泰信先行策略

开放式证券投资基金更新招募说明书

（2019 年第 2 号）

核准文件：证监基金字[2004]69 号文

核准日期：二零零四年五月十日

基金管理人：泰信基金管理有限公司

基金托管人：中国光大银行股份有限公司

本报告送出日期：二〇一九年八月十日

重 要 提 示

1、本基金管理人保证本更新招募说明书的内容真实、准确、完整。本更新招募说明书已报中国证监会备案，但中国证监会对本基金作出的任何决定，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

2、投资有风险，投资人申购本基金时应认真阅读本招募说明书及其更新。

3、基金的过往业绩并不预示其未来表现。

4、本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。

5、本更新招募说明书所载有关财务数据（未经审计）和净值表现及投资组合数据的截止日均为2019年6月30日，其余内容截止日期为2019年6月28日。原招募说明书及其历次更新与本更新招募说明书不一致的，以本更新招募说明书为准。

目　　录

第一节绪言 1
第二节释义 2
第三节基金管理人 4
第四节基金托管人 12
第五节相关服务机构 15
第六节基金份额的申购与赎回 48
第七节基金的转换 54
第八节基金的非交易过户及转托管 60
第九节基金的投资 62
第十节基金的业绩 69
第十一节基金的财产 71
第十二节基金财产的估值 72
第十三节基金的收益分配 76
第十四节基金的费用与税收 77
第十五节基金的会计与审计 80
第十六节基金的信息披露 81
第十七节风险揭示 84
第十八节基金的终止与清算 87
第十九节基金合同的内容摘要 88
第二十节基金托管协议的内容摘要 100
第二十一节对基金份额持有人的服务 107
第二十二节其他应披露事项 111
第二十三节招募说明书的存放及查阅方式 112
第二十四节备查文件 113

第一节 绪 言

本更新招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作管理办法》）、《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《流动性风险管理规定》）等相关法律、法规及《泰信先行策略开放式证券投资基金基金合同》(以下简称《基金合同》）编写、更新。

本更新招募说明书阐述了泰信先行策略开放式证券投资基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资人投资决策有关的全部必要事项，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

本基金管理人承诺本更新招募说明书不存在任何虚假内容、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。

本基金根据原招募说明书所载明资料申请募集，基金合同于2004年6月28日正式生效。

本更新招募说明书由泰信基金管理有限公司解释。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本更新招募说明书中载明的信息，或对更新本招募说明书作出任何解释或者说明。

本更新招募说明书根据本基金的基金合同编写，并经中国证监会核准。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》、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。

本更新招募说明书所载有关财务数据（未经审计）和净值表现及投资组合数据的截止日均为2019年6月30日，其余内容截止日期为2019年6月28日。原招募说明书及其历次更新与本更新招募说明书不一致的，以本更新招募说明书为准。

第二节 释 义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称代表如下含义：

基金或本基金	指泰信先行策略开放式证券投资基金；
基金合同	指《泰信先行策略开放式证券投资基金基金合同》；
招募说明书	指《泰信先行策略开放式证券投资基金招募说明书》；
更新招募说明书	指《泰信先行策略开放式证券投资基金更新招募说明书》，是基金合同生效后对招募说明书的定期更新；
《基金法》	指《中华人民共和国证券投资基金法》；
《运作管理办法》	指《证券投资基金运作管理办法》；
《销售管理办法》	指《证券投资基金销售管理办法》；
《信息披露办法》	指《证券投资基金信息披露管理办法》；
《流动性风险管理规定》	指中国证监会公布的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》；
中国证监会	指中国证券监督管理委员会；
基金管理人	指泰信基金管理有限公司；
基金托管人	指中国光大银行股份有限公司；
直销机构	指泰信基金管理有限公司；
代销机构	指接受基金管理人委托代为办理本基金的认购、申购、赎回、转换及转托管等业务的机构；
销售机构	指直销机构及代销机构；
注册登记业务	指本基金登记、存管、清算和交收业务，具体内容包括投资人基金账户管理、基金份额注册登记、清算及基金交易确认、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等；
注册登记机构	指办理本基金注册登记业务的机构，本基金的注册登记机构为泰信基金管理有限公司；
基金账户	指注册登记机构为基金投资者开立的记录其持有的由该注册登记机构办理注册登记的基金份额余额及其变动情况的账户；
交易账户	指销售机构为基金投资者开立的记录其持有的由该销售机构办理

	认购、申购、赎回、转换及转托管等业务的基金份额余额及其变动情况的账户；
基金成立日	指基金达到成立条件后，基金发起人宣告基金成立的日期；
募集期	指自招募说明书公告之日起到基金合同生效日的时间段，最长不超过 3 个月；
存续期	指基金成立并存续的不定期期限；
工作日	指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日；
开放日	指为投资者办理基金申购、赎回等业务的工作日；
T 日	指销售机构在规定时间受理投资者申购、赎回或其他业务申请的日期；
T+n 日	指 T 日后（不包括 T 日）第 n 个工作日；
认购	指在本基金设立募集期内，投资者申请购买本基金基金份额的行为；
申购	指在本基金成立后，投资者申请购买本基金基金份额的行为；
赎回	指基金份额持有人按基金合同规定的条件要求基金管理人购回基金份额的行为；
基金转换	指基金份额持有人按基金管理人规定的条件，申请将其持有的基金管理人管理的某一基金的全部或部分基金份额转换为基金管理人管理的、并由同一注册登记人办理注册登记的其他基金的基金份额的行为；
转托管	指基金份额持有人申请将其在某一销售机构交易账户持有的基金份额全部或部分转出并转入另一销售机构交易账户的行为；
元	指人民币元；
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、银行存款利息及其他合法收入；
基金资产总值	指基金购买的各类证券、银行存款本息及其他投资等的价值总和；
基金资产净值	指基金资产总值减去负债后的价值；
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；

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；
先行策略	本基金投资策略的核心，是对国际流行的均值反转策略在中国市场的改良应用，在投资操作中注意运用股价波动的均值反转规律，强调“先行价值发现、提前控制风险”；简单讲，就是在市场取得一致认识之前，超前发现和介入价值被低估的行业和个股，并在市场存在下跌风险时，通过资产配置比例的调整，提前控制下跌风险。

第三节 基金管理人

一、基本情况

基金管理人名称：泰信基金管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区浦东南路256号37层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区浦东南路256号华夏银行大厦36、37层

成立日期：2003年5月23日

法定代表人：万众

总经理：葛航

电话：021-20899188

传真：021-20899008

联系人：姚慧

发展沿革：

泰信基金管理有限公司（First-Trust Fund Management Co.，Ltd.）是山东省国际信托投资有限公司（现更名为山东省国际信托股份有限公司）联合江苏省投资管理有限责任公司、青岛国信实业有限公司共同发起设立的基金管理公司。公司于2002年9月24日经中国证券监督委员会批准正式筹建，2003年5月8日获准开业，是以信托投资公司为主发起人而发起设立的基金管理公司。

公司目前下设上海锐懿资产管理有限公司、市场部、产品部、营销部（分华东、华北、

华南三大营销中心）、理财顾问部、深圳分公司、北京分公司、电子商务部、客服中心、基金投资部、研究部、专户投资部、清算会计部、集中交易部、计划财务部、信息技术部、风险管理部、监察稽核部、综合管理部。截至2019年6月底，公司有正式员工97人，多数具有硕士以上学历。所有人员在最近三年内均未受到所在单位及有关管理部门的处罚。

截至 2019 年 6 月 28 日，泰信基金管理有限公司旗下共有泰信天天收益货币、泰信先行策略混合、泰信双息双利债券、泰信优质生活混合、泰信优势增长混合、泰信蓝筹精选混合、泰信债券增强收益、泰信发展主题混合、泰信债券周期回报、泰信中证 200 指数、泰信中小盘精选混合、泰信行业精选混合、泰信中证基本面 400 指数分级、泰信现代服务业混合、泰信鑫益定期开放债券、泰信国策驱动混合、泰信鑫选混合、泰信互联网+混合、泰信智选成长混合、泰信鑫利混合、泰信竞争优选混合共 21 只开放式基金及 15 个特定客户资产管理计划。

二、注册资本、股权结构

泰信基金管理有限公司注册资本 2 亿元人民币。其中，山东省国际信托股份有限公司出资 9000 万元，占公司总股本的 45%；江苏省投资管理有限责任公司出资 6000 万元，占公司总股本的 30%；青岛国信实业有限公司出资 5000 万元，占公司总股本的 25%。公司目前的股权结构如下：

股东单位名称	现金出资金额	股权比例
山东省国际信托股份有限公司	9000万元	45%
江苏省投资管理有限责任公司	6000万元	30%
青岛国信实业有限公司	5000万元	25%
合计	2亿元	100%

三、主要人员情况

（一）基金管理人董事、监事、经理及其他高级管理人员基本情况

（1）董事会成员

万众先生，董事长，高级经济师，硕士；曾任山东省国际信托有限公司副总经理，山东省鲁信实业集团有限公司副总经理，山东省鲁信实业集团有限公司董事长、总经理，山东省国际信托股份有限公司总经理，现任山东省国际信托股份有限公司董事长。

葛航先生，董事，总经理，学士；1989 年 7 月加入山东省国际信托有限公司，曾任山东省国际信托有限公司租赁部高级业务经理、山东省国际信托有限公司自营业务部经理、上海锐懿资产管理有限公司执行董事。

校登楼先生，董事，高级会计师，注册会计师，本科。曾任江苏省国际信托投资公司证券部副科长，江苏省国信集团审计部部长、项目经理、高级经理，现任江苏省投资管理有限公司财务部副总经理。

王静玉先生，董事，国际金融硕士，曾任青岛国信融资担保有限公司副总经理，青岛国信金融控股有限公司研究发展部副经理，青岛国信资本投资有限公司副总经理，青岛国信创新股权投资管理有限公司执行董事兼总经理，现任青岛国信金融控股有限公司副总经理，青岛久实投资管理有限公司执行董事兼法人，青岛国信资本投资有限公司总经理兼董事，青岛海洋创新产业投资基金有限公司总经理兼董事、青岛国信创新股权投资管理有限公司执行董事兼总经理。

王川先生，独立董事，经济管理学大专，高级经济师；曾任山西省委政策研究室干部、省委办公厅秘书，中国农业银行办公室秘书、综合处副处长、人事教育部副主任、研究室副主任、信贷业务部主任、吉林分行行长兼党组书记、党组成员兼纪检组组长、副行长兼党组成员（党委委员）、副行长兼党委副书记，中国光大（集团）总公司副董事长、党委副书记兼中国光大银行副董事长、行长，中国中信集团公司副董事长、党委委员、中信（金融）控股总裁。

郝亮先生，独立董事，本科。曾任中国建设银行青岛市支行副行长、分行办公室副主任，青岛市住房公积金管理中心副主任，深圳大通实业股份有限公司董事会秘书，深圳大通实业股份有限公司副董事长，兼董事会秘书，现任大通金控（青岛）投资管理有限公司董事长。

李华强先生，独立董事，经济学硕士，曾任中国有色金属工业总公司株洲冶炼厂总经理，深圳科技工业园总公司总经理助理，国信证券股份有限公司副总经理，浙江（方正）证券股份有限公司董事长、党委书记兼总裁，华西证券股份有限公司副总裁，华林证券股份有限公司总裁、党委副书记，中央汇金投资有限责任公司副董事长。

（2）监事会成员

刘晓东先生，监事会主席，金融学学士，高级经济师；曾任中国工商银行青岛分行资金调度员、信贷员，青岛国际信托投资公司科长、副处长，青岛国信实业有限公司资产管理部经理，青岛国信发展（集团）有限责任公司资产管理部部长；青岛国信城市信息科技有限公司董事长兼总经理。

张牧农先生，监事，工学硕士，高级经济师；曾任山东省国际信托投资公司投资部副经理、项目评审部副经理，青岛华和国际租赁公司副总经理，法国巴黎鲁新公司副总经理，山东省国际信托投资公司投资部副经理；现任山东鲁信投资控股公司投资管理部高级业务经

理。

叶茂先生，监事，本科。曾任东方海外物流（中国）有限公司南京分公司项目经理、南京水门电子有限公司销售经理。现任江苏省投资管理有限公司资产管理部办事员。

周向光先生，职工监事，本科。2002 年 12 月加入泰信基金管理有限公司，先后担任综合管理部副经理、北京办事处主任、行政副总监兼理财顾问部业务副总监，现任董监事工作部主任、综合管理部副总监、工会主席。

张萍历女士，职工监事，硕士。2007 年 7 月加入泰信基金管理有限公司，现任公司集中交易部总监。

胡囡女士，职工监事，经济学硕士。2006 年加入泰信基金管理有限公司，现任监察稽核部总监、上海锐懿资产管理有限公司监事。

（3）公司高级管理人员

万众先生，董事长，高级经济师，硕士；曾任山东省国际信托有限公司副总经理，山东省鲁信实业集团有限公司副总经理，山东省鲁信实业集团有限公司董事长、总经理，山东省国际信托股份有限公司总经理，现任山东省国际信托股份有限公司董事长。

葛航先生，董事，总经理，学士；1989 年 7 月加入山东省国际信托有限公司，曾任山东省国际信托有限公司任租赁部高级业务经理、山东省国际信托有限公司自营业务部经理、上海锐懿资产管理有限公司执行董事

吴胜光先生，督察长，硕士，高级经济师；曾任南京大学城市与资源系副主任、江苏省国际信托投资公司投资银行部业务二部经理、信泰证券有限责任公司投资银行部副总经理。经历了泰信基金管理有限公司的筹建及成立，并担任公司督察长至今。

桑维英女士，副总经理兼董事会秘书，硕士；2002 年 10 月加入泰信基金管理有限公司，经历了公司的筹建及成立，历任监察稽核部负责人兼营销策划部负责人、行政总监、第一届及第二届监事会职工监事、总经理助理、上海锐懿资产管理有限公司监事。

韩波先生，副总经理、财务负责人，大学本科；曾先后任山东国投上海证券部财务经理，鲁信投资有限公司财务、投资管理部门经理。2002 年 10 月加入泰信基金管理有限公司，经历了公司的筹建及成立，历任公司部门经理、总经理助理。

（二）基金管理小组成员

王博强先生,硕士，证券从业经验10年。2008年12月加入泰信基金管理有限公司，历任基金投资部行政助理、集中交易部交易员、研究部助理研究员、研究员、高级研究员兼泰信发展主题混合基金经理助理。自2015年3月17日起担任泰信现代服务业基金基金经理。自2016

年6月30日起担任泰信先行策略混合基金的基金经理。

附：本基金历任基金经理情况：

姓名	管理本基金的时间
袁园	2012 年 3 月 1 日至 2017 年 8 月 30 日
钱鑫	2014 年 5 月 20 日至 2016 年 6 月 30 日
戴宇虹	2015 年 2 月 5 日至 2016 年 6 月 30 日
朱志权	2012 年 3 月 31 日至 2015 年 2 月 5 日
梁剑	2009 年 4 月 25 日至 2012 年 3 月 31 日
王鹏	2008 年 6 月 28 日至 2009 年 7 月 2 日
董红波	2007 年 2 月 9 日至 2008 年 6 月 28 日
林少立	2006 年 5 月 27 日至 2007 年 5 月 10 日
张翎	2005 年 5 月 17 日至 2006 年 5 月 27 日
郝兵	2005 年 5 月 17 日至 2005 年 12 月 31 日
管文浩	2004 年 6 月 28 日至 2005 年 5 月 17 日

（三）投资决策委员会成员名单

本基金采取集体投资决策制度，由分管投资的副总经理韩波先生担任投资决策委员会主任，投资决策委员会成员如下：

葛航先生，董事，总经理；

韩波先生，副总经理；

朱志权先生，基金投资部总监兼投资总监，泰信优势增长混合基金、泰信智选成长混合基金的基金经理；

梁剑先生，研究部副总监兼研究副总监；

何俊春女士，基金投资部固定收益投资总监，泰信天天收益货币基金、泰信双息双利债券基金、泰信债券增强收益基金、泰信债券周期回报基金、泰信鑫益定期开放债券基金、泰信鑫利混合基金的基金经理；

另外，督察长、风险管理部负责人、监察稽核部负责人及相关基金经理列席会议。

（四）上述人员之间均不存在近亲属关系。

四、基金管理人的职责

基金管理人应当履行下列职责：

（一）依法募集基金，办理或者委托经国务院证券监督管理机构认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

（二）办理基金备案手续；

（三）对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；

（四）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；

（五）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

（六）编制中期和年度基金报告；

（七）计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；

（八）办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；

（九）召集基金份额持有人大会；

（十）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；

（十一）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；

（十二）国务院证券监督管理机构规定的其他职责。

五、基金管理人的承诺

（一）本基金管理人将根据基金合同的规定，按照招募说明书列明的投资目标、理念、策略及限制等全权处理本基金的投资。

（二）本基金管理人不得从事以下违反《证券法》《基金法》以及其它国家法律法规的行为，并承诺建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止下列行为的发生：

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、依照法律、行政法规有关规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他行为。

（三）基金财产不得用于下列投资或者活动：

1、承销证券；

2、向他人贷款或者提供担保；

3、从事承担无限责任的投资；

4、买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；

5、向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；

6、买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；

7、从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

8、依照法律、行政法规有关规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

（四）本基金管理人将加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下行为：

1、越权或违规经营；

2、违反基金合同或托管协议；

3、故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法利益；

4、在向中国证监会报送的材料中弄虚作假；

5、拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；

6、玩忽职守、滥用职权；

7、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；

8、其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

（五）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、被代理人、被代表人、受雇人或任何其他第三人谋取不当利益；

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。

六、基金管理人的内部控制制度

（一）内部控制的原则

1、全面性原则。内部控制制度覆盖公司的各项业务、各个部门和各级人员，并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个经营环节。

2、独立性原则。公司设立独立的督察长与监察稽核部门，并使它们保持高度的独立性与权威性。

3、相互制约原则。公司部门和岗位的设置权责分明、相互牵制，并通过切实可行的相互制衡措施来消除内部控制中的盲点。

4、重要性原则：公司的发展必须建立在风险控制完善和稳固的基础上，内部风险控制与公司业务发展同等重要。

（二）内部控制的主要内容

1、控制环境

公司董事会、监事会重视建立完善的公司治理结构与内部控制体系。本公司在董事会下设立有独立董事参加的审计、合规与风险控制委员会，负责评价与完善公司的内部控制体系；公司监事会负责审阅外部独立审计机构的审计报告，确保公司财务报告的真实性、可靠性，督促实施有关审计建议。

公司管理层在总经理领导下，认真执行董事会确定的内部控制战略，为了有效贯彻公司董事会制定的经营方针及发展战略，设立了总经理办公会、投资决策委员会等，负责公司经营、基金投资、风险管理的重大决策。

