华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金

基金合同

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

目录

第一部分 前言 1
第二部分 释义 3
第三部分 基金的基本情况 7
第四部分 基金的历史沿革 9
第五部分 基金的存续 10
第六部分 基金份额的申购、赎回与转换 11
第七部分 基金合同当事人及其权利义务 20
第八部分 基金份额持有人大会 27
第九部分 基金管理人、基金托管人的更换条件和程序 35
第十部分 基金的托管 38
第十一部分 基金份额的注册登记 39
第十二部分 基金的投资 40
第十三部分 基金的财产 49
第十四部分 基金资产的估值 50
第十五部分 基金费用与税收 53
第十六部分 基金收益与分配 56
第十七部分 基金的会计与审计 58
第十八部分 基金的信息披露 59
第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算 65
第二十部分 违约责任 68
第二十一部分 争议的处理 69
第二十二部分 基金合同的效力 70
第二十四部分 基金合同摘要 72

第一部分 前言

（一）订立《华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“本基金合同”）的目的、依据和原则

1、订立本基金合同的目的

订立本基金合同的目的是明确本基金合同当事人的权利义务、规范华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）的运作，保护基金份额持有人的合法权益。

2、订立本基金合同的依据

订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）和《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性风险规定》”)及其他法律法规的有关规定。

3、订立本基金合同的原则

订立本基金合同的原则是平等自愿、诚实信用、充分保护基金份额持有人的合法权益。

（二）本基金由基金管理人依照《基金法》、本基金合同和其他有关法律法规规定募集，并经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)注册。中国证监会对本基金的注册，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但由于证券投资具有一定的风险，因此不保证投资于本基金一定盈利，也不保证基金份额持有人的最低收益。

投资者应当认真阅读基金招募说明书、基金合同、基金产品资料概要等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，自主做出投资策略，自行承担投资风险。

（三）本基金合同是约定本基金合同当事人之间基本权利义务的法律文件，其他与本基金相关的涉及本基金合同当事人之间权利义务关系的任何文件或表述，均以本基金合同为准。本基金合同的当事人包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人。基金投资者自依本基金合同取得本基金基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基

金份额的行为本身即表明其对本基金合同的承认和接受。基金份额持有人作为本基金合同当事人并不以在本基金合同上书面签章为必要条件。本基金合同的当事人按照《基金法》、本基金合同及其他有关法律法规规定享有权利、承担义务。

（四）本基金合同应当适用《基金法》及相应法律法规之规定，若因法律法规的修改或更新导致本基金合同的内容存在与届时有效的法律法规的规定不一致之处，应当以届时有效的法律法规的规定为准，及时作出相应的变更和调整，同时就该等变更或调整进行公告。

（五）当本基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，基金管理人履行相应程序后，可以启用侧袋机制，具体详见基金合同和招募说明书的有关章节。侧袋机制实施期间，基金管理人将对基金简称进行特殊标识，并不办理侧袋账户的申购赎回。请基金份额持有人仔细阅读相关内容并关注本基金启用侧袋机制时的特定风险。

第二部分 释义

本基金合同中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

基金或本基金：	指华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金；
基金合同或本基金合同：	指《华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充；
招募说明书：	指《华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金招募说明书》及其更新；
发售公告：	指《华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金基金份额发售公告》
托管协议：	指《华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金托管协议》及其任何有效修订和补充；
基金产品资料概要：	指《华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金基金产品资料概要》及其更新（本基金合同关于基金产品资料概要的编制、披露及更新等内容，将不晚于 2020 年 9 月 1 日起执行）；
中国证监会：	指中国证券监督管理委员会；
中国银监会：	指中国银行业监督管理委员会；
《基金法》：	指 2012 年 12 月 28 日经第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议通过的自 2013 年 6 月 1 日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及不时做出的修订；
《销售办法》：	指 2013 年 3 月 15 日由中国证监会公布并于同年 6 月 1 日起实施的《证券投资基金销售管理办法》及不时做出的修订；
《运作办法》：	指 2014 年 7 月 7 日由中国证监会公布并于同年 8 月 8 日起实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及不时做出的修订；
《信息披露办法》：	指中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订；
《流动性风险规定》：	指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订
元：	指人民币元；
基金管理人：	指华泰柏瑞基金管理有限公司；

基金托管人：	指中国银行股份有限公司；
注册登记业务：	指本基金登记、存管、清算和交收业务，具体内容包括投资者基金账户管理、基金份额注册登记、清算及基金交易确认、发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等；
注册登记机构：	指办理本基金注册登记业务的机构。本基金的注册登记机构为华泰柏瑞基金管理有限公司或接受华泰柏瑞基金管理有限公司委托代为办理本基金注册登记业务的机构；
投资者：	指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者；
个人投资者：	指依据中华人民共和国有关法律法规可以投资于证券投资基金的自然人；
机构投资者：	指在中国境内合法注册登记或经有权政府部门批准设立和有效存续并依法可以投资于证券投资基金的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织；
合格境外机构投资者：	指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理办法》及相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者；
基金份额持有人大会：	指按照本基金合同第九部分之规定召集、召开并由基金份额持有人或其合法的代理人进行表决的会议；
基金募集期：	指基金合同和招募说明书中载明，并经中国证监会核准的基金份额募集期限，自基金份额发售之日起最长不超过 3 个月；
基金合同生效日：	指募集结束，基金募集的基金份额总额、募集金额和基金份额持有人人数符合相关法律法规和基金合同规定的，基金管理人依据《基金法》向中国证监会办理备案手续后，中国证监会的书面确认之日；
存续期：	指本基金合同生效至终止之间的不定期期限；
工作日：	指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日；
认购：	指在基金募集期内，投资者按照本基金合同的规定申请购买本基金基金份额的行为；
申购：	指在本基金合同生效后，投资者根据基金合同和招募说明书的规定在指定期间申请购买本基金基金份额的行为；
赎回：	指在本基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同规定的条件要求基金管理人购回本基金基金份额的行为；
销售服务费：	指从基金财产中计提的，用于本基金市场推广、销售以及基

金份额持有人服务的费用；

基金份额分类：指本基金根据申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者申购基金份额时收取申购费用而不计提销售服务费的，称为 A 类、D 类基金份额；在投资者申购基金份额时不收取申购费用，而从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额；

基金转换：指基金份额持有人按基金管理人规定的条件，申请将其持有的基金管理人管理的某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金的基金份额的行为；

转托管：指基金份额持有人将其基金账户内的某一基金的基金份额从一个销售机构托管到另一销售机构的行为；

指令：指基金管理人在运用基金财产进行投资时，向基金托管人发出的资金划拨及实物券调拨等指令；

代销机构：指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金代销业务资格并接受基金管理人委托，代为办理基金认购、申购、赎回和其他基金业务的机构；

销售机构：指基金管理人及本基金代销机构；

基金销售网点：指基金管理人的直销中心及基金代销机构的代销网点；

指定媒介：指中国证监会指定的用以进行信息披露的全国性报刊及指定互联网网站（包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介；

基金账户：指注册登记机构为基金投资者开立的记录其持有的由该注册登记机构办理注册登记的基金份额余额及其变动情况的账户；

交易账户：指销售机构为投资者开立的记录投资者通过该销售机构办理认购、申购、赎回、转换及转托管等业务而引起的基金份额的变动及结余情况的账户；

开放日：指为投资者办理基金申购、赎回等业务的工作日；

T 日：指投资者向销售机构提出申购、赎回或其他业务申请的开放日。

T+n 日：指 T 日后（不包括 T 日）第 n 个工作日，n 指自然数；

基金收益：指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息以及其他合法收入；

基金资产总值：指基金持有的各类有价证券、银行存款本息、应收款项以及以其他资产等形式存在的基金财产的价值总和；

基金资产净值：	指基金资产总值减去基金负债后的价值；
基金份额净值：	指以计算日基金资产净值除以计算日基金份额余额所得的单位基金份额的价值；
流动性受限资产：	指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、资产支持证券，因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等；
侧袋机制：	指将基金投资组合中的特定资产从原有账户分离至专门账户进行处置清算，目的在于有效隔离并化解风险，确保投资者得到公平对待，属于流动性风险管理工具。侧袋机制实施期间，原有账户称为主袋账户，专门账户称为侧袋账户；
特定资产：	包括：（一）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的资产；（二）按摊余成本计量且计提资产减值准备仍导致资产价值存在重大不确定性的资产；（三）其他资产价值存在重大不确定性的资产；
基金资产估值：	指计算、评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程；
法律法规：	指中华人民共和国现行有效的法律、行政法规、司法解释、地方法规、地方规章、部门规章及其他规范性文件以及对于该等法律法规的不时修改和补充；
不可抗力：	指任何无法预见、无法克服、无法避免的事件和因素，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、疫情、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律变化、突发停电、电脑系统或数据传输系统非正常停止以及其他突发事件、证券交易场所非正常暂停或停止交易等。

第三部分 基金的基本情况

（一）基金名称

华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金

（二）基金的类别

债券型证券投资基金

（三）基金的运作方式

契约型、开放式

（四）基金投资目标

在合理控制风险的基础上，追求基金资产的长期稳健增值，力争实现超越业绩比较基准的投资收益。

（五）基金份额初始面值和认购费用

本基金的初始面值为人民币 1.00 元

本基金认购费率具体由基金管理人决定并在招募说明书中列示。

（六）基金最低募集份额总额和最低募集金额

本基金的募集份额总额应不少于 2 亿份，基金募集金额不少于 2 亿元人民币。

（七）基金存续期限

不定期

（八）基金份额类别设置

本基金根据申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为 A 类、C 类和 D 类不同的类别。在投资者申购基金份额时收取申购费用而不计提销售服务费的,称为 A 类、D 类基金份额;在投资者申购基金份额时不收取申购费用而是从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为 C 类基金份额。A 类、C 类和 D 类基金份额分别设置代码，分别计算和公告基金份

额净值和基金份额累计净值。

投资者在申购基金份额时可自行选择基金份额类别。

有关基金份额类别的具体设置、费率水平等由基金管理人确定，并在招募说明书中公告。

根据基金销售情况，在符合法律法规且不损害已有基金份额持有人权益的情况下，基金管理人在履行适当程序后可以增加新的基金份额类别、或者在法律法规和基金合同规定的范围内变更现有基金份额类别的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式等，调整前基金管理人需及时公告。本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。

第四部分 基金的历史沿革

华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金根据 2012 年 10 月 22 日中国证监会《关于核准华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金募集的批复》（证监许可【2012】1383 号）和 2012 年 10 月 23 日中国证监会基金监管部《关于华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金募集时间安排的确认函》（基金部函【2012】963 号）的批复，进行募集。基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金于 2012 年 10 月 29 日至 2012 年 11 月 30 日公开募集，募集结束后基金管理人向中国证监会办理备案手续。经中国证监会书面确认，《华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金基金合同》于 2012 年 12 月 4 日正式生效。

随着《公开募集证券投资基金参与国债期货交易指引》的发布与实施，以套期保值为目的参与国债期货交易有利于风险管理工具的多样化。而同业存单的推行以及期限曲线结构的不断完善，使其逐步成为较为重要的货币市场投资工具，有利于资产优化配置。因此，为维护基金份额持有人利益，在投资范围中增加国债期货、同业存单。

