

# 西部利得新动力灵活配置混合型证券投资基金

## 更新招募说明书

(2018 年第二期)

### 重要提示

本基金的募集申请经中国证券监督管理委员会2016年8月15日证监许可【2016】1835号文准予注册。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）注册，但中国证监会对本基金募集申请的注册，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，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资人根据所持有份额享受基金的收益，但同时也要承担相应的投资风险。投资有风险，投资人在投资本基金前，请认真阅读本招募说明书，全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，获得基金投资收益，亦承担基金投资中出现的各类风险。基金投资中的风险包括：市场风险、管理风险、技术风险、合规风险等，也包括本基金的特定风险等。

本基金为混合型基金，在通常情况下其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于证券投资基金中等风险水平的投资品种。

投资有风险，投资人认购（申购）基金时应认真阅读本基金的招募说明书及基金合同。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行负责。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。

本次招募说明书的更新内容中与托管相关的信息已经本基金托管人复核。所载内容截止日为 2018 年 11 月 19 日，投资组合报告为 2018 年三季度报告，有关财务数据和净值表现截止日为 2018 年 9 月 30 日（财务数据未经审计）。

**基金管理人：西部利得基金管理有限公司**

**基金托管人：平安银行股份有限公司**

二〇一八年十二月

# 目录

第一部分绪言 .....	1
第二部分释义 .....	2
第三部分基金管理人 .....	7
第四部分基金托管人 .....	20
第五部分相关服务机构.....	26
第六部分基金的募集 .....	40
第七部分基金合同的生效.....	41
第八部分基金份额的申购与赎回.....	42
第九部分与基金管理人管理的其他基金转换.....	52
第十部分基金份额的登记、转托管、非交易过户、冻结、解冻和质押.....	59
第十一部分基金的投资.....	62
第十二部分基金资产估值.....	78
第十三部分基金的收益与分配.....	83
第十四部分基金费用与税收.....	85
第十五部分基金的会计与审计.....	88
第十六部分基金的信息披露.....	89
第十七部分风险揭示 .....	95
第十八部分基金合同的变更、终止与基金财产清算.....	100
第十九部分基金合同摘要.....	102
第二十部分托管协议摘要.....	118
第二十一部分对基金份额持有人的服务.....	137
第二十二其他应披露事项.....	139
第二十三部分招募说明书的存放及查阅方式.....	143
第二十四部分备查文件.....	144

## 第一部分绪言

本招募说明书依据《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》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《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“《流动性规定》”）和其他有关法律法规的规定，以及《西部利得新动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

本基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。

本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本招募说明书由本基金管理人解释。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书做出任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写，并经中国证监会注册。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依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的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

## 第二部分释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

- 1、基金或本基金：指西部利得新动力灵活配置混合型证券投资基金
- 2、基金管理人：指西部利得基金管理有限公司
- 3、基金托管人：指平安银行股份有限公司
- 4、基金合同：指《西部利得新动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充
- 5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《西部利得新动力灵活配置混合型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
- 6、招募说明书或本招募说明书：指《西部利得新动力灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》及其定期的更新
- 7、基金份额发售公告：指《西部利得新动力灵活配置混合型证券投资基金基金份额发售公告》
- 8、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等
- 9、《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，2012 年 12 月 28 日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，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》，并经 2015 年 4 月 24 日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修改的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 10、《销售办法》：指中国证监会 2013 年 3 月 15 日颁布、同年 6 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 11、《信息披露办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 8 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《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

12、《运作办法》：指中国证监会 2014 年 7 月 7 日颁布、同年 8 月 8 日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

13、《流动性规定》：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

14、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

15、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会

16、基金合同当事人：指受基金合同约束，根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人

17、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

18、机构投资者：指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织

19、合格境外机构投资者：指符合现时有效的相关法律法规规定可以投资于依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者

20、投资人：指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称

21、基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人

22、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务。

23、销售机构：指西部利得基金管理有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议，代为办理基金销售业务的机构

24、登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等

25、登记机构：指办理登记业务的机构。基金的登记机构为西部利得基金管理有限公司或接受西部利得基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构

26、基金账户：指登记机构为投资人开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户

27、基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构办理认购、申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户

28、基金合同生效日：指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期

29、基金合同终止日：指基金合同规定的基金合同终止事由出现后，基金财产清算完毕，清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期

30、基金募集期：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过 3 个月

31、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

32、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

33、T 日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日

34、T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日（不包含 T 日），n 为自然数

35、开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

36、开放时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

37、《业务规则》：指《西部利得基金管理有限公司开放式基金业务规则》，是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金登记方面的业务规则，由基金管理人和投资人共同遵守

38、认购：指在基金募集期内，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

39、申购：指基金合同生效后，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

40、赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为

41、基金份额类别：指本基金根据认购/申购费用、赎回费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用、赎回时收取赎回费用的，称为 A 类基金份额；在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用，赎回时收取赎回费用，且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

42、销售服务费：指从基金资产中计提的，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，本基金只对 C 类基金份额持有人收取销售服务费

43、基金转换：指基金份额持有人按照基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金基金份额的行为

44、转托管：指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基金份额销售机构的操作

45、定期定额投资计划：指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期申购日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及受理基金申购申请的一种投资方式

46、巨额赎回：指本基金单个开放日，基金净赎回申请（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）超过上一开放日基金总份额的 10%

47、元：指人民币元

48、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、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约

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

50、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

51、基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

52、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



53、指定媒介：指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站及其他媒介

54、不可抗力：指基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

55、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）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、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。

## 第三部分基金管理人

### 一、公司概况

名称：西部利得基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 11 层 02、03 单元

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 11 层 02、03 单元

法定代表人：刘建武

成立时间：2010 年 7 月 20 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监许可[2010]864 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：叁亿伍仟万元

存续期限：持续经营

联系人：陈眉媚

联系电话：（021）38572888

股权结构：

股东	出资额（元）	出资比例
西部证券股份有限公司	178,500,000	51%
利得科技有限公司	171,500,000	49%
合计	350,000,000	100%

### 二、主要人员情况

#### 1、董事会成员

刘建武先生：董事

刘建武先生，董事，博士研究生，高级经济师。毕业于陕西财经学院、西北大学，分别获工业经济学硕士和政治经济学博士学位。16 年证券从业经历。1991 年起在陕西省计划委员会经济研究所工作。1993 年起在西安市人民政府办公厅工作，历任财贸、金融、经济管理副处级秘书，科技文教管理处处长。

2001年起任西安高新管委会管理办副主任及西安高科集团公司副总经理。2002年起任西安市投资服务中心投资管理副主任。2003年起任陕西省投资集团公司金融证券部经理。2005年10月起任西部证券股份有限公司董事长、党委书记。目前兼任陕西能源集团有限公司董事。2014年10月加入本公司，历任公司董事，自2018年10月起任公司董事长。

贺燕萍女士：董事

贺燕萍女士，董事，硕士研究生，高级经济师。毕业于中国社会科学院研究生院，获经济学硕士学位，21年证券从业经历。1990年起任北京市永安宾馆业务主管。1998年起任华夏证券股份有限公司研究所客户部经理。2006年起任中信建投证券股份有限公司机构销售部总经理助理。2007年起在光大证券股份有限公司工作，历任销售交易部副总经理、销售交易部总经理。2013年1月起任光大证券资产管理有限公司总经理。2013年8月起任国泰基金管理有限公司副总经理。自2015年11月起任公司总经理。

李兴春先生：董事

李兴春先生，董事，博士。毕业于南京大学，获管理科学与工程博士学位。曾任携程旅行网高级总监，富友证券有限责任公司副总裁，泛亚信托投资有限公司执行副总裁，西部发展控股有限公司董事、总裁，利得科技有限公司执行董事，现任利得科技有限公司董事长兼总经理。

陈伟忠先生：独立董事

陈伟忠，教授，独立董事，博士研究生。毕业于西安交通大学，获管理学博士学位。长期从事金融研究及管理工作。1984年起历任西安交通大学教研室主任、系主任、博导，同济大学经管学院现代金融研究所所长。现担任同济大学经济金融系主任、同济大学上海期货研究院院长、应用经济学学术委员会主任、中国金融学会金融工程分会理事、上海金融学会常务理事。

沈宏山先生：独立董事

沈宏山先生：独立董事。毕业于北京大学法学院，获法学硕士学位。曾任君安证券、国泰君安证券法律事务部、人力资源部、收购兼并部门业务董事，方正证券法律事务部总经理等职务。爱建证券有限公司、上海辰光医疗股份有限公司独立董事，安信证券内核委员。现任德恒上海律师事务所主任，高级合伙人。

严荣荣女士：独立董事

严荣荣，独立董事，硕士研究生。毕业于西北政法学院、美国纽约大学法学院。曾任 Gless Lutz & Partner 律师事务所法律顾问。现任君合律师事务所合伙人。中华全国律师协会会员和上海市律师协会会员。

## 2、监事会成员

徐剑钧先生：监事会主席

徐剑钧，监事会主席。博士研究生，高级经济师。毕业于陕西师范大学、复旦大学及西安西北大学，分别获理学硕士（基础数学）和经济学博士学位。曾在英国爱丁堡大学从事资本市场研究工作，24 年证券从业经历。1995 年 3 月起任陕西省证监局市场部负责人。1995 年 10 月起任陕西证券有限公司总经理助理。2001 年起任西部证券股份有限公司副总经理。2010 年 7 月加入本公司，历任公司督察长、董事长，自 2018 年 10 月起任公司监事会主席。

何方先生：监事

何方先生，监事。毕业于上海财经大学，硕士研究生学历。曾任汉唐证券资产管理部研究员、西部证券投资管理总部投资经理、西部证券投资管理总部副总经理、西部证券投资管理总部总经理、西部证券总经理助理兼上海第一分公司总经理、西部证券副总经理。现任西部证券总经理。

杨超先生：监事

杨超先生，监事，硕士学历。先后毕业于上海同济大学信息工程专业，获学士学位；上海交通大学软件工程专业，获硕士学位。曾任汇添富基金高级 IT 经理、中银国际证券信息技术部经理、华夏证券软件开发工程师。现任公司总经理助理兼事业十二部总经理。

谢娟女士：监事

谢娟女士，监事。毕业于四川大学行政管理专业，获硕士学位。曾任中国银行重庆市分行助理风险经理、南洋商业银行总行风险主任。现任公司风险管理部副总经理（主持工作）。

## 3、公司高级管理人员

刘建武先生：董事长

博士研究生，高级经济师。毕业于陕西财经学院、西北大学，分别获工业经济学硕士和政治经济学博士学位。16 年证券从业经历。1991 年起在陕西省计

划委员会经济研究所工作。1993年起在西安市人民政府办公厅工作，历任财贸、金融、经济管理副处级秘书，科技文教管理处处长。2001年起任西安高新管委会管理办副主任及西安高科集团公司副总经理。2002年起任西安市投资服务中心投资管理副主任。2003年起任陕西省投资集团公司金融证券部经理。2005年10月起任西部证券股份有限公司董事长、党委书记。目前兼任陕西能源集团有限公司董事。2014年10月加入本公司，历任公司董事，自2018年10月起任公司董事长。

贺燕萍女士：总经理

贺燕萍女士，总经理，硕士研究生，高级经济师。毕业于中国社会科学院研究生院，获经济学硕士学位，21年证券从业经历。1990年起任北京市永安宾馆业务主管。1998年起任华夏证券股份有限公司研究所客户部经理。2006年起任中信建投证券股份有限公司机构销售部总经理助理。2007年起在光大证券股份有限公司工作，历任销售交易部副总经理、销售交易部总经理。2013年1月起任光大证券资产管理有限公司总经理。2013年8月起任国泰基金管理有限公司副总经理。自2015年11月起任公司总经理。

赵毅先生：督察长

赵毅先生，督察长，硕士研究生，毕业于加拿大卡尔加里大学工商管理硕士专业，23年证券从业经历。1988年起任北京大学社会科学处职员。1993年起任北京市波姆红外技术公司总经理助理。1996年起任华夏证券有限责任公司高级投资经理。2007年起在华夏基金管理有限公司工作，历任股票分析师、风险管理部总经理助理、风险管理部总经理，自2016年9月起任公司督察长。

#### 4、本基金基金经理

韩丽楠女士，事业三部副总经理，硕士研究生，毕业于英国约克大学经济与金融专业，获理学硕士学位。14年证券从业年限。曾任渣打银行国际管理培训生、诺德基金管理有限公司研究员、上海元普投资管理有限公司固定收益投资总监。2015年5月加入西部利得基金管理有限公司，曾任基金经理助理，现任事业三部副总经理。自2015年8月起担任西部利得成长精选灵活配置混合型证券投资基金、西部利得多策略优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，自2016年2月起担任西部利得新盈灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，自2016年3月起担任西部利得行业主题优选灵活配置混合型证券投资基金的基

金经理，自 2016 年 6 月起担任西部利得稳健双利债券型证券投资基金的基金经理，自 2016 年 8 月至 2017 年 10 月担任西部利得合享债券型证券投资基金的基金经理，自 2016 年 9 月至 2017 年 10 月担任西部利得合赢债券型证券投资基金的基金经理，自 2016 年 12 月至 2018 年 8 月担任西部利得天添金货币市场基金的基金经理，自 2016 年 12 月起担任西部利得祥运灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，自 2017 年 2 月至 2018 年 4 月担任西部利得汇逸债券型证券投资基金的基金经理，自 2017 年 2 月起担任西部利得新动力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，自 2017 年 3 月至 2018 年 5 月担任西部利得汇享债券型证券投资基金的基金经理，自 2017 年 8 月起担任西部利得天添益货币市场基金的基金经理，自 2018 年 5 月起担任西部利得汇盈债券型证券投资基金的基金经理。

林静女士，基金经理，硕士毕业于上海财经大学金融学专业。11 年证券从业年限。曾任东方证券研究所研究员、国联安基金管理有限公司高级研究员。2016 年 11 月加入本公司，自 2017 年 3 月起担任西部利得稳健双利债券型证券投资基金、西部利得新动力灵活配置混合型证券投资基金、西部利得祥运灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，自 2017 年 6 月起担任西部利得新富灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

#### 5、基金投资决策委员会成员

本基金采取集体投资决策制度。

投资决策委员会由下述委员组成：

投资决策委员会主任委员，吴江先生，总经理助理、投资总监，硕士毕业于复旦大学财政学专业。12 年证券从业年限。曾任兴业银行资金营运中心交易员、农银汇理基金管理有限公司基金经理、固定收益部副总经理。2016 年 8 月加入本公司，现任总经理助理、投资总监。

投资决策委员会副主任委员，刘荟女士，公募投资部副总经理，毕业于辽宁大学应用数学专业。10 年证券从业年限。曾任群益证券股份有限公司研究员。2014 年 1 月加入本公司，曾任研究员，现任公募投资部副总经理、基金经理。自 2016 年 1 月起担任西部利得策略优选混合型证券投资基金的基金经理，自 2017 年 7 月起担任西部利得祥盈债券型证券投资基金的基金经理，自 2018 年 6 月西部利得景程灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

投资决策委员会委员，韩丽楠女士，事业三部副总经理、基金经理，硕士研究生，毕业于英国约克大学经济与金融专业，获理学硕士学位。14年证券从业年限。曾任渣打银行国际管理培训生、诺德基金管理有限公司研究员、上海元普投资管理有限公司固定收益投资总监。2015年5月加入西部利得基金管理有限公司，曾任基金经理助理，现任事业三部副总经理、基金经理。自2015年8月起担任西部利得成长精选灵活配置混合型证券投资基金、西部利得多策略优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，自2016年2月起担任西部利得新盈灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，自2016年3月起担任西部利得行业主题优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，自2016年6月起担任西部利得稳健双利债券型证券投资基金的基金经理，自2016年12月起担任西部利得祥运灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，自2017年2月起担任西部利得新动力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，自2017年8月起担任西部利得天添益货币市场基金的基金经理，自2018年5月起担任西部利得汇盈债券型证券投资基金的基金经理。

投资决策委员会委员，陈保国先生，研究部副总经理，硕士毕业于上海理工大学系统理论专业，获理学硕士学位。8年证券从业年限。曾任西藏同信证券有限公司研究员、上海嘉华投资有限公司研究员。2016年1月加入我公司，现任研究部副总经理（主持工作）。

投资决策委员会委员，盛丰衍先生，基金经理，硕士毕业于复旦大学计算机应用技术专业。5年证券从业年限。曾任光大证券股份有限公司权益投资助理、上海光大证券资产管理有限公司研究员、兴证证券资产管理有限公司量化研究员。2016年10月加入本公司，现任基金经理。自2016年11月起担任西部利得中证500等权重指数分级证券投资基金的基金经理，自2018年1月起担任西部利得久安回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，自2018年7月起担任西部利得中证国有企业红利指数增强型证券投资基金（LOF）的基金经理。

投资决策委员会委员，刘心峰先生，基金经理，英国曼彻斯特大学数量金融专业，获得理学硕士学位。6年证券从业年限。曾任中德安联人寿保险有限公司交易员、华泰柏瑞基金管理有限公司交易员。2016年11月加入本公司，现任基金经理。自2017年2月起担任西部利得天添鑫货币市场基金、西部利得

天添富货币市场基金、西部利得合享债券型证券投资基金的基金经理，自 2017 年 8 月起担任西部利得天添益货币市场基金的基金经理。

投资决策委员会委员，严志勇先生，基金经理，硕士毕业于复旦大学数量经济学专业，获得理学硕士学位。7 年证券从业年限。曾任上海强生有限公司管理培训生、中国国际金融股份有限公司研究员、中证指数有限公司研究员、兴业证券股份有限公司研究员、鑫元基金管理有限公司债券研究主管。2017 年 5 月加入本公司，现任基金经理。自 2017 年 8 月起担任西部利得汇享债券型证券投资基金、西部利得祥盈债券型证券投资基金的基金经理，自 2018 年 4 月起担任西部利得合享债券型证券投资基金的基金经理，自 2018 年 6 月西部利得景程灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