公司设督察长，履行职责的范围涵盖基金及公司运作的所有业务环节，对公司和基金运作的合法性、合规性及合理性进行全面检查与监督，参与公司风险控制工作，发生重大风险事件时向公司董事长和中国证监会报告。

2、风险评估

风险管理部定期评估公司及基金的风险状况，包括所有能对经营目标、投资目标产生负面影响的内部和外部因素，对公司总体经营目标产生影响的可能性及影响程度。

3、操作控制

公司内部组织结构的设计方面，体现部门之间职责有分工，但部门之间又相互合作与制衡的原则。基金投资管理、基金运作、市场等业务部门有明确的授权分工，各部门的操作相互独立，并且有独立的报告系统。各业务部门之间相互核对、相互牵制。

各业务部门内部工作岗位分工合理、职责明确，形成相互检查、相互制约的关系，以减少舞弊或差错发生的风险，各工作岗位均制定有相应的书面管理制度。

在明确的岗位责任制度基础上，设置科学、合理、标准化的业务操作流程，每项业务操作有清晰、书面化的操作手册，同时，规定完备的处理手续，保存完整的业务记录，制定严格的检查、复核标准。

4、信息与沟通

公司建立了内部办公自动化信息系统与业务汇报体系，通过建立有效的信息交流渠道，保证公司员工及各级管理人员可以充分了解与其职责相关的信息，保证信息及时送达适当的人员进行处理。

5、监督与内部稽核

本公司设立了独立于各业务部门的监察稽核部，履行内部稽核职能，检查、评价公司内部控制制度合理性、完备性和有效性，监督公司内部控制制度的执行情况，揭示公司内部

管理及基金运作中的风险，及时提出改进意见，促进公司内部管理制度有效地执行。内部稽核人员具有相对的独立性，内部稽核报告报董事长及中国证监会。

（三）基金管理人关于内部控制的声明

1、本公司确知建立、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的变化及公司的发展不断完善内部控制制度。

第四节 基金托管人

一、基金托管人情况

名称：中国光大银行股份有限公司

住所及办公地址：北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心

成立日期：1992 年 6 月 18 日

批准设立机关和批准设立文号：国务院、国函[1992]7 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：466.79095 亿元人民币

法定代表人：李晓鹏

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【2002】75 号

投资与托管业务部总经理：张博

电话：（010） 63636363

传真：（010） 63639132

网址：www.cebbank.com

二、主要人员情况

法定代表人李晓鹏先生,曾任中国工商银行河南省分行党组成员、副行长，中国工商银行总行营业部总经理，中国工商银行四川省分行党委书记、行长，中国华融资产管理公司党委委员、副总裁，中国工商银行党委委员、行长助理兼北京市分行行长，中国工商银行党委委员、副行长，中国工商银行股份有限公司党委委员、副行长、执行董事；中国投资有限责任公司党委副书记、监事长；招商局集团副董事长、总经理、党委副书记。曾兼任工银国际控股有限公司董事长、工银金融租赁有限公司董事长、工银瑞信基金管理公司董事长，招商银行股份有

限公司副董事长、招商局能源运输股份有限公司董事长、招商局港口控股有限公司董事会主席、招商局华建公路投资有限公司董事长、招商局资本投资有限责任公司董事长、招商局联合发展有限公司董事长、招商局投资发展有限公司董事长等职务。现任中国光大集团股份公司党委书记、董事长，兼任中国光大银行股份有限公司党委书记、董事长，中国光大集团有限公司董事长，中国旅游协会副会长、中国城市金融学会副会长、中国农村金融学会副会长。武汉大学金融学博士研究生，经济学博士，高级经济师。

行长葛海蛟先生，曾任中国农业银行辽宁省分行国际业务部总经理助理、副总经理、总经理，中国农业银行辽宁省辽阳市分行党委书记、行长，中国农业银行大连市分行党委委员、副行长，中国农业银行新加坡分行总经理，中国农业银行国际业务部副总经理(部门总经理级)，中国农业银行黑龙江省分行党委副书记、党委书记、行长兼任悉尼分行海外高管，黑龙江省第十二届人大代表。曾兼任中国光大实业（集团）有限责任公司董事长，光大证券股份有限公司董事，中国光大集团股份公司上海总部主任，中国光大集团股份公司文旅健康事业部总经理。现任中国光大银行股份有限公司党委副书记、行长，中国光大集团股份公司党委委员。南京农业大学农业经济管理专业博士研究生，管理学博士，高级经济师。

张博先生，曾任中国光大银行厦门分行副行长，西安分行行长，乌鲁木齐分行筹备组组长、分行行长，青岛分行行长，光大消费金融公司筹备组组长。曾兼任中国光大银行电子银行部副总经理（总经理级），负责普惠贷款团队业务。现任中国光大银行投资与托管业务部总经理。

三、基金托管业务经营情况

截至 2018 年 12 月 31 日，中国光大银行股份有限公司托管华夏睿磐泰利六个月定期开放混合型证券投资基金、天弘尊享定期开放债券型发起式证券投资基金、汇安多策略灵活配置混合型证券投资基金等共 128 只证券投资基金，托管基金资产规模 3091.02 亿元。同时，开展了证券公司资产管理计划、专户理财、企业年金基金、QDII、银行理财、保险债权投资计划等资产的托管及信托公司资金信托计划、产业投资基金、股权基金等产品的保管业务。

四、基金托管人的内部控制制度

1、内部控制目标

确保有关法律法规在基金托管业务中得到全面严格的贯彻执行；确保基金托管人有关基金托管的各项管理制度和业务操作规程在基金托管业务中得到全面严格的贯彻执行；确保基金财产安全；保证基金托管业务稳健运行；保护基金份额持有人、基金管理公司及基金托管人的合法权益。

2、内部控制的原则

（1）全面性原则。内部控制必须渗透到基金托管业务的各个操作环节，覆盖所有的岗位，不留任何死角。

（2）预防性原则。树立“预防为主”的管理理念，从风险发生的源头加强内部控制，防患于未然，尽量避免业务操作中各种问题的产生。

（3）及时性原则。建立健全各项规章制度，采取有效措施加强内部控制。发现问题，及时处理，堵塞漏洞。

（4）独立性原则。基金托管业务内部控制机构独立于基金托管业务执行机构，业务操作人员和内控人员分开，以保证内控机构的工作不受干扰。

3、内部控制组织结构

中国光大银行股份有限公司董事会下设风险管理委员会、审计委员会，委员会委员由相关部门的负责人担任，工作重点是对总行各部门、各类业务的风险和内控进行监督、管理和协调，建立横向的内控管理制约体制。各部门负责分管系统内的内部控制的组织实施，建立纵向的内控管理制约体制。投资与托管业务部建立了严密的内控督察体系，设立了风险管理处，负责证券投资基金托管业务的风险管理。

4、内部控制制度

中国光大银行股份有限公司投资与托管业务部自成立以来严格遵照《基金法》、《中华人民共和国商业银行法》、《信息披露办法》、《运作办法》、《销售办法》等法律、法规的要求，并根据相关法律法规制订、完善了《中国光大银行证券投资基金托管业务内部控制规定》、《中国光大银行投资与托管业务部保密规定》等十余项规章制度和实施细则，将风险控制落实到每一个工作环节。中国光大银行投资与托管业务部以控制和防范基金托管业务风险为主线，在重要岗位（基金清

算、基金核算、监督稽核）还建立了安全保密区，安装了录像监视系统和录音监听系统，以保障基金信息的安全。

五、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

根据法律、法规和基金合同等的要求，基金托管人主要通过定性和定量相结合、事前监督和事后控制相结合、技术与人工监督相结合等方式方法，对基金投资品种、投资组合比例每日进行监督；同时，对基金管理人就基金资产净值的计算、基金管理人和基金托管人报酬的计提和支付、基金收益分配、基金费用支付等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

基金托管人发现基金管理人的违反法律、法规和基金合同等规定的行为，及时以书面或电话形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

第五节 相关服务机构

一、基金份额发售机构

（一）直销机构：

1、泰信基金管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区浦东南路256号37层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区浦东南路256号华夏银行大厦36、37层

法定代表人：万众

总经理：葛航

成立日期：2003年5月23日

电话：021-20899188

传真：021-20899060

联系人：史明伟

网址：www.ftfund.com

2、泰信基金管理有限公司北京分公司

营业场所：北京市西城区广成街4号院1号楼305、306室

电话：010-66215978

传真：010-66215968

联系人：林洁

网址：www.ftfund.com

3、泰信基金管理有限公司深圳分公司

营业场所：深圳市福田区福华一路98号卓越大厦1608室

电话：0755-33988759

传真：0755-33988757

联系人：史明伟

网址：www.ftfund.com

（二）销售机构

（1）中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：陈四清

客服电话：95588

网址：www.icbc.com.cn

（2）中国银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：陈四清

传真：010-66594942

客服电话：95566

网址：www.boc.cn

（3）交通银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：彭纯

联系人：曹榕

电话：021-58781234

传真：021-58408483

客服电话：95559

网址：www.bankcomm.com

（4）中国农业银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：周慕冰

传真：010-85109219

客服电话：95599

网址：www.95599.cn

（5）中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：田国立

传真：010-66275654

客服电话：95533

网址：www.ccb.com

（6）中国光大银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心

办公地址：北京市西城区太平桥大街 25 号光大中心

法定代表人：李晓鹏

联系人：朱红

电话：010-63636153

传真：010-63639709

客服电话：95595

网址：www.cebbank.com

（7）招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：李建红

联系人：邓炯鹏

电话：0755-83198888

传真：0755-83195049

客服电话：95555

网址：www.cmbchina.com

（8）上海银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 168 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号

法定代表人：金煜

联系人：汤征程

电话：021-68475521

传真：021-68476497

客服电话：021-962888

网址：www.bankofshanghai.com

（9）上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区浦东南路 500 号

办公地址：上海市北京东路 689 号东银大厦 17 楼

法定代表人：高国富

联系人：倪苏云

电话： 021-61618888

传真： 021-63604199

客服电话：95528

网址：www.spdb.com.cn

（10）中信银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区朝阳门北大街 9 号

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街 9 号

法定代表人：李庆萍

传真：010-85230059

客服电话：95558

网址：bank.ecitic.com

（11）华夏银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 22 号华夏银行大厦

办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号华夏银行大厦

法定代表人：李民吉

客服电话：95577

网址：www.hxb.com.cn

（12）北京银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街甲 17 号首层

办公地址：北京市西城区金融大街丙 17 号

法定代表人：张东宁

联系人：谢小华

电话：010-66223587

传真：010-66226045

客户服务电话：95526

公司网站：www.bankofbeijing.com.cn

（13）中国民生银行股份有限公司

注册地址：北京市复兴门内大街 2 号

办公地址：北京市复兴门内大街 2 号

法定代表人：洪崎

联系人：董云巍 吴海鹏

客服电话：95568

网址：www.cmbc.com.cn

（14）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

联系人：张莉

电话：021-38637673

传真：021-50979507

客服电话：95511-3

网址：bank.pingan.com

（15）宁波银行股份有限公司

注册地址：宁波市江东区中山东路 294 号

办公地址：宁波市鄞州区宁南南路 700 号宁波银行 24 楼

法定代表人：陆华裕

联系人：胡技勋

电话：021-63586210

传真：021-63586215

客服电话：96528， 962528（上海地区）

网址：www.nbcb.com.cn

（16）南京银行股份有限公司

注册地址：中国江苏省南京市白下区淮海路 50 号

办公地址：中国江苏省南京市白下区淮海路 50 号

法定代表人：胡升荣

联系人：翁俊

电话：025-84544021

传真：025-84544129

客户服务：40088-96400

网址：www.njcb.com.cn

（17）金华银行股份有限公司

注册地址：金华市金东区光南路 668 号

办公地址：金华市金东区光南路 668 号

法定代表人：徐雅清

联系人：李飒

电话：0579-82178322

传真：025-84544129

客服电话：400-7116668　0579-2178322

网址：www.jhccb.com

（18）国泰君安证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 层

法定代表人：杨德红

联系人：芮敏祺

电话：021-38676666

传真：021-38670666

客服电话：400-8888-666

网址：www.gtja.com

(19)中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市东城区朝阳门内大街 188 号

法定代表人：王常青

联系人：权唐

传真：010-65182261

客服电话：400-8888-108

网址：www.csc108.com

（20）国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1010 号国际信托大厦 21 楼

法定代表人：何如

联系人：李颖

电话：0755-82130833

传真：0755-82133952

客服电话：95536

网址：www.guosen.com.cn

（21）招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 楼

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 楼

法定代表人：霍达

联系人：林生迎

电话：0755-82960223

传真：0755-83734343

客服电话：95565

网址：www.newone.com.cn

（22）广发证券股份有限公司

注册地址：广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街 2 号 618 室

办公地址：广州市天河区马场路 26 号广发证券大厦

法定代表人：孙树明

联系人：黄岚

客服电话：95575 或致电各地营业网点

网址：www.gf.com.cn

（23）中信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 A 层

办公地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 A 层

法定代表人：张佑君

联系人：陈忠

电话：010-84588888

传真：010-60838888

客服电话：95558

网址：www.cs.ecitic.com

（24）中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 35 号 2-6 层

办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：陈共炎

联系人：田薇

电话：010-66568888

传真：010-66568990

客服电话：400-8888-888 或 95551

网址：www.chinastock.com.cn

（25）海通证券股份有限公司

注册地址：上海市淮海中路 98 号

办公地址：上海市广东路 689 号海通证券大厦

法定代表人：周杰

联系人：李笑鸣

电话：021-23219000

传真：021-23219100

客服电话：95553

网址：www.htsec.com

（26）申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址：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

电话：021-33389888

传真：021-33388224

客服电话：95523 或 4008895523

网址：www.swhysc.com

（27）兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 268 号

办公地址：上海市浦东新区长柳路 36 号

法定代表人：杨华辉

联系人：乔琳雪

电话：021-38565547

客服电话：95562

网址：www.xyzq.com.cn

（28）安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

办公地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

深圳市福田区深南大道 2008 号中国凤凰大厦 1 栋 9 层

法定代表人：王连志

联系人：陈剑虹

电话：0755-82825551

传真：0755-82558355

统一客服电话：4008-001-001

网址：www.essence.com.cn

（29）湘财证券股份有限公司

注册地址：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼

办公地址：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼

法定代表人：孙永祥

联系人：李欣

电话：021-38784580-8918

传真：021-68865680

客服电话：95351

网址：www.xcsc.com

（30）万联证券股份有限公司

注册地址：广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 F 栋 18、19 层

办公地址：广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 F 栋 18、19 层

法定代表人：张建军

联系人：王鑫

电话：020-38286651

传真：020-22373718-1013

客服电话：400-8888-133

网址：www.wlzq.com.cn

（31）民生证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区朝阳门外大街 16 号中国人寿大厦 1901 室

法定代表人：冯鹤年

联系人：赵明

电话：010-85127622

传真：010-85127917

客服电话：400-619-8888

网址：www.mszq.com

（32）渤海证券股份有限公司

注册地址：天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

法定代表人：王春峰

联系人：蔡霆

联系电话：022-28451991

传真：022-28451892

客户服务电话：400-6515-988

网址：www.bhzq.com

（33）华泰证券股份有限公司

注册地址：南京市江东中路 228 号

办公地址：南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场

法定代表人：周易

联系人：庞晓芸

电话：0755-82492193

传真： 0755-82492962（深圳）

客服电话：95597

网址： www.htsc.com.cn

（34）山西证券股份有限公司

注册地址：太原市府西街 69 号山西国贸中心东塔楼

办公地址：太原市府西街 69 号山西国贸中心东塔楼

法定代表人：侯巍

联系人：郭熠

电话：0351-8686659

传真：0351-8686619

客服电话：400-666-1618

网址：www.i618.com.cn

（35）东方证券股份有限公司

注册地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层、23 层、25 层-29 层

办公地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 13 层、21 层-23 层、25-29 层、32 层、36 层、39 层、40 层

法定代表人：潘鑫军

联系人：孔亚楠

电话：021-63325888

传真：021-63326729

客服电话：95503

网址：www.dfzq.com.cn

（36）光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闸路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闸路 1508 号

法定代表人：周健男

联系人：刘晨

电话：021-22169999

传真：021-22169134

客服电话：400-8888-788，10108998

网址：www.ebscn.com

（37）上海证券有限责任公司

注册地址：上海市西藏中路 336 号

办公地址：上海市黄浦区四川中路 213 号久事商务大厦 8 楼

法定代表人：李俊杰

联系人：张瑾

电话：021-53519888

传真：021-53519888

客服电话：021-962518　全国客服热线 4008918918

网址：www.962518.com

（38）新时代证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 1 号 A 座 8 层

办公地址：北京市西城区金融大街 1 号 A 座 8 层

法定代表人：叶顺德

联系人：孙恺

电话：010-83561000

传真：010-83561001

客服电话：4006989898

网址：www.xsdzq.cn

（39）平安证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场裙楼 8 楼

办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场裙楼 8 楼

法定代表人：何之江

联系人：吴琼

电话：0755-22621866

传真：0755-82400862

客服电话：95511-8

网址：stock.pingan.com

（40）华安证券股份有限公司

注册地址：安徽省合肥市长江中路 357 号

办公地址：安徽省合肥市阜南路 166 号

法定代表人：章宏韬

联系人：甘霖

电话：0551-5161821

传真：0551-5161672

客服电话：95318、400-809-6518

网址：www.hazq.com.cn

（41）财富证券有限责任公司

注册地址：长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 楼

办公地址：长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 楼

法定代表人：蔡一兵

联系人：郭磊

电话：0731-84403319

传真：0731-84403439

客服电话：0731-84403350

网址：www.cfzq.com

（42）国都证券股份有限公司

注册地址：北京东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

办公地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

法定代表人：王少华

联系人：黄静

电话：010-84183333

传真：010-84183311

客服电话：400-818-8118

网址：www.guodu.com

（43）东海证券股份有限公司

注册地址：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18、19 楼

办公地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦

法定代表人：赵俊

联系人：王一彦

电话：021-20333333

传真：021-50498825

客服电话：95531、400-888-8588

网址：www.longone.com.cn

（44）中银国际证券有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层

办公地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层

法定代表人：宁敏

联系人：王炜哲

电话：021-68604866

传真：021-50372474

客服电话：400-620-8888

网址：www.bocichina.com.cn

（45）中泰证券股份有限公司

注册地址：山东省济南市经七路 86 号

办公地址：山东省济南市经七路 86 号

法定代表人：李玮

联系人：吴阳

电话：0531-68889155

传真：0531-68889752

客服电话：95538 或拨打各城市营业网点咨询电话

网址：www.zts.com.cn

（46）中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼 2001

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层

法定代表人：姜晓林

联系人：吴忠超

电话：0532-85022326

传真：0532-85022605

客服电话：0532-95548

网址：www.zxwt.com.cn

（47）中航证券有限公司

注册地址：江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号南昌国际金融大厦 A 栋 41 层

办公地址：江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号南昌国际金融大厦 A 栋 41 层

法定代表人：王晓峰

联系人：史江蕊

电话：010-64818301

传真：010-64818443

客服电话：400-8866-567

网址：www.avicsec.com

（48）中国中投证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层-21 层及第 04 层 01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23 单元