自 2016 年 9 月 7 日至 2016 年 9 月 29 日华泰柏瑞稳健收益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《关于修改华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金基金合同的议案》，内容包括对《基金合同》的投资范围、投资策略、投资比例限制、基金资产估值等事项进行相应修改以及根据《基金法》、《运作办法》的陆续修改和实施对《基金合同》进行的必要修订。

上述基金份额持有人大会决议事项自表决通过之日起生效。自 2016 年 10 月 10 日起，由原《基金合同》修订而成的《华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金基金合同》生效，原《基金合同》同日起失效。

第五部分 基金的存续

本合同存续期内，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的，按其规定办理。

第六部分 基金份额的申购、赎回与转换

（一）申购与赎回的场所

本基金的销售机构包括基金管理人和基金管理人委托的代销机构。具体的销售网点将由基金管理人在招募说明书、基金份额发售公告或其他公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减代销机构，并在基金管理人网站公示。投资者可以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的申购与赎回。

（二）申购与赎回办理的开放日及时间

1、开放日及开放时间

本基金的开放日为本合同生效后基金管理人公告开始办理申购、赎回业务后，上海证券交易所和深圳证券交易所同时开放交易的工作日，基金管理人依据法律法规或基金合同规定公告暂停申购、赎回时除外。具体业务办理时间以销售机构公布的时间为准。

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并公告。

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。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请的，视为下一个开放日的申请，其基金份额申购、赎回价格为下次办理基金份额申购、赎回时间所在开放日的价格。

2、申购与赎回的开始时间

本基金的申购自基金合同生效日起不超过 3 个月的时间开始办理。

本基金的赎回自基金合同生效日起不超过 3 个月的时间开始办理。

在确定申购开始时间与赎回开始时间后，由基金管理人按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

（三）申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即任一类基金份额的申购与赎回价格以受理申请当日该类基金份额净值为基准进行计算；

2、基金采用金额申购和份额赎回的方式，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、基金份额持有人在赎回基金份额时，基金管理人按先进先出的原则，即对该基金份额持有人在该销售机构托管的基金份额进行处理时，申购确认日期在先的基金份额先赎回，申购确认日期在后的基金份额后赎回，以确定所适用的赎回费率；

4、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间内撤销，在当日的业务办理时间结束后不得撤销；

5、基金管理人可在法律法规允许、并在不影响基金持有人利益的情况下，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、申购与赎回申请的提出

基金投资者须按销售机构规定的手续，在开放日的业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

投资者申购本基金，须按销售机构规定的方式全额交付申购款项。

投资者提交赎回申请时，其在销售机构（网点）必须有足够的基金份额余额。

2、申购与赎回申请的确认

基金管理人应自身或要求注册登记机构在 T+1 日对基金投资者申购、赎回申请的有效性进行确认。投资者应在 T+2 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。

基金销售机构对申购与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。申购与赎回申请的确认以基金注册登记机构或基金管理人的确认结果为准。

3、申购与赎回申请的款项支付

申购采用全额交款方式，投资者交付申购款项，申购成立；注册登记机构确认基金份额时，申购生效。若资金在规定时间内未全额到账则申购不成功，申购款项将退回投资者账户。

基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；注册登记机构确认赎回时，赎回生效。投资者赎回申请成交后，基金管理人应通过注册登记机构按规定向投资者支付赎回款项，赎回款项在自受理基金投资者有效赎回申请之日起不超过 7 个工作日的时间内划往投资者银行账户。在发生巨额赎回时，赎回款项的支付办法按本基金合同和有关法律法规规定处理。

（五）申购与赎回的数额限制

1、本基金申购和赎回的数额限制由基金管理人确定并在招募说明书中列示。

2、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，具体规定请参见招募说明书或相关公告。

3、基金管理人可根据市场情况，合理调整对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。

（六）申购份额与赎回金额的计算方式

本基金将基金份额分为 A 类份额、C 类份额和 D 类份额三种。A 类、D 类份额收取申购费，并对持有期限少于一定期限的本类别基金份额的赎回收取赎回费，但不收取销售服务费；C 类份额从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取申购费用，并对持有期限少于一定期限的本类别基金份额的赎回收取赎回费。

1、申购份额的计算方式：

A 类、D 类基金份额申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除申购费用后，以申请当日该类基金份额净值为基准计算，各计算结果均按照四舍五入方法，保留小数点后两位，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

本基金的 A 类、D 类基金份额申购金额包括申购费用和净申购金额。其中，

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，或申购费用=固定申购费金额

申购份数=净申购金额/T 日该类基金份额净值

C 类基金份额申购的有效份额为按实际确认的申购金额，以申请当日 C 类基金份额净值为基准计算，各计算结果均按照四舍五入方法，保留小数点后两位，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

本基金的 C 类基金份额申购时不收取申购费用，申购金额即为净申购金额。

申购份数=净申购金额/T 日 C 类基金份额净值

2、赎回金额的计算方式：

A 类、C 类和 D 类基金份额赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以申请当日该类基金份额净值的金额，净赎回金额为赎回金额扣除赎回费用的金额，各计算结果均按照四舍五入方法，保留小数点后两位，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

本基金的净赎回金额为赎回金额扣减赎回费用。其中，

赎回金额＝赎回份数×T 日该类基金份额净值

赎回费用＝赎回金额×赎回费率

净赎回金额=赎回金额－赎回费用

（七）申购和赎回的费用及其用途

1、本基金 A 类、D 类基金份额的申购费率按照申购金额递减，即申购金额越大，所适用的申购费率越低，申购费用等于申购金额减净申购金额或固定申购费金额（见前述计算公式）。实际执行的申购费率在招募说明书中载明。投资者在一天之内如有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。

2、本基金的赎回费率按照持有时间递减，即同类基金份额持有时间越长，所适用的赎回费率越低，赎回费用等于赎回金额乘以所适用的赎回费率（见前述计算公式）。实际执行的赎回费率在招募说明书中载明，其中对持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5%的赎回费并全额计入基金财产。

3、本基金 A 类、D 类基金份额的申购费用由申购该类基金份额的投资人承担，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用，不列入基金财产。

本基金的赎回费用由基金份额持有人承担，其中归入基金财产的比例不得低于法律法规或中国证监会规定的比例下限（具体比例见招募说明书），其余部分用于支付注册登记费等相关手续费。

4、基金管理人可以在法律法规和本基金合同规定范围内调整申购费率和赎回费率。费率如发生变更，基金管理人应在调整实施 3 个工作日前在指定媒介上公告。

（八）申购与赎回的注册登记

1、经基金销售机构同意，基金投资者提出的申购和赎回申请，在基金管理人规定的时间之前可以撤销。

2、投资者 T 日申购基金成功后，基金注册登记机构在 T＋1 日为投资者增加权益并办理注册登记手续，投资者自 T＋2 日起有权赎回该部分基金份额。

3、投资者 T 日赎回基金成功后，基金注册登记机构在 T＋1 日为投资者扣除权益并办理相应的注册登记手续。

4、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，并依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

（九）巨额赎回的认定及处理方式

1、巨额赎回的认定

单个开放日中，本基金的基金份额净赎回申请（赎回申请总份额扣除申购总份额后的余额）与净转出申请（转出申请总份额扣除转入申请总份额后的余额）之和超过上一日基金总份额的 10%，为巨额赎回。

2、巨额赎回的处理方式

出现巨额赎回时，基金管理人可以根据本基金当时的资产组合状况决定接受全额赎回或部分延期赎回。

（1）接受全额赎回：当基金管理人认为有能力兑付投资者的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

（2）部分延期赎回：当基金管理人认为兑付投资者的赎回申请有困难，或认为兑付投

资者的赎回申请进行的资产变现可能使基金资产净值发生较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一日基金总份额 10%的前提下，对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个基金份额持有人申请赎回份额占当日申请赎回总份额的比例，确定该基金份额持有人当日受理的赎回份额；未受理部分除投资者在提交赎回申请时选择将当日未获受理部分予以撤销者外，延迟至下一开放日办理，赎回价格为下一个开放日的价格。转入下一开放日的赎回申请不享有赎回优先权，以此类推，直到全部赎回为止。

（3）若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额的 20%，基金管理人可以先行对该单个基金份额持有人超出 20%的赎回申请实施延期办理。而对该单个基金份额持有人 20%以内（含 20%）的赎回申请，基金管理人根据前述“（1）接受全额赎回”或“（2）部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。如下一开放日，该单一基金份额持有人剩余未赎回部分仍旧超出前述比例约定的，继续按前述规则处理，直至该单一基金份额持有人单个开放日内申请赎回的基金份额占上一开放日基金总份额的比例低于前述比例。

（4）当发生巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或招募说明书规定的其他方式，在 3 个工作日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，并在 2 日内在指定媒介上公告。

（5）暂停接受和延缓支付：本基金连续 2 个开放日以上发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但延缓期限不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒介上公告。

（十）拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理

1、在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资者的申购申请：

（1）因不可抗力导致基金管理人无法受理投资者的申购申请；

（2）证券、期货交易场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；

（3）发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况；

（4）基金财产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人的利益的情形；

（5）接受某笔或者某些申购申请有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。

（6）当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上的，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。

（7）本基金的资产组合中的重要部分发生暂停交易或其他重大事件，继续接受申购可能会影响或损害其他基金份额持有人利益时；

（8）基金管理人、基金托管人、基金销售机构或基金注册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时；

（9）法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生上述第（1）、（2）、（3）、（6）、（7）、（8）、（9）项暂停申购情形，基金管理人决定拒绝或暂停接受某些投资者的申购申请时，申购款项将退回投资者账户。基金管理人决定暂停接受申购申请时，应当依法公告。在暂停申购的情形消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理并依法公告。

2、在以下情况下，基金管理人可以暂停接受投资者的赎回申请：

（1）因不可抗力导致基金管理人无法支付赎回款项；

（2）证券、期货交易场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；

（3）基金连续发生巨额赎回，根据本基金合同规定，可以暂停接受赎回申请的情况；

（4）发生本基金合同规定的暂停基金资产估值的情况；

（5）本基金的资产组合中的重要部分发生暂停交易或其他重大事件，继续接受赎回可能会影响或损害其他基金份额持有人利益时；

（6）当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上的，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施。

（7）基金管理人、基金托管人、基金销售机构或基金注册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；

（8）法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一的，基金管理人应当在当日向中国证监会备案，并及时公告。除非发生巨额赎回，已接受的赎回申请，基金管理人应当足额支付。如暂时不能足额支付的，可延期支付部分赎回款项，按每个赎回申请人已被接受的赎回申请量占已接受赎回申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分由基金管理人按照发生的情况制定相应的处理办法在后续开放日予以支付。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依法公告。

3、暂停基金的申购、赎回，基金管理人应按规定公告。

4、暂停申购或赎回期间结束，基金重新开放时，基金管理人应依法公告。

（1）如果发生暂停的时间为一天，基金管理人将于重新开放日，在指定媒介，刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并公告最近一个开放日的各类基金份额净值。

（2）如果发生暂停的时间超过一天但少于两周，暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人将提前一个工作日，在指定媒介，刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近一个开放日的各类基金份额净值。

（3）如果发生暂停的时间超过两周，暂停期间，基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次；当连续暂停时间超过两个月时，可对重复刊登暂停公告的频率进行调整。暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前三个工作日，在指定媒介连续刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近一个开放日的各类基金份额净值。

（十一）基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及本基金合同的规定，在条件成熟的情况下提供本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换服务。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本基金合同的规定制定并公告。