投资决策委员会委员，崔惠军先生，公募投资部副总经理、权益量化投资总监、基金经理。硕士毕业于中国人民大学数量经济学专业，获得理学硕士学位。17 年证券从业年限。曾任世纪证券证券投资部分析师、中企东方资产管理有限公司投资策略部高级经理、东方证券金融衍生品业务总部总经理助理、鹏华基金量化及衍生品投资部总经理助理。于 2017 年 8 月加入本公司，现任公募投资部副总经理、权益量化投资总监、基金经理。自 2018 年 1 月起担任西部利得个股精选股票型证券投资基金的基金经理，自 2018 年 7 月起担任西部利得中证国有企业红利指数增强型证券投资基金（LOF）的基金经理。

投资决策委员会委员，张翔先生，事业十六部总经理、基金经理，硕士毕业于荷兰代尔夫特理工大学概率、风险及统计专业，获得理学硕士学位。12 年证券从业年限。曾任上海汇富融略投资顾问有限公司助理副总裁、派杰亚洲证券有限公司研究员及产品协调员、华富基金管理有限公司高级经理、德邦基金管理有限公司基金经理。2017 年 3 月加入本公司，现任事业十六部总经理、基金经理。自 2017 年 10 月起担任西部利得得尊纯债债券型证券投资基金、西部利得新润灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

6. 上述人员之间不存在近亲属关系。

### 三、基金管理人的职责

1. 依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

2. 办理基金备案手续；



3. 对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；
4. 按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；
5. 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
6. 编制季度、半年度和年度基金报告；
7. 计算并公告基金资产及基金份额（参考）净值，确定基金份额申购、赎回价格；
8. 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；
9. 按照规定召集基金份额持有人大会；
10. 保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
11. 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
12. 有关法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他职责。

#### **四、基金管理人的承诺**

1. 基金管理人将遵守《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》等法律法规的相关规定，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违法违规行为的发生。

2. 基金管理人不得从事下列行为：

- (1) 将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
- (2) 不公平地对待其管理的不同基金财产；
- (3) 利用基金财产或职务之便为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；
- (4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- (5) 侵占、挪用基金财产；
- (6) 泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
- (7) 玩忽职守，不按照规定履行职责；
- (8) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。

3. 基金经理承诺

- (1) 依照有关法律法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持

有人谋取最大利益；

(2) 不利用职务之便为自己、代理人、代表人、受雇人或任何其他第三人牟取不当利益；

(3) 不泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；

(4) 不得以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

## **五、基金管理人内部控制制度及风险控制体系**

### **1. 内部控制制度概述**

公司内部控制是指公司为合理地评价和控制风险，保证经营运作符合公司的发展规划，防范和化解风险，保护投资人、公司和公司股东的合法权益，在充分考虑内外部环境的基础上，通过建立组织机制、运用管理方法、实施操作程序与控制措施所形成的风险导向型的内部控制系统。

#### **(1) 内部控制的原则**

1) 健全性原则：内部控制须覆盖公司的各项业务、各个部门或机构和各级岗位，并渗透到各项业务过程，涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个环节；

2) 有效性原则：通过科学的内控手段和方法，建立合理适用的内控程序，并适时调整和不断完善，维护内控制度的有效执行；

3) 独立性原则：公司各机构、部门和岗位的职责应当保持相对独立，公司基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离；

4) 防火墙原则：公司管理的基金资产、自有资产以及其他资产的运作应当分离，基金投资研究、决策、执行、清算、评估等部门和岗位，应当在物理上和制度上适当隔离，以达到风险防范的目的；

5) 相互制约原则：公司组织机构、内部部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡；

6) 成本效益原则：公司运用科学化的经营管理方法降低运作成本，提高经济效益，以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

#### **(2) 内部控制的制度系统**

公司内部控制制度系统包括四个层次：第一个层次是国家有关法律法规和公司章程；第二个层次是包括内部控制大纲在内的基本管理制度；第三个层次是部门管理制度；第四个层次是各项具体业务规则。

1) 国家有关法律法规是公司一切制度的最高准则，公司章程是公司管理制度的基本原则，公司章程、董事会及其下属的专门委员会的管理规定是制订各项制度的基础和前提；

2) 内部控制大纲是依据国家相关法律法规、监管机构的有关规定以及公司章程规定的内控原则而确定的方针和策略，是内部控制纲领性文件，对制订各项基本管理制度和部门业务规章起着指导性的作用。公司内部控制是公司为实现内部控制目标而建立的一系列组织机制、管理办法、操作程序与控制措施的总称；

3) 公司基本管理制度包括了以下内容：内部控制大纲、风险控制制度、投资管理制度、监察稽核制度、基金会计制度、信息披露制度、信息技术管理制度、紧急应变制度、公司财务管理制度、人力资源管理制度和资料档案管理制度等；

4) 部门管理制度是根据公司章程和内控大纲等文件的要求，在基本管理制度的基础上，对各部门内部管理的具体说明，包括主要职责、岗位设置、岗位职责及操作规程等；

5) 各项具体业务规则是针对公司的某项具体业务，对该业务的操作要求、流程、授权等作出的详细完整的规定。

### (3) 内部控制的要素

公司内部控制的要素主要包括：控制环境、风险评估、控制活动、信息沟通及内部监控。

#### 1) 控制环境

公司设立董事会，向股东会负责。董事会由 7 名董事组成，其中独立董事 3 名。董事会下设合规审核委员会、资格审查委员会及薪酬与考核委员会等各专门委员会。董事会是股东会的执行机构，依照法律法规及公司章程的规定贯彻执行股东会的决议，行使决定公司经营和投资方案等重大职权。公司设立监事会，向股东会负责，依照《公司法》和公司章程对公司经营管理活动、董事和公司管理层的经营管理行为进行监督。公司的日常经营管理工作在总经理的领导下运行，总经理直接对董事会负责。

公司设立督察长，对董事会负责，负责监督检查基金和公司运作的合法合规情况及公司内部风险控制情况，行使法律法规及公司章程规定的职权。

## 2) 风险评估

A、董事会下属的合规审核委员会对公司制度的合规性和有效性进行评估，并对公司与基金运作的合法合规性进行监督检查，以协助董事会确定风险管理目标，提出风险防范措施的建议，建立并有效维持公司内部控制系统，确保公司规范健康发展；

B、公司经营层下设风险控制委员会，向总经理负责，负责对基金投资风险控制及公司运作风险控制的有效性进行分析和评估，评估公司面临的风险事项将导致公司在承担法律责任、社会和公众责任、经济损失或是在以上三个领域的任何组合损失，以及对商业机会、运营基础以及法律责任等方面的影响，具体包括负责审核公司的风险控制制度和风险管理流程，识别、监控与管理公司整体风险；

C、公司经营层下设投资决策委员会，负责对公司的基金产品及各投资品种的市场风险、流动性风险、信用风险等进行风险分析和评估，采用风险量化技术和风险限额控制等方法把控基金投资整体风险；

D、各业务部门是公司内部控制的具体实施单位，负责对职责范围内的业务所面临的风险进行识别和评估。各业务部门在公司基本管理制度的基础上，根据具体情况制订本部门的业务管理规定、操作流程及内部控制规定，对业务风险进行控制。部门管理层定期对部门内风险进行评估，确定风险管理措施并实施，监控风险管理绩效，以不断改进风险管理能力。

## 3) 控制活动

公司根据自身经营的特点，从组织结构、操作流程及报告制度等多种管理方式入手，设立顺序递进、权责统一、严密有效的内控防线：

A、各岗位职责明确，有详细的岗位说明书和业务流程，各岗位人员在上岗前均应知悉并以书面方式承诺遵守，在授权范围内承担责任；

B、建立重要业务处理凭据传递和信息沟通机制，相关部门和岗位之间相互监督制衡；

C、公司督察长和内部监察稽核部门独立于其他部门，对内部控制制度的执行情况实行严格的检查和反馈。

## 4) 信息与沟通

公司采用适当、有效的信息系统，识别、采集、加工并相互交流经营活动

所需的一切信息。信息系统须保证业务经营信息和财务会计资料的真实性、准确性和完整性，必须能实现公司内部信息的沟通和共享，促进公司内部管理顺畅实施。公司根据组织架构和授权制度，建立清晰的业务报告系统，保障信息的及时、准确的传递，并且维护渠道的畅通。

#### 5) 内部监控

公司内部控制的监督系统由监事会、督察长和监察稽核部等组成，监督系统通过其监督职能的行使确保公司决策系统和执行系统合法、合规、高效地运作。根据市场环境、新的金融工具、新的技术应用和新的法律法规等情况，公司组织专门部门对原有的内部控制进行全面的自查，审查其合法合规性、合理性和有效性，适时改进。

#### (4) 内部控制的检测

内部控制检测的过程包括如下：

- 1) 内控制度设计检测；
- 2) 内部控制执行情况测试；
- 3) 将测试结果与内控目标进行比较；
- 4) 形成测试报告，得出继续运行或纠偏的结论。

#### (5) 风险控制体系

公司风险控制体系包括以下三个层次：

- 1) 第一层次为公司各业务相关部门对各自部门的风险控制负责；
- 2) 第二层次为总经理、风险控制委员会及监察稽核部；
- 3) 第三层次为董事会、合规审核委员会及督察长；
- 4) 为了有效地控制公司内部风险，公司各业务部门建立第一道监控防线。

独立的监察稽核部，对各业务部门的各项业务全面实行监督反馈，必要时对有关部门进行不定期突击检查。同时，监察稽核部对于日常操作中发现的或认为具有潜在可能的问题出具监察稽核报告向风险控制委员会和总经理报告，形成第二道监控防线。督察长在工作上向中国证监会和董事会负责，并将检查结果汇报合规审核委员会和董事会，形成第三道监控防线。

### 3. 基金管理人关于内部控制的声明

(1) 本基金管理人知晓建立、实施和维持内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任；

- (2) 上述关于内部控制的披露真实、准确；
- (3) 本公司承诺将根据市场环境变化及公司发展不断完善内部控制制度。

## 第四部分基金托管人

### 一、基金托管人情况

#### 1、基本情况

名称：平安银行股份有限公司

住所：广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号

办公地址：广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号

法定代表人：谢永林

成立日期：1987 年 12 月 22 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：17,170,411,366 元

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监许可[2008]1037 号

联系人：高希泉

联系电话：(0755) 2219 7701

#### 1、平安银行基本情况

平安银行股份有限公司是一家总部设在深圳的全国性股份制商业银行（深圳证券交易所简称：平安银行，证券代码 000001）。其前身是深圳发展银行股份有限公司，于 2012 年 6 月吸收合并原平安银行并于同年 7 月更名为平安银行。中国平安保险（集团）股份有限公司及其子公司合计持有平安银行 58% 的股份，为平安银行的控股股东。截至 2018 年 9 月末，平安银行有 77 家分行，共 1,056 家营业机构。

2018 年 1-9 月，平安银行实现营业收入 866.64 亿元（同比增长 8.6%）、净利润 204.56 亿元（同比增长 6.8%）、资产总额 33,520.56 亿元（较上年末增长 3.2%）、吸收存款余额 21,346.41 亿元（较上年末增长 6.7%）、发放贷款和垫款总额（含贴现）19,220.47 亿元（较上年末增幅 12.8%）。

平安银行总行设资产托管事业部，下设市场拓展处、创新发展处、估值核算处、资金清算处、规划发展处、IT 系统支持处、督察合规处、基金服务中心 8 个处室，目前部门人员为 60 人。

#### 2、主要人员情况

陈正涛,男,中共党员, 经济学硕士、高级经济师、高级理财规划师、国际注册私人银行家, 具备《中国证券业执业证书》。长期从事商业银行工作, 具有本外币资金清算, 银行经营管理及基金托管业务的经营管理经验。1985 年 7 月至 1993 年 2 月在武汉金融高等专科学校任教; 1993 年 3 月至 1993 年 7 月在招商银行武汉分行任客户经理; 1993 年 8 月至 1999 年 2 月在招行武汉分行武昌支行任计划信贷部经理、行长助理; 1999 年 3 月—2000 年 1 月在招行武汉分行青山支行任行长助理; 2000 年 2 月至 2001 年 7 月在招行武汉分行公司银行部任副总经理; 2001 年 8 月至 2003 年 2 月在招行武汉分行解放公园支行任行长; 2003 年 3 月至 2005 年 4 月在招行武汉分行机构业务部任总经理; 2005 年 5 月至 2007 年 6 月在招行武汉分行硚口支行任行长; 2007 年 7 月至 2008 年 1 月在招行武汉分行同业银行部任总经理; 自 2008 年 2 月加盟平安银行先后任公司业务部总经理助理、产品及交易银行部副总经理, 一直负责公司银行产品开发与管理, 全面掌握银行产品包括托管业务产品的运作、营销和管理, 尤其是对商业银行有关的各项监管政策比较熟悉。2011 年 12 月任平安银行资产托管部副总经理; 2013 年 5 月起任平安银行资产托管事业部副总裁(主持工作); 2015 年 3 月 5 日起任平安银行资产托管事业部总裁。

### 3、基金托管业务经营情况

2008 年 8 月 15 日获得中国证监会、银监会核准开办证券投资基金托管业务。

截至 2018 年 11 月末, 平安银行股份有限公司托管净值规模合计 5.76 万亿, 托管证券投资基金共 113 只, 具体包括华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金、华富量子生命力股票型证券投资基金、长信可转债债券型证券投资基金、招商保证金快线货币市场基金、平安日增利货币市场基金、新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金、东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金、平安财富宝货币市场基金、红塔红土盛世普益灵活配置混合型发起式证券投资基金、新华活期添利货币市场证券投资基金、民生加银优选股票型证券投资基金、新华增盈回报债券型证券投资基金、鹏华安盈宝货币市场基金、平安新鑫先锋混合型证券投资基金、新华万银多元策略灵活配置混合型证券投资基金、中海进取收益灵活配置混合型证券投资基金、东吴移动互联灵活配置混合型证券投资基金、平安智慧中国灵活配置混合型证券投资基金、国金通用鑫新灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、嘉合磐石混合型证券投资基金、平安鑫享混合型证



券投资基金、广发聚盛灵活配置混合型证券投资基金、鹏华弘安灵活配置混合型证券投资基金、博时裕泰纯债债券型证券投资基金、德邦增利货币市场基金、中海顺鑫保本混合型证券投资基金、民生加银新收益债券型证券投资基金、东方红睿轩沪港深灵活配置混合型证券投资基金、浙商汇金转型升级灵活配置混合型证券投资基金、广发安泽回报纯债债券型证券投资基金、博时裕景纯债债券型证券投资基金、平安惠盈纯债债券型证券投资基金、长城久源保本混合型证券投资基金、平安安盈保本混合型证券投资基金、嘉实稳盛债券型证券投资基金、长信先锐债券型证券投资基金、华润元大现金通货币市场基金、平安鼎信定期开放债券型证券投资基金、平安鼎泰灵活配置混合型证券投资基金、南方荣欢定期开放混合型发起式证券投资基金、长信富平纯债一年定期开放债券型证券投资基金、中海合嘉增强收益债券型证券投资基金、富兰克林国海新活力灵活配置混合型证券投资基金、南方颐元债券型发起式证券投资基金、鹏华弘惠灵活配置混合型证券投资基金、鹏华兴安定期开放灵活配置混合型证券投资基金、西部利得天添利货币市场基金、鹏华弘腾灵活配置混合型证券投资基金、博时安祺一年定期开放债券型证券投资基金、安信活期宝货币市场基金、广发鑫源灵活配置混合型证券投资基金、平安惠享纯债债券型证券投资基金、广发安悦回报灵活配置混合型证券投资基金、平安惠融纯债债券型证券投资基金、广发沪港深新起点股票型证券投资基金、平安惠金定期开放债券型证券投资基金、鹏华弘腾成长多策略灵活配置混合型证券投资基金、博时丰达纯债 6 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、英大睿鑫灵活配置混合型证券投资基金、西部利得新动力灵活配置混合型证券投资基金、平安惠利纯债债券型证券投资基金、广发鑫盛 18 个月定期开放混合型证券投资基金、长盛盛丰灵活配置混合型证券投资基金、鹏华丰盈债券型证券投资基金、平安惠隆纯债债券型证券投资基金、平安金管家货币市场基金、平安鑫利定期开放灵活配置混合型证券投资基金、国联安睿智定期开放混合型证券投资基金、华泰柏瑞享利灵活配置混合型证券投资基金、广发汇平一年定期开放债券型证券投资基金、平安中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金、前海开源聚财宝货币市场基金、招商稳阳定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长盛盛瑞灵活配置混合型证券投资基金、前海开源沪港深隆鑫灵活配置混合型证券投资基金、金鹰添荣纯债债券型证券投资基金、西部利得汇享债券型证券投资基金、鹏华丰玉债券型