办公地址：深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 04、18 层至 21 层

法定代表人：高涛

联系人：刘毅

电话：0755-82023442

传真：0755-82026539

客服电话：400-600-8008

网址：www.china-invs.cn

（49）德邦证券股份有限公司

注册地址：上海市普陀区曹杨路 510 号南半幢 9 楼

办公地址：上海市福山路 500 号城建大厦 26 楼

法定代表人：武晓春

联系人：罗芳

电话：021-68761616

传真：021-68767981

客服电话：400-8888-128

网址：www.tebon.com.cn

（50）金元证券股份有限公司

注册地址：海南省海口市南宝路 36 号证券大厦 4 层

办公地址：深圳市深南大道 4001 号时代金融中心 17 层

法定代表人：王作义

联系人：马贤清

电话：0755-83025022

传真：0755-83025625

客服电话：400-8888-228

网址：www.jyzq.cn

（51）西藏东方财富证券股份有限公司

注册地址：拉萨市北京中路 101 号

办公地址：上海市闸北区永和路 118 弄 24 号

法定代表人：陈宏

联系人：周艳琼

电话：021-36537945

传真：021-36538467

客服电话：400-9112-233

网址：www.xzsec.com

（52）恒泰证券股份有限公司

注册地址：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街 111 号

办公地址：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街 111 号

法定代表人：庞介民

联系人：荀航

电话：0471-4979545

传真：0471-4961259

客服电话：0471-4961259

网址：www.cnht.com.cn

（53）江海证券有限公司

注册地址：哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

办公地址：哈尔滨市松北区创新三路 833 号 13 楼

法定代表人：赵洪波

联系人：周俊

电话：0451-85863726

传真：0451-82337279

客服电话：4006662288

网址：www.jhzq.com.cn

（54）长城证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

办公地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

法定代表人：丁益

联系人：刘阳

电话：0755-83516289

传真：0755-83515567

客服电话：0755-33680000、400-6666-888

网址：www.cgws.com

（55）爱建证券有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道 1600 号 1 幢 32 楼

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 1600 号 1 幢 32 楼

法定代表人：祝健

联系人：王薇

电话：021-32229888

传真：021-68728707

客服电话：4001-962502

网址：www.ajzq.com

（56）华宝证券有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 57 层

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 57 层

法定代表人：陈林

联系人：刘闻川

电话：021-68778790

传真：021-68777992

客服电话：400-820-9898

网址：www.cnhbstock.com

（57）英大证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层

办公地址：深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层

法定代表人：吴骏

联系人：吴尔晖

电话：0755-83007159

传真：0755-83007034

客服电话：4000-188-688

网址：www.ydsc.com.cn

（58）国金证券股份有限公司

注册地址：成都市东城根上街 95 号

办公地址：成都市东城根上街 95 号

法定代表人：冉云

联系人：贾鹏

电话： 028-86690057、028-86690058

传 真：028-86690126

客户热线： 95310

网址：www.gjzq.com.cn

（59）华福证券有限责任公司

注册地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层

办公地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7 至 10 层

法定代表人：黄金琳

电话：0591-87383623

传真：0591-87383610

联系人：张腾

客户热线：96326（福建省外请先拨 0591）

网址：www.hfzq.com.cn

（60）长江证券股份有限公司

注册地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：尤习贵

联系人：奚博宇

电话：027-65799999

传真：027-85481900

客户服务热线：95579 或 4008-888-999

网址：www.95579.com

（61）大通证券股份有限公司

注册地址：大连市中山区人民路 24 号

办公地址：大连市沙河口区会展路 129 号大连期货大厦 38-39 层

法定代表人：赵玺

电话： 0411-39673202

传真：0411-39673219

联系人：谢立军

客户服务电话：4008-169-169

网址：www.daton.com.cn

（62）信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

办公地址：北京市西城区宣武门西大街甲 127 号大成大厦 6 层

法定代表人：张志刚

联系人：唐静

联系电话：010-63081000

传真：010-63080978

客服电话：95321

公司网址：www.cindasc.com

（63）华龙证券有限责任公司

注册地址：甘肃省兰州市静宁路 308 号

办公地址：甘肃省兰州市静宁路 308 号

法定代表人：李晓安

电话： 0931-8888088

传真： 09131-4890515

联系人：李昕田

客户服务电话：0931-96668、4890208

网址：www.hlzqgs.com

（64）国联证券股份有限公司

注册地址：江苏省无锡市县前东街 168 号

办公地址：江苏省无锡市太湖新城金融一街 8 号国联金融大厦 702

法定代表人：姚志勇

联系人：徐欣

联系电话：0510-82831662

联系传真：0510-82830162

客服电话：400-888-5288

公司网址：www.glsc.com.cn

（65）广州证券股份有限公司

注册地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层

办公地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层

法定代表人：胡伏云

联系人：林洁茹

电话：020-88836999

传真：020-88836654

客服电话：95396

网址：www.gzs.com.cn

（66）五矿证券有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4028 号荣超经贸中心办公室 47 层 01 单元

办公地址：深圳市福田区金田路 4028 号荣超经贸中心 47-49 楼

法定代表人：黄海洲

客服电话：40018-40028

网址：www.wkzq.com.cn

（67）上海长量基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区东方路 1267 号 11 层

法定代表人：张跃伟

客服电话：400-820-2899

网址：www.erichfund.com

（68）蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

注册地址：杭州市余杭区仓前街道海曙路东 2 号

办公地址：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：祖国明

客服电话：4000-766-123

网址： www.fund123.cn

（69）诺亚正行基金销售有限公司

办公地址：上海市杨浦区长阳路 1687 号 2 号楼 1 楼

法定代表人：汪静波

客服电话：400－821－5399

网址：www.noah-fund.com

（70）上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

办公地址：上海市徐汇区龙田路（近田东路）195 号 3C 幢 9 楼

法定代表人：其实

客服电话：400-1818-188

网址：www.1234567.com.cn

（71）和讯信息科技有限公司

办公地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

法定代表人：王莉

客服电话：400-920-0022

网址：licaike.hexun.com

（72）嘉实财富管理有限公司

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 8 号国金中心二期 4606-10 单元

法定代表人：赵学军

联系人：景琪

客服电话：400-021-8850

网址：www.harvestwm.cn

（73）中山证券有限责任公司

注册地址：深圳市南山区创业路 1777 号海信南方大厦 21、22 层

办公地址：深圳市南山区创业路 1777 号海信南方大厦 21、22 层

法定代表人：林炳城

联系人：罗艺琳

电话：0755-82943755

传真：0755-82960582

客服电话：95329

网址：www.zszq.com

（74）上海联泰基金销售有限公司

办公地址：上海市长宁区福泉北路 518 号 8 座 3 层

法定代表人：燕斌

联系人：凌秋艳

客服电话：4000-466-788

网址：www.66zichan.com

（75）上海利得基金销售有限公司

办公地址：上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼

法定代表人：李兴春

联系人：赵沛然

客服电话：400-921-7755

网址：www.leadbank.com.cn

（76）中信期货有限公司

办公地址：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：洪诚

客服电话：400-990-8826

网址：www.citicsf.com

（77）上海好买基金销售有限公司

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903-906 室

法定代表人：杨文斌

联系人：张茹

客服电话：400-700-9665

网址：www.ehowbuy.com

（78）深圳众禄基金销售股份有限公司

办公地址：深圳市罗湖区梨园路 8 号 HALO 广场 4 楼

法定代表人：薛峰

客服电话：4006-788-887

网址：www.zlfund.cn 及 www.jjmmw.com

（79）北京恒天明泽基金销售有限公司

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 39 号第一上海中心 C 座 6 层

法定代表人：周斌

客服电话：4008-980-618

网址：www.chtfund.com

（80）上海汇付基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区 100 号 19 层

办公地址：上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼

法定代表人：冯修敏

联系人：朱翔宇

客服电话：400-820-2819

（81）深圳富济基金销售有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路 3088 号中洲大厦 3203A 单元

办公地址：深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路 3088 号中洲大厦 3203A 单元

法定代表人：刘鹏宇

联系人：刘勇

电话：0755-83999907-8814

传真：0755-83999926

客服电话：0755-83999907

网址：www.fujifund.cn

（82）北京虹点基金销售有限公司

办公地址：北京市朝阳区工人体育馆北路甲 2 号盈科中心 B 座裙楼二层

法定代表人：郑毓栋

联系人：张婷婷

客服电话：400-068-1176

网址：www.hongdianfund.com

（83）中国国际金融股份有限公司

办公地址：北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

法定代表人：丁学东

联系人：秦朗

客服电话：400-910-1166

网址：www.cicc.com

（84）大泰金石基金销售有限公司

办公地址：上海市长宁区虹桥路 1386 号文广大厦 15 楼

法定代表人：姚杨

联系人：何庭宇

客服电话：400-928-2266 021-22267995

网址：www.dtfunds.com

（85）上海陆金所基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号

法定代表人：王之光

联系人：宁博宇

电话：021-20665952

传真：021-22066653

客服电话：4008219031

网址：www.lufunds.com

（86）北京增财基金销售有限公司

注册地址：北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208 室

办公地址：北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208 室

法定代表人：罗细安

联系人：李皓

客服电话：400-001-8811

网址：www.zengcaiwang.com

（87）北京钱景基金销售有限公司

办公地址：北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012

法定代表人：赵荣春

联系人：申泽灏

客服电话：400-893-6885

网址：www.qianjing.com

（88）厦门市鑫鼎盛控股有限公司

注册地址：厦门市思明区鹭江道2号厦门第一广场西座1501-1504室

办公地址：厦门市思明区鹭江道2号厦门第一广场西座1501-1504室

法定代表人：陈洪生

联系人：陈承智

电话：0592-3122673

客服电话：400-918-0808

网址：www.xds.com.cn

（89）深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

办公地址：北京市西城区宣武门外大街28号富卓大厦16层

法定代表人：马勇

联系人：文雯

客服电话：400-116-1188

网址：8.jrj.com.cn

（90）泰诚财富基金销售（大连）有限公司

办公地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号

法定代表人：林卓

客服电话：400-6411-999

网址：www.taichengcaifu.com

（91）申万宏源西部证券有限公司

注册地址：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

办公地址：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：李琦

联系人：唐岚

电话：010-88085858

传真：010-88085195

客户服务电话：400-800-0562

网址：www.hysec.com

（92）北京晟视天下基金销售有限公司

办公地址：北京市怀柔区九渡河镇黄坎村 735 号 03 室

法定代表人：蒋煜

客服电话：400-818-8866

网址：www.shengshiview.com

（93）武汉市伯嘉基金销售有限公司

办公地址：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

客服电话：400-027-9899

网址：www.buyfunds.cn

（94）上海万得基金销售有限公司

办公地址：上海市浦东新区浦明路 1500 号万得大厦 11 楼

法定代表人：王廷富

客服电话：400-821-0203

网址：www.520fund.com.cn

（95）上海华信证券有限责任公司

注册地址：上海浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 9 楼

办公地址：上海市黄浦区南京西路 399 号明天广场 22 楼

法定代表人：陈灿辉

联系人：陈媛

客服电话：400-820-5999

网址：www.shhxzq.com

（96）南京苏宁基金销售有限公司

注册地址：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

法定代表人：王锋

客服电话：95177

网址：www.snjijin.com

（97）上海华夏财富投资管理有限公司

注册地址：上海市虹口区东大名路 687 号 1 幢 2 楼 268 室

办公地址：北京市西城区金融大街通泰大厦 B 座 8 层

法定代表人：毛淮平

客服电话：400-817-5666

网址：www.amcfortune.com

（98）北京肯特瑞基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区海淀东三街2号4层401-15

办公地址：北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-06

法定代表人：江卉

客服电话：95118

网址：jr.jd.com

（99）万家财富基金销售（天津）有限公司

注册地址：天津自贸区（中心商务区）迎宾大道1988号滨海浙商大厦公寓2-2413室

办公地址：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

客服电话：010-59013895

网址：www.wanjiawealth.com

（100）珠海盈米基金销售有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔1201-1203室

法定代表人：肖雯

客服电话：020-89629066

网址：www.yingmi.cn

（101）世纪证券有限责任公司

办公地址：深圳市福田区深南大道招商银行大厦40/42层

法定代表人：姜昧军

客服电话：4008323000

网址：www.csco.com.cn

（102）上海基煜基金销售有限公司

注册地址：上海市崇明县长兴镇潘园公路1800号2号楼6153室（上海泰和经济发展区）

办公地址：上海市浦东新区银城中路488号太平金融大厦1503室

法定代表人：王翔

客服电话：400-820-5369

网址：www.jiyufund.com.cn

（103）济安财富（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区太阳宫中路16号院1号楼3层307

办公地址：北京市朝阳区太阳宫中路16号院1号楼3层307

法定代表人：杨健

客服电话：400-673-7010

网址：www.jianfortune.com

（104）天津国美基金销售有限公司

注册地址：天津经济技术开发区第一大街79号MSDC1-28层2801

办公地址：天津经济技术开发区第一大街79号MSDC1-28层2801

法定代表人：丁东华

客服电话：400-111-0889

网址：www.gomefund.com

（105）沈阳麟龙投资顾问有限公司

注册地址：辽宁省沈阳市东陵区白塔二南街18-2号B座601

办公地址：上海市虹口区青云路266号四楼

法定代表人：朱荣晖

客服电话：400-003-5811

网址：www.jinjiwo.com

（106）上海中正达广基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙腾大道2815号302室

办公地址：上海市徐汇区龙腾大道2815号302室

法定代表人：黄欣

客服电话：400-6767-523

网址：www.zhongzhengfund.com

（107）阳光人寿保险股份有限公司

注册地址：海南省三亚市迎宾路360-1号三亚阳光金融广场16层

办公地址：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

电话：010-85632771

传真：010-85632773

客服电话：95510

网址：http://fund.sinosig.com

二、注册登记机构

注册登记机构名称：泰信基金管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区浦东南路256号37层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区浦东南路256号华夏银行大厦36、37层

法定代表人：万众

总经理：葛航

成立日期：2003年5月23日

电话：021-20899188

传真：021-20899060

联系人：韩波

三、出具法律意见的律师事务所

名称：上海源泰律师事务所

地址：上海市浦东南路256号华夏银行大厦14层

负责人：廖海

电话：021-51150298，021-51150391

传真：021-51150398

经办律师：刘佳、梁丽金

四、审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

办公地址：上海市卢湾区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼

法定代表人：杨绍信

联系电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

经办注册会计师：单峰、周祎

第六节 基金份额的申购与赎回

一、申购与赎回的场所

本基金的日常申购和赎回将通过基金管理人的直销网点和公司网站及基金代销机构的代销网点（具体名单以基金管理人的公告为准）进行。投资者应当在销售机构办理开放式基金业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金的申购与赎回。

泰信基金管理有限公司可以根据情况变化增加或者减少代销机构，并另行公告；销售机构可以根据情况变化增加或者减少其销售城市、网点，并另行公告。

二、申购和赎回的开放日及时间

（一）开放日及开放时间

本基金为投资者办理申购与赎回等基金业务的时间即开放日为上海证券交易所、深圳证券交易所的交易日。开放日的具体业务办理时间即开放时间为上海证券交易所、深圳证券交易所交易日的交易时间，当前开放时间为上午9:30-11:30和下午1:00-3:00。

基金管理人可与销售机构约定在开放日增加其他开放时间，但基金管理人不得在基金合同约定之外的日期和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、赎回或者转换申请的，其基金份额申购、赎回价格为下次办理基

金份额申购、赎回时间所在开放日的价格。

若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整并公告。

（二）申购的开始时间

本基金于2004年7月7日正式开始接受并办理申购业务。

（三）赎回的开始时间

本基金于2004年8月6日正式开始接受并办理赎回业务。

三、申购和赎回的程序

（一）申请方式

基金投资者须按基金销售机构规定的手续，在开放日的业务办理时间提出申购或赎回的申请。如投资者是首次申购本基金，可能需要申请开立泰信基金管理有限公司基金账户或销售机构交易账户。

投资人申购本基金，须按销售机构规定的方式备足申购资金。

投资人提交赎回申请时，其在销售机构（网点）必须有足够的基金份额余额。

（二）申购与赎回的原则

1.“未知价”原则，即本基金的申购、赎回价格以受理申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算。

2.本基金采用金额申购和份额赎回的方式，即申购以金额申请，赎回以份额申请。

3.当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以前撤销。

4、基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可更改上述原则。基金管理人最迟于新规则开始实施日前3个工作日在指定媒体公告。

（三）申购与赎回的确认

T日规定时间受理的申请，正常情况下投资者可在T+2日通过本公司客户服务电话或到其办理业务的销售网点查询确认情况，打印确认单。

（四）申购与赎回款项支付的方式与时间

申购采用全额交款方式，若资金在规定时间内未全额到账则申购不成功，申购不成功的款项将退回投资者账户。

投资者赎回申请成功后，基金管理人将指示基金托管人按有关规定划付赎回款项。赎回款项将在不超过T+5个工作日之内从基金托管人处划出。在发生巨额赎回时，款项的支付办法按基金合同及本招募说明书有关规定处理。

四、申购和赎回的数额与价格

（一）申购数额、余额的处理方式

1、投资者通过代销网点或基金管理人的网上交易系统每次申购的最低金额为500元（含申购费），通过基金管理人的直销柜台首次申购的单笔最低金额为50000元（含申购费），追加申购的最低金额为500元，已在直销网点有认购本基金记录的投资人不受首次申购最低金额的限制。代销网点的投资者欲转入直销网点进行交易要受直销网点最低金额的限制。基金管理人可根据市场情况，调整首次申购的最低金额。

2、基金份额持有人在销售机构赎回时，每次赎回申请不得低于100份基金份额。基金份额持有人赎回时或赎回后在销售机构（网点）保留的基金份额余额不足100份的，在赎回时需一次全部赎回。

3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， 具体请参见更新招募说明书或相关公告。

4、本基金不对单个投资人累计持有的基金份额上限进行限制，但法律法规或监管机构另有规定或基金合同另有约定的除外。

5、基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可以根据实际情况对以上限制进行调整，最迟在调整生效前3个工作日在指定媒体公告。

（二）申购份额与赎回金额的计算公式

1、申购份数的计算

本基金采用“外扣法”计算基金的申购费用及申购份额，具体计算公式如下：

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/申购当日基金份额净值

申购份数保留小数点后两位，小数点两位以后的部分舍去，舍去部分所代表的资产归基金所有。

例1：不同申购金额的申购份数计算

假定T日的基金份额净值为1.2000元，申购金额分别为10,000.00元、600，000.00元、1，000，000.00元、3,000,000.00元、5,000,000.00元，则：