（十二）基金的非交易过户、转托管、冻结与质押

（1）基金注册登记机构只受理继承、捐赠、司法强制执行和经注册登记机构认可的其他情况下的非交易过户。其中：

“继承”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”仅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的情形；

“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、社会团体或其他组织。

办理非交易过户业务必须提供基金注册登记机构规定的相关资料。

（2）符合条件的非交易过户申请自申请受理日起二个月内办理；申请人按基金注册登记机构规定的标准缴纳过户费用。

（3）基金份额持有人可以办理其基金份额在不同销售机构的转托管手续。转托管在转出方进行申报，基金份额转托管一次完成。投资者于 T 日转托管基金份额成功后，转托管份额于 T+1 日到达转入方网点，投资者可于 T+2 日起赎回该部分基金份额。

（4）基金注册登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金账户或基金份额的冻结与解冻。基金账户或基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益（包括现金分红和红利再投资）一并冻结。

（5）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。

（十三）实施侧袋机制期间本基金的申购与赎回

本基金实施侧袋机制的，本基金的申购和赎回安排详见招募说明书或相关公告。

第七部分 基金合同当事人及其权利义务

（一）基金管理人

1、基金管理人基本情况

名称：华泰柏瑞基金管理有限公司

住所： 中国（上海）自由贸易试验区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层

法定代表人：贾波

设立日期：2004 年 11 月 18 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字【2004】178 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：贰亿元人民币

存续期限：持续经营

联系电话：（021）38601777

2、基金管理人的权利

（1）依法募集基金，办理基金备案手续；

（2）依照法律法规和基金合同独立管理运用基金财产；

（3）根据法律法规和基金合同的规定，制订、修改并公布有关基金认购、申购、赎回、转托管、基金转换、非交易过户、冻结、收益分配等方面的业务规则；

（4）根据法律法规和基金合同的规定决定本基金的相关费率结构和收费方式，获得基金管理费，收取认购费、申购费、赎回费、销售服务费及其他事先核准或公告的合理费用以及法律法规规定的其他费用；

（5）根据法律法规和基金合同的规定销售基金份额；

（6）在本合同的有效期内，在不违反公平、合理原则以及不妨碍基金托管人遵守相关

法律法规及其行业监管要求的基础上，基金管理人有权对基金托管人履行本合同的情况进行必要的监督。如认为基金托管人违反了法律法规或基金合同规定对基金财产、其他基金合同当事人的利益造成重大损失的，应及时呈报中国证监会，以及采取其他必要措施以保护本基金及相关基金合同当事人的利益；

（7）根据基金合同的规定选择适当的基金代销机构并有权依照代销协议和有关法律法规对基金代销机构行为进行必要的监督和检查；

（8）自行担任基金注册登记机构或选择、更换基金注册登记代理机构，办理基金注册登记业务，并按照基金合同规定对基金注册登记代理机构进行必要的监督和检查；

（9）在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回的申请；

（10）在法律法规允许的前提下，为基金份额持有人的利益依法为基金进行融资、融券；

（11）依据法律法规和基金合同的规定，制订基金收益分配方案；

（12）按照法律法规，代表基金对被投资企业行使股东权利，代表基金行使因投资于其他证券所产生的权利；

（13）在基金托管人职责终止时，提名新的基金托管人；

（14）依据法律法规和基金合同的规定，召集基金份额持有人大会；

（15）选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构并确定有关费率；

（16）法律法规、基金合同规定的其他权利。

3、基金管理人的义务

（1）依法申请并募集基金，办理或者委托经国务院证券监督管理机构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）按基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；

（7）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；

（8）进行基金会计核算并编制基金的财务会计报告；

（9）依法接受基金托管人的监督；

（10）编制季度报告、中期报告和年度报告；

（11）采取适当合理的措施使计算开放式基金份额认购、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；

（12）计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回价格；

（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以保密，不得向他人泄露；

（15）按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

（16）保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表、代表基金签订的重大合同及其他相关资料；

（17）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；

（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的合法权益，应承担赔偿责任，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）法律法规、基金合同及中国证监会规定的其他义务。

（二）基金托管人

1、基金托管人基本情况

名称：中国银行股份有限公司

住所：北京市复兴门内大街 1 号

法定代表人：葛海蛟

成立日期：1983 年 10 月 31 日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整

存续期间：持续经营

经营范围：吸收人民币存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；从事同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱服务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外币兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代营外汇买卖；外汇信用卡的发行和代理国外信用卡的发行及付款；资信调查、咨询、见证业务；组织或参加银团贷款；国际贵金属买卖；海外分支机构经营与当地法律许可的一切银行业务；在港澳地区的分行依据当地法令可发行或参与代理发行当地货币；经中国人民银行批准

的其他业务。

2、基金托管人的权利

（1）依据法律法规和基金合同的规定安全保管基金财产；

（2）依照基金合同的约定获得基金托管费；

（3）监督基金管理人对本基金的投资运作；

（4）在基金管理人职责终止时，提名新的基金管理人；

（5）依据法律法规和基金合同的规定召集基金份额持有人大会；

（6）法律法规、基金合同规定的其他权利。

3、基金托管人的义务

（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）按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；

（4）除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得以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）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和独立；

（6）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；

（7）保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

（8）按照基金合同的约定，根据基金管理人的指令，及时办理清算、交割事宜；

（9）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以保密，不得向他人泄露；

（10）根据法律法规及本合同的约定，办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

（11）对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告的相关内容出具意见，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；

（12）建立并保存基金份额持有人名册；

（13）复核基金管理人计算的基金资产净值、各类基金份额净值和基金份额申购、赎回价格；

（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）按照法律法规监督基金管理人的投资运作；

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

（19）因基金管理人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，除法律法规另有规定外，基金托管人不承担连带责任；

（20）法律法规、基金合同及中国证监会规定的其他义务。

（三）基金份额持有人

1、基金投资者购买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基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同当事人。基金份额持有人作为当事人并不以在基金合同上书面签章为必要条件。除法律法规另有规定或基金合同另有约定外，同一类别每份基金份额具有同等的合法权益。

2、基金份额持有人的权利

（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）依法转让或者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或者召集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、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；

（9）法律法规、基金合同规定的其他权利。

3、基金份额持有人的义务

（1）遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；

（2）缴纳基金认购、申购款项及基金合同规定的费用；

（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、其他基金份额持有人及其他基金合同当事人合法利益的活动；

（5）执行基金份额持有人大会的决议；

（6）返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；

（7）遵守基金管理人、销售机构和注册登记机构的相关交易及业务规则；

（8）法律法规及基金合同规定的其他义务。

第八部分 基金份额持有人大会

（一）本基金的基金份额持有人大会，由本基金的基金份额持有人或其合法的代理人组成。除法律法规另有规定或基金合同另有约定外，基金份额持有人持有的同一类别每一基金份额拥有平等的投票权。本基金未设立基金份额持有人大会的日常机构，如今后设立基金份额持有人大会的日常机构，日常机构的设立按照相关法律法规的要求执行。

（二）有以下情形之一时，应召开基金份额持有人大会：

1、终止基金合同；

2、转换基金运作方式；

3、提高基金管理人、基金托管人的报酬标准或提高销售服务费，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；

4、更换基金管理人、基金托管人；

5、变更基金类别；

6、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）；

7、变更基金份额持有人大会议事程序、表决方式和表决程序；

8、本基金与其他基金合并；

9、对基金合同当事人权利、义务产生重大影响，需召开基金份额持有人大会的变更基金合同等其他事项；

10、法律法规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。

（三）有以下情形之一的，不需召开基金份额持有人大会：

1、调低基金管理费率、基金托管费率；

2、在法律法规和基金合同规定的范围内变更本基金的申购费率或收费方式、调低赎回费率、调低销售服务费率；

3、因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改；

4、对基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化；

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；

6、除法律法规或基金合同规定应当召开基金份额持有人大会以外的其他情形。

（四）召集方式：

1、除法律法规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。基金管理人未按规定召集或者不能召集时，基金托管人仍认为有必要召开的，应当自行召集。

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，并自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

3、代表基金份额 10%以上（含 10%，下同）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书面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，并至少提前 30 日报中国证监会备案。

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。

6、基金份额持有人大会的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

（五）通知

召开基金份额持有人大会，召集人应当于会议召开前 30 天在指定媒介上公告。基金份额持有人大会不得就未经公告的事项进行表决。基金份额持有人大会通知将至少载明以下内容：

1、会议召开的时间、地点、方式；

2、会议拟审议的主要事项、议事程序和表决方式；

3、代理投票授权委托书送达时间和地点；

4、会务常设联系人姓名、电话；

5、权益登记日；

6、如采用通讯表决方式，还应载明具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表达意见的寄交和收取方式、投票表决的截止日以及表决票的送达地址等内容。

（六）开会方式

基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会。现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委派其代理人出席，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；通讯方式开会指按照基金合同的相关规定以通讯的非现场方式进行表决。会议的召开方式由召集人确定，但决定基金管理人更换或基金托管人的更换、转换基金运作方式和终止基金合同事宜必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

1、亲自出席会议者持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、本基金合同和会议通知的规定；

2、经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，全部有效凭证所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的 50%以上（含 50%，下同）。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

1、召集人按基金合同规定公布会议通知后，在两个工作日内连续公布相关提示性公告；

2、召集人按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见；

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

4、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其他代表，同时提交的持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和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；

5、会议通知公布前已报中国证监会备案。

参加基金份额持有人大会的基金份额持有人所代表的基金份额低于上述现场开会条件第 2 项或通讯开会条件第 3 项规定比例的，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会，应当有代表 1/3 以上（含 1/3）基金份额的基金份额持有人或其代理人参加，方可召开。

在不与法律法规冲突的前提下，基金份额持有人大会可通过网络、电话或其他方式召开，基金份额持有人可以采用书面、网络、电话或其他监管机构允许的方式进行表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

基金份额持有人授权他人代为出席会议并表决的，授权方式可以采用书面、网络、电话或其他监管机构允许的方式，具体方式在会议通知中列明。

（七）议事内容与程序

1、议事内容及提案权

（1）议事内容限为本条前述第（二）款规定的基金份额持有人大会召开事由范围内的事项。

（2）基金管理人、基金托管人、代表基金份额 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：

a、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。

b、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）代表基金份额 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，或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，未获得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不得对未事先公告的议事内容进行表决。

2、议事程序

在现场开会的方式下，首先由召集人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议，报中国证监会备案。

若召集人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人以所持表决权的 50%以上选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

在通讯表决开会的方式下，首先由召集人在会议通知中公布提案，在所通知的表决截止日期后第 2 个工作日由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证，报中国证监会备案。

（八）表决

1、基金份额持有人所持每份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）特别决议

对于特别决议应当经参加大会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。

（2）一般决议

对于一般决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的 50%以上通过。

更换基金管理人或者基金托管人、转换基金运作方式、终止基金合同或与其他基金合并应当以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，符合法律法规、基金合同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。

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。

（九）计票

1、现场开会

（1）基金份额持有人大会的主持人为召集人授权出席大会的代表，如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人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(如果基金管理人为召集人，则监督员由基金托管人担任；如基金托管人为召集人，则监督员由基金托管人在出席会议的基金份额持有人中指定)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中推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并由大会主持人当场公布计票结果。

（3）如果大会主持人对于提交的表决结果有怀疑，可以对所投票数进行重新清点；如果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者基金份额持有人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。