证券投资基金、华安睿安定期开放混合型证券投资基金、西部利得久安回报灵活配置混合型证券投资基金、广发汇安 18 个月定期开放债券型证券投资基金、上投摩根岁岁金定期开放债券型证券投资基金、平安转型创新灵活配置混合型证券投资基金、南方和元债券型证券投资基金、中金丰沃灵活配置混合型证券投资基金、兴银消费新趋势灵活配置混合型证券投资基金、南方高元债券型发起式证券投资基金、易方达瑞智灵活配置混合型证券投资基金、中金丰颐灵活配置混合型证券投资基金、中金丰鸿灵活配置混合型证券投资基金、平安惠泽纯债债券型证券投资基金、南方智造未来股票型证券投资基金、万家安弘纯债一年定期开放债券型证券投资基金、平安量化先锋混合型发起式证券投资基金、平安沪深 300 指数量化增强证券投资基金、平安合正定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、嘉合磐通债券型证券投资基金、华夏鼎旺三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰安惠收益定期开放债券型证券投资基金、博时富安纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、富荣福鑫灵活配置混合型证券投资基金、富荣福锦混合型证券投资基金、前海开源丰鑫灵活配置混合型证券投资基金、平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金（ETF）、汇添富鑫成定期开放债券型发起式证券投资基金、平安合韵定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、易方达恒安定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券汇享定期开放债券型发起式证券投资基金、平安 MSCI 中国 A 股低波动交易型开放式指数证券投资基金（ETF）、平安合悦定期开放债券型发起式证券投资基金、平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中金瑞祥灵活配置混合型证券投资基金、招商添荣 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金。

## 二、基金托管人的内部风险控制制度说明

### 1、内部控制目标

作为基金托管人，平安银行股份有限公司严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管要求，自觉形成守法经营、规范运作的经营理念和经营风格；确保基金财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益；确保内部控制和风险管理体系的有效性；防范和化解经营风险，确保业务的安全、稳健运行，促进经营目标的实现。

### 2、内部控制组织结构

平安银行股份有限公司设有总行独立一级部门资产托管事业部，是全行资产托管业务的管理和运营部门，专门配备了专职内部监察稽核人员负责托管业务的内部控制和风险管理工作，具有独立行使监督稽核工作的职权和能力。

### 3、内部控制制度及措施

资产托管事业部具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；取得基金从业资格的人员符合监管要求；业务管理严格实行复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

## 三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

### 1、监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。利用行业普遍使用的“资产托管业务系统——监控子系统”，严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督，并定期编写基金投资运作监督报告，报送中国证监会。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

### 2、监督流程

(1) 每工作日按时通过监控子系统，对各基金投资运作比例控制指标进行例行监控，发现投资比例超标等异常情况，向基金管理人发出书面通知，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，并及时报告中国证监会。

(2) 收到基金管理人的投资指令后，对涉及各基金的投资范围、投资对象及交易对手等内容进行合法合规性监督。

(3) 根据基金投资运作监督情况，定期编写基金投资运作监督报告，对各基金投资运作的合法合规性、投资独立性和风格显著性等方面进行评价，报送中国证监会。

(4) 通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求管理人进行解释或举证，并及时报告中国证监会。

## 第五部分相关服务机构

### 一、基金份额销售机构

#### 1. 直销机构：

名称：西部利得基金管理有限公司直销柜台及电子交易平台

住所：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 11 层 02、03 单元

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 11 层 02、03 单元

法定代表人：刘建武

联系人：陈眉媚

联系电话：400-700-7818

网址：[www.westleadfund.com](http://www.westleadfund.com)

#### 2. 代销机构：

##### 1) 西部证券股份有限公司

地址：西安市新城东大街319号8幢10000室

法定代表人：刘建武

联系人：梁承华

客服热线：95582

网址：[www.westsecu.com](http://www.westsecu.com)

##### 2) 上海利得基金销售有限公司

地址：上海浦东新区峨山路91弄61号10号楼14楼

法定代表人：李兴春

联系人：曹怡晨

客服热线：400-921-7755

网址：[www.leadfund.com.cn](http://www.leadfund.com.cn)

##### 3) 中国银行股份有限公司

地址：北京市西城区复兴门内大街1号

法定代表人：田国立

联系人：陈宏源

客服热线：95566

网址：<http://www.boc.cn/>

4) 招商银行股份有限公司

地址：深圳市福田区深南大道7088号

法定代表人：李建红

联系人：周嘉谊

客服热线：95555

网址：[www.cmbchina.com](http://www.cmbchina.com)

5) 平安银行股份有限公司

地址：广东省深圳市罗湖区深南东路5047号

法定代表人：孙建一

联系人：鲁承文

客服热线：95511-3

网址：<http://bank.pingan.com>

6) 光大证券股份有限公司

地址：上海市新闻路 1508 号

法定代表人：薛峰

联系人：刘晨

客服热线：95525、400-8888-788

网址：[www.ebscn.com](http://www.ebscn.com)

7) 中信证券股份有限公司

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：张佑君

联系人：侯艳红

客服热线：95548

网址：<http://www.cs.ecitic.com/>

8) 中信证券（山东）有限责任公司

地址：青岛市市南区东海西路28号龙翔广场东座5层

法定代表人：杨宝林

联系人：孙秋月

客服热线：95548

网址：[www.zxwt.com.cn](http://www.zxwt.com.cn)

9) 中国银河证券股份有限公司

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：田薇

客服热线：400-888-8888

网址：[www.chinastock.com.cn](http://www.chinastock.com.cn)

10) 中银国际证券有限责任公司

地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39F

法定代表人：钱卫

联系人：王炜哲

客服热线：400-620-8888

网址：[www.bocichina.com](http://www.bocichina.com)

11) 中泰证券股份有限公司

地址：山东省济南市市中区经七路 86 号

法定代表人：李玮

联系人：吴阳

客服热线：95538

网址：[www.zts.com.cn](http://www.zts.com.cn)

12) 东海证券股份有限公司

地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦

法定代表人：刘化军

联系人：王一彦

客服热线：95531；400-8888-588

网址：[www.longone.com.cn](http://www.longone.com.cn)

13) 申万宏源证券有限公司

地址：上海市徐汇区长乐路989号45层

法定代表人：李梅

联系人：黄莹

客服热线：95523或4008895523

网址：www.swhysc.com

14) 申万宏源西部证券有限公司

地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室

法定代表人：韩志谦

联系人：王怀春

客服热线：0991-2307105

网址：www.hysec.com

15) 中信建投证券股份有限公司

地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：王常青

联系人：魏明

客服热线：400-8888-108

网址：www.csc108.com

16) 招商证券股份有限公司

地址：深圳市福田区益田路江苏大厦38-45层

法定代表人：宫少林

联系人：黄婵君

客服热线：95565、4008888111

网址：www.newone.com.cn

17) 上海华信证券有限责任公司

地址：上海市黄浦区南京西路399号明天广场18-23层

法定代表人：郭林

联系人：李颖

客服热线：4008205999

网址：www.shhxzq.com

18) 联储证券有限责任公司

地址：广东省深圳市福田区华强北路圣廷苑酒店B座26楼

法定代表人：沙常明

联系人：丁倩云



客服热线：4006206868

网址：[www.lczq.com](http://www.lczq.com)

19) 长城证券股份有限公司

地址：深圳市福田区深南大道6008号报业大厦14楼、16楼、17楼

法定代表人：何伟

联系人：金夏

客服热线：400-6666-888

网址：<http://www.cgws.com>

20) 世纪证券股份有限公司

地址：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦40-42 层

法定代表人：姜味军

联系人：王雯

客服热线：4008-323-000

网址：<http://www.csc.com.cn/>

21) 平安证券有限责任公司

地址：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 号

法定代表人：谢永林

联系人：石静武

客服热线：95511-820

网址：<http://stock.pingan.com>

22) 国金证券股份有限公司

地址：成都市青羊区东城根上街95号

法定代表人：冉云

联系人：刘婧漪、贾鹏

客服热线：95310

网址：[www.gjzq.com.cn](http://www.gjzq.com.cn)

23) 信达证券股份有限公司

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：尹旭航

客服热线：95321

网址：www.cindasc.com

24) 安信证券股份有限公司

地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元

法定代表人：王连志

联系人：陈剑虹

客服电话：95517

网址：www.essence.com.cn

25) 上海天天基金销售有限公司

地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

法定代表人：其实

联系人：朱钰

客服热线：400-1818-188

网址：www.1234567.com.cn

26) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

地址：上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层

法定代表人：张跃伟

客服热线：400-089-1289

网址：www.erichfund.com

27) 北京钱景财富投资管理有限公司

地址：北京市海淀区丹棱街丹棱 SOHO10 层

法定代表人：赵荣春

联系人：盛海娟

客服热线：400-893-6885

网址：www.qianjing.com

28) 浙江同花顺基金销售有限公司

地址：浙江省杭州市翠柏路 7 号杭州电子商务产业园 2 号楼 2 楼21

法定代表人：凌顺平

联系人：杨翼

客服热线：4008-773-772

网址：www.5ifund.com

29) 北京汇成基金销售有限公司

地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108 号

法定代表人：王伟刚

联系人：丁向坤

客服热线：400-619-9059

网址：www.fundzone.cn

30) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼

法定代表人：陈柏青

联系人：张裕

客服热线：400-0766-123

网址：www.fund123.cn

31) 泛华普益基金销售有限公司

地址：四川省成都市锦江区东大街 99 号平安金融中心 1501

法定代表人：于海锋

联系人：陈金红

客服热线：400-8878-566

网址：www.pyfund.cn

32) 大泰金石基金销售有限公司

地址：南京市建邺区江东中路222号南京奥体中心现代五项馆2105室

法定代表人：袁顾明

联系人：朱海涛

客服热线：4009282266

网址：www.dtfunds.com

33) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#

法定代表人：张彦

联系人：文雯

客服热线：4001661188

网址：<http://www.new-rand.cn>

34) 上海万得投资顾问有限公司

地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路33号11楼B座

法定代表人：王廷富

联系人：徐亚丹

客服热线：400-821-0203

网址：[www.520fund.com.cn](http://www.520fund.com.cn)

35) 奕丰金融服务（深圳）有限公司

地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入住深圳市前海商务秘书有限公司）

法定代表人：TAN YIK KUAN

联系人：叶健

客服热线：400-684-0500

网址：[www.ifastps.com.cn](http://www.ifastps.com.cn)

36) 上海好买基金销售有限公司

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：王诗琦

客服热线：400-700-9665

网址：[www.ehowbuy.com](http://www.ehowbuy.com)

37) 泰诚财富基金销售（大连）有限公司

地址：辽宁省大连市沙河口区星海公园3号

法定代表人：林卓

联系人：姜焕洋

客服热线：0411-88891212

网址：<http://www.taichengcaifu.com>

38) 武汉市伯嘉基金销售有限公司

地址：湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际SOHO城（一期）第七幢23层1号4号

法定代表人：陶捷

联系人：徐博

客服热线：400-027-9899

网址：[www.buyfunds.cn](http://www.buyfunds.cn)

39) 天津万家财富资产管理有限公司

地址：北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦5层

法定代表人：李修辞

联系人：邵玉磊

客服热线：010-59013825

网址：<http://www.wanjiawealth.com/>

40) 北京晟视天下基金销售有限公司

地址：北京市怀柔区九渡河镇黄坎村735号03室

法定代表人：蒋煜

联系人：殷雯

客服热线：400-818-8866

网址：[www.shengshiview.com](http://www.shengshiview.com)

41) 海银基金销售有限公司

地址：上海市浦东新区银城中路8号4楼

法定代表人：刘惠

联系人：毛林

客服热线：400-808-1016

网址：[www.fundhaiyin.com](http://www.fundhaiyin.com)

42) 成都华弈恒信财富投资管理有限公司

地址：成都市高新区天府大道中段199号棕榈泉国际中心1幢1单元19层  
4号

法定代表人：赵壁

联系人：谭佳洲

客服热线：400-8010-009

网址：<http://www.huayihengxin.com>

43) 喜鹊财富基金销售有限公司

地址：西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦1513室

法定代表人：陈皓

联系人：曹砚财、张萌

客服热线：0891-6177483

网址：www.xiquefund.com

44) 上海挖财基金销售有限公司

地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室

法定代表人：胡燕亮

联系人：李娟

客服热线：021-50810673

网址：www.wacaijijin.com

45) 上海华夏财富投资管理有限公司

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：毛淮平

联系人：仲秋玥

客服热线：400-817-5666

网址：www.amcfortune.com

46) 西部期货有限公司

地址：陕西省西安市新城东大街319号8幢10000室9层

法定代表人：陈杰

联系人：闫海

客服热线：400-688-6896

网址：www.westfutu.com

47) 上海基煜基金销售有限公司

地址：上海市昆明路518号北美广场A1002-A1003室

法定代表人：王翔

联系人：吴鸿飞

客服热线：400-820-5369

网址：www.jiyufund.com.cn

48) 大河财富基金销售有限公司

地址：贵州省贵阳市南明区新华路110-134号富中国际广场1栋20层1.2号

法定代表人：王荻

联系人：方凯鑫

客服热线：0851-8823-5678

网址：[www.urainf.com](http://www.urainf.com)

49) 北京恒天明泽基金销售有限公司

地址：北京市朝阳区东三环北路甲19号SOHO嘉盛中心30层3001室

法定代表人：周斌

联系人：陈霞

客服热线：400-8980-618

网址：[www.chtwm.com](http://www.chtwm.com)

50) 北京蛋卷基金销售有限公司

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：戚晓强

客服热线：4000-618-518

网址：<https://danjuanapp.com>

51) 上海联泰资产管理有限公司

地址：上海市长宁区金钟路 658 弄 2 号楼 B 座 6 楼

法定代表人：燕斌

联系人：陈东

客服热线：021-52822063

公司网址：[www.91fund.com.cn](http://www.91fund.com.cn)

52) 中信期货有限公司

地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层

法定代表人：张皓

联系人：罗文燕

客服热线：400-990-8826

网址：[www.citicsf.com](http://www.citicsf.com)

53) 京东金融-北京肯特瑞财富投资管理有限公司

地址：北京市大兴区亦庄经济开发区科创十一街十八号院京东集团总部

法定代表人：陈超

联系人：赵德赛

客服热线：95118

网址：<http://fund.jd.com>

54) 上海陆金所资产管理有限公司

地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元

法定代表人：鲍东华

联系人：宁博宇

客服热线：4008219031

网址：[www.lufunds.com](http://www.lufunds.com)

55) 和讯信息科技有限公司

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：于杨

客服热线：400-920-0022

网址：[www.licaike.com](http://www.licaike.com)

56) 沈阳麟龙投资顾问有限公司

地址：辽宁省沈阳市东陵区白塔二南街18-2号b座601

法定代表人：朱荣晖

联系人：庞园

客服热线：400—003—5811

网址：[www.jinjiwo.com](http://www.jinjiwo.com)

57) 南京苏宁基金销售有限公司

地址：南京市玄武区苏宁大道1-5号

法定代表人：钱燕飞

联系人：喻明明

客服热线：95177

网址：[www.snjijin.com](http://www.snjijin.com)

58) 深圳众禄基金销售股份有限公司



地址：深圳市罗湖区笋岗街道梨园路物资控股置地大厦8楼801

法定代表人：薛峰

联系人：童彩平

客服热线：0755-33227950

网址：www.zlfund.cn

59) 阳光人寿保险股份有限公司

地址：北京市朝阳区朝阳门外大街乙12号院1号昆泰国际大厦12层

法定代表人：李科

联系人：王超

客服热线：95510

网址：<http://fund.sinosig.com/>

60) 中证金牛（北京）投资咨询有限公司

地址：北京市西城区宣武门外大街甲1号环球财讯中心A座5层

法定代表人：钱昊旻

联系人：孙雯

客服热线：4008-909-998

网址：[www.jnlc.com](http://www.jnlc.com)

3. 基金管理人可根据有关法律法规要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金或变更上述销售机构，并及时公告。

## 二、注册登记机构

名称：西部利得基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 11 层 02、03 单元

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 11 层 02、03 单元

法定代表人：刘建武

电话：（021）38572888

传真：（021）38572750

联系人：张皞骏

客户服务电话：400-700-7818；

## 三、出具法律意见书的律师事务所

名称：上海源泰律师事务所

住所：上海市浦东南路 256 号华夏银行大厦 1405 室

办公地址：上海市浦东南路 256 号华夏银行大厦 1405 室

负责人：廖海

联系电话：（021）51150298

传真：（021）51150398

联系人：刘佳

经办律师：廖海、刘佳

#### **四、审计基金财产的会计师事务所**

名称：毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)

住所：北京市东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层

办公地址：上海市南京西路 1266 号恒隆广场 50 楼

法定代表人：邹俊

联系电话：（021）2212 2888

传真：（021）6288 1889

联系人：黄小熠

## 第六部分基金的募集

### 一、基金募集情况

本基金于 2016 年 10 月 24 日获得中国证监会证监许可【2016】2409 号核准，募集期自 2016 年 11 月 7 日至 2016 年 11 月 15 日止。募集期内，该基金的有效认购份额为 205,109,624.90 份，利息结转的基金份额为 8,325.09 份，两项合计共 205,117,949.99 份基金份额。

## 第七部分基金合同的生效

### 一、基金合同生效

本基金基金合同于 2016 年 11 月 17 日生效。

### 二、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

《基金合同》生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元的，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。

法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

## 第八部分基金份额的申购与赎回

### 一、申购和赎回场所

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

投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，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

本基金自 2016 年 11 月 21 日起开始办理日常赎回业务，自 2016 年 12 月 16 日起开始办理日常申购业务。

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、赎回或转换申请且登记机构确认接收的，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。

### 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各类基金份额净值为基准进行计算；
- 2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；
- 3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；
- 4、赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人认购、申购的先后次序进行顺序赎回；