	申购 1	申购 2	申购 3	申购 4	申购 5

申购金额（元）	10,000.00	600,000.00	1,000,000.00	3,000,000.00	5,000,000.00
适用费率	1.5%	1.2%	0.75%	0.5%	每笔 1,000.00 元
净申购金额(元)	9852.21	592,885.37	992,555.83	2,985,074.62	4,999,000.00
申购费用(元)	147.79	7,114.63	7,444.17	14,925.38	1000.00
申购份数	8,210.17	494,071.14	827,129.85	2,487,562.18	4,165,833.33

2、赎回金额的计算

本基金的赎回金额为赎回总额扣减赎回费用。其中，

赎回总额=赎回份数×T日基金份额净值

赎回费用=赎回总额×赎回费率

赎回金额=赎回总额－赎回费用

赎回总额、赎回费用保留小数点后两位，小数点两位以后的部分舍去，舍去部分所代表的资产归基金所有。

例2：赎回金额的计算

假定T日的基金份额净值为1.2000元，投资者赎回10,000份，则：

	赎回 1	赎回 2	赎回 3	赎回 4	赎回 5	赎回 6
持有时间	0～6 天	7 天～90 天	91～180 天	181~365 天	366~730 天	731 天及以上
适用费率	1.5%	0.5%	0.35%	0.18%	0.1%	0%
赎回费用	180.00 元	60.00 元	42.00 元	21.6 元	12.00 元	0.00 元
赎回金额	11,820.00 元	11,940.00 元	11,958.00 元	11,978.40 元	11988.00 元	12,000.00 元

3、T日的基金份额净值在当天收市后计算，并在T＋1日公告。遇特殊情况，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。

（三）基金份额资产净值的计算公式

基金份额资产净值=基金资产净值/基金份额

五、拒绝或暂停接受受理申购和情形及处理方式

（一）除出现如下情形，基金管理人不得拒绝或暂停接受基金投资者的申购申请：

1、不可抗力的原因导致基金无法正常运作；

2、证券交易场所依法决定停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；

3、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，或可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人的利益；

4、基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益或对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响的某笔申购。

5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；

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，基金管理人应当暂停接受基金申购申请；

7、法律、法规规定或中国证监会认定的其他情形；

（二）如发生上述拒绝申购的情形，被拒绝的申购款项应全额退还投资者。基金管理人拒绝或暂停接受申购的方式包括：

1、拒绝接受、暂停接受某笔或某数笔申购申请；

2、拒绝接受、暂停接受某个或某数个工作日的全部申购申请；

3、按比例拒绝接受、暂停接受某个或某数个工作日的申购申请。

（三）发生基金合同或招募说明书中未予载明的事项，但基金管理人有正当理由认为需要暂停接受基金申购申请的，报经中国证监会批准后可以暂停接受投资人的申购申请。

（四）基金暂停申购，基金管理人应立即在指定媒体上公告；暂停期间结束基金重新开放时，基金管理人应当公告最新的基金份额净值。如果发生暂停的时间为1天，基金管理人应于重新开放日在指定媒体刊登基金重新开放申购的公告，并公告最新的基金份额净值。如果发生暂停的时间超过1天但少于2周，暂停结束基金重新开放申购时，基金管理人应提前2个工作日在指定媒体刊登基金重新开放申购的公告，并在重新开放申购日公告最新的基金份额净值。如果发生暂停的时间超过两周，暂停期间，基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次；当连续暂停时间超过两个月时，可对重复刊登暂停公告的频率进行调整。暂停结束基金重新开放申购时，基金管理人应提前3个工作日在指定媒体连续刊登基金重新开放申购的公告，并在重新开放申购日公告最新的基金份额净值。

六、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形及处理方式

（一）除下列情形外，基金管理人不得拒绝接受或暂停接受投资者的赎回申请：

1、不可抗力的原因导致基金无法正常运作；

2、证券交易场所依法决定停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；

3、因市场剧烈波动或其它原因而出现连续巨额赎回，导致本基金的现金支付出现困难；

4、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，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请；

5、法律、法规规定或中国证监会认定的其它情形。

（二）发生上述情形之一的，基金管理人应在当日立即向中国证监会备案。已接受的赎回申请，基金管理人将足额支付；如暂时不能支付时，将按每个赎回申请人已被接受的赎回申请量占已接受赎回申请总量的比例分配给赎回申请人，其余部分由基金管理人按照相应的处理办法在后续开放日予以兑付。

（三）发生基金合同或招募说明书中未予载明的事项，但基金管理人有正当理由认为需要暂停接受基金赎回申请的，报经中国证监会批准后可以暂停接受投资人的赎回申请。

（四）基金暂停赎回，基金管理人应立即在指定媒体上公告。暂停期间结束基金重新开放时，基金管理人应当公告最新的基金份额净值。如果发生暂停的时间为1天，基金管理人应于重新开放日在指定媒体刊登基金重新开放赎回的公告并公告最新的基金份额净值。如果发生暂停的时间超过1天但少于2周，暂停结束基金重新开放赎回时，基金管理人应提前2个工作日在指定媒体刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放赎回日公告最新的基金份额净值。如果发生暂停的时间超过2周，暂停期间，基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次；当连续暂停时间超过2个月时，可对重复刊登暂停公告的频率进行调整。暂停结束基金重新开放赎回时，基金管理人应提前3个工作日在指定媒体连续刊登基金重新开放赎回的公告，并在重新开放赎回日公告最新的基金份额净值。

七、巨额赎回的情形及处理方式

（一）巨额赎回的情形

单个开放日中，本基金的基金份额净赎回申请（赎回申请总数扣除申购申请总数后的余额）与净转出申请（转出申请总数扣除转入申请总数后的余额）之和超过前一日基金份额总份额数的10%，即认为发生了巨额赎回。

（二）巨额赎回的处理方式

当出现巨额赎回时，基金管理人可以根据该基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分顺延赎回。

1、全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资者的赎回申请时，按正常赎回程序执行。

2、部分顺延赎回：当基金管理人认为支付投资者的赎回申请有困难或认为支付投资者的赎回申请可能会对该基金的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该基金总份额的10%的前提下，对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个帐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；投资者未能赎回部分，除投资者在提交赎回申请时明确作出不参加顺延下一个开放日赎回的表示外，自动转

为下一个开放日赎回处理。转入下一个开放日的赎回不享有赎回优先权并将以下一个开放日的基金份额净值为准进行计算，并以此类推，直到全部赎回为止。投资者在提出赎回申请时可选择将当日未获受理部分予以撤销。

（3）当发生巨额赎回且存在单个基金份额持有人当日赎回申请超过上一开放日基金总份额20%以上的情形时，基金管理人可以对该基金份额持有人超过前述约定比例的赎回申请进行延期办理，对于当日未延期办理的赎回申请，基金管理人根据上述（1）或（2）处理。当日未获受理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；如该持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。部分顺延赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

3、当发生巨额赎回并顺延赎回时，基金管理人应立即向中国证监会备案并在3个工作日内通过指定媒体、基金管理人的公司网站或代销机构的网点刊登公告，并说明有关处理方法。

4、本基金连续两日以上（含2日）发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过正常支付时间20个工作日，并应当在指定媒体上进行公告

八、申购和赎回的注册登记

基金投资者对本基金提出的申购和赎回申请，在当日交易时间结束前可以撤销，交易时间结束后即不得撤销。

（一）投资者申购基金成功后，基金注册与过户登记人在T+1 工作日为投资者增加权益并办理注册登记手续，投资者自T+2 工作日起有权赎回该部分基金份额。

（二）投资者赎回基金成功后，基金注册与过户登记人在T+1 工作日为投资者扣除权益并办理相应的注册登记手续。

基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，并最迟于开始实施前三个工作日予以公告。

第七节 基金的转换

一、基金转换

基金转换是指基金份额持有人按基金管理人规定的条件，申请将其持有的基金管理人管理的某一基金的全部或部分基金份额转换为基金管理人管理的、并由同一注册登记人办理

注册登记的其他基金的基金份额的行为。

可办理本基金转换业务的销售机构名单如下：

泰信直销(柜台、网上)、中信银行、交通银行、中国银行、宁波银行、农业银行、华夏银行、北京银行、民生银行、建设银行、平安银行、南京银行、招商银行、光大银行、浦发银行、上海银行、金华银行、工商银行、上海证券、中信建投证券、长城证券、国信证券、中泰证券、海通证券、渤海证券、华安证券、国都证券、华宝证券、信达证券、中信证券、中信证券（山东）、中航证券、江海证券、爱建证券、国泰君安证券、银河证券、安信证券、申万宏源证券、华龙证券、国金证券、东方证券、广发证券、招商证券、中山证券、中金公司、兴业证券、平安证券、华泰证券、华福证券、财富证券、德邦证券、广州证券、东海证券、中银国际证券、上海华信证券、世纪证券、国联证券、诺亚正行、嘉实财富、蚂蚁基金、天天基金、联泰基金、长量基金、好买基金、众禄基金、恒天明泽、和讯信息、富济基金、金石基金、虹点基金、增财基金、钱景基金、鑫鼎盛、新兰德、泰诚财富、晟视天下、伯嘉基金、万得基金、苏宁基金、肯特瑞基金、万家财富、盈米基金、利得基金、基煜基金、济安财富、国美基金、麟龙投顾、中信期货、中正达广、阳光人寿。

二、基金转换申请人的范围

基金份额持有人均可以按照基金合同的规定申请和办理基金转换。

三、基金转换受理场所

基金转换将通过基金管理人的直销渠道及基金代销机构的代销网点进行。

基金转换只能在同一销售机构办理，且该销售机构须同时代理拟转出基金及拟转入基金的销售。

目前，投资者可通过以下途径办理：泰信基金管理有限公司直销网点（公司总部、北京分公司、深圳分公司），泰信基金管理有限公司网站（www.ftfund.com），泰信基金管理有限公司客户服务电话(400-888-5988，021-38784566)。

本公司将在条件成熟后，通过其他销售机构开办此项业务。由于各销售机构的系统差异以及业务安排等原因，开展该业务的时间可能有所不同，投资者应以各销售机构公告的时间为准。

四、基金转换受理时间

目前，基金管理人接受办理基金间转换的时间为上海证券交易所、深圳证券交易所交易日。若出现新的证券交易市场或交易所交易时间更改或其它原因，基金管理人可视情况进行相应的调整，并提前2日在指定媒体公告。

五、基金转换的程序与原则

（一）基金转换费用

1、基金转换费用构成及计算公式

基金转换费用由转出基金的赎回费、转出和转入基金的申购费补差构成。

1、转出基金赎回费：基于每份转出基金份额在转换申请日的适用赎回费率，计算转出基金赎回费。

2、转换申购费补差：当转出基金申购费率低于转入基金申购费率时,补差费为按照转入金额(不含转出基金赎回费)计算的申购费用差额;当转出基金申购费率高于转入基金申购费率时,不收取补差费。

3. 基金转换采取未知价法,以申请当日(以下简称"T"日)基金份额资产净值为基础计算。具体计算公式为:

①转出金额=转出基金份额×转出基金 T 日基金份额净值

②转出基金赎回费用=转出金额×转出基金赎回费率

③转入金额=转出金额-转出基金赎回费用

④转入基金申购费=转入金额/(1+转入基金申购费率)×转入基金申购费率

若转入基金申购费适用固定费用,则转入基金申购费=转入基金固定申购费

⑤转出基金申购费=转入金额/(1+转出基金申购费率)×转出基金申购费率

若转出基金申购费适用固定费用,则转出基金申购费=转出基金固定申购费

⑥补差费用=Max{(转入基金申购费-转出基金申购费)，0}

⑦净转入金额=转入金额-补差费用

⑧转入份额=净转入金额/转入基金 T 日基金份额净值

注：公式中的“转出基金申购费”是在本次转换过程中按照转入金额重新计算的费用，仅用于计算补差费用，非转出基金份额在申购时实际支付的费用。

（二）基金转换的申请与确认

1、基金转换的申请方式

基金份额持有人必须根据基金管理人和基金代销机构规定的手续，在开放日的交易时间段内提出基金转换申请。

基金转换以份额为单位进行申请。投资者办理基金转换业务时，转出方的基金必须处于可赎回状态，转入方的基金必须处于可申购状态。已冻结份额不得申请基金转换。

基金转换采取“未知价原则”，即以申请受理当日各转出、转入基金的基金份额资产

净值为基础进行计算。

2、基金转换申请的确认

基金管理人应以收到基金转换申请的当天作为基金转换申请日（T 日），正常情况下，基金注册与过户登记人将在T+1日对投资者T日的基金转换业务申请进行有效性确认。

基金转换所涉及的两只基金，其中任何一只处于封闭期、暂停赎回期等非开放日，或者转换申请份额处于冻结状态，基金转换都不予确认。

单个开放日基金净赎回份额及净转出申请份额之和超过上一开放日基金总份额的10%时，为巨额赎回。发生巨额赎回时，基金转出与基金赎回具有相同的优先级，基金管理人可根据基金资产组合情况，决定全额转出或部分转出，并且对于基金转出和基金赎回，将采取相同的比例确认。在转出申请得到部分确认的情况下，未确认的转出申请将不予以顺延。

投资人可在T+2 工作日及之后到其提出基金转换申请的网点进行成交查询。

（三）基金转换的数额限制

本基金遵循“份额转换”的原则，基金转出的最低申请份额为100份；在一个销售机构的最低持有份额不得低于100份。若基金份额持有人的某笔基金转换将导致其在该销售机构所持有的剩余基金份额低于100份的，应申请一并转换，否则，注册登记系统可自动对该剩余份额做强制赎回处理。

单笔转入申请不受转入基金最低申购限额限制。

（四）基金转换的注册登记

1、T日的转换申请可以在T日规定的正常交易时间内撤消；

2、基金份额持有人申请基金转换成功后，基金注册登记人在T+1 工作日为基金份额持有人办理相关的注册登记手续；

3、目前，本公司旗下的开放式基金均采用前端收费模式，故投资者转入的基金份额将被自动记入前端收费模式下，且持有人对转入基金的持有期限自转入之日起计算；

4、基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，并最迟于开始实施前2个工作日予以公告。

六、拒绝或暂停基金转换的情形及处理方式

（一）除非出现如下情形，基金管理人不得拒绝或暂停接受各基金份额持有人的基金转换申请：

1、不可抗力；

2、证券交易场所在交易时间非正常停市；

3、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换；

4、基金管理人有正当理由认为需要拒绝或暂停接受基金转换申请的；

5、法律、法规规定或中国证监会认定的其他情形。

如果基金份额持有人的基金转换申请被拒绝，基金份额持有人持有的原基金份额不变。

（二）暂停基金转换，基金管理人应立即在指定媒体上公告；暂停期间结束基金重新开放时，基金管理人应当公告最新的基金份额资产净值。如果发生暂停的时间为1天，基金管理人应于重新开放日在指定媒体刊登基金重新开放基金转换的公告，并公告最新的基金份额资产净值；如果发生暂停的时间超过1天但少于2周，暂停结束基金重新开放基金转换时，基金管理人应提前2个工作日在指定媒体刊登基金重新开放基金转换的公告，并在重新开放基金转换日公告最新的基金份额资产净值；如果发生暂停的时间超过两周，暂停期间，基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次；当连续暂停时间超过两个月时，可对重复刊登暂停公告的频率进行调整。暂停结束基金重新开放基金转换时，基金管理人应提前2个工作日在指定媒体连续刊登基金重新开放基金转换的公告，并在重新开放基金转换日公告最新的基金份额资产净值。

七、定期定额投资计划

基金管理人可以为投资者办理定期定额投资计划，具体规则由基金管理人在届时发布公告或更新的招募说明书中确定。

截至 2019 年 6 月 28 日，可办理本基金定期定额投资的销售机构如下：

序号	机构名称	最低限额（元）
1	工商银行	100
2	农业银行	200
3	中国银行	100
4	交通银行	100
5	光大银行	300
6	招商银行	普通定投 300 聪明定投 30
7	上海银行	500
8	浦发银行	300
9	中信银行	300
10	华夏银行	200
11	北京银行	200
12	民生银行	300
13	平安银行	100
14	宁波银行	200

15	南京银行	100
16	泰信网上直销	100
17	国泰君安证券	100
18	国信证券	100
19	中信证券	500
20	招商证券	100
21	华安证券	100
22	海通证券	100
23	江海证券	100
24	爱建证券	200
25	华福证券	100
26	中信建投证券	100
27	银河证券	100
28	安信证券	300
29	万联证券	100
30	平安证券	100
31	华泰证券	100
32	长城证券	100
33	中信证券（山东）	500
34	中泰证券	100
35	华宝证券	100
36	恒泰证券	300
37	信达证券	100
38	华龙证券	100
39	长量基金	100
40	诺亚正行	100
41	蚂蚁基金	100
42	天天基金	100
43	和讯信息	100
44	金华银行	100
45	中山证券	100
46	利得基金	100
47	中信期货	500
48	好买基金	200
49	众禄基金	100
50	恒天明泽	100
51	富济基金	100
52	虹点基金	100
53	兴业证券	100
54	增财基金	200
55	广州证券	200

56	德邦证券	300
57	钱景基金	100
58	鑫鼎盛	100
59	新兰德	100
60	陆基金	100
61	泰诚财富	100
62	晟视天下	100
63	伯嘉基金	200
64	万得基金	100
65	上海华信证券	100
66	中银国际证券	100
67	肯特瑞基金	100
68	金石基金	100
69	盈米基金	100
70	世纪证券	100
71	基煜基金	100
72	济安财富	100
73	国金证券	100
74	国联证券	100
75	苏宁基金	100
76	麟龙投顾	100
77	中金公司	100
78	东海证券	500
79	中正达广	100
80	中投证券	100
81	阳光人寿	100

第八节 基金的非交易过户及转托管

一、非交易过户是指不采用申购、赎回等基金交易方式，将一定数量的基金份额按照一定规则从某一投资者基金账户转移到另一投资者基金账户的行为，包括继承、捐赠、遗赠、自愿离婚、国有资产无偿划转、机构合并或分立、资产售卖、机构清算、企业破产清算、司法执行，及基金注册与过户登记人认可的其它行为。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是合格的个人投资者或机构投资者。其中：

（一）“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或受遗赠人继承；

（二）“捐赠”仅指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或其他具有社会公益性质的社会团体；

（三）“遗赠”指基金份额持有人立遗嘱将其持有的基金份额赠给法定继承人以外的其他人；

（四）“自愿离婚”指原属夫妻共同财产的基金份额因基金份额持有人自愿离婚而使原在某一方名下的部分或全部基金份额划转至另一方名下；

（五）“国有资产无偿划转”指因管理体制改革、组织形式调整或资产重组等原因引起的作为国有资产的基金份额在不同国有产权主体之间的无偿转移；

（六）“机构合并或分立”指因机构的合并或分立而导致的基金份额的划转；

（七）“资产售卖”指一企业出售它的下属部门（独立部门、分支机构或生产线）的整体资产给另一企业的交易，在这种交易中，前者持有的基金份额随其他经营性资产一同转让给后者，由后者一并支付对价；