（4）在基金管理人或基金托管人担任召集人的情形下，如果在计票过程中基金管理人或者基金托管人拒不配合的，则参加会议的基金份额持有人有权推举三名基金份额持有人代表共同担任监票人进行计票。

2、通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式可采取如下方式：

由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

（十）生效与公告

1、基金份额持有人大会按照《基金法》有关法律法规规定表决通过的事项，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会备案。基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效。

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、基金托管人均有法律约束力。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的决定。

3、基金份额持有人大会决议应当自生效后 2 日内，由基金份额持有人大会召集人在指定媒介上公告。

4. 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、公证机关、公证员姓名等一同公告。

（十一）实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定

若本基金实施侧袋机制，则相关基金份额或表决权的比例指主袋份额持有人和侧袋份额持有人分别持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例，但若相关基金份额持有人大会召集和审议事项不涉及侧袋账户的，则仅指主袋份额持有人持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例：

1、基金份额持有人行使提议权、召集权、提名权所需单独或合计代表相关基金份额 10%以上（含 10%）；

2、现场开会的到会者在权益登记日代表的基金份额不少于本基金在权益登记日相关基金份额的二分之一（含二分之一）；

3、通讯开会的直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日相关基金份额的二分之一（含二分之一）；

4、当参与基金份额持有人大会投票的基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日相关基金份额的二分之一，召集人在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内就原定审议事项重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）相关基金份额的持有人参与或授权他人参与基金份额持有人大会投票；

5、现场开会由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人；

6、一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过；

7、特别决议应当经参加大会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。

侧袋机制实施期间，基金份额持有人大会审议事项涉及主袋账户和侧袋账户的，应分别由主袋账户、侧袋账户的基金份额持有人进行表决，同一类别账户内的每份基金份额具有平等的表决权。表决事项未涉及侧袋账户的，侧袋账户份额无表决权。

侧袋机制实施期间，关于基金份额持有人大会的相关规定以本节特殊约定内容为准，本节没有规定的适用上文相关规定。

（十二）法律法规或监管机关对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

第九部分 基金管理人、基金托管人的更换条件和程序

（一）基金管理人和基金托管人的更换条件

1、有下列情形之一的，基金管理人职责终止，须更换基金管理人：

（1）基金管理人被依法取消基金管理资格；

（2）基金管理人依法解散、依法被撤销或被依法宣告破产；

（3）基金管理人被基金份额持有人大会解任；

（4）法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

2、有下列情形之一的，基金托管人职责终止，须更换基金托管人：

（1）基金托管人被依法取消基金托管资格；

（2）基金托管人依法解散、依法被撤销或被依法宣告破产；

（3）基金托管人被基金份额持有人大会解任；

（4）法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

（二）基金管理人和基金托管人的更换程序

1、基金管理人的更换程序

原基金管理人退任后，基金份额持有人大会需在 6 个月内选任新基金管理人。在新基金管理人产生前，中国证监会可指定临时基金管理人。

（1）提名：新任基金管理人由基金托管人或代表 10%以上（含 10%，下同）基金份额的基金份额持有人提名。

（2）决议：基金份额持有人大会对更换基金管理人形成有效决议。

（3）备案并公告：基金份额持有人大会决议自通过之日起 5 日内，由大会召集人报中国证监会备案，并应自基金份额持有人大会决议生效后 2 日内在指定媒介上公告。

（4）交接：基金管理人职责终止的，应当妥善保管基金管理业务资料，及时办理基金

管理业务的移交手续，新基金管理人或者临时基金管理人应当及时接收。新任基金管理人或临时基金管理人应与基金托管人核对基金资产总值和净值。

（5）审计并公告：基金管理人职责终止的，应当按照规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报中国证监会备案。

（6）基金名称变更：基金管理人更换后，本基金应替换或删除基金名称中与原基金管理人有关的名称或商号字样。

2、基金托管人的更换程序

原基金托管人退任后，基金份额持有人大会需在六个月内选任新基金托管人。在新基金托管人产生前，中国证监会可指定临时基金托管人。

（1）提名：新任基金托管人由基金管理人或代表 10%以上基金份额的基金份额持有人提名。

（2）决议：基金份额持有人大会对更换基金托管人形成有效决议。

（3）备案并公告：基金份额持有人大会决议自通过之日起 5 日内，由大会召集人报中国证监会备案，并应自基金份额持有人大会决议生效后 2 日内在指定媒介上公告。

（4）交接：基金托管人职责终止的，应当妥善保管基金财产和基金托管业务资料，及时办理基金财产和基金托管业务的移交手续，新基金托管人或者临时基金托管人应当及时接收。新任基金托管人或临时基金托管人与基金管理人核对基金资产总值和净值。

（5）审计并公告：基金托管人职责终止的，基金管理人应当按照规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报中国证监会备案。

3、基金管理人与基金托管人同时更换

（1）提名：如果基金管理人和基金托管人同时更换，由单独或合计持有基金总份额 10%以上的基金份额持有人提名新的基金管理人和基金托管人；

（2）基金管理人和基金托管人的更换分别按上述程序进行；

（3）公告：新任基金管理人和新任基金托管人应在更换基金管理人和基金托管人的基金份额持有人大会决议生效后 2 日内在指定媒介上联合公告。

4、新基金管理人接受基金管理或新基金托管人接受基金财产和基金托管业务前，原基金管理人或基金托管人应依据法律法规和基金合同的规定继续履行相关职责，并保证不对基金份额持有人的利益造成损害。原基金管理人或基金托管人在继续履行相关职责期间，仍有权按照本合同的规定收取基金管理费或基金托管费。

第十部分 基金的托管

本基金财产由基金托管人依法保管。基金管理人应与基金托管人按照《基金法》、本基金合同及其他有关法律法规规定订立《华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金托管协议》，以明确基金管理人与基金托管人之间在基金份额持有人名册登记、基金财产的保管、基金财产的管理和运作及相互监督等相关事宜中的权利、义务及职责，确保基金财产的安全，保护基金份额持有人的合法权益。

第十一部分 基金份额的注册登记

（一）本基金基金份额的注册登记业务指本基金登记、存管、过户、清算和交收业务，具体内容包括投资者基金账户管理、基金份额注册登记、清算及基金交易确认、发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等。

（二）本基金的注册登记业务由基金管理人或基金管理人委托的其他符合条件的机构办理。基金管理人委托其他机构办理本基金注册登记业务的，应与代理机构签订委托代理协议，以明确基金管理人和代理机构在投资者基金账户管理、基金份额注册登记、清算及基金交易确认、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等事宜中的权利和义务，保护基金投资者和基金份额持有人的合法权益。

（三）注册登记机构履行如下职责：

1、建立和保管基金份额持有人开户资料、交易资料、基金份额持有人名册等；

2、配备足够的专业人员办理本基金的注册登记业务；

3、严格按照法律法规和本基金合同规定的条件办理本基金的注册登记业务；

4、接受基金管理人的监督；

5、妥善保存登记数据，并将基金份额持有人名称、身份信息及基金份额明细等数据备份至中国证监会认定的机构，其保存期限自基金账户销户之日起不得少于 20 年；

6、对基金份额持有人的基金账户信息负有保密义务，因违反该保密义务对投资者或基金带来的损失，须承担相应的赔偿责任，但按照法律法规的规定进行披露的情形除外；

7、按本基金合同及招募说明书、定期更新的招募说明书的规定，为投资者办理非交易过户、转托管等业务、提供基金收益分配等其他必要的服务；

8、在法律、法规允许的范围内，对注册登记业务的办理时间进行调整，并最迟于开始实施前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告；

9、法律法规规定的其他职责。

（四）注册登记机构履行上述职责后，有权取得注册登记费。

第十二部分 基金的投资

（一）投资目标

在合理控制风险的基础上，追求基金资产的长期稳健增值，力争实现超越业绩比较基准的投资收益。

（二）投资范围

本基金的投资范围包括国债、地方政府债、金融债、央行票据、中期票据、次级债、企业债、公司债、可分离交易可转债的纯债部分、资产支持证券、短期融资券、银行存款、债券回购、国债期货、同业存单等固定收益类金融工具，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金不直接买入股票、权证等权益类资产，也不参与新股申购和新股增发，可转债仅投资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，其投资比例遵循届时有效法律法规或相关规定。

本基金投资组合资产配置比例：债券等固定收益类资产占基金资产的比例不低于 80%；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，本基金持有的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）及到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%。

（三）投资理念

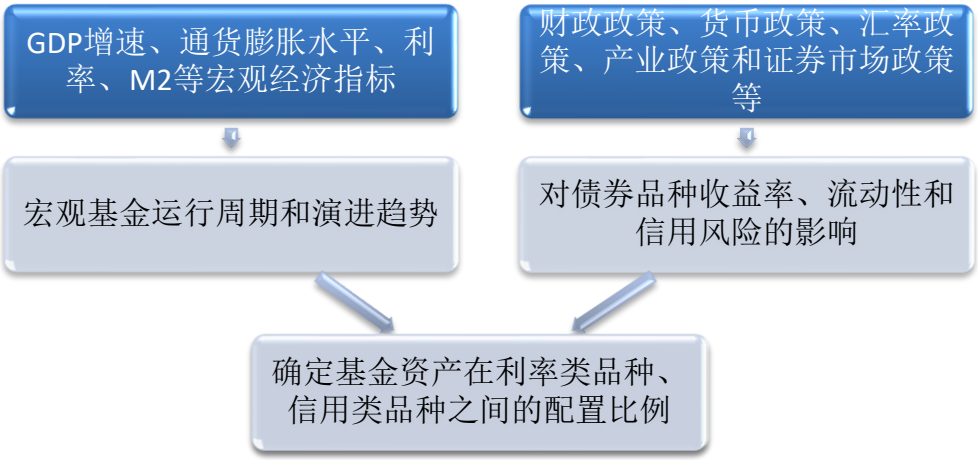
通过对宏微观经济以及货币政策的深入研究，以价值分析为基础，积极主动地构建债券投资组合，在风险可控的前提下，力求基金资产长期稳健增值。

（四）投资策略

1、类属资产配置策略：

本基金以宏观经济趋势以及货币政策研究导向，重点关注 GDP 增速、通货膨胀水平、利率变化趋势以及货币供应量等宏观经济指标，研判宏观经济运行所处的经济周期及其演进趋势；同时，积极关注财政政策、货币政策、汇率政策、产业政策和证券市场政策等的变化，分析其对不同类别资产的市场影响方向与程度；进而比较各固定收益类金融工具的风险收益

特性，在基金合同约定比例的范围内，寻求各类债券品种在收益性、流动性和信用风险补偿间的最佳平衡点，通过动态调整基金资产在利率类固定收益品种（国债、央行票据等）、信用类固定收益品种以及其他资产之间的配置比例，力争实现基金资产的长期稳健增值。



2、债券投资策略：

本基金将在对宏观经济走势、利率变化趋势、收益率曲线形态变化和发债主体基本面分析的基础上，综合运用久期管理策略、期限结构配置策略、骑乘策略、息差策略等主动投资策略，选择合适的时机和品种构建债券组合。

（1）久期管理策略：

本基金通过对宏观经济变量以及宏观经济政策等因素进行分析判断，形成对未来利率走势的合理预测，根据利率水平的预期变化主动调整债券组合的久期，有效控制基金组合整体风险，以达到优化资产收益率的目的。