5、投资人办理申购、赎回等业务时应提交的文件和办理手续、办理时间、处理规则等在遵守基金合同和招募说明书规定的前提下，以各销售机构的具体规定为准；

6、办理申购、赎回业务时，应当遵循基金份额持有人利益优先原则。

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

#### **四、申购与赎回的程序**

##### **1、申购和赎回的申请方式**

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

##### **2、申购和赎回的款项支付**

投资人申购基金份额时，必须全额交付申购款项，投资人全额交付申购款项，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。投资人赎回生效后，基金管理人将在 T+7 日(包括该日)内支付赎回款项。遇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。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。

基金管理人可以在法律法规和基金合同允许的范围内，对上述业务办理时间进行调整，基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

##### **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和赎回申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购和赎回申请的确认以登记机构的确认结果为准。

## 五、申购与赎回的数额限制

1、投资人通过本基金代销机构及网上交易系统办理申购时，单笔申购最低金额为 10.00 元（含申购费），每笔追加申购的最低金额为 10.00 元（含申购费）。通过直销机构首次申购的最低金额为 50,000.00 元（含申购费），追加申购最低金额为 10,000.00 元（含申购费），已有认/申购本基金记录的投资人不受首次申购最低金额的限制，但受追加申购最低金额的限制。代销机构的投资人欲转入直销机构进行交易要受直销机构最低金额的限制。投资人可多次申购，对单个投资人累计持有份额不设上限限制。

2、基金份额持有人在销售机构赎回时，每笔赎回申请不得低于 10 份基金份额。基金份额持有人赎回时或赎回后将导致在销售机构（网点）保留的基金份额余额不足 10 份的，在赎回时须一次性全部赎回。

3、基金份额持有人每个交易账户的最低份额余额为 10 份。基金份额持有人因赎回、转换等原因导致其单个基金账户内剩余的基金份额低于 10 份时，注册登记系统可对该剩余的基金份额自动进行强制赎回处理。

4、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。

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实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。

## 六、申购和赎回的价格、费用及其用途

### 1、基金份额的申购费用

本基金基金份额分为 A 类和 C 类基金份额。投资人申购 A 类基金份额在申购时支付申购费用，申购 C 类基金份额不支付申购费用。A 类基金份额的申购费用不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用。

本基金 A 类基金份额的申购费率如下表所示：

申购金额（含申购费）	A类基金份额申购费率
100 万元以下	1.2%
100 万元（含）以上，200 万元以下	1.0%
200 万元（含）以上，500 万元以下	0.8%
500 万元（含）以上	每笔交易 1000 元

## 2、基金份额的赎回费用

本基金基金份额的赎回费率随投资人申请份额持有时间的增加而递减。本基金的赎回费率如下：

本基金 A 类基金份额的赎回费率：

持有时间（T）	赎回费率	计入基金财产比例
T<7 日	1.50%	100%
7 日≤T<30 日	0.75%	100%
30 日≤T<3 个月	0.50%	75%
3 个月≤T<6 个月	0.50%	50%
6 个月≤T<1 年	0.20%	25%
T≥1 年	0	0

（注：上表中，1 个月指 30 天，1 年按 365 天计算。）

本基金 C 类基金份额的赎回费率：

持有时间（T）	赎回费率	计入基金财产比例
T<7 日	1.50%	100%
7 日≤T<30 日	0.50%	100%
T≥30 日	0	0

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。

3、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。



4、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定，且对基金份额持有人利益无实质性不利影响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本基金的申购费率和基金赎回费率。

## 七、申购份额与赎回金额的计算

### 1、申购份额计算

本基金申购的有效份额为净申购金额除以当日相应类别的基金份额净值，有效份额单位为份，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。

具体的计算方法如下：

(1) 申购本基金 A 类基金份额时：

当申购费用适用比例费率时：

净申购金额 = 申购金额 / (1 + 申购费率)；

申购费用 = 申购金额 - 净申购金额；

申购份额 = 净申购金额 / 申购当日 A 类基金份额的基金份额净值。

当申购费用适用固定申购金额时：

申购费用 = 固定金额；

净申购金额 = 申购金额 - 申购费用；

申购份额 = 净申购金额 / 申购当日 A 类基金份额的基金份额净值。

例：某投资人投资 10,000 元申购本基金 A 类基金份额，申购费率为 1.20%，假定申购当日 A 类基金份额净值为 1.0500 元，则可申购基金份额为：

净申购金额 = 10,000 / (1 + 1.20%) = 9881.42 元

申购费用 = 10,000 - 9881.42 = 118.58 元

申购份额 = 9881.42 / 1.0500 = 9410.88 份

即：投资人投资 10,000 元申购本基金 A 类基金份额，假设申购当日的 A 类基金份额净值为 1.0500 元，可得到 9410.88 份 A 类基金份额。

(2) 申购本基金 C 类基金份额时：

净申购金额 = 申购金额

申购份额 = 净申购金额 / 申购当日 C 类基金份额的基金份额净值。

例：某投资人投资 10,000.00 元申购本基金 C 类基金份额，假定申购当日 C 类基金份额净值为 1.0500 元，则可申购基金份额为：

$$\text{净申购金额} = 10,000.00$$

$$\text{申购份额} = 10,000.00 / 1.050 = 9523.81 \text{ 份}$$

即：投资人投资 10,000.00 元申购本基金 C 类基金份额，假设申购当日的 C 类基金份额净值为 1.0500 元，可得到 9523.81 份 C 类基金份额。

## 2、赎回金额计算

本基金赎回的赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日相应类别的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。

具体的计算方法如下：

$$\text{赎回总金额} = \text{赎回份额} \times \text{赎回当日基金份额净值}$$

$$\text{赎回费用} = \text{赎回总金额} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{净赎回金额} = \text{赎回总金额} - \text{赎回费用}$$

例：某投资人赎回 10,000 份 A 类基金份额，份额持有期限 5 天，对应赎回费率为 1.50%，假设赎回当日 A 类基金份额净值是 1.1000 元，则其可得到的赎回金额为：

$$\text{赎回金额} = 10,000 \times 1.1000 = 11,000.00 \text{ 元}$$

$$\text{赎回费用} = 11,000.00 \times 1.50\% = 165.00 \text{ 元}$$

$$\text{净赎回金额} = 11,000.00 - 165.00 = 10,835.00 \text{ 元}$$

即：投资人赎回 10,000 份本基金 A 类基金份额，假设赎回当日的 A 类基金份额净值为 1.1000 元，可得到 10,835.00 元赎回金额。

## 3、基金份额净值的计算

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

$$\text{计算日基金份额净值} = \text{计算日各类基金份额的基金资产净值} / \text{计算日各类基金份额余额总数}$$

## 八、申购和赎回的注册登记

1、投资者申购基金份额成功后，在正常情况下，登记机构在 T+1 日为投资者登记权益并办理登记手续，投资者自 T+2 日（含该日）后有权赎回基金份额。

2、投资者赎回基金份额成功后，登记机构在 T+1 日为投资者办理扣除权益的登记手续。

3、基金管理人可以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，但不得实质影响投资者的合法权益，并最迟于开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

### **九、拒绝或暂停申购的情形**

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

- 1、因不可抗力导致基金无法正常运作。
- 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况。
- 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可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。
- 5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人利益的情形。
- 6、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，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。
- 7、基金管理人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。
- 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、6、8 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人的申购申请时，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。

### **十、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形**

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

- 1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况。

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、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

5、发生继续接受赎回申请将损害现有持有人利益的情形时，应当及时暂停赎回业务。

6、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、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投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项时，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。若出现上述第 4 项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

## 十一、巨额赎回的情形及处理方式

### 1、巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过前一开放日的基金总份额的 10%，即认为是发生了巨额赎回。

### 2、巨额赎回的处理方式

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

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

(2) 部分延期赎回：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，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的 10% 的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。部分延期赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

当基金发生巨额赎回，在单个基金份额持有人超过基金总份额 20% 以上的赎回申请情形下，基金管理人可以延期办理赎回申请。基金管理人对单个基金份额持有人超过基金总份额 20% 以上部分的赎回申请，实施延期办理，对该单个基金份额持有人 20% 以内（含 20%）的赎回申请，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，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的 10% 的前提下，对于当日的赎回申请，按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例支付当日的赎回款项。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。延期部分如选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

(3) 暂停赎回：连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒介上进行公告。

### 3、巨额赎回的公告

当发生上述巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在指定媒介上刊登公告。

## **十二、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告**

1、发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人当日应立即向中国证监会备案，并在规定期限内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，基金管理人可以根据暂停申购或赎回的时间，依照《信息披露办法》的有关规定，最迟于重新开放日在指定媒介上刊登重新开放申购或赎回的公告；也可以根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间，届时不再另行发布重新开放的公告。

## **十三、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。

## 第九部分与基金管理人管理的其他基金转换

### 一、基金转换申请人的范围

本基金的持有人均可以按照基金合同的规定申请和办理本基金与基金管理人管理的其他基金的转换。

### 二、基金转换受理场所

基金转换受理场所与基金份额申购、赎回申请的受理场所相同。

目前本公司直销柜台、网上直销、本基金的代销机构包括申万宏源、光大证券、国金证券、银河证券、中信建投、平安证券、东海证券、西部证券、利得基金、同花顺、联泰资产、上海长量基金、汇成基金、泛华普益、钱景财富、中泰证券、陆金所已开通本基金与公司管理的策略优选混合型证券投资基金、新动向灵活配置混合型证券投资基金、稳健双利债券型证券投资基金、中证500等权重指数分级证券投资基金（场外）、成长精选灵活配置混合型证券投资基金、多策略优选灵活配置混合型证券投资基金、新盈灵活配置混合型证券投资基金、行业主题优选灵活配置混合型证券投资基金、天添鑫货币市场基金、景瑞灵活配置混合型证券投资基金、合享债券型证券投资基金、合赢债券型证券投资基金、天添富货币市场基金、祥盈债券型证券投资基金间的相互转换业务。

京东金融已开通本基金与公司管理的策略优选混合型证券投资基金、新动向灵活配置混合型证券投资基金、稳健双利债券型证券投资基金、中证500等权重指数分级证券投资基金（场外）、成长精选灵活配置混合型证券投资基金、多策略优选灵活配置混合型证券投资基金、新盈灵活配置混合型证券投资基金、行业主题优选灵活配置混合型证券投资基金、天添鑫货币市场基金、合享债券型证券投资基金、景瑞灵活配置混合型证券投资基金、合赢债券型证券投资基金、天添金货币市场基金、祥盈债券型证券投资基金、祥运灵活配置混合型证券投资基金间的相互转换业务。

华信证券已开通本基金与公司管理的策略优选混合型证券投资基金、新动向灵活配置混合型证券投资基金、稳健双利债券型证券投资基金、中证500等权重指数分级证券投资基金（场外）、成长精选灵活配置混合型证券投资基金、多策略优选灵活配置混合型证券投资基金、新盈灵活配置混合型证券投资基金、

行业主题优选灵活配置混合型证券投资基金、天添鑫货币市场基金、合享债券型证券投资基金、景瑞灵活配置混合型证券投资基金、合赢债券型证券投资基金、天添金货币市场基金、祥盈债券型证券投资基金、祥运灵活配置混合型证券投资基金、个股精选股票型证券投资基金、汇逸债券型证券投资基金、得尊纯债债券型证券投资基金、久安回报灵活配置混合型证券投资基金、汇享债券型证券投资基金间的相互转换业务。

大泰金石已开通本基金与公司管理的策略优选混合型证券投资基金、新动向灵活配置混合型证券投资基金、稳健双利债券型证券投资基金、中证 500 等权重指数分级证券投资基金（场外）、成长精选灵活配置混合型证券投资基金、多策略优选灵活配置混合型证券投资基金、新盈灵活配置混合型证券投资基金、行业主题优选灵活配置混合型证券投资基金、天添鑫货币市场基金、合享债券型证券投资基金、景瑞灵活配置混合型证券投资基金、合赢债券型证券投资基金、天添富货币市场基金、天添金货币市场基金、祥盈债券型证券投资基金、祥运灵活配置混合型证券投资基金、祥逸债券型证券投资基金间的相互转换业务。

新兰德已开通本基金与公司管理的策略优选混合型证券投资基金、新动向灵活配置混合型证券投资基金、稳健双利债券型证券投资基金、中证 500 等权重指数分级证券投资基金（场外）、成长精选灵活配置混合型证券投资基金、多策略优选灵活配置混合型证券投资基金、新盈灵活配置混合型证券投资基金、行业主题优选灵活配置混合型证券投资基金、天添鑫货币市场基金、合享债券型证券投资基金、景瑞灵活配置混合型证券投资基金、合赢债券型证券投资基金、天添金货币市场基金、祥盈债券型证券投资基金、祥运灵活配置混合型证券投资基金、得尊纯债债券型证券投资基金、久安回报灵活配置混合型证券投资基金、个股精选股票型证券投资基金、汇享债券型证券投资基金、汇逸债券型证券投资基金、祥逸债券型证券投资基金间的相互转换业务。

钱景财富已开通本基金与公司管理的策略优选混合型证券投资基金、新动向灵活配置混合型证券投资基金、稳健双利债券型证券投资基金、中证 500 等权重指数分级证券投资基金（场外）、成长精选灵活配置混合型证券投资基金、多策略优选灵活配置混合型证券投资基金、新盈灵活配置混合型证券投资基金、行业主题优选灵活配置混合型证券投资基金、天添鑫货币市场基金、合享债券



型证券投资基金、景瑞灵活配置混合型证券投资基金、合赢债券型证券投资基金、天添金货币市场基金、祥盈债券型证券投资基金、祥运灵活配置混合型证券投资基金、得尊纯债债券型证券投资基金、久安回报灵活配置混合型证券投资基金、个股精选股票型证券投资基金、汇享债券型证券投资基金、汇逸债券型证券投资基金、祥逸债券型证券投资基金间的相互转换业务。

万得投顾已开通本基金与公司管理的策略优选混合型证券投资基金、新动向灵活配置混合型证券投资基金、稳健双利债券型证券投资基金、中证 500 等权重指数分级证券投资基金（场外）、成长精选灵活配置混合型证券投资基金、多策略优选灵活配置混合型证券投资基金、新盈灵活配置混合型证券投资基金、行业主题优选灵活配置混合型证券投资基金、天添鑫货币市场基金、合享债券型证券投资基金、景瑞灵活配置混合型证券投资基金、合赢债券型证券投资基金、天添富货币市场基金、天添金货币市场基金、祥盈债券型证券投资基金、祥运灵活配置混合型证券投资基金、得尊纯债债券型证券投资基金、久安回报灵活配置混合型证券投资基金、个股精选股票型证券投资基金、汇享债券型证券投资基金、汇逸债券型证券投资基金、祥逸债券型证券投资基金间的相互转换业务。

奕丰金融已开通本基金与公司管理的策略优选混合型证券投资基金、新动向灵活配置混合型证券投资基金、稳健双利债券型证券投资基金、中证 500 等权重指数分级证券投资基金（场外）、成长精选灵活配置混合型证券投资基金、多策略优选灵活配置混合型证券投资基金、新盈灵活配置混合型证券投资基金、行业主题优选灵活配置混合型证券投资基金、天添鑫货币市场基金、合享债券型证券投资基金、景瑞灵活配置混合型证券投资基金、合赢债券型证券投资基金、天添富货币市场基金、天添金货币市场基金、祥盈债券型证券投资基金、祥运灵活配置混合型证券投资基金、得尊纯债债券型证券投资基金、久安回报灵活配置混合型证券投资基金、个股精选股票型证券投资基金、汇享债券型证券投资基金、汇逸债券型证券投资基金、祥逸债券型证券投资基金间的相互转换业务。

好买基金已开通本基金与公司管理的西部利得策略优选混合型证券投资基金、新动向灵活配置混合型证券投资基金、稳健双利债券型证券投资基金、中证 500 等权重指数分级证券投资基金（场外）、成长精选灵活配置混合型证券

投资基金、多策略优选灵活配置混合型证券投资基金、新盈灵活配置混合型证券投资基金、行业主题优选灵活配置混合型证券投资基金、天添鑫货币市场基金、合享债券型证券投资基金、景瑞灵活配置混合型证券投资基金、合赢债券型证券投资基金、天添富货币市场基金、天添金货币市场基金、祥盈债券型证券投资基金、祥运灵活配置混合型证券投资基金、得尊纯债债券型证券投资基金、久安回报灵活配置混合型证券投资基金、个股精选股票型证券投资基金、汇享债券型证券投资基金、汇逸债券型证券投资基金、祥逸债券型证券投资基金间的相互转换业务。

泰诚财富已开通本基金与公司管理的西部利得策略优选混合型证券投资基金、新动向灵活配置混合型证券投资基金、稳健双利债券型证券投资基金、中证 500 等权重指数分级证券投资基金（场外）、成长精选灵活配置混合型证券投资基金、多策略优选灵活配置混合型证券投资基金、新盈灵活配置混合型证券投资基金、行业主题优选灵活配置混合型证券投资基金、天添鑫货币市场基金、合享债券型证券投资基金、景瑞灵活配置混合型证券投资基金、合赢债券型证券投资基金、天添富货币市场基金、天添金货币市场基金、祥盈债券型证券投资基金、祥运灵活配置混合型证券投资基金、得尊纯债债券型证券投资基金、久安回报灵活配置混合型证券投资基金、个股精选股票型证券投资基金、汇享债券型证券投资基金、汇逸债券型证券投资基金、祥逸债券型证券投资基金间的相互转换业务。

