性风险还包括由于本基金出现投资人大额赎回,致使本基金没有足够的现金应付基金赎回支付的要求所引致的风险。

(下转A24版)