如果判断未来利率水平将下降，本基金可通过增加组合的久期，获得债券收益率下降带来的收益；反之，如果预测未来利率水平将上升，本基金可缩短组合的久期，以减小债券收益率上升带来的损失。

（2）期限结构配置策略：

在确定组合久期的基础上，运用统计和数量分析技术、对市场利率期限结构历史数据进行分析检验和情景测试，并综合考虑债券市场微观因素如历史期限结构、新债发行、回购及市场拆借利率等，形成对债券收益率曲线形态及其发展趋势的判断，从而在子弹型、杠铃型或阶梯型配置策略中进行选择并动态调整。其中，子弹型策略是将偿还期限高度集中于收益

率曲线上的某一点；杠铃型策略是将偿还期限集中于收益率曲线的两端；而阶梯型策略是每类期限债券所占的比重基本一致。在收益率曲线变陡时，本基金将采用子弹型配置；当预期收益率曲线变平时，将采用哑铃型配置；在预期收益率曲线平移时，则采用阶梯型配置。

（3）骑乘策略：

通过分析收益率曲线各期限段的利差情况，当债券收益率曲线比较陡峭时，买入期限位于收益率曲线陡峭处右侧的债券。在收益率曲线不变动的情况下，随着债券剩余期限的缩短，债券的收益率水平将会较投资期初有所下降，这样可同时获得该债券持有期的稳定的票息收入以及收益率下降带来的价差收入；即使收益率曲线上升或进一步变陡，这一策略也能够提供更多的安全边际。

（4）息差策略：

根据市场利率水平，收益率曲线的形态以及对利率期限结构的预期，通过采用长期债券和短期回购相结合，获取债券票息收益和回购利率成本之间的利差。当回购利率低于债券收益率时，可以将正回购所获得的资金投资于债券，利用杠杆放大债基投资的收益。

3、资产支持证券投资策略：

本基金将深入研究资产支持证券的发行条款、市场利率、支持资产的构成及质量、支持资产的现金流变动情况以及提前偿还率水平等因素，评估资产支持证券的信用风险、利率风险、流动性风险和提前偿付风险，通过信用分析和流动性管理，辅以量化模型分析，精选那些经风险调整后收益率较高的品种进行投资，力求获得长期稳定的投资收益。

4、国债期货投资策略：

为有效控制债券投资的系统性风险，本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的，适度运用国债期货，提高投资组合的运作效率。

在国债期货投资时，本基金将首先分析国债期货各合约价格与最便宜可交割券的关系，选择定价合理的国债期货合约。其次，考虑国债期货各合约的流动性情况，最终确定与现货组合的合适匹配，以达到风险管理的目标。

（五）投资决策依据

1、国家有关法律、法规、基金合同等的有关规定；

2、研究分析团队对于宏观经济走势、宏观经济政策取向、行业增长速度等经济数据的量化分析的报告和建议；

3、研究分析团队对于企业和债券基础分析的报告和建议；

4、投资风险管理人员对于投资组合风险评估的报告和建议。

（六）投资决策程序

1、研究部、固定收益部和交易部通过自身研究及借助外部研究机构形成宏观经济分析、债券市场分析以及数据模拟的各类报告，为本基金的投资管理提供决策依据。

2、投资决策委员会依据上述报告对基金的投资方向、资产配置比例等提出指导性意见。

3、基金经理根据投资决策委员会的决议，参考上述报告，并结合自身对证券市场和债券价值的分析判断，形成基金投资计划。

4、交易部依据基金经理的指令，制定交易策略，统一执行证券投资组合计划，进行具体品种的交易。

5、风险管理部对投资组合计划的执行过程进行监控。

6、基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下有权根据环境变化和实际需要对上述投资程序做出调整。

（七）业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：中债-综合全价（总值）指数收益率。

1、业绩比较基准设定的原因

（1）基于基金投资范围以及预期投资的主要资产类别，本基金主要投资于债券等资产，相应选取与之匹配的中债-综合全价（总值）指数作为基准要素。同时基于本基金债券等固定收益类资产占基金资产的比例不低于 80%；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，本基金持有的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）及到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%等投资比例限制，以及预期的资产配置比例中枢，本基金将中债-综合全价（总值）指数权重设置为 100%。

（2）基于基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金将在对宏观经济走势、利率变

化趋势、收益率曲线形态变化和发债主体基本面分析的基础上，综合运用久期管理策略、期限结构配置策略、骑乘策略、息差策略等主动投资策略，选择合适的时机和品种构建债券组合。综合考虑基准指数与产品定位和投资风格的匹配度，同时兼顾考虑基准指数的表征性、认可度等，本基金选取中债-综合全价（总值）指数作为债券部分的业绩比较基准要素。

中债-综合全价（总值）指数具有良好的市场代表性和较高的知名度，适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

综上，本基金选取的业绩比较基准与基金投资目标、投资范围、投资策略、投资比例限制相匹配。

2、业绩比较基准要素的基本信息

中债-综合全价（总值）指数由中债金融估值中心有限公司编制发布，指数代码为CBA00203，指数具体信息详见中国债券信息网，网址：www.chinabond.com.cn。

3、业绩比较基准的计算方法

本基金业绩比较基准收益率的计算方法以每日收益率为基础，以时间加权为计算原则。

4、管理投资偏离业绩比较基准的定性或定量方法

本基金管理人对基金实际投资与业绩比较基准的偏离情况进行动态跟踪与监测评估，监测指标主要包括超额收益、大类资产配置比例等指标，以更好管理基金实际投资与业绩比较基准的偏离情况，从而在控制风险的基础上追求超越业绩比较基准的投资回报。

本基金为主动管理型基金，其业绩比较基准是表征产品风格、衡量产品业绩、约束投资行为的参考标准，并非本基金的跟踪标的。基金管理人在基金合同约定的投资范围、投资限制内享有充分的投资决策自主权，可根据投资策略、市场研判等综合因素，自主构建投资组合，包括酌情投资于业绩比较基准要素成份证券以外的证券。本基金投资组合相对业绩比较基准要素成份证券和权重可能存在偏离。

5、未来可能变更业绩比较基准的情况和程序

业绩比较基准变更符合下列条件之一且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的，基金管理人应当与基金托管人协商，在新业绩比较基准生效前三十日公告并充分说明变更原因、差异及影响，无需召开基金份额持有人大会：

（1）原有业绩比较基准的要素无法持续运作、编制方案发生重大修订等客观因素导致业绩比较基准无法再表征基金产品投资风格，或不再符合基金合同关于投资目标、投资范围、投资策略、投资比例限制等的约定，或与主要的资产类别、国别或地区、市场板块、货币类型等不再匹配；或业绩比较基准的要素不再具备市场代表性；

（2）调整业绩比较基准的要素权重、更换相同或相近特征的要素等，使新业绩比较基准代表性更强，且符合相关法律法规规定的；

（3）中国证监会认可的其他情形。

业绩比较基准变更涉及以下情形的，基金管理人应当按照规定履行变更注册、召开基金份额持有人大会等程序，法律法规、中国证监会另有规定的除外：

（1）基金投资目标、投资范围、投资策略、投资比例等拟进行重大调整，并变更业绩比较基准的；

（2）其他对基金份额持有人利益产生重大实质性影响的情形。

（八）风险收益特征

本基金属于证券投资基金中的较低风险品种，预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

（九）投资禁止行为与限制

1、禁止用本基金财产从事以下行为

（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）买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；

（5）向基金管理人、基金托管人出资；

（6）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；

（7）依照法律、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，应当符合本基金的投资目标和投资策略，遵循持有人利益优先原则，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同意，符合中国证监会的规定，并履行披露义务。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。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

2、基金投资组合比例限制

（1）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%；

（2）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%；

（3）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；

（4）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%；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%；同一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%；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%，但中国证监会规定的特殊品种除外；

（5）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；

（6）本基金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，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金（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；

（7）本基金在任何交易日日终，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%；

（8）本基金在任何交易日日终，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%；

（9）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）应当符合本基金投资范围中关于债券资产投资比例的有关约定；

（10）本基金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%；因证券市场波动、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，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

（12）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；

（13）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资比例限制。

如果法律法规对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。

除上述第（5）、（6）、（11）、（12）项外，因证券、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、法规另有规定时，从其规定。

3、若将来法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更，致使本款前述约定的投资禁止行为和投资组合比例限制被修改或取消，基金管理人在依法履行相应程序后，本基金可相应调整禁止行为和投资比例限制规定。

（十）投资组合比例调整

基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。期间，本基金的投资范围、投资策略应当符合本基金合同的约定。因证券、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不符合基金合同约定的投资比例规定的，基金管理人应当在十个交易日内进行调整。法律法规或监管机构另有规定时，从其规定。

（十一）基金的融资、融券

本基金可以按照国家的有关法律法规规定进行融资、融券。

（十二）侧袋机制的实施和投资运作安排

当基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，根据最大限度保护基金份额持有人利益的原则，基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制，无需召开基金份额持有人大会审议。

侧袋机制实施期间，本部分约定的投资组合比例、投资策略、组合限制、业绩比较基准、风险收益特征等约定仅适用于主袋账户。基金管理人原则上应当在侧袋机制启用后 20 个交易日内完成对主袋账户投资组合的调整，因资产流动性受限等中国证监会规定的情形除外。

侧袋账户的实施条件、实施程序、运作安排、投资安排、特定资产的处置变现和支付等对投资者权益有重大影响的事项详见招募说明书的规定。

第十三部分 基金的财产

（一）基金资产总值

本基金的基金资产总值包括基金所持有的各类有价证券、银行存款本息、基金的应收款项和其他投资所形成的价值总和。

（二）基金资产净值

本基金的基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

（三）基金财产的账户

本基金根据相关法律法规、规范性文件开立基金资金账户以及证券账户，与基金管理人和基金托管人自有的财产账户以及其他基金财产账户独立。

（四）基金财产的保管及处分

1、本基金财产独立于基金管理人及基金托管人的固有财产，并由基金托管人保管。

2、基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益，归基金财产。

3、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范围。

4、基金财产的债权不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债务相抵销；不同基金财产的债权债务，不得相互抵销。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

第十四部分 基金资产的估值

（一）估值目的

基金估值的目的是为了准确、真实地反映基金相关金融资产和金融负债的公允价值。开放式基金份额申购、赎回价格应按基金估值后确定的各类基金份额净值计算。

（二）估值日

本基金的估值日为相关的证券、期货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。

（三）估值对象

基金所持有的金融资产和金融负债。

（四）估值方法

1、固定收益证券的估值办法

（1)证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘净价估值，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净价估值；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）证券交易所市场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(自债券计息起始日或上一起息日至估值当日的利息)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，按有交易的最近交易日所采用的净价估值；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）未上市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的情况下，按成本估值。

（4）在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。

（5）交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，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，按成本进行后续计量。

（6）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。

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

3、本基金持有的银行存款和备付金余额以本金列示，按相应利率逐日计提利息。

4、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。

5、本基金投资同业存单，按估值日第三方估值机构提供的估值净价估值；选定的第三方估值机构未提供估值价格的，按成本估值。

6、在任何情况下，基金管理人采用上述 1-5 项规定的方法对基金财产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人有充足的理由认为按上述方法对基金财产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素的基础上与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

7、国家有最新规定的，按国家最新规定进行估值。

（五）估值程序

基金日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行。各类基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果报给基金托管人，基金托管人按《基金合同》规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金托管人复核无误后返回给基金管理人，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。