长城证券已开通本基金与公司管理的西部利得策略优选混合型证券投资基金、新动向灵活配置混合型证券投资基金、稳健双利债券型证券投资基金、中证 500 等权重指数分级证券投资基金（场外）、成长精选灵活配置混合型证券投资基金、多策略优选灵活配置混合型证券投资基金、新盈灵活配置混合型证券投资基金、行业主题优选灵活配置混合型证券投资基金、天添鑫货币市场基金、合享债券型证券投资基金、景瑞灵活配置混合型证券投资基金、合赢债券型证券投资基金、天添富货币市场基金、天添金货币市场基金、祥盈债券型证券投资基金、祥运灵活配置混合型证券投资基金、得尊纯债债券型证券投资基金、久安回报灵活配置混合型证券投资基金、个股精选股票型证券投资基金、汇享债券型证券投资基金、汇逸债券型证券投资基金、祥逸债券型证券投资基金间的相互转换业务。

基金转换只能在同一销售机构进行，转换的两只基金必须都是该销售机构代理销售的本公司管理的基金。其他销售机构基金转换业务的具体办理时间、流程以销售机构及其网点的安排和规定为准。

### 三、基金转换受理时间

投资人可以在基金开放日的交易时间段申请办理基金转换业务，具体办理时间与基金申购、赎回业务办理时间一致。

### 四、基金转换费用

1. 转换费用由二部分组成：转出基金赎回费和转入基金与转出基金的申购补差费。

2. 赎回费：赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。如涉及的转出基金有赎回费用的，收取该基金的赎回费用。收取的赎回费用 100% 归入基金财产。

3. 申购补差费：按照转入基金与转出基金的申购费的差额收取补差费。转出基金金额所对应的转出基金申购费率低于转入基金的申购费率的，补差费率为转入基金和转出基金的申购费率差额；转出基金金额所对应的转出基金申购费率高于转入基金的申购费率的补差费为零。从申购费率低的基金向申购费率高的基金转换时，收取申购补差费用；从申购费率高的基金向申购费率低的基金转换时，不收取申购补差费用。

4. 投资者可以发起多次基金转换业务，基金转换费用按每笔申请单独计算。计算基金转换费用所涉及的赎回费率和申购费率均按正常费率执行。

5. 转换费用以人民币为单位，计算结果按照四舍五入方法，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。

6. 如遇申购费率优惠活动，基金转换费用的构成同样适用于前述规则，即基金转换费用由基金赎回费用及基金申购补差费用构成。

7. 各基金赎回费率以及各基金申购费率请参照相应基金的招募说明书，或参照本公司优惠活动公告。

### 五、基金转换公式

#### 1. 费用

转换费用 = 赎回费 + 申购补差费

赎回费 = 转出基金份额 × 当日转出基金份额净值 × 转出基金赎回费率

申购补差费 = (转出基金份额 × 当日转出基金份额净值 - 赎回费) × 申购补差费率 / (1 + 申购补差费率)

各基金赎回费率以及各基金申购费率请参照相应基金的招募说明书，或参照本公司优惠活动公告。

## 2. 金额与份额

转出金额 = 转出基金份额 × 转出基金当日基金份额净值

转入净额 = 转出金额 - 转换费用

转入份额 = 转入金额 / 转入基金当日基金份额净值

## 3. 例如：

### a. 转入基金的申购费率 > 转出基金的申购费率：

转出基金申购费率为 0.8%，转出基金赎回费率为 0.1%，转出基金当日基金份额净值为 1.000 元，转入基金申购费率为 1.5%，转入基金当日基金份额净值为 2.000 元，转出份额为 500,000.00 份。

转出金额 = 500,000.00 份 × 1.000 元 = 500,000.00 元

转换费用 = 500,000.00 元 × 0.1% + 500,000.00 元 × (1 - 0.1%) × 0.7% / (1 + 0.7%) = 500.00 元 + 3,472.19 元 = 3,972.19 元

转入金额 = 500,000.00 元 - 3,972.19 元 = 496,027.81 元

转入份额 = 496,027.81 元 ÷ 2.000 元 = 248,013.91 份

### b. 转出基金的申购费率 ≥ 转入基金的申购费率：

转出基金申购费率为 1.2%，转出基金赎回费率为 0.5%，转出基金当日基金份额净值为 1.000 元，转入基金申购费率为 0.8%，转入基金当日基金份额净值为 2.000 元，转出份额为 500,000.00 份。

转出金额 = 500,000.00 份 × 1.000 元 = 500,000.00 元

转换费用 = 500,000.00 元 × 0.5% = 2,500.00 元

转入金额 = 500,000.00 元 - 2,500 元 = 497,500.00 元

转入份额 = 497,500.00 元 ÷ 2.000 元 = 248,750.00 份

## 六、拒绝或暂停基金转换的情形及处理方式

### 1. 在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资人的转入申请：

- (1) 因不可抗力导致基金管理人无法接受投资人的转入申请；
- (2) 证券交易场所交易时间临时停市；

- (3) 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；
- (4) 其他可能对基金业绩或流动性产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人利益的情形；
- (5) 基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔转入；
- (6) 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；
- (7) 基金管理人接受某笔或者某些转入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。
- (8) 法律、法规、规定或中国证监会认定的其他情形。

2. 在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资人的转出申请：

- (1) 因不可抗力导致基金管理人不能支付转出款项；
- (2) 证券交易场所交易时间临时停市；
- (3) 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) 当基金管理人认为某笔转出会有损于现有基金份额持有人利益；
- (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。
- (6) 法律、法规规定或中国证监会认定的其它情形。

如发生基金合同、招募说明书或本公告中未予载明的事项，但基金管理人 有正当理由认为需要暂停接受基金转换申请的，应当报经中国证监会批准后在 至少一种中国证监会指定媒体上公告。

投资人到相关基金代销机构的销售网点办理相关基金转换业务时，其相关 具体办理规定以各代销机构的规定为准。

## 第十部分基金份额的登记、转托管、非交易过户、冻结、解冻和质押

### 一、基金份额的登记

#### 1、基金的份额登记业务

本基金的登记业务指本基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等。

#### 2、基金登记业务办理机构

本基金的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登记业务的，应与代理人签订委托代理协议，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事宜中的权利和义务，保护基金份额持有人的合法权益。

#### 3、基金登记机构的权利

基金登记机构享有以下权利：

- (1) 取得登记费；
- (2) 建立和管理投资者基金账户；
- (3) 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；
- (4) 在法律法规允许的范围内，对登记业务的办理时间进行调整，并依照有关规定于开始实施前在指定媒介上公告；
- (5) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

#### 4、基金登记机构的义务

基金登记机构承担以下义务：

- (1) 配备足够的专业人员办理本基金份额的登记业务；
- (2) 严格按照法律法规和《基金合同》规定的条件办理本基金份额的登记业务；

(3) 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；

(4) 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，但司法强制检查情形及法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他情形除外；

(5) 按《基金合同》及招募说明书规定为投资者办理非交易过户业务、提供其他必要的服务；

(6) 接受基金管理人的监督；

(7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## **二、基金的转托管**

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。

## **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。

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。

## **四、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。基金份额的冻结手续、冻结方式按照登记机构的相关规定办理。基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益按照我国法律法规、监管规章及国家有权机关的要求以及登记机构业务规定来处理。

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。



## 第十一部分基金的投资

### 一、投资目标

本基金通过投资于促进中国经济发展方式转变的消费服务和技术创新等领域的上市公司，在严格控制风险的前提下，力求获得长期稳定的收益。

### 二、投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、政府支持机构债券、企业债、公司债、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、可交换债券、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据、公开发行次级债券等）、同业存单、债券回购、货币市场工具、权证、股指期货、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

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。

基金的投资组合比例为：

股票资产占基金资产的 0%-95%。其中，基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%；本基金每个交易日日终在扣除股指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%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。

### 三、投资策略

#### 1、大类资产配置策略

本基金采取积极的大类资产配置策略，通过评估整个股票市场的系统性风险来调整本基金股票资产的投资比例，随着股票市场系统风险的增大而逐步降低股票资产的投资比例，随着股票市场系统风险的减少而逐步提高股票资产的投资比例，尽力实现投资组合的风险收益最优化。

#### 2、股票投资策略

本基金遵循行业间优势配置、各行业内优选个股相结合的股票投资策略，综合评判行业所处的状况和未来发展趋势，筛选出经济周期不同阶段的优势行业，这些优势行业具有综合性的比较优势、较高的投资价值、能够取得超越各

行业平均收益率的投资收益；行业内优选个股是以若干财务指标、成长性、估值、在所属行业当中的竞争地位、企业的盈利前景及成长空间、是否具有主题型投资机会等定性与定量指标为基础，筛选出经济周期与行业发展的不同阶段下，具有较高投资价值、持续成长性较好的优势个股。

#### （1）行业间优势配置策略

本基金管理人在进行行业配置时，将采用自上而下与自下而上相结合的方式，以证监会行业分类为标准，对行业配置定期进行综合评估，遴选出优势行业，并制定以及调整行业资产配置比例。在投资组合管理过程中，基金管理人也将根据宏观经济形势以及各个行业的基本面特征对行业配置进行持续动态地调整，以把握行业景气轮动带来的投资机会。

#### （2）个股筛选策略

在行业配置策略的基础上，本基金重点投资于优势行业中获益程度较高且具有核心竞争优势的上市公司。基金管理人将综合采用定量和定性相结合的方式；基于公司基本面全面考量、筛选优势企业，分析股票内在价值，结合风险管理，构建股票组合并对其进行动态调整。

##### 定量分析：

成长性指标包括未来 3 年公司主营业务收入、毛利率及净利率增长率；累计及新增研发支出；资本支出；人员招聘情况等。

盈利能力指标包括毛利率和净利率的变动趋势；净资产回报率等。

估值水平指标包括 P/E；P/S；P/B 等。

##### 定性分析：

在定量分析的基础上，基金管理人还将发挥其在股票研究方面的专业优势，综合利用卖方研究报告、实地调研和财务分析等多种手段，对进入研究范围的上市公司基本面进行深入分析，从定性的角度筛选出基本面良好、成长潜力较大的股票进行投资。

### 3、债券投资策略

本基金可投资于国债、金融债、公司债、企业债、可转换债券（含可交换债券）、央行票据、次级债、地方政府债券等债券品种，基金经理通过对收益率、流动性、信用风险和风险溢价等因素的综合评估，合理分配固定收益类证

券组合中投资于国债、金融债、企业债、短期金融工具等产品的比例，构造债券组合。

在选择国债品种中，本产品将重点分析国债品种所蕴含的利率风险和流动性风险，根据利率预测模型构造最佳期限结构的国债组合；在选择金融债、企业债品种时，本基金将重点分析债券的市场风险以及发行人的资信品质。资信品质主要考察发行机构及担保机构的财务结构安全性、历史违约/担保纪录等。本基金还将关注可转债价格与其所对应股票价格的相对变化，综合考虑可转债的市场流动性等因素，决定投资可转债的品种和比例，捕捉其套利机会。

#### 4、资产支持证券的投资策略

本基金将综合运用定性方法和定量方法，基本面分析和数量化模型相结合，对资产证券化产品的基础资产质量及未来现金流进行分析，并结合发行条款、提前偿还率、风险补偿收益等个券因素以及市场利率、流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析和价值评估后进行投资。本基金将严格遵守法律法规和基金合同的约定，严格控制资产支持证券的投资比例、信用等级并密切跟踪评级变化，采用分散投资方式以降低流动性风险，在保证本金安全和基金资产流动性的基础上获得稳定收益。

#### 5、股指期货投资策略

在股指期货投资上，本基金以避险保值、管理投资组合的系统性风险、改善投资组合的风险收益特性为主。在控制风险的前提下，谨慎适当参与股指期货的投资。

#### 6、权证投资策略

本基金将因为上市公司进行股权分置改革、或增发配售等原因被动获得权证，或者本基金在进行套利交易、避险交易等情形下将主动投资权证。本基金进行权证投资时，将在对权证标的证券进行基本面研究及估值的基础上，结合隐含波动率、剩余期限、标的证券价格走势等参数，运用数量化期权定价模型，确定其合理内在价值，从而构建套利交易或避险交易组合，力求取得最优的风险调整收益。

### 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) 本基金股票资产占基金资产的 0%-95%;
- (2) 本基金每个交易日日终在扣除股指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% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等;
- (3) 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%;
- (5) 本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的 3%;
- (6) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证,不得超过该权证的 10%;
- (7) 本基金在任何交易日买入权证的总金额,不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%;
- (8) 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%;
- (9) 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%;
- (10) 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%;
- (11) 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%;
- (12) 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;
- (13) 基金财产参与股票发行申购,本基金所申报的金额不超过本基金的总资产,本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;
- (14) 基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%;
- (15) 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;

(16) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；

(17) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等（不持有买入期货合约时，本条不适用）；

(18) 本基金在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；

(19) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；

(20) 本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指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 20%；

(21) 本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；

(22) 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、上市公司股票停牌、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，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(23) 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；

(24) 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。因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，除上述第（2）、（12）、（22）、（23）条外，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，本基金的投资范围、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。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。

如果法律法规或监管部门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，但须提前公告，不需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) 买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、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) 依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人可以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，应当符合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的同意，并按法律法规予以披露。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。

法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制或按变更后的规定执行。

## 五、业绩比较基准

沪深 300 指数收益率\*50%+中证全债指数收益率\*50%

沪深 300 指数是上海证券交易所和深圳证券交易所共同推出的沪深两个市场第一个统一指数，该指数编制合理、透明，有一定市场覆盖率，抗操纵性强，并且有较高的知名度和市场影响力。中证全债指数是中证指数公司编制的综合

反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数，具有很高的代表性。综合考虑基金资产配置与市场指数代表性等因素，本基金选用沪深 300 指数和中证全债指数加权作为本基金的投资业绩比较基准。

如果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，或者本基金的业绩比较基准停止发布时，本基金可以经基金管理人和基金托管人协商一致后变更业绩比较基准并及时公告，无需召开基金份额持有人大会。

## 六、风险收益特征

本基金为混合型基金，在通常情况下其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于证券投资基金中等风险水平的投资品种。

## 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、有利于基金资产的安全与增值；
- 2、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；
- 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。

## 八、基金投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据基金合同规定，复核了本报告中的投资组合报告内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截止 2018 年 9 月 30 日，本报告所列财务数据未经审计。

### 1. 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	88,145,146.70	39.11
	其中：股票	88,145,146.70	39.11

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	89,728,489.00	39.82
	其中：债券	89,728,489.00	39.82
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	20,079,230.12	8.91
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	23,783,798.27	10.55
8	其他资产	3,623,962.13	1.61
9	合计	225,360,626.22	100.00

## 2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

### (1) 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	675,950.00	0.32
B	采矿业	6,979,603.47	3.28
C	制造业	41,724,763.48	19.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	2,453,000.00	1.15
F	批发和零售业	3,845,368.00	1.81
G	交通运输、仓储和邮政业	3,148,600.00	1.48
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,614,975.00	2.64
J	金融业	16,058,840.00	7.54
K	房地产业	2,966,450.00	1.39
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-



N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,686,707.25	0.79
R	文化、体育和娱乐业	2,990,889.50	1.40
S	综合	-	-
	合计	88,145,146.70	41.40

(2) 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

3. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600036	招商银行	171,000	5,247,990.00	2.46
2	600519	贵州茅台	6,400	4,672,000.00	2.19
3	000860	顺鑫农业	100,500	4,582,800.00	2.15
4	601318	中国平安	61,500	4,212,750.00	1.98
5	000963	华东医药	91,600	3,845,368.00	1.81
6	600030	中信证券	200,000	3,338,000.00	1.57
7	601088	中国神华	160,000	3,262,400.00	1.53
8	600406	国电南瑞	180,500	3,185,825.00	1.50
9	300144	宋城演艺	134,422	2,990,889.50	1.40
10	603899	晨光文具	96,000	2,980,800.00	1.40

4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,053,964.00	4.72
	其中：政策性金融债	10,053,964.00	4.72

4	企业债券	70,016,525.00	32.88
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	9,658,000.00	4.54
9	其他	-	-
10	合计	89,728,489.00	42.14

5. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值 （元）	占基金资 产净值比 例（%）
1	1680065	16普湾债	200,000	18,974,000.00	8.91
2	112278	15东莞债	157,500	16,076,025.00	7.55
3	112289	15顺鑫02	150,000	14,992,500.00	7.04
4	018005	国开1701	99,940	10,053,964.00	4.72
5	136022	15东吴债	100,000	10,003,000.00	4.70

6. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

贵金属不在本基金投资范围内。

8. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

股指期货不在本基金投资范围内。

#### 10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

国债期货不在本基金投资范围内。

#### 11. 投资组合报告附注

(1) 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

(2) 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

(3) 其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	98,041.92
2	应收证券清算款	1,542,772.74
3	应收股利	-
4	应收利息	1,983,107.52
5	应收申购款	39.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,623,962.13

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

(6) 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，本报告中涉及比例计算的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

### 九、基金的业绩

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，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说

明书。

1. 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1) 西部利得新动力混合 A:

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2016年11月17日-2016年12月31日	21.31%	2.34%	-2.65%	0.43%	23.96%	1.91%
2017年1月1日-2017年12月31日	6.01%	0.15%	10.30%	0.32%	-4.29%	-0.17%
2018年1月1日-2018年9月30日	1.22%	0.28%	-4.67%	0.61%	5.89%	-0.33%
2016年11月17日-2018年9月30日	30.17%	0.66%	2.37%	0.47%	27.80%	0.19%

2) 西部利得新动力混合 C:

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
----	--------	-----------	------------	---------------	-----	-----

2016年11月 17日-2016年 12月31日	-0.39%	0.06%	-2.65%	0.43%	2.26%	-0.37%
2017年1月1 日-2017年12 月31日	5.83%	0.15%	10.30%	0.32%	-4.47%	-0.17%
2018年1月1 日-2018年9 月30日	1.06%	0.28%	-4.67%	0.61%	5.73%	-0.33%
2016年11月 17日-2018年 9月30日	6.54%	0.21%	2.37%	0.47%	4.17%	-0.26%