（八）“机构清算”是指机构因组织文件规定的期限届满或出现其他解散事由，或因其权力机关作出解散决议，或依法被责令关闭或撤销而导致解散，或因其他原因解散，从而进入清算程序（破产清算程序除外），清算组（或类似组织，下同）将该机构持有的基金份额分配给该机构的债权人以清偿债务，或将清偿债务后的剩余财产中的基金份额分配给机构的股东、成员、出资者或开办人；

（九）“企业破产清算”是指一企业法人根据《中华人民共和国企业破产法（试行）》或《中华人民共和国民事诉讼法》第十九章的有关规定被宣告破产，清算组依法将破产企业持有的基金份额直接分配给该破产企业的债权人所导致的基金份额的划转；

（十）“司法执行”是指依据生效法律文书将基金份额持有人持有的基金份额划转给其他自然人、法人、社会团体或其他组织。

二、办理非交易过户业务必须提供基金注册与过户登记人要求提供的相关资料，其中，因继承、捐赠、遗赠、自愿离婚原因导致的非交易过户向基金销售网点申请办理，因国有资产无偿划转、机构合并或分立、资产售卖、机构清算、企业破产清算、司法执行原因导致的非交易过户直接向基金注册与过户登记人统一申请办理。

三、符合条件的非交易过户申请自申请受理日起，二个月内办理；申请人按基金注册与过户登记人规定的标准缴纳过户费用。

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

五、基金注册与过户登记人只受理国家有权机关依法要求的基金账户或基金份额的冻

结与解冻。基金账户或基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益（包括现金分红和红利再投资）一并冻结。

六、在相关法律法规有明确规定的条件下，基金管理人将可以办理基金份额的质押业务或其他基金业务，并制定、公布并实施相应的业务规则。

第九节 基金的投资

一、投资目标

运用多层次先行策略，灵活配置各类资产，追求收益的长期稳定增长；提前发现和介入价值被市场低估的价值成长股票，在其价值回归过程中获取超额收益。

二、投资范围

限于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行上市的股票、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中债券包括国债、金融债、企业（公司）债（包括可转债）等。

三、投资策略

（一）投资策略

1、股票投资策略

本基金区别于其他基金的主要特点，是先行策略的运用。先行策略，是对国际流行的均值反转策略在中国市场的改良应用，在投资操作中注意运用股价波动的均值反转规律，强调“先行价值发现、提前控制风险”，简单讲，就是在市场取得一致认识之前，超前发现和介入价值被低估的行业和个股，并在市场存在下跌风险时，通过资产配置比例的调整，提前控制下跌风险。

先行策略的主要目标是那些相对于近两、三年价格高点，股价处于相对低位的股票。通过对其所处行业、公司基本面的分析，寻找价值未能被市场充分认识的股票作为投资对象，利用市场的均值反转规律，在其价值回归过程中获益。

本基金股票投资部分以先行策略为核心，实行自上而下三个层次的资产配置。

（1）大类资产配置

本基金执行灵活的资产配置政策，利用宏观策略分析系统和市场价值中枢评估系统，灵活选择在各类别资产上的进出时机和配置比例。

①宏观策略分析系统包括对宏观经济运行趋势的判断、经济政策调整的前瞻性分析，

以及各类别资产的政策效应研究。

②市场价值中枢评估系统，通过对移动平均市盈率(PE动量)等指标的综合分析，合理评估市场价值中枢。根据市场即时市盈率与市场价值中枢的偏离程度，灵活调整大类资产配置比例。在市场处于价值中枢下方时，逐步提高股票投资比例；反之，逐步降低股票投资比例。

（2）行业资产配置

行业价值评估系统包括对行业景气度、行业增长前景、行业盈利能力和行业指数市场表现等因素的综合分析，是本基金实施行业资产配置的决策依据。

本基金重点投资处于景气复苏期或者进入稳定增长期的传统行业，以及处于成熟早期的新兴行业；减持处于景气高峰、供给趋于过剩的行业，或进入萧条期的行业。

（3）股票选择标准

根据先行策略选股系统，选择兼具价值成长特征和价值回归潜能的股票：

①盈利指标和理论增长率达到价值成长股的基本标准（剔除预计当年亏损以及近三年理论增长率为负的股票）。

②过去一段相对较长的时间内股价相对涨幅不大。

③综合动态市盈率（PEG）、市净率（B/M）、每股经营现金流/每股价格（C/P）及主营业务收入增长率（SG）等指标的价值成长评级处于A股公司前列；其中B/M、C/P为价值因子，SG为成长因子，PEG是兼顾价值和成长的因子。价值成长评级由四个指标值排序结果（其中PEG采取升序排列，SG、C/P和B/M采取降序排列）的加权相加值来决定，每个指标的权重根据其对超额收益的贡献度来确定。

④企业所处行业发展前景良好，已进入景气复苏期、稳定增长期（传统行业）或成熟早期（新兴行业），预期主营业务利润和主营业务收入增长率保持在较高水平；

⑤企业内部治理结构比较完善，产品具有较高的市场知名度，处于行业领先水平。

2、债券投资策略

本基金债券投资部分主要运用久期调整、收益率曲线配置、类别配置、无风险套利和融资杠杆等策略。

本基金债券投资部分主要投资于国债及信用评级BBB以上的债券,具有以下一项或多项特征的债券，将是本组合债券投资重点关注的对象：

（1）流动性较好；

（2）到期收益率相对于同类债券较高；

（3）发行人资信程度和财务状况良好，偿债能力强；

（4）符合本基金投资策略和资产配置的要求。

（二）决策依据

1、国家有关法律、法规和《基金合同》的规定；

2、政治形势、政策趋势和宏观经济形势；

3、货币政策、利率趋势；

4、行业和上市公司基本面；

5、证券市场发展趋势。

（三）决策和操作程序

本基金参与投资决策和操作的机构和部门包括：投资决策委员会、基金投资部、研究部。具体程序如下：

（1）金融工程人员选择合适的金融工具，对市场各类收益率曲线进行拟合，并对各类收益率曲线之间的相对关系以及收益率曲线和宏观经济之间的关系进行数量分析；

（2）研究部与基金投资部联合对宏观经济和债券市场深入研究，初步确定资产配置方案；

（3）基金经理构造投资组合计划；

（4）金融工程人员对投资组合计划进行风险收益分析，提出修正意见；研究部策略分析师通过宏观经济以及债券市场分析，对投资组合的资产配置提出调整意见；

（5）投资决策委员会最后确定投资组合方案；

（6）基金经理通过交易过程完成投资组合方案的构建；

（7）金融工程人员对投资组合进行跟踪评估，提出风险控制意见，按照风险大小，定期或随时向基金经理、投资总监、投资决策委员会报告；

（8）风险管理部、监察稽核部对投资组合计划的执行过程进行监控；

（9）评估和调整决策程序：投资决策委员会根据市场环境的变化和实际需要可以调整决策的程序，基金经理调整投资组合应按授权权限和批准程序进行；

（10）在确保基金份额持有人合法权益的前提下，基金管理人有权根据市场变化和实际需要对上述程序做适当的调整。

四、业绩比较基准

本基金业绩比较基准：65%*富时中国A600指数+ 35%*富时中国国债指数

说明：富时中国A600指数是新华富时指数公司编制的包含上海、深圳两个证券交易所

流通市值最大的600只股票并以流通股本加权的股票指数，是目前中国证券市场中公信力较好的股票指数。富时中国国债指数涵盖了沪深挂牌的国债，是比较有市场影响的国债指数。根据本基金的投资策略和投资范围的限定，选用以上比较基准是合适的。

五、投资限制

（一）基金投资限制

1、基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的10%；

2、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，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

3、基金与由基金管理人管理的其他基金持有任何一家公司发行的证券的总和，不超过该证券的10%；

4、基金投资于股票、债券的比例不低于基金资产总值的80％；

4、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；

6、不违反基金合同关于投资范围、投资策略和投资比例等约定；

7、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%；

8、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；

9、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；

10、法律法规规定的其他限制。

对上述限制，法律法规另有规定时，从其规定。

本基金于基金成立之日起6个月内达到符合规定的比例限制。

除上述第2、8、9项外，因基金规模或市场剧烈变化导致投资组合不符合上述规定时，基金管理人应在10个交易日内进行调整，以符合上述规定。

（二）禁止行为

1、投资于其他证券投资基金，但是国务院另有规定的除外；

2、承销证券；

3、以基金的名义使用不属于基金名下的资金买卖证券；

4、动用银行信贷资金从事基金投资；

5、将基金资产用于担保、资金拆借或者贷款；

6、从事证券信用交易；

7、以基金资产进行房地产投资；

8、从事承担无限责任的投资；

9、向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；

10、买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；

11、以任何方式使用基金资产与基金管理人或基金托管人的固有资产进行交易，或者使用基金管理人管理的其他基金的基金资产与本基金的基金资产进行交易，但法律法规另有规定，基金合同另有约定，经有关基金份额持有人基金份额持有人同意并以公平的市场价格进行交易的除外；

12、当时有效的法律法规、规章、中国证监会及基金合同规定禁止从事的其他行为。

对上述事项，法律法规另有规定时从其规定。

六、基金管理人代表基金行使所投资证券产生权利的处理原则及方法

（一）不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；

（二）有利于基金财产的安全与增值；

（三）基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金投资者的利益。

七、基金投资组合报告（未经审计）

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

本基金的托管人中国光大银行股份有限公司根据基金合同已于 2019 年 7 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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	790,182,992.09	83.72
	其中：股票	790,182,992.09	83.72
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	100,340,000.00	10.63
	其中：债券	100,340,000.00	10.63
	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	-	-
	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	26,760,360.44	2.84
8	其他资产	26,575,239.97	2.82
9	合计	943,858,592.50	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	27,689,212.86	2.94
C	制造业	618,191,694.28	65.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	64,841,103.80	6.89
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	38,539,145.59	4.10
J	金融业	-	-
K	房地产业	30,009,631.30	3.19
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	10,912,204.26	1.16
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	790,182,992.09	84.02

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	002157	正邦科技	4,870,859	81,148,510.94	8.63
2	002124	天邦股份	5,054,770	63,842,200.80	6.79
3	002798	帝欧家居	2,643,329	48,399,353.99	5.15
4	603363	傲农生物	2,503,700	47,970,892.00	5.10
5	002567	唐人神	4,087,988	47,216,261.40	5.02
6	600745	闻泰科技	1,170,355	38,879,193.10	4.13
7	002548	金新农	2,875,676	35,658,382.40	3.79
8	600519	贵州茅台	34,829	34,271,736.00	3.64
9	002352	顺丰控股	992,465	33,704,111.40	3.58
10	603128	华贸物流	3,312,446	31,136,992.40	3.31

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	100,340,000.00	10.67
	其中：政策性金融债	100,340,000.00	10.67
4	企业债券	-	-
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	其他	-	-
10	合计	100,340,000.00	10.67

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	140224	14 国开 24	500,000	50,270,000.00	5.35
2	140439	14 农发 39	500,000	50,070,000.00	5.32

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

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名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8、投资组合报告附注

8.1 本基金本期投资的前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

8.2报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

8.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,057,036.74
2	应收证券清算款	21,038,493.44
3	应收股利	-
4	应收利息	4,269,098.18
5	应收申购款	210,611.61
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	26,575,239.97

8.4 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。

8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	002124	天邦股份	22,052,000.00	2.34	流通受限

8.6 本报告涉及合计数相关比例的，均以合计数除以相关数据计算，而不是对不同比例进行合计。

第十节 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

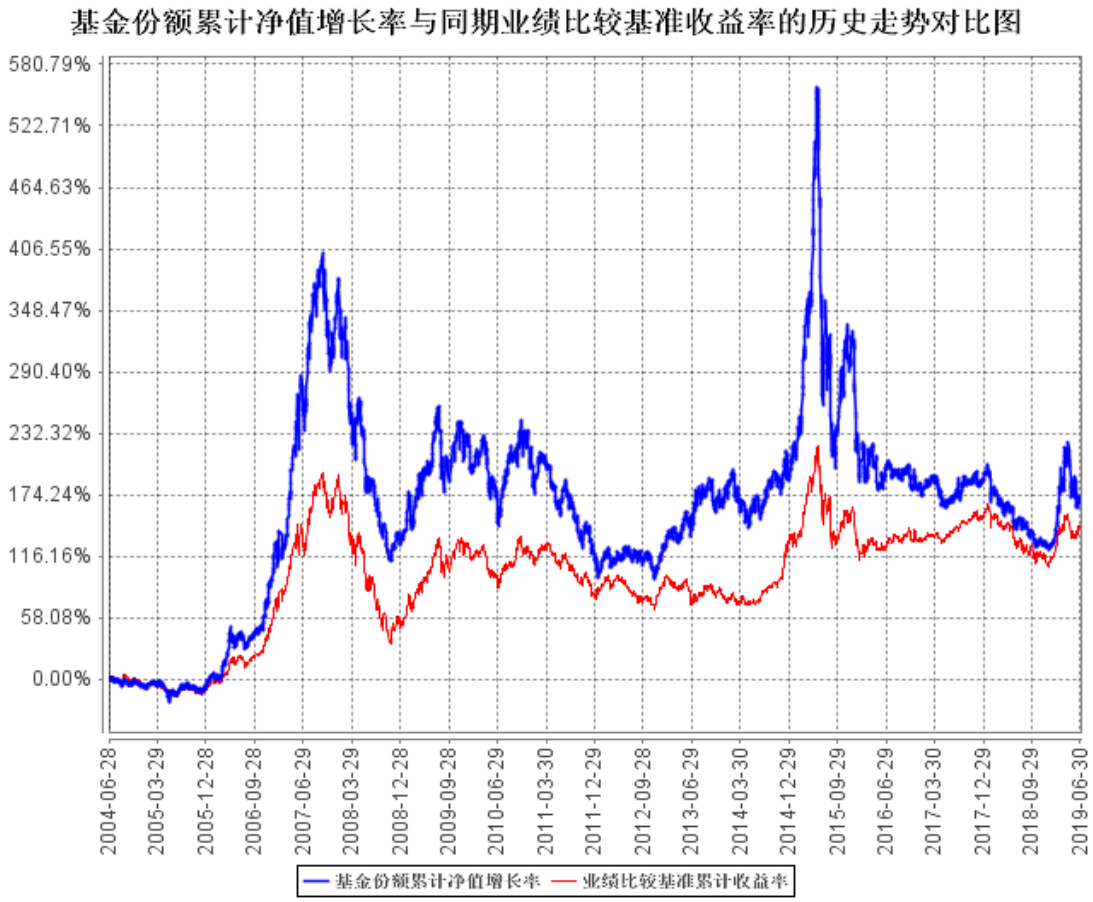
基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

（一）基金合同生效日为2004年6月28日。基金合同生效以来（截至2019年6月30日）的投资业绩与同期基准的比较如下表所示：

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
20190101-20190630	18.64%	1.91%	16.92%	1.00%	1.72%	0.91%
20180101-20181231	-22.09%	0.86%	-17.53%	0.88%	-4.56%	-0.02%
20170101-20171231	3.06%	0.84%	9.76%	0.42%	-6.70%	0.42%
20160101-20161231	-32.14%	1.66%	-10.32%	0.96%	-21.82%	0.71%
20150101-20151231	41.22%	2.89%	10.49%	1.60%	30.73%	1.29%
20140101-20141231	6.68%	1.31%	29.63%	0.77%	-22.95%	0.54%
20130101-20131231	27.15%	1.26%	-3.78%	0.89%	30.93%	0.37%
20120101-20121231	-0.34%	1.04%	4.54%	0.85%	-4.88%	0.19%
20110101-20111231	-31.24%	1.28%	-17.72%	0.86%	-13.52%	0.42%
20100101-20101231	-4.44%	1.58%	-4.44%	1.01%	0.00%	0.57%
20090101-20091231	44.62%	1.76%	55.03%	1.32%	-10.41%	0.44%
20080101-20081231	-48.15%	1.92%	-47.05%	1.98%	-1.10%	-0.06%
20070101-20071231	126.73%	2.10%	99.77%	1.50%	26.96%	0.60%
20060101-20061231	108.35%	1.37%	78.37%	0.91%	29.98%	0.46%
20050101-20051231	-1.32%	1.07%	-4.80%	0.93%	3.48%	0.14%
20040628-20041231	-5.80%	0.80%	-4.93%	0.98%	-0.87%	-0.18%
20040628-20190630	167.04%	1.58%	143.43%	1.12%	23.61%	0.46%

（二）自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况，及与同期业绩比较基准的变动进行比较：

（2004 年 6 月 28 日至 2019 年 06 月 30 日）



注：1、本基金基金合同于 2004 年 6 月 28 日正式生效。

2、本基金建仓期为六个月。建仓期满各项投资比例符合基金合同关于投资组合的相关规定。在正常市场情况下，本基金组合投资的基本范围为：股票资产 30%－95%，债券资产 0%－65%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金净资产的 5%。，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等

第十一节 基金的财产

一、基金财产的构成

基金资产总值是指基金所拥有的各类证券、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和。

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

二、基金财产的账户

本基金托管人以托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限公司上海分公司/深圳分公司开设证券账户，以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/

深圳分公司开立基金证券交易资金账户，用于证券清算。以本基金的名义开立银行间债券托管账户并报中国证监会备案。

本基金的基金财产账户，与基金管理人和基金托管人自有的财产账户以及其他基金财产账户独立。

三、基金财产的保管与处分

（一）本基金的基金资产独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。基金管理人、基金托管人不得将基金财产归入其固有资产。

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

（三）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。

（四）非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

第十二节 基金财产的估值

一、估值目标

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

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

三、估值对象

基金所拥有的股票、债券、权证和银行存款本息等资产和负债。

四、估值方法

本基金按以下方式进行估值：

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，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

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

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

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

2、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市价（收盘价）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市价（收盘价）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、因持有股票而享有的配股权，从配股除权日起到配股确认日止，如果收盘价高于配股价，按收盘价高于配股价的差额估值。收盘价等于或低于配股价，则估值为零。

4、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

5、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。

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。

根据《基金法》，基金管理人计算并公告基金资产净值，基金托管人复核、审查基金

管理人计算的基金资产净值。因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。

五、估值程序

基金日常估值由基金管理人进行。基金管理人完成估值后，将估值结果加盖业务公章以书面形式加密传真至基金托管人，基金托管人按法律法规、《基金合同》规定的估值方法、时间、程序进行复核，复核无误后在基金管理人传真的书面估值结果上加盖业务公章返回给基金管理人；月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

六、估值错误的确认与处理

基金份额净值的计算保留到小数点后4位，小数点后第5位四舍五入。当估值或份额净值计价错误实际发生时，基金管理人应当立即纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。当错误达到或超过基金资产净值的0.25%时，基金管理人应报中国证监会备案；当估值错误偏差达到基金份额净值的0.5%时，基金管理人应当公告，并报中国证监会备案。因基金估值错误给投资者造成损失的，应先由基金管理人承担，基金管理人对不应由其承担的责任，有权向过错人追偿。