（六）暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券、期货交易所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财产价值时；

3、当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上的，经与基金托管人协商一致的，基金管理人应当暂停基金估值；

4、中国证监会认定的其他情形。

（七）基金份额净值的确认

用于基金信息披露的基金净值信息由基金管理人负责计算，基金托管人进行复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的各类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信息予以公布。

各类基金份额净值的计算均精确到 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。

（八）估值错误的处理

1、当基金财产的估值导致任一类基金份额净值小数点后 4 位（含第 4 位）内发生差错时，视为该类基金份额净值估值错误。

2、基金管理人和基金托管人将采取必要、适当合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金估值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当错误偏差达到或超过该类基金份额净值的 0.25%时，基金管理人应当报中国证监会备案；当错误偏差达到或超过该类基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告，并同时报中国证监会备案。

3、前述内容如法律法规或监管机构另有规定的，按其规定处理。

（九）实施侧袋机制期间的基金资产估值

本基金实施侧袋机制的，应根据本部分的约定对主袋账户资产进行估值并披露主袋账户的基金份额净值，暂停披露侧袋账户的基金份额净值。

（十）特殊情形的处理

1、基金管理人按本条第（四）款有关估值方法规定的第 6 项条款进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

2、由于不可抗力原因，或由于证券、期货交易所及登记结算公司发送的数据错误，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，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人和基金管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

第十五部分 基金费用与税收

（一）基金费用的种类

1、基金管理人的管理费；

2、基金托管人的托管费；

3、销售服务费；

4、因基金的证券、期货交易或结算而产生的费用；

5、基金合同生效以后的信息披露费用；

6、基金份额持有人大会费用；

7、基金合同生效以后的会计师费和律师费；

8、基金资产的资金汇划费用；

9、按照国家有关法律法规规定可以列入的其他费用。

（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

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的0.3%年费率计提。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的0.3%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×0.3%÷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。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

2、基金托管人的基金托管费

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的0.1%年费率计提。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的0.1%年费率计提。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，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

3、基金销售服务费

本基金A类、D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按前一日C类基金资产净值的0.4%年费率计提，计算方法如下：

H＝E×基金销售服务费年费率÷当年天数

H为C类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E为C类基金份额前一日的基金资产净值

销售服务费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

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，基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。

4、本条第（一）款第4至第9项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入当期基金费用。

（三）不列入基金费用的项目

本条第（一）款约定以外的其他费用，以及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等不列入基金费用。

（四）实施侧袋机制期间的基金费用

本基金实施侧袋机制的，与侧袋账户有关的费用可以从侧袋账户中列支，但应待侧袋账户资产变现后方可列支。侧袋账户资产不收取管理费，其他费用详见招募说明书的规定。

（五）基金管理费、基金托管费和基金销售服务费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费、基金托管费和基金销售服务费，无须召开基金份额持有人大会。

（六）税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

第十六部分 基金收益与分配

（一）收益的构成

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。

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部分的孰低数。

（二）收益分配原则

1、基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式，基金份额持有人可自行选择收益分配方式；基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金红利；选择红利再投资的，现金红利则按除权日经除权后的基金份额净值自动转为相应类别的基金份额进行再投资；

2、由于基金费用的不同，不同类别的基金份额在收益分配数额方面可能有所不同，基金管理人可对各类别基金份额分别制定收益分配方案，同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

3、基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值，基金收益分配基准日即期末可供分配利润计算截止日；

4、投资者的现金红利和分红再投资形成的基金份额均保留到小数点后第 2 位，小数点后第 3 位开始舍去，舍去部分归基金资产；

5、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

（三）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明基金期末可供分配利润、基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式及有关手续费等内容。

（四）收益分配方案的确定与公告

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后确定，基金管理人依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

（五）收益分配中发生的费用

1、收益分配采用红利再投资方式免收再投资的费用。

2、收益分配时发生的银行转账等手续费用由基金份额持有人自行承担。如果基金份额持有人所获现金红利不足支付前述银行转账等手续费用，注册登记机构自动将该基金份额持有人的现金红利按除权日除权后的基金份额净值转为相应类别的基金份额。

（六）实施侧袋机制期间的收益分配

本基金实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配，详见招募说明书的规定。

第十七部分 基金的会计与审计

（一）基金会计政策

1、基金的会计年度为公历每年 1 月 1 日至 12 月 31 日。

2、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位。

3、会计核算制度按国家有关的会计核算制度执行。

4、本基金独立建账、独立核算。

5、本基金会计责任人为基金管理人。

6、基金管理人应保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关法律法规规定编制基金会计报表，基金托管人定期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）基金审计

1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相独立的、具有从事证券、期货相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师等对基金年度财务报表及其他规定事项进行审计。

2、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所。基金管理人应在更换会计师事务所后依照《信息披露办法》的有关规定公告。

3、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。

第十八部分 基金的信息披露

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、行政法规和中国证监会规定的自然人、法人和非法人组织。

本基金信息披露义务人以保护基金份额持有人利益为根本出发点，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、完整性、及时性、简明性和易得性。

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的全国性报刊（以下简称“指定报刊”）及指定互联网网站（以下简称“指定网站”）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。

（一）基金招募说明书、基金合同、基金托管协议、基金产品资料概要

基金募集申请经中国证监会注册后，基金管理人应当在基金份额发售的 3 日前，将招募说明书、基金合同摘要登载在指定报刊和网站上；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各自公司网站上。

基金合同生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在指定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。

基金产品资料概要是基金招募说明书的摘要文件，用于向投资者提供简明的基金概要信息。基金合同生效后，基金产品资料概要的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金产品资料概要，并登载在指定网站及基金销售机构网站或营业网点；基金产品资料概要其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金产品资料概要。

（二）基金份额发售公告

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

（三）基金合同生效公告

基金管理人应当在基金合同生效的次日在指定报刊和网站上登载基金合同生效公告。

（四）基金净值信息

基金合同生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周在指定网站披露一次各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过指定网站、销售机构网站或者营业网点披露开放日的各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。

基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在指定网站披露半年度和年度最后一日的各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。

（五）定期报告

基金定期报告由基金管理人按照法律法规和中国证监会颁布的有关证券投资基金信息披露内容与格式的相关文件的规定单独编制，由基金托管人按照法律法规的规定对相关内容进行复核。基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告。

1、基金年度报告：基金管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载在指定网站上，并将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计。

2、基金中期报告：基金管理人应当在上半年结束之日起两个月内，编制完成基金中期报告，将中期报告登载在指定网站上，并将中期报告提示性公告登载在指定报刊上。

3、基金季度报告：基金管理人应当在季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，将季度报告登载在指定网站上，并将季度报告提示性公告登载在指定报刊上。

基金合同生效不足 2 个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。

如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本基金的特有风险。中国证监会认定的特殊情形除外。

本基金持续运作过程中，基金管理人应当在基金年度报告和中期报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。

法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定。

（六）临时报告

基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在两日内编制临时报告书，并登载在指定报刊和指定网站上。

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事件，包括：

1、基金份额持有人大会的召开及决定的事项；

2、《基金合同》终止、基金清算；

3、转换基金运作方式、基金合并；

4、更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；

5、基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；

6、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；

7、基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人的实际控制人变更；

8、基金管理人的高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；

9、基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十，基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十；

10、涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁；

11、基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；

12、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

联交易事项，但中国证监会另有规定的除外；

13、基金募集期延长或提前结束募集；

14、基金收益分配事项；

15、管理费、托管费、销售服务费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；

16、某类基金份额净值计价错误达该类基金份额净值 0.5%；

17、基金开始办理申购、赎回；

18、基金发生巨额赎回并延期办理；

19、基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；

20、基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；

21、变更基金份额类别的设置；

22、基金份额上市交易；

23、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；

24、基金信息披露义务人认为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其他事项或中国证监会规定的其他事项。

（七）公开澄清

在基金合同期限内，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，以及可能损害基金份额持有人权益的，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。

（八）投资国债期货信息披露

基金管理人应当在季度报告、中期报告、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。

（九）清算报告

基金合同终止的，基金管理人应当依法组织基金财产清算小组对基金财产进行清算并作出清算报告。基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

（十）实施侧袋机制期间的信息披露

本基金实施侧袋机制的，相关信息披露义务人应当根据法律法规、基金合同和招募说明书的规定进行信息披露，详见招募说明书的规定。

（十一）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，指定专门部门及高级管理人员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等法规的规定。

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、各类基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告、更新的招募说明书、基金产品资料概要、基金清算报告等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人进行书面或电子确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定报刊中选择一家报刊披露本基金信息。基金管理人、基金托管人应当向中国证监会基金电子披露网站报送拟披露的基金信息，并保证相关报送信息的真实、准确、完整、及时。

基金管理人、基金托管人除按法律法规要求披露信息外，也可着眼于为投资者决策提供有用信息的角度，在保证公平对待投资者、不误导投资者、不影响基金正常投资操作的前提下，自主提升信息披露服务的质量。具体要求应当符合中国证监会及自律规则的相关规定。前述自主披露如产生信息披露费用，该费用不得从基金财产中列支。

（十二）信息披露文件的存放与查阅

依法必须披露的信息发布后，基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于各自住所，供社会公众免费查阅。投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件。

（十三）本基金信息披露事项以法律法规规定及本章节约定的内容为准。

第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算

（一）基金合同的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。

2、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备案，并自决议生效后两日内在指定媒介公告。

3、但如因相应的法律法规发生变动并属于本基金合同必须遵照进行修改的情形，或者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变化或对基金份额持有人利益无实质性不利影响的，可不经基金份额持有人大会决议，而经基金管理人和基金托管人同意修改后公布，并报中国证监会备案。

（二）基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同应当终止：

1、基金份额持有人大会决定终止；

2、因重大违法、违规行为，被中国证监会责令终止的；

3、基金管理人、基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金管理人、基金托管人承接的；

4、法律法规和基金合同规定的其他情形。

基金合同终止后，基金管理人和基金托管人有权依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关法律法规的规定，行使请求给付报酬、从基金财产中获得补偿的权利。

（三）基金财产的清算

1、基金合同终止，基金管理人应当按法律法规和本基金合同的有关规定组织清算组对基金财产进行清算。

2、基金财产清算组

（1）自基金合同终止事由之日起 30 个工作日内由基金管理人组织成立基金财产清算组，在基金财产清算组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

（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、期货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。

3、清算程序

（1）基金合同终止情形发生后，由基金财产清算组统一接管基金财产；

（2）基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；

（3）基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；

（4）对基金财产进行评估和变现；

（5）制作清算报告；

（6）聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；

（7）将清算报告报中国证监会备案并公告；

（8）对基金财产进行分配。

4、清算费用

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

5、基金剩余财产的分配

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各类基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款（1）、（2）、（3）项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

对于基金缴存于中国证券登记结算有限责任公司的最低结算备付金和交易席位保证金等，在中国证券登记结算有限责任公司对其进行调整后方可收回。

6、基金财产清算的公告

基金财产清算组做出的清算报告经具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并公告。基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

7、基金财产清算账册及文件由基金托管人保存 15 年以上。

第二十部分 违约责任

（一）因基金管理人或基金托管人违约给基金财产或者基金份额持有人造成损害的，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任，因共同行为给基金财产或者基金份额持有人造成损害的，应当承担连带赔偿责任。