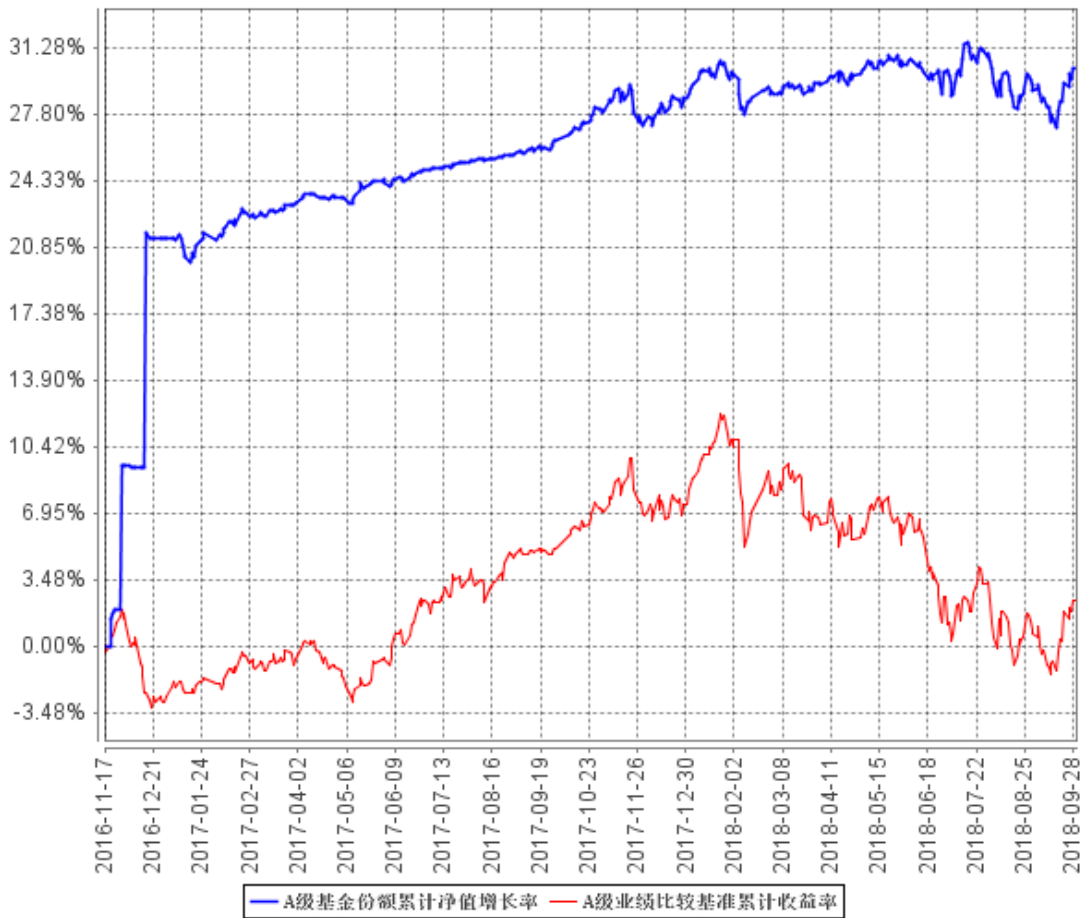
2. 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

西部利得新动力灵活配置混合型证券投资基金份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

1) 西部利得新动力混合 A:

(2016年11月17日至2018年9月30日)

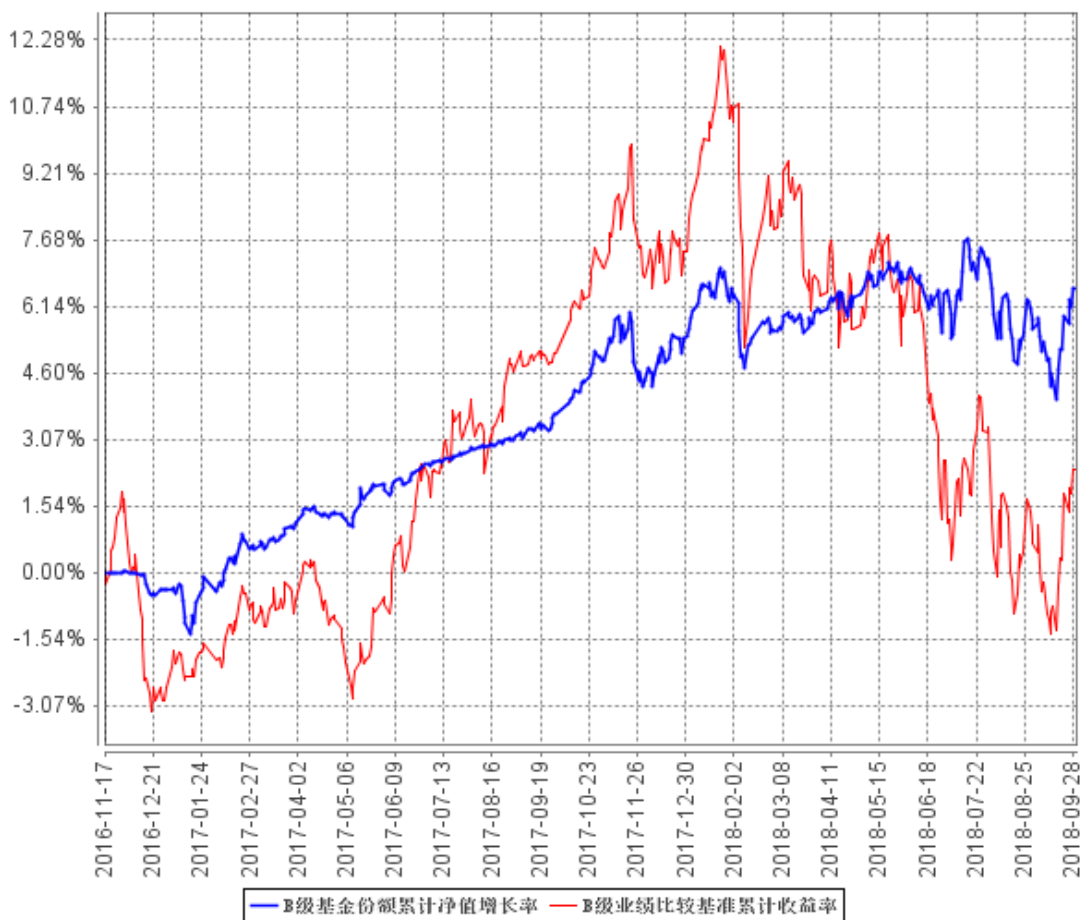
A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



2) 西部利得新动力混合 C:

(2016年11月17日至2018年9月30日)

B级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



## 第十一部分基金的财产

### 一、基金资产总值

基金资产总值是指拥有的各类有价证券、银行存款本息和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、期货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。



## 第十二部分基金资产估值

### 一、估值目的

基金资产估值的目的是客观、准确地反映基金资产是否保值、增值，依据经基金资产估值后确定的基金资产净值而计算出的基金份额净值，是计算基金申购与赎回价格的基础。

### 二、估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券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。

### 三、估值对象

基金所拥有的股票、权证、股指期货合约、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

### 四、估值程序

1、相应类别基金份额的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，精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人于每个工作日计算基金资产净值及各类基金份额净值，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，将各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，由基金管理人对外公布。

### 五、估值方法

#### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

(1) 交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

(2) 交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（基金合同另有规定的除外），选取估值日第三方估值机构提供的相应品种对应的估值净价估值，具体估值机构由基金管理人与托管人另行协商约定。

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

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

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

(1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值。

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

(3) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，以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。

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、股指期货合约按照结算价估值，如估值日无结算价且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日结算价估值。

6、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。

7、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人根据基金资产净值的计算结果对外予以公布。

## 六、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。当任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，由基金管理人先行赔付，基金管理人按错误情形，有权向其他估值错误责任方追偿；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) 错误偏差达到或超过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；错误偏差达到或超过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。

## 七、暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券/期货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一致，基金管理人应当暂停基金估值；

4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

## **八、基金净值的确认**

用于基金信息披露的基金资产净值和各类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工作日交易结束后计算当日的基金资产净值和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予以公布。

## **九、特殊情形的处理**

1、基金管理人按本部分第三条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/期货交易所及登记机构发送的数据错误等，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免除赔偿责任。但基金管理人和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。

## 第十三部分基金的收益与分配

### 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、由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，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；

2、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 50%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

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每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值。

5、同一类别每一基金份额享有同等分配权；

6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在符合法律法规及基金合同约定，并对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则和支付方式进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

### 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 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，不足以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。

## 第十四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、本基金从C类基金份额的基金财产中计提的销售服务费；
- 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/期货账户开户费用、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1.2%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.2\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 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0.15%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

### 3、C 类基金份额的销售服务费

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按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.2% 年费率计提。C 类基金份额的销售服务费计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

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

C 类基金份额销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金份额销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取并付给基金管理人，由基金管理人代付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

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》生效前的相关费用；
- 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。

五、在法律法规规定的范围内，基金管理人和基金托管人在履行适当程序后可协商酌情调整基金管理费、基金托管费或 C 类基金份额销售服务费等相关

费率。基金管理人必须依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介和基金管理人网站上刊登公告。

## 第十五部分基金的会计与审计

### 一、基金的会计政策

- 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；基金首次募集的会计年度按如下原则：如果《基金合同》生效少于2个月，可以并入下一个会计年度；
- 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日内在指定媒介公告并报中国证监会备案。

## 第十六部分基金的信息披露

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：

- (一) 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，说明基金认购、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日前向主要办公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。

基金募集申请经中国证监会注册后，基金管理人在基金份额发售的3日前，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。

## （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媒介上。

## （三）《基金合同》生效公告

基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日在指定媒介上登载《基金合同》生效公告。

## （四）基金资产净值、基金份额净值

《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公告一次基金资产净值和各类基金份额净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，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。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和各类基金份额净值。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、各类基金份额净值和各类基金份额累计净值登载在指定媒介上。

#### （五）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发售网点查阅或者复制前述信息资料。

#### （六）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、半年度报告或者年度报告。

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。

基金持续运作过程中，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。

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，为保障其他投资者利益，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。

#### （七）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 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；
- 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、销售服务费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- 17、任一类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、本基金发生巨额赎回并延期办理；
- 24、本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；

- 25、本基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；
- 26、调整基金份额类别；
- 27、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时；
- 28、中国证监会规定的其他事项。

#### （八）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。

#### （九）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。

（十）基金管理人应当在基金季度报告、基金半年度报告、基金年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露股指期货交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示股指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等。

（十一）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。

（十二）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、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媒介。

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**

当出现下述情况时，基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金相关信息：

- (1) 不可抗力；
- (2) 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；
- (3) 法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的情况。

## 第十七部分 风险揭示

本基金的主要风险在于以下几方面：

### 一、市场风险

证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响，导致基金收益水平变化，产生风险，主要包括：

1、政策风险。因国家宏观政策发生变化，导致市场价格波动而产生风险。

2、经济周期风险。随经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化。基金投资于上市公司的股票，收益水平也会随之变化，从而产生风险。

3、利率风险。利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动，也影响着企业的融资成本和利润，基金收益水平会受到利率变化的影响。

4、上市公司经营风险。上市公司的经营好坏受多种因素影响，如管理能力、财务状况、市场前景、行业竞争、人员素质等，这些都会导致企业的盈利发生变化。如果基金所投资的上市公司经营不善，其股票价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，使基金投资收益下降。虽然基金可以通过投资多样化来分散这种非系统风险，但不能完全规避。

5、信用风险。基金所投资企业债券的发行人如出现违约、无法支付到期本息，或由于企业债券发行人信用等级降低导致债券价格下降，将造成基金资产损失。

6、购买力风险。因为通货膨胀的影响而导致货币购买力下降，从而使基金的实际收益下降。

### 二、管理风险

在基金管理运作过程中基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的占有和对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平。因此，本基金的收益水平与本基金管理人的管理水平、管理手段和管理技术等相关性较大。因此本基金可能因为基金管理人的因素而影响基金收益水平。

### 三、技术风险

当计算机、通讯系统、交易网络等技术保障系统或信息网络支持出现异常情况，可能导致基金日常的申购赎回无法按正常时限完成、登记结算系统瘫痪、核算系统无法按正常时限产生净值、基金的投资交易指令无法及时传输等风险。

#### 四、本基金特定风险

1、本基金作为混合型基金，股票资产占基金资产的 0%-95%，具有对股票市场的系统性风险，不能完全规避市场下跌的风险，在市场大幅上涨时也不能保证基金净值能够完全跟随或超越市场上涨幅度。

#### 2、股指期货等金融衍生品投资风险

金融衍生品是一种金融合约，其价值取决于一种或多种基础资产或指数，其评价主要源自于对挂钩资产的价格或价格波动的预期。投资于衍生品需承受市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险和法律风险等。由于衍生品通常具有杠杆效应，价格波动比标的工具更为剧烈，有时候比投资标的资产要承担更高的风险。并且由于衍生品定价相当复杂，不适当的估值有可能使基金资产面临损失风险。

股指期货采用保证金交易制度，由于保证金交易具有杠杆性，当出现不利行情时，标的资产价格的微小变动就可能会使投资人权益遭受较大损失。股指期货采用每日无负债结算制度，如果没有在规定的时间内补足保证金，按规定将被强制平仓，可能给投资带来重大损失。

#### 五、流动性风险

流动性风险是指基金所持证券资产变现的难易程度，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。本基金的流动性风险一方面来自于投资人的集中巨额赎回，另一方面来自于其投资组合或其中的部分资产变现能力变弱所产生的风险。主要包括：

##### （一）基金申购、赎回安排

投资人具体请参见本招募说明书“第八部分 基金份额的申购与赎回”，详细了解本基金的申购以及赎回安排。

在本基金发生流动性风险时，基金管理人可以综合利用备用的流动性风险管理工具以减少或应对基金的流动性风险，投资者可能面临赎回申请被暂停接受、赎回款项被延缓支付、被收取短期赎回费、基金估值被暂停等风险。投资者应该了解自身的流动性偏好，并评估是否与本基金的流动性风险匹配。

## （二）拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

本基金组合资产的流动性与基金合同约定的申购赎回安排匹配，投资策略能够支持不同市场情形下投资者的赎回要求，基金投资者结构、基金估值计价等方面安排能够使投资者得到公平对待。本基金的投资交易限制符合《流动性规定》。

基金管理人加强本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易风险对手的集中度，按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的交易对手实时交易额度管理并进行动态调整。基金管理人已建立健全逆回购交易质押品管理制度，根据质押品资质审慎确定质押率水平，持续监测质押品的风险状况与价值变动，质押品按照公允价值计算足额。

## （三）巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

当本基金发生巨额赎回情形时，基金管理人可以采用以下流动性风险管理措施：

- 1、暂停接受赎回申请；
- 2、延缓支付赎回款项；
- 3、延期办理赎回申请；
- 4、中国证监会认定的其他措施。

## （四）实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响

基金管理人经与基金托管人协商，在确保投资者得到公平对待的前提下，可依照法律法规及基金合同的约定，综合运用各类流动性风险管理工具，对赎回申请等进行适度调整，作为特定情形下基金管理人流动性风险的辅助措施，包括但不限于：

- 1、暂停接受赎回申请或延期办理赎回申请

投资人具体请参见本招募说明书“第八部分 基金份额的申购与赎回”中的“十、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形”和“十一、巨额赎回的情形及处理方式”，详细了解本基金暂停接受赎回申请及延期办理赎回申请的情形及程序。

在此情形下，投资人的部分或全部赎回申请可能被拒绝，同时投资人完成基金赎回时的基金份额净值可能与其提交赎回申请时的基金份额净值不同。

## 2、延缓支付赎回款项

投资人具体请参见本招募说明书“第八部分 基金份额的申购与赎回”中的“十、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形”和“十一、巨额赎回的情形及处理方式”，详细了解本基金延缓支付赎回款项的情形及程序。

在此情形下，投资人接收赎回款项的时间将可能比一般正常情形下有所延迟。

## 3、收取短期赎回费

本基金对持续持有期少于 7 日的投资者收取 1.5%的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产。

## 4、暂停基金估值

投资人具体请参见本招募说明书“第十二部分 基金资产估值”中的“七、暂停估值的情形”，详细了解本基金暂停估值的情形及程序。

在此情形下，投资人没有可供参考的基金份额净值，同时赎回申请可能被延期办理或被暂停接受，或被延缓支付赎回款项。

## 5、中国证监会认定的其他措施。

## 六、其他风险

1、因基金业务快速发展而在制度建设、人员配备、内控制度建立等方面不完善而产生的风险；

2、因人为因素而产生的风险，如内幕交易、欺诈等行为产生的风险；

3、对主要业务人员如基金经理的依赖而可能产生的风险；

4、因业务竞争压力可能产生的风险；

5、其他风险。

## 七、声明

本基金未经任何一级政府、机构及部门担保。基金投资人自愿投资于本基金，须自行承担投资风险。

除基金管理人直接办理本基金的销售外，本基金还通过基金销售机构代理销售，但是，基金资产并不是销售机构的存款或负债，也没有经基金销售机构担保收益，销售机构并不能保证其收益或本金安全。



## 第十八部分 基金合同的变更、终止与基金财产清算

### 一、《基金合同》的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或基金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。对于法律法规规定和基金合同约定可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，并自决议生效后两个工作日内在指定媒介公告。

### 二、《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- 3、《基金合同》约定的其他情形；
- 4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### 三、基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