关于差错处理，基金合同的当事人按照以下约定处理：

1、差错类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或注册登记机构、或代理销售机构、或投资者自身的过错造成差错，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该差错遭受损失的当事人（“受损方”）按下述“差错处理原则”给予赔偿承担赔偿责任。

上述差错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；对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平无法预见、无法避免、无法抗拒，则属不可抗力，按照下述规定执行。

由于不可抗力原因造成投资者的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

2、差错处理原则

（1）差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已产生的差

错，给当事人造成损失的由差错责任方承担；若差错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。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正。

（2）差错的责任方对可能导致有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对差错的有关直接当事人负责，不对第三方负责。

（3）因差错而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但差错责任方仍应对差错负责，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”），则差错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差错责任方。

（4）差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式。

（5）差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人过错造成基金资产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人过错造成基金资产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。除基金管理人和托管人之外的第三方造成基金资产的损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错方追偿。

（6）如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿，并且依据法律、行政法规、《基金合同》或其他规定，基金管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任，则基金管理人有权向出现过错的当事人进行追索，并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失。

（7）按法律法规规定的其他原则处理差错。

3、差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

（1）查明差错发生的原因，列明所有的当事人，并根据差错发生的原因确定差错的责任方；

（2）根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；

（3）根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失；

（4）根据差错处理的方法，需要修改基金注册登记机构的交易数据的，由基金注册登记机构进行更正，并就差错的更正向有关当事人进行确认；

（5）基金管理人及基金托管人基金份额净值计算错误偏差达到基金份额净值的0.25%

时，基金管理人应当报告中国证监会；基金管理人及基金托管人基金份额净值计算错误偏差达到基金份额净值的0.5%时，基金管理人应当公告并报中国证监会备案。

七、暂停估值的情形及处理

1、与本基金投资有关的证券交易场所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人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的，基金管理人应当暂停基金估值；

4、法律法规、中国证监会认定的其他情形。

八、特殊情形的处理

1、基金管理人按估值方法的第6项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理；

2、由于证券交易所及其登记结算公司发送的数据错误，或由于其他不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

第十三节 基金的收益分配

一、收益的构成

（一）基金投资所得红利、股息、债券利息、回购利息收入；

（二）买卖证券差价；

（三）银行存款利息；

（四）因运用基金财产带来的成本或费用的节约；

（五）其他收入。

二、基金净收益

基金净收益为基金收益扣除按照有关规定可以在基金收益中扣除的费用后的余额。

三、收益分配原则

（一）基金收益采用现金方式分配，投资者可选择获取现金红利或者将现金红利按红利发放日前一日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资（下称“再投资方式”）；如果

投资者没有明示选择，则视为选择现金方式分配；

（二）每一基金份额享有同等分配权；

（三）基金当期收益先弥补上期亏损后，方可进行当期收益分配；

（四）基金收益分配后每份基金份额净值不能低于面值；

（五）如果基金投资当期出现亏损，则不进行收益分配；

（六）基金收益分配比例按照有关规定执行；

（七）在符合基金分红条件下，本基金每年至少分红一次。当年成立不满3个月，收益可不分配。

法律、法规或监管机构另有规定的从其规定。

四、收益分配方案

基金收益分配方案中载明基金收益的范围、基金净收益、基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式及有关手续费等内容。

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，并由基金托管人核实后确定，在报中国证监会备案后52个工作日内由基金管理人公告。

六、收益分配中发生的费用

（一）收益分配采用红利再投资方式免收再投资的费用。

（二）收益分配时发生的银行转帐或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金注册与过户登记人可将投资人的现金红利按红利发放日前一日的基金份额净值自动转为基金份额。

第十四节 基金的费用与税收

一、与基金运作有关的费用

（一）基金管理人的管理费

1、基金管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×1.5%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

2、基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金管理人向基金托

管人发送基金管理费划付指令，托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

（二）基金托管人的托管费

1、基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×0.25%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

2、基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

基金管理人和基金托管人可磋商酌情调低基金管理费和基金托管费，此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。

（三）其它与基金运作有关的费用

1、基金信息披露费用；

2、基金份额持有人大会费用；

3、与基金相关的会计师费和律师费；

4、证券交易费用；

5、按照国家有关规定和基金合同规定可以列入的其他费用。

法律法规另有规定时从其规定。

上述基金费用由基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付，列入当期基金费用。

（四）不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金资产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。

二、与基金销售有关的费用

（一）申购费

1、本基金的申购费按申购金额采用差别费率，投资人在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。费率表如下：

申购金额（元）	申购费率
50万以下	1.50%

50万≤M＜100万	1.20%
100万≤M＜250万	0.75%
250万≤M＜500万	0.50%
M≥500万	每笔1000元

基金的申购金额包括申购费用和净申购金额。

2、计算公式

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

申购费以人民币元为单位，保留至小数点后两位，小数点后两位以下舍去，不向投资者收取。

3、收取方式和使用方式

基金的申购费由申购人承担，用于支付基金销售代理费和注册登记费等相关手续费，不计入基金财产。

（二）赎回费

1、赎回费率随基金持有时间的增加而递减，费率分为六档。持有期限的起始日为基金权益登记日。

持有期限	赎回费率
0-6天	1.5%
7-90天	0.5%
91-180天	0.35%
181-365天	0.18%
366-730天	0.1%
731天及以上	0

2、计算公式

赎回总额=赎回数量×T日基金份额净值

赎回费用=赎回总额×赎回费率

基金的赎回金额为赎回总额扣减赎回费用，赎回总额、赎回费以人民币元为单位，保留小数点后两位，小数点后两位以下舍去，舍去部分所代表的财产计入基金财产。

3、收取方式及使用方式

赎回费用由赎回人承担，对持续持有期少于7日的投资者收取的赎回费全额计入基金财

产；对其他投资者收取的赎回费中75%用于支付销售代理费用和注册登记费用等相关手续费，25%归基金资产。

（三）申购、赎回费率的调整

基金管理人可以在基金合同许可的范围内调整申购费率和赎回费率，最新的申购费率和赎回费率在招募说明书中列示。费率如发生变更，基金管理人最迟将于新的费率开始实施前3个工作日在指定媒体公告。

三、基金费用种类的调整

本基金可在中国证监会允许的条件下按照国家的有关规定增加其他种类的基金费用。如本基金仅对新发行的基金份额适用新的基金费用种类，不涉及已有基金份额持有人利益的，无须召开基金份额持有人大会

四、税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

第十五节 基金的会计与审计

一、投资的会计政策

（一）基金管理人为本基金的基金会计责任方；

（二）基金的会计年度为公历每年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：如果基金成立少于3 个月，可以并入下一个会计年度；

（三）基金核算以人民币为记帐账本位币，记帐账单位是人民币元；

（四）会计制度执行国家有关的会计制度；

（五）本基金独立建账、独立核算；

（六）基金管理人及基金托管人各自保留完整的基金会计账目、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；

（七）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、投资的审计

（一）基金管理人聘请具有证券业从业资格的会计师事务所及其注册会计师对基金年度财务报表及其它规定事项进行审计。会计师事务所及其注册会计师与基金管理人、基金托管人相互独立。

（二）会计师事务所更换经办注册会计师时，须事先征得基金管理人同意，并报中国证监会备案；

（三）基金管理人（或基金托管人）认为有充足理由更换会计师事务所的，经基金托管人（或基金管理人）同意后可以更换会计师事务所。基金管理人应当在更换会计师事务所后的两个工作日内编制临时报告书，予以公告，同时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。

第十六节 基金的信息披露

一、信息披露的形式

本基金的信息披露按照《基金法》、《运作管理办法》、《信息披露办法》、基金合同及其他有关规定办理。本基金的信息披露事项须在指定媒体上公告，并同时在本基金管理人的公司网站上刊登（www.ftfund.com）。

注：本基金目前选择的指定的信息披露媒体是《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》。

二、信息披露的种类、披露时间和披露形式

（一）基金募集信息披露

1、基金招募说明书、基金合同、托管协议书：

基金管理人按照《基金法》、《运作管理办法》、基金合同编制招募说明书，并在基金份额发售的三日前将招募说明书、基金合同摘要登载在指定报刊和网站上；同时，基金管理人、基金托管人将基金合同、基金托管协议登载在网站上。

2、基金份额发售公告：

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

3、基金合同生效公告：

基金管理人应当在基金合同生效的次日在指定报刊和网站上登载基金合同生效公告。

4、更新招募说明书：

基金合同生效后，基金管理人应当在每六个月结束之日起四十五日内，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报刊上。基金管理人应当在公告的十五日前向中国证监会报送更新的招募说明书，并就有关更新内容提供书面说明。

（二）基金运作信息披露

本基金运作信息披露包括年度报告、半年度报告、季度报告等定期报告和基金资产净值、基金份额净值公告等。由基金管理人和基金托管人按照《基金法》、《信息披露办法》等相关文件进行编制，并在中国证监会指定的信息披露媒体上公告，同时报中国证监会备案。

年度报告、半年度报告、季度报告等定期报告应当在公开披露的第二个工作日，采用电子文本和书面报告两种方式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。

1、年度报告：基金管理人应当在每年结束之日起九十日内，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报刊上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。

2、半年度报告：基金管理人应当在上半年结束之日起六十日内，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报刊上。

3、季度报告：基金管理人应当在每个季度结束之日起十五个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定媒体上。

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

如报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额20%的情形，为保障其他投资者的权益，基金管理人至少应当在基金定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及产品的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。4、基金资产净值公告：

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，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在上述规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值、基金份额累计净值登载在指定报刊和网站上。

（三）基金临时信息披露

本基金在运作过程中发生如下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重大事件时，有关信息披露义务人应当在两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中国证监会派出机构备案。

1、基金份额持有人大会的召开；

2、提前终止基金合同；

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、涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼；

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、管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；

17、基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；

18、基金改聘会计师事务所；

19、变更基金份额发售机构；

20、基金更换注册登记机构；

21、基金开始办理申购、赎回；

22、基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；

23、基金发生巨额赎回并延期支付；

24、基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；

25、基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；

26本基金发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；

27、中国证监会规定的其他事项。

（四）澄清公告与说明

任何公共媒体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。

三、信息披露文件的存放与查阅

基金合同、招募说明书及其摘要、定期报告、临时报告等文本存放在基金管理人、基金托管人和代销机构的办公场所和营业场所，投资者可免费查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。基金管理人和基金托管人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

如有必要，投资者可直接登录本基金管理人的网站(www.ftfund.com)查阅或下载上述文件。

第十七节 风险揭示

一、投资于本基金的主要风险

（一）市场风险

证券市场价格因受各种因素的影响而引起的波动，将使本基金资产面临潜在的风险。市场风险可以分为股票投资风险和债券投资风险。

股票投资风险主要包括：

1、国家货币政策、财政政策、产业政策等的变化对证券市场产生一定的影响，导致市场价格水平波动的风险。

2、宏观经济运行周期性波动，对股票市场的收益水平产生影响的风险。

3、上市公司的经营状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务等都会导致公司盈利发生变化，从而导致股票价格变动的风险。

债券投资风险主要包括：

1、市场平均利率水平变化导致债券价格变化的风险。

2、债券市场不同期限、不同类属债券之间的利差变动导致相应期限和类属债券价格变化的风险。

3、债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下降的风险。

（二）管理风险

本基金将通过对市场走势的正确判断实现较高的投资回报，但并不保证基　金投资收益为正。管理人可能因信息不全等原因导致判断失误，使得基金投资目标无法完成，甚至造成基金资产损失。

（三）流动性风险

本基金属于混合型基金，通过合理配置股票、债券和现金的投资比例获取较高的投资收益，在市场或个股流动性不足的情况下，基金管理人可能无法迅速、低成本地调整基金资产的配置比例，对基金收益造成不利影响。

由于开放式基金的特殊要求，本基金必须保持一定的现金比例以应付赎回要求，在管理现金头寸时，有可能存在现金不足的风险和现金过多带来的机会成本风险。

1、基金申购、赎回安排

本基金申购、赎回的具体安排请参见本招募说明书“第六节 基金份额的申购与赎回”章节。

2、拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

本基金的投资市场主要为证券交易所、全国银行间债券市场等流动性较好的规范型交易场所，主要投资对象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、债券和货币市场工具等），同时本基金基于分散投资的原则在行业和个券方面未有高集中度的特征，综合评估在正常市场环境下本基金的流动性风险适中。

3、巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

基金出现巨额赎回情形下，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况或巨额赎回份额占比情况决定全额赎回或部分延期赎回。同时，如本基金单个基金份额持有人在单个开放日申请赎回基金份额超过基金总份额一定比例以上的，基金管理人有权对其采取延期办理赎回申请的措施。

4、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

在市场大幅波动、流动性枯竭等极端情况下发生无法应对投资者巨额赎回的情形时，基金管理人将以保障投资者合法权益为前提，严格按照法律法规及基金合同的规定，谨慎选取延期办理巨额赎回申请、暂停接受赎回申请、延缓支付赎回款项、收取短期赎回费、暂停基金估值等流动性风险管理工具作为辅助措施。对于各类流动性风险管理工具的使用，基金管理人将依照严格审批、审慎决策的原则，及时有效地对风险进行监测和评估，使用前经过内部审批程序并与基金托管人协商一致。在实际运用各类流动性风险管理工具时，投资者的赎回申请、赎回款项支付等可能受到相应影响，基金管理人将严格依照法律法规及基金合同的

约定进行操作，全面保障投资者的合法权益。

（四）操作或技术风险

相关当事人在业务各环节操作过程中，因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险，例如，越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误、IT系统故障等风险。

在开放式基金的各种交易行为或者后台运作中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致投资者的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理公司、注册登记机构、销售机构、证券交易所、证券登记结算机构等等。

（五）法律风险

由于法律法规方面的原因，某些市场行为受到限制或合同不能正常执行，导致基金资产的损失。

（六）其它风险

战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致基金资产的损失。金融市场危机、行业竞争、代理商违约、托管行违约等超出基金管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致基金或者基金份额持有人利益受损。

二、基金产品的风险和风险控制

（一）本基金利用宏观策略分析系统和市场价值中枢评估系统来完成大类资产配置。这两个系统主要依据历史数据及经验值来评估股票市场的整体投资价值和风险程度，历史数据的局限性以及经验值的主观性可能导致系统失效，从而影响择时的准确性，给基金投资带来风险。风险防范措施：发挥专业人员知识优势，动态跟踪市场变化，不断调整系统的重要参数，以适应市场；以定性分析来弥补数量分析的不足。

（二）本基金利用行业价值评估系统来完成行业资产配置。该系统对行业景气度、行业增长前景等的分析可能由于历史数据和某些指标的局限性，导致对行业投资价值的误判。风险防范措施：深入研究经济起飞阶段发展中国家的行业发展轨迹，积极探索行业景气与国内宏观经济波动的基本规律，不断提高行业研究的水平。

（三）本基金利用先行策略选股系统选择个股。该系统重视选股指标的历史表现，但如果完全依赖这些指标的历史表现来选择个股，可能会导致忽略一些过去业绩不佳但近期基本面突然改善的个股，也可能会导致对历史业绩优良个股的过度投资。风险防范措施：对上市公司业绩变化保持密切跟踪并进行动态评级，加强对基本面可能发生突变的公司的关注。

第十八节 基金的终止与清算

一、基金终止的情形及处理方式

本基金出现下列情形之一的，经中国证监会批准后将终止：

（一）存续期间内，基金份额持有人数量连续60个工作日达不到200人，或连续60个工作日基金资产净值低于人民币5000万元，基金管理人将宣布本基金终止；

（二）经基金份额持有人大会表决终止的；

（三）因重大违法、违规行为，被中国证监会责令终止的；

（四）基金管理人职责终止，在6个月内没有新基金管理人承接的；

（五）基金托管人职责终止，在6个月内没有新基金管托管人承接的；

（六）由于投资方向变更引起的基金合并、撤销；

（七）中国证监会允许的其他情况。

基金终止后，基金管理人和基金托管人依照《信托法》、《基金法》、《运作管理办法》、《基金合同》及其他有关规定，行使请求给付报酬、从基金资产中获得补偿的权利时，可以留置基金资产或者对基金资产的权利归属人提出请求。

二、基金清算

（一）基金清算小组

1、自基金终止之日起30个工作日内成立清算小组，基金清算小组在中国证监会的监督下进行基金清算。

2、基金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、具有从事证券法律业务资格的律师以及中国证监会指定的人员组成。基金清算小组可以聘用必要的工作人员。清算小组在成立后五个工作日内应当公告

3、基金清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金清算小组可以依法以基金的名义进行必要的民事活动。

（二）清算程序

1、基金终止后，由基金清算小组统一接管基金财产；

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、对基金财产进行分配；

5、将基金清算结果报告中国证监会；

56、公布基金清算公告。

（三）清算费用

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

（四）基金清算剩余财产的分配

1、支付清算费用；

2、交纳所欠税款；

3、清偿基金债务；

4、按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金资产未按前款1 至3项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

（五）清算的公告

基金财产清算过程中的有关重大事项须及时公告；清算小组作出的清算报告经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案，并在指定媒体上公告。

（六）清算的账册及文件的保存

基金清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。

第十九节 基金合同的内容摘要

一、基金份额持有人权利和义务

（一）基金份额持有人的权利

基金份额持有人有权按法律法规、本基金合同以及依据本基金合同制定的其他法律文件的规定享有下列权利：

1、分享基金财产收益；

2、参与分配清算后的剩余基金财产；

3、依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；

4、按照规定要求召开基金份额持有人大会；

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、对基金管理人、基金托管人、基金份额发售机构损害其合法权益的行为依法提起诉

讼；

8、要求基金管理人或基金托管人按法律法规、本基金合同以及依据本基金合同制定的其他法律文件的规定履行其义务；

9、基金合同约定的其他权利。

（二）基金份额持有人的义务

（1）遵守本基金合同及根据本基金合同制订的相关业务规则；

（2）交纳基金认购、申购款项及规定的费用；

（3）在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；

（4）返还持有基金份额过程中获得的不当得利；

（5）不从事任何有损基金及其他基金份额持有人利益的活动；

（6）法律法规、本基金合同以及依据本基金合同制定的其他法律文件所规定的其他义务。

二、基金管理人的权利和义务

（一）基金管理人的权利

1、自本基金成立之日起，基金管理人根据基金合同的规定，独立运用并管理基金财产；

2、根据基金合同的规定获得基金管理人报酬；

3、担任基金的注册登记机构并获得基金合同规定的注册登记费用；选择和更换注册登记代理机构，并对其注册登记代理行为进行必要的监督；

4、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；

5、依据基金合同的规定，决定基金收益的分配方案；

6、提议召开基金份额持有人大会；

7、在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

8、依据基金合同及有关法律规定监督基金托管人的托管行为，如认为基金托管人违反了本基金合同或国家有关法律规定对基金财产或基金份额持有人利益造成重大损失的，应呈报中国证监会，并有权提议召开基金份额持有人大会，由基金份额持有人大会表决更换基金托管人，或采取其他必要措施保护基金投资者的利益；