（二）基金合同当事人违反本基金合同，给基金财产或其他基金合同当事人造成损失的，应承担相应的赔偿责任。

（三）发生下列情况时，当事人可以免责：

1、基金管理人和/或基金托管人按照中国证监会的规定或当时有效的法律法规或规章的作为或不作为而造成的损失等；

2、在无过错情况下，基金管理人由于按照本基金合同规定的投资原则进行的投资所造成的损失等；

3、不可抗力。基金管理人及基金托管人因不可抗力不能履行本合同的，可根据不可抗力的影响部分或全部免除责任，但法律另有规定的除外。任何一方迟延履行后发生不可抗力的，不能免除责任。

（四）在发生一方或多方当事人违约的情况下，基金合同能够继续履行的应当继续履行。

（五）本基金合同当事人一方违约后，其他当事方应当采取适当措施防止损失的扩大；没有采取适当措施致使损失扩大的，不得就扩大的损失要求赔偿。守约方因防止损失扩大而支出的合理费用由违约方承担。

第二十一部分 争议的处理

（一）本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

（二）本基金合同的当事人之间因本基金合同产生的或与本基金合同有关的争议可通过友好协商解决，但若自一方书面提出协商解决争议之日起 60 日内争议未能以协商方式解决的，则任何一方有权将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会，按照其时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。

（三）除争议所涉内容之外，本基金合同的其他部分应当由本基金合同当事人继续履行。

第二十二部分 基金合同的效力

（一）本基金合同是基金合同当事人之间的法律文件，应由基金管理人和基金托管人的法定代表人或其授权签字人签字并加盖公章。基金合同于投资者缴纳认购的基金份额的款项时成立，自基金募集结束报中国证监会备案并获中国证监会书面确认后生效。

（二）本基金合同的有效期自其生效之日起至本基金财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止。

（三）本基金合同自生效之日起对包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人在内的基金合同各方当事人具有同等的法律约束力。

（四）本基金合同正本一式六份，除上报有关监管机构二份外，基金管理人、基金托管人各持有二份，每份具有同等的法律效力。

（五）基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

基金合同存放在基金管理人和基金托管人住所，投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件，基金合同条款及内容应以基金合同正本为准。

第二十三部分 其他事项

《基金合同》如有未尽事宜，由《基金合同》当事人各方按有关法律法规协商解决。

第二十四部分 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

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）依法募集基金，办理基金备案手续；

（2）依照法律法规和基金合同独立管理运用基金财产；

（3）根据法律法规和基金合同的规定，制订、修改并公布有关基金认购、申购、赎回、转托管、基金转换、非交易过户、冻结、收益分配等方面的业务规则；

（4）根据法律法规和基金合同的规定决定本基金的相关费率结构和收费方式，获得基金管理费，收取认购费、申购费、赎回费、销售服务费及其他事先核准或公告的合理费用以及法律法规规定的其他费用；

（5）根据法律法规和基金合同的规定销售基金份额；

（6）在本合同的有效期内，在不违反公平、合理原则以及不妨碍基金托管人遵守相关法律法规及其行业监管要求的基础上，基金管理人有权对基金托管人履行本合同的情况进行必要的监督。如认为基金托管人违反了法律法规或基金合同规定对基金财产、其他基金合同当事人的利益造成重大损失的，应及时呈报中国证监会，以及采取其他必要措施以保护本基金及相关基金合同当事人的利益；

（7）根据基金合同的规定选择适当的基金代销机构并有权依照代销协议和有关法律法规对基金代销机构行为进行必要的监督和检查；

（8）自行担任基金注册登记机构或选择、更换基金注册登记代理机构，办理基金注册登记业务，并按照基金合同规定对基金注册登记代理机构进行必要的监督和检查；

（9）在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回的申请；

（10）在法律法规允许的前提下，为基金份额持有人的利益依法为基金进行融资、融券；

（11）依据法律法规和基金合同的规定，制订基金收益分配方案；

（12）按照法律法规，代表基金对被投资企业行使股东权利，代表基金行使因投资于其他证券所产生的权利；

（13）在基金托管人职责终止时，提名新的基金托管人；

（14）依据法律法规和基金合同的规定，召集基金份额持有人大会；

（15）选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构并确定有关费率；

（16）法律法规、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）依法申请并募集基金，办理或者委托经国务院证券监督管理机构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）按基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；

（7）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；

（8）进行基金会计核算并编制基金的财务会计报告；

（9）依法接受基金托管人的监督；

（10）编制季度报告、中期报告和年度报告；

（11）采取适当合理的措施使计算开放式基金份额认购、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；

（12）计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回价格；

（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以保密，不得向他人泄露；

（15）按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

（16）保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表、代表基金签订的重大合同及其他相关资料；

（17）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；

（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的合法权益，应承担赔偿责任，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）法律法规、基金合同及中国证监会规定的其他义务。

3、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）依据法律法规和基金合同的规定安全保管基金财产；

（2）依照基金合同的约定获得基金托管费；

（3）监督基金管理人对本基金的投资运作；

（4）在基金管理人职责终止时，提名新的基金管理人；

（5）依据法律法规和基金合同的规定召集基金份额持有人大会；

（6）法律法规、基金合同规定的其他权利。

4、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）按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；

（4）除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得以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）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和独立；

（6）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；

（7）保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

（8）按照基金合同的约定，根据基金管理人的指令，及时办理清算、交割事宜；

（9）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以保密，不得向他人泄露；

（10）根据法律法规及本合同的约定，办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

（11）对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告的相关内容出具意见，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；

（12）建立并保存基金份额持有人名册；

（13）复核基金管理人计算的基金资产净值、各类基金份额净值和基金份额申购、赎回价格；

（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）按照法律法规监督基金管理人的投资运作；

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

（19）因基金管理人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，除法律法规另有规定外，基金托管人不承担连带责任；

（20）法律法规、基金合同及中国证监会规定的其他义务。

5、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）依法转让或者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或者召集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、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；

（9）法律法规、基金合同规定的其他权利。

6、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）缴纳基金认购、申购款项及基金合同规定的费用；

（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、其他基金份额持有人及其他基金合同当事人合法利益的活动；

（5）执行基金份额持有人大会的决议；

（6）返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；

（7）遵守基金管理人、销售机构和注册登记机构的相关交易及业务规则；

（8）法律法规及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

1、本基金的基金份额持有人大会，由本基金的基金份额持有人或其合法的代理人组成。除法律法规另有规定或基金合同另有约定外，基金份额持有人持有的同一类别每一基金份额拥有平等的投票权。本基金未设立基金份额持有人大会的日常机构，如今后设立基金份额持有人大会的日常机构，日常机构的设立按照相关法律法规的要求执行。

2、有以下情形之一时，应召开基金份额持有人大会：

（1）终止基金合同；

（2）转换基金运作方式；

（3）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准或提高销售服务费，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；

（4）更换基金管理人、基金托管人；

（5）变更基金类别；

（6）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）；

（7）变更基金份额持有人大会议事程序、表决方式和表决程序；

（8）本基金与其他基金合并；

（9）对基金合同当事人权利、义务产生重大影响，需召开基金份额持有人大会的变更基金合同等其他事项；

（10）法律法规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。

3、有以下情形之一的，不需召开基金份额持有人大会：

（1）调低基金管理费率、基金托管费率；

（2）在法律法规和基金合同规定的范围内变更本基金的申购费率或收费方式、调低赎回费率、调低销售服务费率；

（3）因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改；

（4）对基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化；

（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；

（6）除法律法规或基金合同规定应当召开基金份额持有人大会以外的其他情形。

4、召集方式：

（1）除法律法规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。基金管理人未按规定召集或者不能召集时，基金托管人仍认为有必要召开的，应当自行召集。

（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，并自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

（3）代表基金份额 10%以上（含 10%，下同）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书面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，并至少提前 30 日报中国证监会备案。

（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。

（6）基金份额持有人大会的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

5、通知

召开基金份额持有人大会，召集人应当于会议召开前 30 天在指定媒介上公告。基金份额持有人大会不得就未经公告的事项进行表决。基金份额持有人大会通知将至少载明以下内容：

（1）会议召开的时间、地点、方式；

（2）会议拟审议的主要事项、议事程序和表决方式；

（3）代理投票授权委托书送达时间和地点；

（4）会务常设联系人姓名、电话；

（5）权益登记日；

（6）如采用通讯表决方式，还应载明具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表达意见的寄交和收取方式、投票表决的截止日以及表决票的送达地址等内容。

6、开会方式

基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会。现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委派其代理人出席，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；通讯方式开会指按照基金合同的相关规定以通讯的非现场方式进行表决。会议的召开方式由召集人确定，但决定基金管理人更换或基金托管人的更换、转换基金运作方式和终止基金合同事宜必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

（1）亲自出席会议者持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、本基金合同和会议通知的规定；

（2）经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，全部有效凭证所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的 50%以上（含 50%，下同）。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

（1）召集人按基金合同规定公布会议通知后，在两个工作日内连续公布相关提示性公告；

（2）召集人按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见；

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

（4）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其他代表，同时提交的持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和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；

（5）会议通知公布前已报中国证监会备案。

参加基金份额持有人大会的基金份额持有人所代表的基金份额低于上述现场开会条件第 2 项或通讯开会条件第 3 项规定比例的，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会，应当有代表 1/3 以上（含 1/3）基金份额的基金份额持有人或其代理人参加，方可召开。

在不与法律法规冲突的前提下，基金份额持有人大会可通过网络、电话或其他方式召开，基金份额持有人可以采用书面、网络、电话或其他监管机构允许的方式进行表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

基金份额持有人授权他人代为出席会议并表决的，授权方式可以采用书面、网络、电话或其他监管机构允许的方式，具体方式在会议通知中列明。

7、议事内容与程序

（1）议事内容及提案权

1）议事内容限为本条前述第 2 款规定的基金份额持有人大会召开事由范围内的事项。

2）基金管理人、基金托管人、代表基金份额 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：

a、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。

b、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）代表基金份额 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，或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，未获得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不得对未事先公告的议事内容进行表决。

（2）议事程序

在现场开会的方式下，首先由召集人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议，报中国证监会备案。

若召集人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人以所持表决权的 50%以上选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

在通讯表决开会的方式下，首先由召集人在会议通知中公布提案，在所通知的表决截止日期后第 2 个工作日由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证，报中国证监会备案。

8、表决

（1）基金份额持有人所持每份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）特别决议

对于特别决议应当经参加大会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。

2）一般决议

对于一般决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的 50%以上通过。

更换基金管理人或者基金托管人、转换基金运作方式、终止基金合同或与其他基金合并应当以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，符合法律法规、基金合同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。

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。

9、计票

（1）现场开会

1）基金份额持有人大会的主持人为召集人授权出席大会的代表，如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金

份额持有人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(如果基金管理人为召集人，则监督员由基金托管人担任；如基金托管人为召集人，则监督员由基金托管人在出席会议的基金份额持有人中指定)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中推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并由大会主持人当场公布计票结果。

3）如果大会主持人对于提交的表决结果有怀疑，可以对所投票数进行重新清点；如果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者基金份额持有人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。

4）在基金管理人或基金托管人担任召集人的情形下，如果在计票过程中基金管理人或者基金托管人拒不配合的，则参加会议的基金份额持有人有权推举三名基金份额持有人代表共同担任监票人进行计票。