3、在基金财产清算过程中，基金管理人和基金托管人应各自履行职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和本托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

4、基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

5、基金财产清算程序：

- (1) 《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；

- (2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- (3) 对基金财产进行估值和变现；
- (4) 制作清算报告；
- (5) 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；
- (6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；
- (7) 对基金剩余财产进行分配。

6、基金财产清算的期限为 6 个月。

#### **四、清算费用**

清算费用是指基金财产清算小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小组优先从基金剩余财产中支付。

#### **五、基金财产清算剩余资产的分配**

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

#### **六、基金财产清算的公告**

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

#### **七、基金财产清算账册及文件的保存**

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上，法律法规另有规定的从其规定。



## 第十九部分基金合同摘要

(本摘要如与基金合同正文不符,以基金合同正文为准)

### 一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

#### (一) 基金份额持有人的权利、义务

基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受,基金投资者自依据《基金合同》取得基金份额,即成为本基金份额持有人和《基金合同》的当事人,直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为《基金合同》当事人并不以在《基金合同》上书面签章或签字为必要条件。

同一类别每份基金份额具有同等的合法权益。

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金份额持有人的权利包括但不限于:

- (1) 分享基金财产收益;
- (2) 参与分配清算后的剩余基金财产;
- (3) 依法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或仲裁;
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金份额持有人的义务包括但不限于:

- (1) 认真阅读并遵守《基金合同》、招募说明书等信息披露文件;
- (2) 了解所投资基金产品,了解自身风险承受能力,自主判断投资价值,自主做出投资决策,自行承担投资风险;
- (3) 关注基金信息披露,及时行使权利和履行义务;

- (4) 缴纳基金认购、申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；
- (5) 在其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；
- (6) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；
- (7) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- (8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## (二) 基金管理人的权利、义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

- (1) 依法募集资金；
- (2) 自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
- (3) 依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- (4) 销售基金份额；
- (5) 按照规定召集基金份额持有人大会；
- (6) 依据《基金合同》及有关法律、法规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- (7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- (8) 选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；
- (9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；
- (10) 依据《基金合同》及有关法律、法规规定决定基金收益的分配方案；
- (11) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购、赎回和转换申请；
- (12) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

(13) 以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

(14) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；

(15) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换和非交易过户的业务规则；

(16) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

(1) 依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

(2) 办理基金备案手续；

(3) 自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；

(4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

(5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；

(6) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

(7) 依法接受基金托管人的监督；

(8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回的价格；

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(10) 编制季度、半年度和年度基金报告；

(11) 严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

(12) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；

(13) 按《基金合同》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；

(14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

(15) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

(16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上；

(17) 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件；

(18) 组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

(19) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

(20) 因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(21) 监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

(22) 当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；

(23) 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；

(24) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人；

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(26) 建立并保存基金份额持有人名册；

(27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

### (三) 基金托管人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：

(1) 自《基金合同》生效之日起，依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产；

(2) 依《基金合同》约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用；

(3) 监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人违反《基金合同》及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

(4) 根据相关市场规则，为基金开设证券账户、期货账户等投资所需账户，为基金办理证券、期货交易资金清算。

(5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

(6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

(2) 设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；

(3) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

(4) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；

(5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

(6) 按规定开设基金财产的资金账户、证券账户和期货账户等投资所需账户，按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

(7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；

(8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、赎回价格；

(9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

(10) 对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行；如果基金管理人未执行《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；

(11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；

(12) 建立并保存基金份额持有人名册；

(13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

(14) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；

(15) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

(16) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；

(17) 参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

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

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

(20) 按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿；

(21) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## 二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。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。

本基金份额持有人大会不设日常机构。

### (一) 召开事由

1、除法律法规另有规定或《基金合同》另有约定外，当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

(1) 终止《基金合同》；

(2) 更换基金管理人；

(3) 更换基金托管人；

(4) 转换基金运作方式；

(5) 调整基金管理人、基金托管人的报酬标准或提高销售服务费率；

(6) 变更基金类别；

(7) 本基金与其他基金的合并；

(8) 变更基金投资目标、范围或策略；

(9) 变更基金份额持有人大会程序；

(10) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；

(11) 单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；

(12) 对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

(13) 法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

2、在不违反法律法规、基金合同以及在不损害已有基金份额持有人权益的前提下，以下情况可由基金管理人和基金托管人协商一致后修改，不需召开基金份额持有人大会：

(1) 调低销售服务费和其他应由基金承担的费用；

(2) 法律法规要求增加的基金费用的收取；

(3) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内，且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下调整本基金的申购费率、赎回费率；

(4) 在不违反法律法规以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，增加、减少、调整基金份额类别或分类规则，或变更收费方式；

(5) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；

(6) 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生重大变化；

(7) 在不违反法律法规以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金管理人、登记机构、基金销售机构在法律法规规定或中国证监会许可的范围内调整有关申购、赎回、转换、基金交易、非交易过户、转托管等业务规则；

(8) 按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

## (二) 会议召集人及召集方式

1、除法律法规规定或《基金合同》另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。

3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集，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。

4、代表基金份额 10%以上（含 10%）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，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（含 10%）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。

5、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表基金份额 10%以上（含 10%）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。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、基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

### （三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 30 日，在指定媒介公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

- （1）会议召开的时间、地点和会议形式；
- （2）会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；
- （3）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
- （4）授权委托证明的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；
- （5）会务常设联系人姓名及联系电话；
- （6）出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- （7）召集人需要通知的其他事项。

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、表决意见寄交的截止时间和收取方式。

3、如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。

### （四）基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会、通讯开会或法律法规和监管机关允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托证明委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或基金托管人不派代表列席的，不影响表决效力。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、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；

（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，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）。若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以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基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效的基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之一（含三分之一）。

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式或会议通知载明的其他形式在表决截至日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式或会议通知载明的其他方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

（1）会议召集人按《基金合同》约定公布会议通知后，在2个工作日内连续公布相关提示性公告；

（2）召集人按基金合同约定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取表决意见的，不影响表决效力；

（3）本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之

一)；若本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以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三分之一以上(含三分之一)基金份额的持有人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见；

(4) 上述第(3)项中直接出具表决意见的基金份额持有人或受托代表他人出具表决意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具表决意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托书符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并与基金登记机构记录相符。

3、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、短信或其他方式进行表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

4、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、短信或其他方式，具体方式在会议通知中列明。

#### (五) 议事内容与程序

##### 1、议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如《基金合同》的重大修改、决定终止《基金合同》、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及《基金合同》规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开前及时公告。

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

###### (1) 现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第(七)条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持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，由基金托管人授权其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所持表决权的二分之一以上（含二分之一）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拒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。

会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名（或单位名称）、身份证明文件号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）和联系方式等事项。

#### （2）通讯开会

在通讯开会的情况下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后 2 个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

#### （六）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1、一般决议，一般决议须经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）通过方为有效；除下列第 2 项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

2、特别决议，特别决议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）通过方可做出。除基金合同另有约定外，转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》、本基金与其他基金合并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，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具表决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。

## （七）计票

### 1、现场开会

（1）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和代理人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，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选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

（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）如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有怀疑，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

（4）计票过程应由公证机关予以公证，基金管理人或基金托管人拒不出席大会的，不影响计票的效力。

### 2、通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：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表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

## （八）生效与公告

基金份额持有人大会的决议，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的决议自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起2个工作日内在指定媒介上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

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议。生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。

(九) 本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人与基金托管人协商一致并提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

### 三、基金合同解除和终止的事由、程序

#### (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。对于法律法规规定和基金合同约定可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，并自决议生效后两个工作日内在指定媒介公告。

#### (二) 《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在6个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- 3、《基金合同》约定的其他情形；
- 4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

#### (三) 基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起30个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

3、在基金财产清算过程中，基金管理人和基金托管人应各自履行职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和本托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

4、基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

5、基金财产清算程序：

(1) 《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；

(2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；

(3) 对基金财产进行估值和变现；

(4) 制作清算报告；

(5) 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；

(6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；

(7) 对基金剩余财产进行分配。

6、基金财产清算的期限为 6 个月。

(四) 清算费用

清算费用是指基金财产清算小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小组优先从基金剩余财产中支付。

(五) 基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

(六) 基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

#### （七）基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上，法律法规另有规定的从其规定。

#### 四、争议的处理和适用的法律

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交上海国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为上海，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，仲裁费用和律师费用由败诉方承担。

争议处理期间，双方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行《基金合同》和托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

《基金合同》受中国法律管辖。

#### 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》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》可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅。



## 第二十部分托管协议摘要

(本摘要如与托管协议正文不符,以托管协议正文为准)

### 一、托管协议当事人

#### (一) 基金管理人

名称:西部利得基金管理有限公司

住所:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路799号11层02、03单元

办公地址:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路799号11层02、03单元

法定代表人:刘建武

成立日期:2010年7月20日

批准设立机关及批准设立文号:中国证监会证监许可【2010】864号

组织形式:有限责任公司

注册资本:叁亿伍仟万元

存续期间:持续经营

经营范围:(021)38572888

#### (二) 基金托管人

名称:平安银行股份有限公司

注册地址:广东省深圳市深南东路5047号

办公地址:广东省深圳市深南东路5047号

法定代表人:谢永林

成立时间:1987年12月22日

组织形式:股份有限公司

注册资本:17,170,411,366元

存续期间:永续经营

基金托管资格批准文号:中国证监会证监许可[2008]1037号

经营范围:办理人民币存、贷、结算、汇兑业务;人民币票据承兑和贴现  
各项信托业务;经监管机构批准发行或买卖人民币有价证券;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;外汇存款、汇款;境内  
境外借款;从事同业拆借;外汇借款;外汇担保;在境内境外发行或代理发行

外币有价证券；买卖或代客买卖外汇及外币有价证券、自营外汇买卖；贸易、非贸易结算；办理国内结算；国际结算；外币票据的承兑和贴现；外汇贷款；资信调查、咨询、见证业务；保险兼业代理业务；代理收付款项；黄金进出口业务；提供信用证服务及担保；提供保管箱服务；外币兑换；结汇、售汇；信用卡业务；经有关监管机构批准或允许的其他业务。

## 二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。

基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种池和交易对手库，以便基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、政府支持机构债券、企业债、公司债、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、可交换债券、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据、公开发行次级债券等）、同业存单、债券回购、货币市场工具、权证、股指期货、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

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。

本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 0%-95%。其中，基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%；本基金每个交易日日终在扣除股指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%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。

(二) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督：

基金的投资组合应遵循以下限制：

- (1) 本基金股票资产占基金资产的 0%-95%；

(2) 本基金每个交易日日终在扣除股指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% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等;

(3) 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%;

(5) 本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的 3%;

(6) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证,不得超过该权证的 10%;

(7) 本基金在任何交易日买入权证的总金额,不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%;

(8) 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%;

(9) 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%;

(10) 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%;

(11) 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%;

(12) 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;

(13) 基金财产参与股票发行申购,本基金所申报的金额不超过本基金的总资产,本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;

(14) 基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%;

(15) 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;

(16) 本基金在任何交易日日终,持有的买入股指期货合约价值,不得超过基金资产净值的 10%;

(17) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等（不持有买入期货合约时，本条不适用）；

(18) 本基金在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；

(19) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；

(20) 本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指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 20%；

(21) 本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；

(22) 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、上市公司股票停牌、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，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(23) 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；

(24) 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。因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，除上述第（2）、（12）、（22）、（23）条外，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，本基金的投资范围、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。

如果法律法规或监管部门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，但须提前公告，不需经基金份额持有人大会审议。

（三）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对本托管协议第十五条第（九）款基金投资禁止行为进行监督。

基金托管人通过事后监督方式对基金管理人基金投资禁止行为进行监督。

基金管理人可以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，应当符合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的同意，并按法律法规予以披露。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。

根据法律法规有关基金从事关联交易的规定，基金管理人和基金托管人应事先相互提供与本机构有控股关系的股东、与本机构有其他重大利害关系的公司名单及有关关联方发行的证券名单。基金管理人和基金托管人有责任确保关联交易名单的真实性、准确性、完整性，并负责及时将更新后的名单发送给对方。

（四）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。

基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的、经慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手名单。基金管理人应严格按照交易对手名单的范围在银行间债券市场选择交易对手。基金托管人监督基金管理人是否按事前提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易。基金管理人可以每半年对银行间债券市场交易对手名单进行更新，新名单确定前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。如基金管理人根据市场情况需要临时调整银行间债券市场交易对手名单的，应

向基金托管人说明理由，并在与交易对手发生交易前3个工作日内与基金托管人协商解决。

基金管理人负责对交易对手的资信控制，按银行间债券市场的交易规则进行交易，并承担交易对手不履行合同造成的损失，基金托管人则根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督。如基金托管人事后发现基金管理人没有按照事先约定的交易对手进行交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人，基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任。

(五) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金管理人选择存款银行进行监督。

基金投资银行定期存款的，基金管理人应根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，确定符合条件的所有存款银行的名单，并及时提供给基金托管人，基金托管人应据以对基金投资银行存款的交易对手是否符合有关规定进行监督。

本基金投资银行存款应符合如下规定：

1、基金管理人、基金托管人应当与存款银行建立定期对账机制，确保基金银行存款业务账目及核算的真实、准确。

2、基金管理人与基金托管人应根据相关规定，就本基金银行存款业务另行签订书面协议，明确双方在相关协议签署、账户开设与管理、投资指令传达与执行、资金划拨、账目核对、到期兑付、文件保管以及存款证实书的开立、传递、保管等流程中的权利、义务和职责，以确保基金财产的安全，保护基金份额持有人的合法权益。

3、基金托管人应加强对基金银行存款业务的监督与核查，严格审查、复核相关协议、账户资料、投资指令、存款证实书等有关文件，切实履行托管职责。

4、基金管理人与基金托管人在开展基金存款业务时，应严格遵守《基金法》、《运作办法》等有关法律法规，以及国家有关账户管理、利率管理、支付结算等的各项规定。基金托管人发现基金管理人在选择存款银行时有违反有关法律法规的规定及《基金合同》的约定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人在10个工作日内纠正。基金管理人未能在10个工作日内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人在10个工

作日内纠正或拒绝结算，若基金管理人拒不执行造成基金财产的损失，基金托管人不承担任何责任。

（六）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资流通受限证券进行监督。

1. 基金投资流通受限证券，应遵守《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。

2. 流通受限证券，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。

3. 在首次投资流通受限证券之前，基金管理人应当制定相关投资决策流程、风险控制等规章制度。基金管理人应当根据基金的投资风格和流动性的需要合理安排流通受限证券的投资比例，并在相关制度中明确具体比例，避免基金出现流动性风险。基金投资非公开发行股票，基金管理人还应提供流动性风险处置预案。上述资料应包括但不限于基金投资流通受限证券的投资额度和投资比例控制情况。

上述规章制度须经基金管理人董事会批准。上述规章制度经董事会通过之后，基金管理人应至少于首次投资流通受限证券之前两个工作日将上述资料书面发至基金托管人，保证基金托管人有足够的时间进行审核。

4. 在投资流通受限证券之前，基金管理人应按约定时间向基金托管人提供符合法律法规要求的有关流通受限证券的信息，具体应当包括但不限于如下文件（如有）：拟发行证券主体的中国证监会批准文件、拟发行数量、定价依据、锁定期、基金拟认购的数量、价格、总成本、总成本占基金资产净值的比例、已持有流通受限证券市值占基金资产净值的比例、划款账号、划款金额、划款时间文件等。基金管理人应保证上述信息的真实、完整。

5. 基金投资流通受限证券，基金管理人应根据本协议的规定与基金托管银行签订风险控制补充协议。协议应包括基金托管人对于基金管理人是否遵守相关制度、流动型风险处置预案以及相关投资额度和比例的情况进行监督等内容。

6. 基金管理人应在基金投资非公开发行股票后两个交易日内，在中国证监会制定媒介披露所投资非公开发行股票的名称、数量、总成本、账面价值，以及总成本和账面价值占基金资产净值的比例、锁定期等信息。

7. 基金托管人应对基金管理人是否遵守法律法规、投资决策流程、风险控制制度、流动性风险处置预案情况进行监督，并审核基金管理人提供的有关书面信息。基金托管人认为上述资料可能导致基金出现风险的，有权要求基金管理人在投资流通受限证券前就该风险的消除或防范措施进行补充书面说明，并保留查看基金管理人风险管理部门就基金投资流通受限证券出具的风险评估报告等备查资料的权利。否则，基金托管人有权拒绝执行有关指令。因拒绝执行该指令造成基金财产损失的，基金托管人不承担任何责任，并有权报告中国证监会。

如基金管理人和基金托管人无法达成一致，应及时上报中国证监会请求解决。

(七) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金资产净值计算、各类基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查。

(八) 基金托管人发现基金管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作违反法律法规、基金合同和本托管协议的规定，应及时以电话提醒或书面提示等方式通知基金管理人限期纠正。

基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到书面通知后应在两个工作日内及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函，就基金托管人的疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

(九) 基金管理人应配合和协助基金托管人依照法律法规、基金合同和本托管协议对基金业务执行核查。

对基金托管人发出的书面提示，基金管理人应在规定时间内答复并改正，或就基金托管人的疑义进行解释或举证；对基金托管人按照法律法规、基金合



同和本托管协议的要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

（十）若基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当立即通知基金管理人。

（十一）基金托管人发现基金管理人有关重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本托管协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的，基金托管人应报告中国证监会。

### **三、基金管理人**对**基金托管人**的业务核查

（一）基金管理人**对基金托管人**履行托管职责情况进行核查，核查事项包括基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户、证券账户和期货账户等投资所需账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和各类基金份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