9、选择、更换代销机构；如果基金管理人认为代销机构的作为或不作为违反了法律法规、基金合同或基金销售代理协议，基金管理人应行使法律法规、基金合同或基金销售代理协议赋予、给予、规定的基金管理人的任何及所有权利和救济措施，以保护基金财产的安全和基金投资者的利益；

10、按照《基金法》及其他有关规定，代表基金对其所投资的企业依法行使股东权利或行使因投资于其他证券产生的权利；

11、法律法规、本基金合同以及依据本基金合同制定的其他法律文件所规定的其他权利。

（二）基金管理人的义务

1、基金管理人将遵守《基金法》、基金合同及其他有关规定，为基金份额持有人的最大利益处理基金事务；

2、基金管理人保证恪尽职守，依照诚实信用、勤勉尽责的原则，谨慎、有效管理和运用基金财产；

3、设置相应的部门并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；

4、设置相应的部门并配备足够的专业人员办理基金份额的认购、申购、赎回和其他业务或委托其他机构代理基金业务；

5、设置相应的部门并配备足够的专业人员办理基金的注册登记工作或委托其他机构代理该项业务；

6、建立健全内部控制制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的固有财产相互独立，确保分别管理、分别记账；保证本基金与基金管理人管理的其他基金之间在财产运作、财务管理等方面相互独立，确保分别管理、分别记账。

7、除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不为自己及任何第三方谋取利益，基金管理人违反此义务，利用基金财产为自己及任何第三方谋取利益，所得利益归于基金财产，造成基金财产损失的，承担赔偿责任；基金管理人不得将基金财产转为其固有财产，违反此款规定的，将承担相应的责任，包括但不限于恢复基金财产的原状、承担赔偿责任；

8、除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，基金管理人不得委托第三人管理、运作基金财产；

9、接受基金托管人依据法律法规、本基金合同和托管协议对基金管理人履行本基金合同和托管协议的情况进行的监督；

10、按规定计算并公告基金资产净值和基金份额净值；

11、按照法律和本基金合同的规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

12、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；

13、保守基金的商业秘密，不得泄露基金投资计划等；除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露，但因遵守和服从

司法机关、中国证监会或其他监管机构的判决、裁决、决定、命令而作出的披露不应视为基金管理人违反本基金合同规定的保密义务；

14、依据基金合同规定决定基金收益分配方案并向基金份额持有人分配基金收益；

15、不谋求对基金财产所投资的公司的控股和直接管理；

16、依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会，执行基金份额持有人大会决议；

17、编制基金的财务会计报告；

18、保存基金的会计账册、报表、及其他处理有关基金事务的完整记录15 年以上；

19、组织并参加基金清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

20、面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其财产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

21、基金托管人因过错造成基金财产损失时，基金管理人应为基金向基金托管人追偿，但除法律法规另有规定外，不承担连带责任、赔偿责任及其他法律责任；

22、基金管理人因违反基金合同规定的信托目的处分基金财产或者因违反基金合同规定的管理职责、处理基金事务不当而致使基金财产或基金份额持有人利益受到损失的，应当承担赔偿责任，其过错责任不因其退任而免除；

23、确保向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间内发出；保证投资者能够按照本基金合同规定的时间和方式，查阅到与基金有关的公开资料，并得到有关资料的复印件；

24、负责为基金聘请注册会计师和律师；

25、不从事任何有损基金及本基金其他当事人利益的活动；

26、法律法规、本基金合同以及依据本基金合同制定的其他法律文件所规定的其他义务。

三、基金托管人的权利和义务

（一）基金托管人的权利

1、依法持有并保管基金的财产；

2、依照基金合同的约定获得基金托管费；

3、监督基金的投资运作；如认为基金管理人违反了本基金合同或国家有关法律规定对基金财产或基金份额持有人利益造成重大损失的，应呈报中国证监会，并有权提议召开基金份额持有人大会，由基金份额持有人大会表决更换基金管理人，或采取其他必要措施保护基金投资者的利益；

4、在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

5、法律法规、基金合同以及依据基金合同制定的其他法律文件所规定的其他权利。

（二）基金托管人的义务

1、基金托管人将遵守《基金法》、基金合同及其他有关规定，依法持有基金财产，为基金份额持有人的最大利益处理基金事务；

2、基金托管人保证恪尽职守，依照诚实信用、勤勉尽责的原则，谨慎、有效地持有并保管基金财产；

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

4、建立健全内部风险监控制度、监察与稽核、财务管理及人事管理制度，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固有财产相互独立，保证其托管的本基金与其托管的其他基金财产之间相互独立；对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名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

5、除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不为自己及任何第三人谋取利益，基金托管人违反此义务，利用基金财产为自己及任何第三方谋取利益，所得利益归于基金财产，造成基金财产损失的，承担赔偿责任；基金托管人不得将基金财产转为其固有财产，违反此款规定的，将承担相应的责任，包括但不限于恢复基金财产的原状、承担赔偿责任；

6、除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产；

7、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；

8、以本基金托管人的名义按照有关规定开立基金托管专户和证券交易资金账户，负责基金投资于证券的清算交割，执行基金管理人的划款指令，并负责办理基金名下的资金往来；

9、保守基金商业秘密。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；但因遵守和服从司法机关、中国证监会或其他监管机构的判决、裁决、决定、命令而作出的披露不应视为基金托管人违反本基金合同规定的保密义务；

10、复核、审查基金管理人计算的基金资产净值及基金份额净值；

11、对基金财务会计报告、半年度和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人有未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；按规定出具基金管理人履行基金合同情况和基金托管情况的报告，并报中国证监会；

12、按规定建立并保管基金份额持有人名册；

13、采取适当、合理的措施，使基金份额的认购、申购和赎回等事项符合基金合同等有关法律文件的规定；

14、采取适当、合理的措施，使基金管理人用以计算开放式基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合法律法规和基金合同等法律文件的规定；

15、采取适当、合理的措施，使基金投资和融资条件符合法律法规和本基金合同等法律文件的规定；

16、监督基金管理人的投资运作，发现基金管理人的投资指令违法、违规的，不予执行，并向中国证监会报告；

17、按有关规定，保存基金的会计账册、报表和其他有关基金托管事务的完整记录等15年以上；

18、按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

19、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；

20、参加基金清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

21、面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其财产时，及时报告中国证监会，并通知基金管理人；

22、基金管理人因过错造成基金财产损失时，基金托管人应为基金向基金管理人追偿，但除法律法规规定外，不承担连带责任、赔偿责任及其他法律责任；

23、不从事任何有损基金及本基金其他当事人利益的活动；

24、法律法规、本基金合同和依据本基金合同制定的其他法律文件所规定的其他义务。

四、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

（一）基金份额持有人大会的召开事由

有以下事由情形之一的，应当召开基金份额持有人大会：

1、修改基金合同，但基金合同另有约定的除外；

2、决定终止本基金合同；

3、转换基金运作方式；

4、变更基金投资目标、范围或策略；

5、变更基金份额持有人大会程序；

6、提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；

7、更换基金管理人；

8、更换基金托管人；

9、本基金与其他基金合并；

10、单独或合计持有本基金10%以上（不含10%）基金份额的基金份额持有人依法定程序（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）要求召开基金份额持有人大会；

11、基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；

12、法律法规、本基金合同或中国证监会规定的其他情形或对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项。

（ 二）基金份额持有人大会的有关事项

1、召集人和召集方式

基金份额持有人大会的召集人为基金管理人、基金托管人和符合规定条件的基金份额持有人。

（1）在正常情况下，基金份额持有人大会由基金管理人召集，开会时间及地点由基金管理人选择确定。

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

在更换基金管理人、审议与基金管理人有利益冲突的事项或基金管理人无法行使召集权的情况下，基金托管人应当召集基金份额持有人大会，并选择确定开会时间及地点。

（3）基金份额持有人要求 召开大会的情形

a、代表基金份额10%以上的基金份额持有人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。

b、基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额10%以上的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。

c、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。

d、基金管理人和基金托管人都不召集基金份额持有人大会的，基金份额持有人可以按

照《基金法》第七十二条第二款的规定自行召集基金份额持有人大会。

e、基金份额持有人自行召集基金份额持有人大会的，应当至少提前30日向中国证监会备案。

基金份额持有人大会的召集方式包括现场开会方式和通讯等方式开会，具体由召集人确定，但更换基金管理人和基金托管人必须采取现场开会方式。

2、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

召开基金份额持有人大会，召集人应当至少提前30天，在指定媒体上公告通知。基金份额持有人大会通知将至少载明以下内容：

（1）会议召开的时间、地点、方式、表决方式；

（2）会议拟审议的主要事项、议事程序；

（3）权利登记日；

（4）投票委托书送达时间和地点；

（5）会务常设联系人姓名、电话；

（6）其他注意事项。

如采用通讯方式开会并进行表决的情况下，会议通知应在公告前5 个工作日报中国证监会备案，且除上述内容外还要在会议通知中说明具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见的寄交和收取的方式等。

3、基金份额持有人出席会议的方式

（1）现场开会

a、本基金合同所指现场开会系指由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席参加基金份额持有人大会。现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席。

b、基金份额持有人本人在出席基金份额持有人大会时，应向召集人出具符合法律法规和规章、本基金合同及会议通知规定的有关证明文件。基金份额持有人代理人在出席基金份额持有人大会时，应向召集人提交有关基金份额持有人出具的有效书面授权书和基金份额持有人应当提交的上述证明文件。

c、基金份额持有人大会应当有代表50%以上基金份额的持有人参加，方可召开。

（2）通讯方式开会

a、本基金合同所指通讯方式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在表决截止日以前送达至召集人指定的地址。

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

c、基金份额持有人本人在以书面通讯方式进行表决时，应向召集人以书面方式提交符合法律法规和规章、本基金合同及会议通知规定的有关证明文件。基金份额持有人代理人在以书面通讯方式进行表决时，应向召集人以书面方式提交有关基金份额持有人出具的有效的书面授权委托书和基金份额持有人应当提交的上述有关证明文件。不能满足上述要求的基金份额持有人或基金份额持有人的代理人所提交的书面表决意见被视为无效，其代表的基金份额不计入参加表决的总份额。召集人在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书面表决意见；在表决截止日以前实际送达召集人指定的地址的投票视为有效投票，本条款不适用本基金合同中有关“视为送达”的规定。

d、基金份额持有人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，所有出具有效书面意见所代表的基金份额持有人所持有的基金份额达到在权利登记日基金总份额的50%以上。

4、议事内容与程序

（1）议事内容

a、基金份额持有人大会可以讨论“召开事由”所规定的任何事项。

b、在基金份额持有人大会上讨论的事项应仅限于在会议通知中列明的事项，未在会议通知中列明的事项不得在基金份额持有人大会上讨论；未经公告的事项不得在基金份额持有人大会上进行表决。

（2）提案权

基金管理人、基金托管人、单独或合计持有本基金10%以上(不含10%)基金份额的基金份额持有人可以在基金份额持有人大会召集人发出会议通知前向大会召集人提交需审议表决的议案。

对于基金份额持有人提交的提案，大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

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

b、程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题作出决定。如将其提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人

可以就程序性问题提请基金份额持有人大会作出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议

（3）议事程序

a、现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照规定程序宣布会议议事程序及注意事项，确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，经律师或公证员见证后形成大会决议。基金份额持有人大会由基金管理人授权代表主持。在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权代表主持；如果基金管理人和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人或其代理人以所代表的基金份额50%以上多数(不含50%)选举产生一名代表作为该次基金份额持有人大会的主持人。召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名(或单位名称)、身份证号码、住所地址、持有或者代表有表决权的基金份额、委托人姓名(或单位名称)等事项。

b、通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，首先由召集人至少提前30天公布提案，在所通知的表决截止日期第二天在公证机构监督下统计全部有效表决，形成决议，报中国证监会备案。

5、决议形成的条件、表决方式和程序

（1）决议形成的条件

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议

a、一般决议

一般决议须经出席会议的基金份额持有人或其代理人所持表决权的半数以上（不含半数）表决通过方为有效。除下列b所规定的须以特别决议通过的事项以外的其他事项均应以一般决议的方式通过。法律法规另有规定时从其规定。

b、特别决议

须经基金份额持有人大会通过的特别决议经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上通过方为有效；转换基金运作方式、本基金的终止、更换基金管理人、更换基金托管人必须以特别决议通过方为有效。

c、与某一表决事项有利害关系的基金份额持有人不得就该事项行使表决权；该基金份额持有人持有的基金份额所代表的表决权份额不计入有效的表决权总额；

（2）表决方式

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取书面通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决；表决意见模糊不清或相互矛盾的视为无效表决。

（3）表决程序

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。

a、现场开会

i. 如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，则基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举三名代表担任监票人。

ii. 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。

iii. 如果大会主持人对于提交的表决结果有怀疑，可以对所投票数进行重新清点；如果大会主持人未进行重新清点，而出席会议的基金份额持有人或者代理人对大会主持人宣布的表决结果有异议，有权在宣布表决结果后立即要求重新清点，大会主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。

b、通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管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。

6、基金份额持有人大会决议的生效与公告

基金份额持有人大会表决通过的事项，召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

基金份额持有人大会决议应自生效之日起2个工作日内在指定媒体上公告

（三）基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人和基金托管人均有约束力。

五、基金合同变更和终止

（一）基金合同的变更

1、本基金合同的修改应经当事人同意，经基金份额持有人大会决议通过，并经中国证监会批准，自批准之日起生效。

2、但在下列情况下，基金管理人和基金托管人协商后可直接修改基金合同，无须召开基金份额持有人大会通过决议，但应进行公告，并报中国证监会备案：

（1）因法律法规及中国证监会颁布之规定的相应修改而导致本基金合同的部分条款与之不符的，则基金管理人可以根据法律法规及中国证监会颁布之规定作相应修改；

（2）因基金管理人、基金托管人的基本情况发生变更，包括但不限于住所、法定代表人、组织形式、注册资本等情况的变更；

（3）不对本基金合同当事人权利义务产生重大影响，并不涉及基金份额持有人利益的基金合同的修改。

3、本基金合同规定基金管理人有权修改的事项，一经公告，即构成对基金合同的修改，修改后的基金合同应报中国证监会备案。

4、出现下列情形，基金合同变更内容对基金合同当事人权利、义务产生重大影响，须召开基金份额持有人大会：

（1）转换基金运作方式；

（2）变更基金投资目标、范围或策略；

（3）变更基金管理人或基金托管人；

（4）变更基金份额持有人大会程序；

（5）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；

（6）在本基金合同规定的申购、赎回费率比例范围以外变更基金申购、赎回费率；

（7）其他对基金合同当事人权利义务产生重大影响的变更。

（二）基金合同的终止

本基金合同出现下列情形之一的，基金合同终止

1、存续期间内，基金份额持有人数量连续60个工作日达不到200人，或连续60个工作日基金资产净值低于人民币5000万元，基金管理人将宣布本基金合同终止；

2、经基金份额持有人大会表决终止的；

3、因重大违法、违规行为，被中国证监会责令终止的；

4、基金管理人职责终止，在6个月内没有新基金管理人承接的；

5、基金托管人职责终止，在6个月内没有新基金管托管人承接的；

6、由于投资方向变更引起的基金合并、撤销；

7、中国证监会允许的其他情况。

基金合同终止后，基金管理人和基金托管人依照《基金法》、基金合同及其他有关规定，行使请求给付报酬、从基金财产中获得补偿的权利时，可以留置基金财产或者对基金财产的权利归属人提出请求。

六、争议解决方式

（一）本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

（二）基金管理人、基金托管人之间因本基金合同产生的或与本基金合同有关的争议可首先通过友好协商解决，自一方书面要求协商解决争议之日起60 日内如果争议未能以协商方式解决，则任何一方有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据提交仲裁时该会的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。除提交仲裁的争议之外，各方当事人仍应履行本基金合同的其他规定。

（三）基金份额持有人或基金投资者作为一方当事人与基金管理人、基金托管人的一方或数方作为另一方当事人之间发生争议，首先通过友好协商解决，自一方书面要求协商解决争议之日起60 日内如果争议未能以协商方式解决，则任何一方有权向有管辖权的人民法院起诉，也可将事后达成的仲裁协议向仲裁机构申请仲裁。

七、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

本基金合同可印制成册并对外公开散发或供投资者在基金管理人、基金托管人、基金代销机构办公场所查阅；投资者也可在支付一定工本费后获得本基金合同复印件或复制件，但应以基金合同正本为准。

第二十节 基金托管协议的内容摘要

一、托管协议当事人

（一）基金管理人（或简称“管理人”）

名称：泰信基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区浦东南路256号37层

法定代表人：万众

注册资本：2亿元人民币

组织形式：有限责任公司

营业期限：持续经营

（二）基金托管人（或简称“托管人”）

名称：中国光大银行股份有限公司（简称“中国光大银行”）

住所：北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心

成立日期：1992 年 8 月 18 日

注册资本：人民币 466.79 亿元

法定代表人：唐双宁

联系人：张建春

电话：010-63639180

传真：010-63639132

网址： www.cebbank.com

二、基金托管人与基金管理人之间的业务监督、核查

（一）基金托管人对基金管理人的业务监督、核查

根据《基金法》、《运作办法》、《基金合同》和有关法律、法规的规定，托管人应对基金管理人就基金资产的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金收益分配等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

1、基金托管人定期对基金管理人在基金投资、运作等方面的运作是否严格按照《基金法》、《运作办法》、《基金合同》和有关法律、法规的规定进行监督和核查，对因基金管理人的过错导致基金资产灭失、减损、或处于危险状态的，基金托管人应立即以书面的方式要求基金管理人予以纠正和采取必要的补救措施。基金托管人有权要求基金管理人赔偿基金因此所遭受的损失。

2、基金托管人发现基金管理人有违反《基金法》、《运作办法》、《基金合同》和有关法律、法规规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

3、如基金托管人认为基金管理人的作为或不作为违反了法律法规、《基金合同》或本托管协议，基金托管人应呈报中国证监会和其他监管部门，有权利并有义务行使法律法规、《基金合同》或本托管协议赋予、给予、规定的基金托管人的任何及所有权利和救济措施，以保护基金资产的安全和基金投资者的利益，包括但不限于就更换基金管理人事宜召集基金

持有人大会、代表基金对因基金管理人的过错造成的基金资产的损失向基金管理人索赔。

（二）基金管理人对基金托管人的业务监督、核查

根据《基金法》、《运作办法》、《基金合同》及其他有关规定，基金管理人就基金托管人是否及时执行基金管理人的投资指令、是否将基金资产和自有资产分账管理、是否擅自动用基金资产、是否按时将分配给基金持有人的收益划入基金管理人清算账户等事项，对基金托管人进行监督和核查。