（2）通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式可采取如下方式：

由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

10、生效与公告

（1）基金份额持有人大会按照《基金法》有关法律法规规定表决通过的事项，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会备案。基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效。

（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、基金托管人均有法律约束力。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的决定。

（3）基金份额持有人大会决议应当自生效后 2 日内，由基金份额持有人大会召集人在指定媒介上公告。

（4）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、公证机关、公证员姓名等一同公告。

11、实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定

若本基金实施侧袋机制，则相关基金份额或表决权的比例指主袋份额持有人和侧袋份额持有人分别持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例，但若相关基金份额持有人大会召集和审议事项不涉及侧袋账户的，则仅指主袋份额持有人持有或代表的基金份额或表决权符

合该等比例：

1、基金份额持有人行使提议权、召集权、提名权所需单独或合计代表相关基金份额 10%以上（含 10%）；

2、现场开会的到会者在权益登记日代表的基金份额不少于本基金在权益登记日相关基金份额的二分之一（含二分之一）；

3、通讯开会的直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日相关基金份额的二分之一（含二分之一）；

4、当参与基金份额持有人大会投票的基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日相关基金份额的二分之一，召集人在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内就原定审议事项重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）相关基金份额的持有人参与或授权他人参与基金份额持有人大会投票；

5、现场开会由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人；

6、一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过；

7、特别决议应当经参加大会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。

侧袋机制实施期间，基金份额持有人大会审议事项涉及主袋账户和侧袋账户的，应分别由主袋账户、侧袋账户的基金份额持有人进行表决，同一类别账户内的每份基金份额具有平等的表决权。表决事项未涉及侧袋账户的，侧袋账户份额无表决权。

侧袋机制实施期间，关于基金份额持有人大会的相关规定以本节特殊约定内容为准，本节没有规定的适用上文相关规定。

12、法律法规或监管机关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

1、收益的构成

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。

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部分的孰低数。

2、收益分配原则

（1）基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式，基金份额持有人可自行选择收益分配方式；基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金红利；选择红利再投资的，现金红利则按除权日经除权后的基金份额净值自动转为相应类别的基金份额进行再投

资；

（2）由于基金费用的不同，不同类别的基金份额在收益分配数额方面可能有所不同，基金管理人可对各类别基金份额分别制定收益分配方案，同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

（3）基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值，基金收益分配基准日即期末可供分配利润计算截止日；

（4）投资者的现金红利和分红再投资形成的基金份额均保留到小数点后第 2 位，小数点后第 3 位开始舍去，舍去部分归基金资产；

（5）法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

3、收益分配方案

基金收益分配方案中应载明基金期末可供分配利润、基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式及有关手续费等内容。

4、收益分配方案的确定与公告

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后确定，基金管理人依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

5、收益分配中发生的费用

（1）收益分配采用红利再投资方式免收再投资的费用。

（2）收益分配时发生的银行转账等手续费用由基金份额持有人自行承担。如果基金份额持有人所获现金红利不足支付前述银行转账等手续费用，注册登记机构自动将该基金份额持有人的现金红利按除权日除权后的基金份额净值转为相应类别的基金份额。

6、实施侧袋机制期间的收益分配

本基金实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配，详见招募说明书的规定。

（四）与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例

1、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）销售服务费；

（4）因基金的证券、期货交易或结算而产生的费用；

（5）基金合同生效以后的信息披露费用；

（6）基金份额持有人大会费用；

（7）基金合同生效以后的会计师费和律师费；

（8）基金资产的资金汇划费用；

（9）按照国家有关法律法规规定可以列入的其他费用。

2、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

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的0.3%年费率计提。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的0.3%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×0.3%÷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。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

（2）基金托管人的基金托管费

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的0.1%年费率计提。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的0.1%年费率计提。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，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

（3）基金销售服务费

本基金A类、D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按前一日C类基金资产净值的0.4%年费率计提，计算方法如下：

H＝E×基金销售服务费年费率÷当年天数

H为C类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E为C类基金份额前一日的基金资产净值

销售服务费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

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，基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。

（4）本条第（一）款第（4）至第（9）项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入当期基金费用。

3、不列入基金费用的项目

本条第（一）款约定以外的其他费用，以及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等不列入基金费用。

4、实施侧袋机制期间的基金费用

本基金实施侧袋机制的，与侧袋账户有关的费用可以从侧袋账户中列支，但应待侧袋账

户资产变现后方可列支。侧袋账户资产不收取管理费，其他费用详见招募说明书的规定。

5、基金管理费、基金托管费和基金销售服务费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费、基金托管费和基金销售服务费，无须召开基金份额持有人大会。

6、税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

（五）投资范围和投资限制

1、投资范围

本基金的投资范围包括国债、地方政府债、金融债、央行票据、中期票据、次级债、企业债、公司债、可分离交易可转债的纯债部分、资产支持证券、短期融资券、银行存款、债券回购、国债期货、同业存单等固定收益类金融工具，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金不直接买入股票、权证等权益类资产，也不参与新股申购和新股增发，可转债仅投资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，其投资比例遵循届时有效法律法规或相关规定。

本基金投资组合资产配置比例：债券等固定收益类资产占基金资产的比例不低于 80%；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，本基金持有的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）及到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%。

2、投资禁止行为与限制

（1）禁止用本基金财产从事以下行为

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）买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；

5）向基金管理人、基金托管人出资；

6）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；

7）依照法律、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，应当符合本基金的投资目标和投资策略，遵循持有人利益优先原则，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

金托管人同意，符合中国证监会的规定，并履行披露义务。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。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

（2）基金投资组合比例限制

1）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%；

2）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%；

3）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；

4）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%；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%；同一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%；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%，但中国证监会规定的特殊品种除外；

5）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；

6）本基金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，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金（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；

7）本基金在任何交易日日终，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%；

8）本基金在任何交易日日终，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%；

9）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）应当符合本基金投资范围中关于债券资产投资比例的有关约定；

10）本基金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%；因证券市场波动、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，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

12）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；

13）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资比例限制。

如果法律法规对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。

除上述第 5）、6）、11）、12）项外，因证券、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、法规另有规定时，从其规定。

（3）若将来法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更，致使本款前述约定的投资禁止行为和投资组合比例限制被修改或取消，基金管理人在依法履行相应程序后，本基金可相应调整禁止行为和投资比例限制规定。

（六）基金资产净值的计算方法

1、估值目的

基金估值的目的是为了准确、真实地反映基金相关金融资产和金融负债的公允价值。开放式基金份额申购、赎回价格应按基金估值后确定的各类基金份额净值计算。

2、估值日

本基金的估值日为相关的证券、期货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。

3、估值对象

基金所持有的金融资产和金融负债。

4、估值方法

（1）固定收益证券的估值办法

1）证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘净价估值，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净价估值；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）证券交易所市场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(自债券计息起始日或上一起息日至估值当日的利息)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，按有交易的最近交易日所采用的净价估值；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）未上市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的情况下，按成本估值。

4）在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。

5）交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，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，按成本进行后续计量。

6）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。

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

（3）本基金持有的银行存款和备付金余额以本金列示，按相应利率逐日计提利息。

（4）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。

（5）本基金投资同业存单，按估值日第三方估值机构提供的估值净价估值；选定的第三方估值机构未提供估值价格的，按成本估值。

（6）在任何情况下，基金管理人采用上述（1）-（5）项规定的方法对基金财产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人有充足的理由认为按上述方法对基金财产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素的基础上与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

（7）国家有最新规定的，按国家最新规定进行估值。

5、估值程序

基金日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行。各类基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果报给基金托管人，基金托管人按《基金合同》规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金托管人复核无误后返回给基金管理人，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。

6、暂停估值的情形

（1）基金投资所涉及的证券、期货交易所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财产价值时；

（3）当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上的，经与基金托管人协商一致的，基金管理人应当暂停基金估值；

（4）中国证监会认定的其他情形。

7、基金份额净值的确认

用于基金信息披露的基金净值信息由基金管理人负责计算，基金托管人进行复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的各类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信息予以公布。

各类基金份额净值的计算均精确到 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。

8、估值错误的处理

（1）当基金财产的估值导致任一类基金份额净值小数点后 4 位（含第 4 位）内发生差错时，视为该类基金份额净值估值错误。

（2）基金管理人和基金托管人将采取必要、适当合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金估值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当错误偏差达到或超过该类基金份额净值的 0.25%时，基金管理人应当报中国证监会备案；当错误偏差达到或超过该类基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告，并同时报中国证监会备案。

（3）前述内容如法律法规或监管机构另有规定的，按其规定处理。

9、实施侧袋机制期间的基金资产估值

本基金实施侧袋机制的，应根据本部分的约定对主袋账户资产进行估值并披露主袋账户的基金份额净值，暂停披露侧袋账户的基金份额净值。

10、特殊情形的处理

（1）基金管理人按本条第 4 款有关估值方法规定的第（6）项条款进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

（2）由于不可抗力原因，或由于证券、期货交易所及登记结算公司发送的数据错误，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，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人和基金管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

（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

1、基金合同的变更

（1）变更基金合同涉及法律法规规定或本合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。

（2）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备案，并自决议生效后两日内在指定媒介公告。

（3）但如因相应的法律法规发生变动并属于本基金合同必须遵照进行修改的情形，或者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变化或对基金份额持有人利益无实质性不利影响的，可不经基金份额持有人大会决议，而经基金管理人和基金托管人同意修改后公布，并报中国证监会备案。

2、基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同应当终止：

（1）基金份额持有人大会决定终止；

（2）因重大违法、违规行为，被中国证监会责令终止的；

（3）基金管理人、基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金管理人、基金托管人承接的；

（4）法律法规和基金合同规定的其他情形。

基金合同终止后，基金管理人和基金托管人有权依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关法律法规的规定，行使请求给付报酬、从基金财产中获得补偿的权利。

3、基金财产的清算

（1）基金合同终止，基金管理人应当按法律法规和本基金合同的有关规定组织清算组对基金财产进行清算。

（2）基金财产清算组

1）自基金合同终止事由之日起 30 个工作日内由基金管理人组织成立基金财产清算组，在基金财产清算组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

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、期货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。

（3）清算程序

1）基金合同终止情形发生后，由基金财产清算组统一接管基金财产；

2）基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；

3）基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；

4）对基金财产进行评估和变现；

5）制作清算报告；

6）聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；

7）将清算报告报中国证监会备案并公告；

8）对基金财产进行分配。

（4）清算费用

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

（5）基金剩余财产的分配

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各类基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款 1）、2）、3）项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

对于基金缴存于中国证券登记结算有限责任公司的最低结算备付金和交易席位保证金等，在中国证券登记结算有限责任公司对其进行调整后方可收回。

（6）基金财产清算的公告

基金财产清算组做出的清算报告经具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并公告。基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

（7）基金财产清算账册及文件由基金托管人保存 15 年以上。

（八）争议解决方式

1、本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

2、本基金合同的当事人之间因本基金合同产生的或与本基金合同有关的争议可通过友好协商解决，但若自一方书面提出协商解决争议之日起 60 日内争议未能以协商方式解决的，则任何一方有权将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会，按照其时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。

3、除争议所涉内容之外，本基金合同的其他部分应当由本基金合同当事人继续履行。

（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六份，除上报有关监管机构二份外，基金管理人、基金托管人各持有二份，每份具有同等的法律效力。

基金合同存放在基金管理人和基金托管人住所，投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件，基金合同条款及内容应以基金合同正本为准。