（二）基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、基金合同、本协议及其他有关规定时，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正。

基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式给基金管理人发出回函，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复基金管理人并改正。

（三）基金管理人发现基金托管人有关重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金托管人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

基金托管人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经基金管理人提出警告仍不改正的，基金管理人应报告中国证监会。

## 四、基金财产的保管

### （一）基金财产保管的原则

1. 基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产；
2. 基金托管人应安全保管基金财产；
3. 基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户、证券账户和期货账户等投资所需账户；
4. 基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立；
5. 基金托管人根据基金管理人的指令，按照基金合同和本协议的约定保管基金财产，如有特殊情况双方可另行协商解决；
6. 对于因为基金投资产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金账户的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金财产造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金财产的损失，基金托管人应当予以配合，但对此不承担任何责任；
7. 除依据法律法规和基金合同的规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

### （二）基金募集期间及募集资金的验资

1. 基金募集期间募集的资金应存于基金募集专户/基金认购专户，该账户由基金管理人开立并管理。
2. 基金募集期满或基金停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，基金管理人应将属于基金财产的全部资金划入基金托管人开立的基金托管专户，同时在规定时间内，聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的 2 名或 2 名以上中国注册会计师签字方为有效。
3. 若基金募集期限届满，未能达到基金合同生效的条件，由基金管理人按规定办理退款等事宜。

### （三）基金托管专户的开立和管理

1. 基金托管人以本基金的名义在其营业机构开设基金托管专户，保管基金的银行存款。本基金的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益、收取申购款，均需通过基金托管专户进行。基金管理人授权基金托管人办理托管专户的开立、销户、变更工作，本基金托管账户无需预留印鉴，具体按基金托管人要求办理。

2. 基金托管专户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立任何其他银行账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

3. 基金托管专户的开立和管理应符合有关法律法规以及银行业监督管理机构的其他有关规定。

#### （四）基金证券账户和结算备付金账户的开立和管理

1. 基金托管人在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司为基金开立基金托管人与本基金联名的证券账户。

2. 基金证券账户的开立和使用，仅限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借或转让基金的任何证券账户，亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

3. 基金证券账户的开立和证券账户卡的保管由基金托管人负责，账户资产的管理和运用由基金管理人负责。

4. 基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司开立结算备付金账户，并代表所托管的基金完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级法人清算工作，基金管理人应予以积极协助。结算备付金、交收价差资金等的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

5. 若中国证监会或其他监管机构在本托管协议订立日之后允许基金从事其他投资品种的投资业务，涉及相关账户的开立、使用的，若无相关规定，则基金托管人比照上述关于账户开立、使用的规定执行。

#### （五）银行间债券托管专户的开设和管理

基金合同生效后，基金管理人负责以本基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表基金进行交易；基金托管人负责以本基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司开设银行间债券市场债券托管账户，

并代表基金进行银行间市场债券的结算。基金管理人和基金托管人共同代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议，基金托管人保管协议正本，基金管理人保存协议副本。

#### （六）其他账户的开立和管理

在本托管协议签订日之后，本基金被允许从事符合法律法规规定和《基金合同》约定的其他投资品种的投资业务时，如果涉及相关账户的开设和使用，由基金管理人协助基金托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定，开立有关账户。该账户按有关规则使用并管理。

#### （七）基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的有关实物证券等有价凭证由基金托管人存放于基金托管人的保管库，也可存入中央国债登记结算有限责任公司、中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司、银行间市场清算所股份有限公司或票据营业中心的代保管库，保管凭证由基金托管人持有。实物证券等有价凭证的购买和转让，由基金管理人和基金托管人共同办理。基金托管人对由基金托管人以外机构实际有效控制的证券不承担保管责任。

#### （八）与基金财产有关的重大合同的保管

与基金财产有关的重大合同的签署，由基金管理人负责。由基金管理人代表基金签署的、与基金财产有关的重大合同的原件分别由基金管理人、基金托管人保管。除本协议另有规定外，基金管理人代表基金签署的与基金财产有关的重大合同包括但不限于基金年度审计合同、基金信息披露协议及基金投资业务中产生的重大合同，基金管理人应保证基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人应在重大合同签署后及时将重大合同传真给基金托管人，并在 30 个工作日内将正本送达基金托管人处。重大合同的保管期限为基金合同终止后 15 年。

对于无法取得二份以上的正本的，基金管理人应向基金托管人提供加盖公章的合同复印件或传真件，未经双方协商一致，合同原件不得转移。

### 五、基金资产净值计算与复核

#### （一）基金资产净值的计算、复核与完成的时间及程序

##### 1. 基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的金额。

相应类别基金份额的基金份额净值是指该类基金资产净值除以当日该类基金份额总数，基金份额净值的计算，精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入，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各类基金份额净值，经基金托管人复核，按规定公告。

## 2. 复核程序

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。基金管理人每工作日对基金资产进行估值后，将各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，由基金管理人对外公布。

3. 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，仍无法达成一致意见的，按照基金管理人对于基金资产净值的计算结果对外予以公布。

## (二) 基金资产估值方法和特殊情形的处理

### 1. 估值对象

基金所拥有的股票、权证、股指期货合约、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

### 2. 估值方法

#### (1) 证券交易所上市的有价证券的估值

① 交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

② 交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（基金合同另有规定的除外），选取估值日第三方估值机构提供的相应品种对应的估值净价估值，具体估值机构由基金管理人与托管人另行协商约定；

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

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

(2) 处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

① 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

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

③ 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

(3) 全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，以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。

(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) 股指期货合约按照结算价估值，如估值日无结算价且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日结算价估值。

(6) 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。

(7) 相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

### 3. 特殊情形的处理

基金管理人、基金托管人按估值方法的第（6）项进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

由于不可抗力原因，或由于证券/期货交易所及登记机构发送的数据错误等，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。

#### （三）基金份额净值错误的处理方式

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。当任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) 错误偏差达到或超过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；错误偏差达到或超过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。

(四) 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一致，基金管理人应当暂停基金估值；

4. 中国证监会和基金合同认定的其他情形。

#### （五）基金会计制度

按国家有关部门规定的会计制度执行。

#### （六）基金账册的建立

基金管理人进行基金会计核算并编制基金财务会计报告。基金管理人、基金托管人独立地设置、记录和保管本基金的全套账册。若基金管理人和基金托管人对会计处理方法存在分歧，应以基金管理人的处理方法为准。若当日核对不符，暂时无法查找到错账的原因而影响到基金资产净值的计算和公告的，以基金管理人的账册为准。

#### （七）基金财务报表与报告的编制和复核

##### 1. 财务报表的编制

基金财务报表由基金管理人编制，基金托管人复核。

##### 2. 报表复核

基金托管人在收到基金管理人编制的基金财务报表后，进行独立的复核。核对不符时，应及时通知基金管理人共同查出原因，进行调整，直至双方数据完全一致。

##### 3. 财务报表的编制与复核时间安排

###### （1）报表的编制

基金管理人应当在每月结束后 5 个工作日内完成月度报表的编制；在每个季度结束之日起 15 个工作日内完成基金季度报告的编制；在上半年结束之日起 60 日内完成基金半年度报告的编制；在每年结束之日起 90 日内完成基金年度报告的编制。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。基金合同生效不足两个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。

## (2) 报表的复核

基金管理人应及时完成报表编制，将有关报表提供基金托管人复核；基金托管人在复核过程中，发现双方的报表存在不符时，基金管理人和基金托管人应共同查明原因，进行调整，调整以国家有关规定为准。

基金管理人应留足充分的时间，便于基金托管人复核相关报表及报告。

## 六、基金份额持有人名册的保管

基金份额持有人名册至少应包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。基金份额持有人名册由基金登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，基金管理人和基金托管人应分别保管基金份额持有人名册。保管方式可以采用电子或文档的形式，保存期不少于 15 年。如不能妥善保管，则按相关法规承担责任。

基金托管人因编制基金定期报告等合理原因要求基金管理人提供相关资料时，基金管理人应将有关资料送交基金托管人，不得无故拒绝或延误提供，并保证其真实性、准确性和完整性。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。

## 七、争议解决方式

各方当事人同意，因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交上海国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为上海，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，仲裁费用和律师费用由败诉方承担。

争议处理期间，双方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行《基金合同》和托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本协议受中国法律管辖。

## 八、托管协议的变更与终止

### (一) 托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行修改。修改后的新协议，其内容不得与基金合同的规定有任何冲突。基金托管协议的变更报中国证监会备案。

### (二) 基金托管协议终止出现的情形

#### 1. 基金合同终止；

2. 基金托管人解散、依法被撤销、破产或由其他基金托管人接管基金资产；
3. 基金管理人解散、依法被撤销、破产或由其他基金管理人接管基金管理权；
4. 发生法律法规或基金合同规定的终止事项。

## 第二十一部分对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务。以下是主要的服务内容，基金管理人根据基金份额持有人的需要和市场的变化，有权增加、修改这些服务项目。

### 一、客户服务专线

#### （一）理财咨询

人工理财咨询、账户查询、投资人个人资料完善等。

（二）全天候的7×24小时电话自助查询（基金净值、账户信息、公司介绍、产品介绍等）。

（三）7×24小时留言信箱。若不在人工服务时间或座席繁忙，可留言，基金管理人会尽快在2个工作日内回电。

### 二、客户投诉及建议受理服务

投资人可以通过信函、电邮、传真等方式提出咨询、建议、投诉等需求，基金管理人将尽快给予回复，并在处理进程中随时给予跟踪反馈。

### 三、短信提示发送服务

投资人可以通过拨打基金管理人客户服务电话申请订制（退订）免费的手機短信资讯。基金管理人定期或不定期向投资人发送短信资讯。

### 四、电子邮件电子刊物发送服务

投资人可以通过拨打基金管理人客户服务电话申请订制（退订）免费的电子邮件资讯。基金管理人定期或不定期向投资人发送电子资讯。

### 五、联系基金管理人

（一）网址：[www.westleadfund.com](http://www.westleadfund.com)

（二）电子邮箱：[service@westleadfund.com](mailto:service@westleadfund.com)

（三）客户服务热线：400-700-7818（全国免长途话费），021-38572666

（四）客户服务传真：021-38572750

（五）基金管理人办公地址：上海市浦东新区杨高南路799号陆家嘴世纪金融广场11层邮编：200127

六、如本招募说明书存在任何您/贵机构无法理解的内容，请通过上述方式联系基金管理人。请确保投资前，您/贵机构已经全面理解了本招募说明书。



## 第二十二其他应披露事项

序号	公告事项	披露日期
1	西部利得基金管理有限公司关于新增武汉市伯嘉基金销售有限公司为代销机构并开通定期定额投资、转换业务及参与其费率优惠活动的公告	2017-06-29
2	西部利得新动力灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书(2017年第一期)	2017-07-01
3	西部利得新动力灵活配置混合型证券投资基金招募说明书(更新)摘要	2017-07-01
4	西部利得基金管理有限公司关于旗下开放式基金 2017 年半年度最后一个自然日基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值的公告	2017-07-01
5	西部利得基金管理有限公司关于新增天津万家财富资产管理有限公司为代销机构并开通转换业务的公告	2017-07-20
6	西部利得新动力灵活配置混合型证券投资基金 2017 年第 2 季度报告	2017-07-21
7	关于新增北京晟视天下投资管理有限公司为西部利得基金管理有限公司旗下部分基金代销机构并开通定期定额投资、转换业务的公告	2017-08-02
8	西部利得基金管理有限公司关于旗下部分证券投资基金在中泰证券股份有限公司开通转换及定投业务并参与其费率优惠活动的公告	2017-08-25
9	西部利得新动力灵活配置混合型证券投资基金 2017 年半年度报告	2017-08-29
10	西部利得新动力灵活配置混合型证券投资基金 2017 年半年度报告摘要	2017-08-29
11	西部利得基金管理有限公司关于新增海银基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构并开通定期定额投资、转	2017-09-13

	换业务及参与其费率优惠活动的公告	
12	西部利得基金管理有限公司关于新增成都华羿恒信财富投资管理有限公司为旗下部分基金代销机构并开通定期定额投资、转换业务及参与其费率优惠活动的公告	2017-09-19
13	西部利得基金管理有限公司关于新增联储证券有限责任公司为旗下部分基金代销机构并开通定期定额投资、转换业务及参与其费率优惠活动的公告	2017-10-18
14	西部利得新动力灵活配置混合型证券投资基金2017年第3季度报告	2017-10-26
15	关于新增喜鹊财富基金销售有限公司为西部利得基金管理有限公司旗下部分基金代销机构并开通定期定额投资、转换业务及参与其费率优惠活动的公告	2017-11-07
16	关于新增上海挖财金融信息服务有限公司为西部利得基金管理有限公司旗下部分基金代销机构并开通定期定额投资业务及参与其费率优惠活动的公告	2017-11-22
17	关于新增华夏财富投资管理有限公司为西部利得基金管理有限公司旗下部分基金代销机构并开通定期定额投资、转换业务及参与其费率优惠活动的公告	2017-12-19
18	西部利得新动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	2017-12-20
19	西部利得基金管理有限公司关于旗下部分基金在直销渠道开展基金转换业务时开展相关费率优惠活动的公告	2017-12-21
20	西部利得新动力灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书(2017年第二期)	2017-12-29
21	西部利得新动力灵活配置混合型证券投资基金招募说明书(更新)摘要(2017年第二期)	2017-12-29
22	西部利得基金管理有限公司关于旗下开放式基金2017年度最后一个自然日基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值的公告	2018-01-02
23	西部利得新动力灵活配置混合型证券投资基金2017年第4季度报告	2018-01-19

24	关于新增西部期货有限公司为西部利得基金管理有限公司旗下部分基金代销机构并开通定期定额投资、转换业务的公告	2018-03-03
25	关于新增上海基煜基金销售有限公司为西部利得基金管理有限公司旗下部分基金代销机构并开通定期定额投资、转换业务与参与其费率优惠活动的公告	2018-03-07
26	关于新增世纪证券有限责任公司为西部利得基金管理有限公司旗下部分基金代销机构并开通定期定额投资、转换业务的公告	2018-03-21
27	西部利得基金管理有限公司关于西部利得新动力灵活配置混合型证券投资基金修改基金合同的公告	2018-03-26
28	西部利得新动力灵活配置混合型证券投资基金托管协议	2018-03-26
29	西部利得新动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同	2018-03-26
30	关于新增中信证券股份有限公司为西部利得基金管理有限公司旗下部分基金代销机构并开通定期定额投资业务的公告	2018-03-27
31	关于新增中信证券（山东）有限责任公司为西部利得基金管理有限公司旗下部分基金代销机构并开通定期定额投资业务的公告	2018-03-27
32	关于新增中信期货有限公司为西部利得基金管理有限公司旗下部分基金代销机构并开通定期定额投资业务的公告	2018-03-28
33	西部利得新动力灵活配置混合型证券投资基金2017年年度报告摘要	2018-03-30
34	西部利得新动力灵活配置混合型证券投资基金2017年年度报告	2018-03-30
35	西部利得新动力灵活配置混合型证券投资基金2018年第一季度报告	2018-04-23
36	关于新增中银国际证券股份有限公司为西部利得基金管理有限公司旗下部分基金代销机构并开通定期定额投资、转换业务的公告	2018-05-12
37	关于新增大河财富基金销售有限公司为西部利得基金管理有限公司旗下部分基金代销机构并开通定期定额投资、转换业务与参与其费率优惠活动的公告	2018-05-30
38	关于新增北京恒天明泽基金销售有限公司为西部利得基金管理有限公司旗下部分基金代销机构并开通定期定额投资、转换业务与参与其费率优惠活动的公告	2018-06-08
39	西部利得新动力灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书(2018年第一期)	2018-06-30
40	西部利得新动力灵活配置混合型证券投资基金招募说明书(更新)摘要(2018年第一期)	2018-06-30



41	关于新增信达证券股份有限公司为西部利得基金管理有限公司旗下部分基金代销机构并开通定期定额投资、转换业务与参与其费率优惠活动的公告	2018-07-12
42	西部利得新动力灵活配置混合型证券投资基金2018年第2季度报告	2018-07-19
43	关于新增北京蛋卷基金销售有限公司为西部利得基金管理有限公司旗下部分基金代销机构并开通定期定额投资、转换业务与参与其费率优惠活动的公告	2018-07-24
44	关于新增安信证券股份有限公司为西部利得基金管理有限公司旗下部分基金代销机构并开通定期定额投资、转换业务与参与其费率优惠活动的公告	2018-08-14
45	西部利得新动力灵活配置混合型证券投资基金2018年半年度报告	2018-08-28
46	西部利得新动力灵活配置混合型证券投资基金2018年半年度报告摘要	2018-08-28
47	西部利得新动力灵活配置混合型证券投资基金2018年第3季度报告	2018-10-24

## 第二十三部分招募说明书的存放及查阅方式

招募说明书在编制完成后，将存放于基金管理人所在地、基金托管人所在地、有关销售机构及其网点，供公众查阅。投资人在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。投资人也可在基金管理人指定的网站上进行查阅。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与公告的内容完全一致。

## 第二十四部分备查文件

备查文件等文本存放在基金管理人、基金托管人和销售机构的办公场所和营业场所，在办公时间内可供免费查阅。

一、中国证监会准予西部利得新动力灵活配置混合型证券投资基金募集的注册文件

二、《西部利得新动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

三、《西部利得新动力灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

四、关于申请募集西部利得新动力灵活配置混合型证券投资基金之法律意见书

五、基金管理人业务资格批件、营业执照

六、基金托管人业务资格批件、营业执照

七、中国证监会要求的其他文件

西部利得基金管理有限公司

2018年12月28日