1、基金管理人定期对基金托管人保管的基金资产进行核查。基金管理人发现基金托管人未对基金资产实行分账管理、擅自挪用基金资产、因基金托管人的过错导致基金资产灭失、减损、或处于危险状态的，基金管理人应立即以书面的方式要求基金托管人予以纠正和采取必要的补救措施。基金管理人有权要求基金托管人赔偿基金因此所遭受的损失。

2、基金管理人发现基金托管人的行为违反《基金法》、《运作办法》、《基金合同》和有关法律、法规的规定，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对基金管理人发出回函。在限期内，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。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应报告中国证监会。

3、如基金管理人认为基金托管人的作为或不作为违反了法律法规、《基金合同》或本托管协议，基金管理人应呈报中国证监会和其他监管部门，有权利并有义务行使法律法规、《基金合同》或本托管协议赋予、给予、规定的基金管理人的任何及所有权利和救济措施，以保护基金资产的安全和基金投资者的利益，包括但不限于就更换基金托管人事宜召集基金持有人大会、代表基金对因基金托管人的过错造成的基金资产的损失向基金托管人索赔。

（三）基金管理人和基金托管人有义务配合和协助对方依照本协议对基金业务执行监督、核查。基金管理人或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，情节严重或经监督方提出警告仍不改正的，监督方应报告中国证监会。

三、基金财产的保管

（一）基金资产保管的原则

基金托管人应安全保管基金的全部资产。

基金资产应独立于基金托管人和基金管理人的资产。

1、本基金所有资产的保管责任，由基金托管人承担。基金托管人将遵守《基金法》、《运作办法》、《基金合同》及其他有关规定，为基金持有人的最大利益处理基金事务。基

金托管人保证恪尽职守，依照诚实信用、勤勉尽责的原则，安全、完整、谨慎、有效地持有并保管基金资产。

2、基金托管人应当设立专门的基金托管部，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金资产托管事宜；建立健全内部风险监控制度，对负责基金资产托管的部门和人员的行为进行事先控制和事后监督，防范和减少风险。

3、基金托管人应当购置并保持对于基金资产的托管所必要的设备和设施（包括硬件和软件），并对设备和设施进行维修、维护和更换，以保持设备和设施的正常运行。

4、除依据《基金法》、《运作办法》、《基金合同》及其他有关规定外，不为自己及任何第三人谋取利益，基金托管人违反此义务，利用基金资产为自己及任何第三方谋取利益，所得利益归于基金资产。

5、基金托管人不得将基金资产转为其自有资产，不得将自有资产与基金资产进行交易，或将不同基金资产进行相互交易；违背此款规定的，将承担相应的责任，包括但不限于恢复基金资产的原状、承担赔偿责任。

6、基金托管人必须将基金资产与自有资产严格分开，将本基金资产与其托管的其他基金资产严格分开；基金托管人应当为基金设立独立的账户，建立独立的帐簿，与基金托管人的其他业务和其他基金的托管业务实行严格的分账管理，保证不同基金之间在名册登记、帐户设置、资金划拨、帐册记录等方面相互独立。

7、除依据《基金法》、《运作办法》、《基金合同》及其他有关规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金资产。

8、未经基金管理人的正当指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何资产。

（二）基金成立时募集资金的验证

基金设立募集期满或基金发起人（即本基金的基金管理人）宣布停止募集时，基金发起人（即本基金的基金管理人）应将设立募集的全部资金存入其指定的验资专户；由基金发起人（即本基金的基金管理人）聘请具有从事证券业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的2名以上（含2名）中国注册会计师签字有效。验资报告出具后，基金成立。

（三）基金的银行账户的开设和管理

1、基金托管人应负责本基金的银行账户的开设和管理。

2、基金托管人以本基金的名义在其营业机构开设本基金的银行账户。本基金的银行预留印鉴，由基金托管人保管和使用。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，均需通过本基金的银行账户进行。

3、本基金银行账户的开立和使用，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其他任何银行账户；亦不得使用基金的任何银行账户进行本基金业务以外的活动。

4、基金银行账户的管理应符合中国银监会的有关规定。

（四）基金证券账户和资金账户的开设和管理

1、基金托管人应当以托管人和基金联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司开设本基金的证券账户。

2、本基金证券账户的开立和使用，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出借和未经另一方同意擅自转让本基金的任何证券账户；亦不得使用本基金的任何证券账户进行本基金业务以外的活动。

3、基金托管人应当在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金帐户，用于本基金的证券交易和资金清算。

4、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本基金从事其他投资品种的投资业务，则基金托管人应当以本基金的名义开设从事该投资业务的账户，并遵守上述关于账户开设、使用的规定。

（五）基金资产投资的有关实物证券的保管

实物证券由基金托管人存放于托管银行的保管库，但要与非本基金的其他实物证券分开保管；也可存入中央国债登记结算有限责任公司或中国证券登记结算有限责任公司的代保管库。保管凭证由基金托管人持有。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。

（六）与基金资产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同的原件分别由基金托管人、基金管理人保管。除本协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时应保证基金一方持有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。如上述合同只有一份正本且该正本首先由基金管理人取得，则基金管理人应及时将该正本送达基金托管人处。

（七）国债托管专户的开设和管理

1、基金成立后，基金管理人负责代表基金向中国证监会和中国银监会申请进入全国银行间同业拆借市场，并代表基金进行交易。由基金托管人以基金名义在中央国债登记结算有

限责任公司开设国债托管帐户，并代表基金进行债券和资金的清算。

2、基金管理人和基金托管人同时代表基金签订全国银行间债券市场债券回　购主协议，协议正本由基金托管人保管，协议副本由基金管理人保存。

（八）因为登记结算模式转换，关于账户开设、超头寸交易等处理，需要双方共同签署《补充托管协议》或《资金结算协议》，待新文本确定后，双方补充签署。《补充托管协议》或《资金结算协议》中如有与本协议相关条款冲突或不一致的内容，以《补充托管协议》或《资金结算协议》为准。如国家法规或监管机构有新的规定，以新的规定为准。

（九）《证券投资基金法》正式实施后，以《证券投资基金法》的相关规定为准进行相应调整。

四、基金资产净值计算与复核

（一）基金资产净值的计算和复核

1、基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。基金份额资产净值是指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数后的价值。

2、基金管理人应于每个工作日对基金资产估值。估值原则应符合《基金合同》的规定。用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额资产净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个工作日结束后计算得出当日的基金份额资产净值，并在盖章后以加密传真方式发送给基金托管人。基金托管人应在收到上述传真后马上对净值计算结果进行复核，并在盖章后以加密传真方式将复核结果传送给基金管理人；如果基金托管人的复核结果与基金管理人的计算结果存在差异，且双方经协商未能达成一致，基金管理人有权按照其对基金净值的计算结果对外予以公布，基金托管人有权将相关情况报中国证监会备案。

（二）基金账册的建账和对账

1、基金管理人和基金托管人在本基金成立后，应按照财政部《证券投资基金会计核算办法》规定的同一记账方法和会计处理原则，分别独立地设置、登录和保管本基金的全套账册，对双方各自的账册定期进行核对，互相监督，以保证基金资产的安全。若双方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。

2、双方应每日核对账目，如发现双方的账目存在不符的，基金管理人和基金托管人必须及时查明原因并纠正，保证双方平行登录的账册记录完全相符。

（三）基金财务报表与报告的编制和复核

1、基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。月度报表的编制，应于每月终了后5日内完成；投资组合公告在本基金成立后每季度公告一次，在该等期间届满

后15个工作日内公告；公开说明书在本基金成立后每六个月公告一次，于该等期间届满后后1个月内公告。年中报告在会计年度半年终了后40日内编制完毕并于会计年度半年终了后60日内予以公告；年度报告在会计年度结束后60日内编制完毕并于会计年度终了后90日内予以公告。

2、基金管理人在月度报表完成当日，将报表盖章后提供基金托管人复核；基金托管人在收到后应及时进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在年中报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人应在收到后20个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在年度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人应在收到后30个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人和基金托管人之间的上述文件往来均以加密传真的方式进行。

3、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，调整以双方认可的账务处理方式为准；若双方无法达成一致以基金管理人的帐务处理为准。核对无误后，基金托管人在基金管理人提供的报告上加盖公章，双方各自留存一份。如果基金管理人与基金托管人不能于应当发布公告之日之前就相关报表达成一致，基金管理人有权按照其编制的报表对外发布公告，基金托管人有权就相关情况报证监会备案。

五、基金份额持有人名册的登记与保管

基金持有人名册，包括基金设立募集期结束时的基金持有人名册、基金权益登记日的基金持有人名册、基金持有人大会登记日的基金持有人名册、每月最后一个交易日的基金持有人名册，均由基金管理人和托管人负责分别保管。

六、争议解决方式

（一）本协议适用中华人民共和国法律并从其解释。

（二）基金管理人、基金托管人之间因本协议产生的或与本协议有关的争议可首先通过友好协商解决，自一方书面提出协商解决争议之日起60日内如果争议未能以协商方式解决，则任何一方有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会北京分会根据提交仲裁时该会的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。除提交仲裁的争议之外，各方当事人仍应履行本协议的其他规定。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，各自继续忠实、勤勉、尽责地履行《基金合同》和托管协议规定的义务，维护基金持有人的合法权益。

七、托管协议的修改与终止

（一）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。修改后的新协议，报中国证监会批准后生效。

（二）发生以下情况，本托管协议终止：

1、基金或《基金合同》终止；

2、本基金更换基金托管人；

3、本基金更换基金管理人；

4、发生《基金法》、《运作办法》或其他法律法规规定的终止事项。

第二十一节 对基金份额持有人的服务

本公司的投资者服务理念是“专业、效率、真诚、超越”。为保证旗下基金的正常运营，为投资者提供安全、高效、方便的服务，本公司建立了完善的投资者服务系统，主要通过柜台直销、电话、传真、网络等方式为投资人提供服务。

（一）为投资者服务的种类

1、柜台服务

代销机构和本公司直销柜台将为投资者提供柜台服务。为方便直销投资者，本公司在上海建立了直销柜台。具体内容包括：

类别	直销柜台	代销柜台
办理交易等业务	仅对直销投资者	仅对代销投资者
个人帐务查询	仅对直销投资者	仅对代销投资者
公共信息查询	所有投资者	所有投资者
问题解答	所有投资者	所有投资者
投诉	接受所有投资者投诉	接受代销投资者投诉

2、Call Center服务

本公司的呼叫中心和各代销机构的Call Center共同为基金投资者提供投资者服务。本公司的呼叫中心设备完善，目前拥有6名坐席、60条中继线，提供5*12小时的人工座席服务及7*24小时的自动语音服务，能够确保投资者的要求在3个工作日内得到答复。呼叫中心提供的服务如下：

类别	泰信基金的CALL-CENTER	代销机构的CALL-CENTER
个人帐务查询	所有投资者	代销投资者

交易确认短信	提供手机号码的投资者	
公共信息查询	所有投资者	所有投资者
问题查询	所有投资者	代销投资者
投诉	接受所有投资者投诉	接受代销投资者投诉

泰信基金的Call Center包括电话中心和人工坐席，功能如下：

功能	IVR（自动语音系统）	人工坐席服务系统
公共信息查询	公司简介 基金产品简介 基金费率 基金分红 销售机构热线 基金经理信息	基金信息 公司信息 开放式基金业务常识解答 政策法规 每日NAV公告
直销投资者帐务查询	成交确认查询 投资者帐务信息查询 查询密码的修改	投资者帐务信息查询 投资者对帐单查询 投资者基本资料的修改 查询密码的修改
投诉	以人工座席服务为主： 接入方式：普通电话接入 回复方式：传真、邮件、短信息、信函、电话 通过坐席与投资者的互动交流，受理、处理、回复投资者的投诉与建议	

3、公司网站

本公司的网站经过版本更新之后，包括泰信之窗、旗下基金、网上交易、净值公告、基金学院及客户服务等多个栏目，能够为投资者提供全面的信息服务。

功能	内容
公共信息查询	基金信息查询 公司信息 开放式基金业务常识解答 每日NAV公告 公司重要公告 政策法规 宏观经济 热点分析 上市公司研究
投资者帐户查询	成交确认查询 账户查询 查询密码的修改 投资者基本资料的查询
网上交易	基金认购

	基金申购 基金定投 基金转换 基金赎回 修改分红方式 个人资料修改
信息定制	短信服务 电子邮件服务
投诉	实现方式：邮件、网站 回复方式：传真、邮件、信函、电话

4、资料寄送

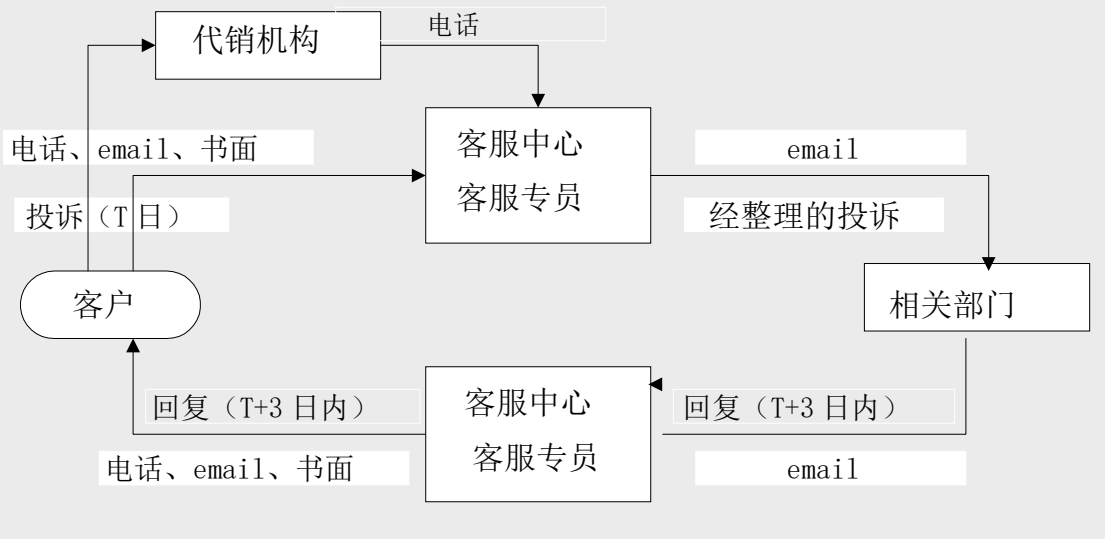
资料类型	投资者类型	寄送方式	寄送人
交易确认单	直销投资者 代销投资者	自助打印（T+2个工作日开始）	
基金帐户开户确认书	直销投资者 代销投资者	自助打印（T+2个工作日开始）	
交易对帐单	直销投资者 代销投资者	公司按月提供电子对账单，纸质对账单对有需求的客户进行寄送	客户服务中心
《泰信通讯》季刊及其他投资理财咨询材料	部分 直销投资者 代销投资者	对有需求的客户进行定期寄送	客户服务中心

5、一对一服务

公司除提供一般的投资者服务内容（包括电话查询、信息查询、资料寄送、基金经理报告会、咨讯服务等）之外，还将以公司的整体资源为支撑，度身定制一对一的、个性化的增值服务，包括指定机构理财经理、上门服务、充分的信息交流等。公司制定了规范的机构投资者访问制度、服务流程和行为准则，并对机构投资者服务人员进行专业知识的培训。

（二）投诉人处理方式

本公司客服中心及时处理投资者的投诉，并在规定的时间内及时反馈。由于呼叫中心将成为投资者投诉的主要诉求对象，为了保证能及时处理投诉事宜，我们设置了完善的投诉处理流程，这是一个闭环流程，任何进入系统内的投诉必须在规定的时间内回复。同时我们将代销机构也纳入了这一系统，保证了我们向投资者提供统一专业的服务。



（三）联络信息

1、泰信基金管理有限公司华东营销中心

地址：中国（上海）自由贸易试验区浦东南路 256 号华厦银行大厦 36、37 层

电话：（021）20899167

传真：（021）20899008

联系人：樊建华

2、泰信基金管理有限公司华北营销中心

地址：北京市西城区广成街 4 号院 1 号楼 305、306 室

电话：010-66215978

传真：010-66215968

联系人：费颖

3、泰信基金管理有限公司华南营销中心

地址：深圳市福田区福华一路 98 号卓越大厦 1608 室

电话：0755-33981702

传真：0755-33988757

联系人：史明伟

4、泰信基金管理有限公司网站

网址：www.ftfund.com

电子信箱：service@ftfund.com

5、客户服务中心

客户服务电话：400-888-5988 或 021-38784566，该电话为 24 小时语音服务电话，在工作时间内可转人工服务。

第二十二节 其他应披露事项

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
	调整东海证券定投业务最低申购金额	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站（http://www.ftfund.com）	2019年1月4日
2	提示投资者更新身份信息公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站（http://www.ftfund.com）	2019年1月11日
3	18 年 4 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站（http://www.ftfund.com）	2019年1月21日
4	暂停旗下基金在大泰金石相关销售业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站（http://www.ftfund.com）	2019年1月30日
5	新增上海中正达广基金销售有限公司为销售机构并开通转换、定投及费率优惠业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站（http://www.ftfund.com）	2019年3月20日
6	提示投资者更新身份信息公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站（http://www.ftfund.com）	2019年3月22日
7	参加国信证券费率优惠业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站（http://www.ftfund.com）	2019年3月26日
8	调整投资者开户证件类型的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站（http://www.ftfund.com）	2019年3月27日
9	18 年年度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站（http://www.ftfund.com）	2019年3月28日
10	提示投资者更新身份信息公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站（http://www.ftfund.com）	2019年3月28日
11	交通银行手机银行费率优惠	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站（http://www.ftfund.com）	2019年3月28日
12	工行费率优惠	《中国证券报》、《上海证券报》、	2019年3月30日

		《证券时报》及本公司网站（http://www.ftfund.com）	
13	在爱建证券开通定投业务并参加费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站（http://www.ftfund.com）	2019年4月4日
14	投资流通受限股票	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站（http://www.ftfund.com）	2019年4月4日
15	提示投资者更新身份信息公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站（http://www.ftfund.com）	2019年4月4日
16	提示投资者更新身份信息公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站（http://www.ftfund.com）	2019年4月16日
17	19 年 1 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站（http://www.ftfund.com）	2019年4月18日
18	提示投资者更新身份信息公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站（http://www.ftfund.com）	2019年5月14日
19	参加北京恒天明泽基金销售有限公司申购费率优惠业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站（http://www.ftfund.com）	2019年5月17日
20	新增阳光人寿保险为销售机构并开通转换定投费率优惠业务	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站（http://www.ftfund.com）	2019年6月11日
21	可投资科创板股票公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站（http://www.ftfund.com）	2019年6月22日
22	参加中国银行定投费率优惠	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站（http://www.ftfund.com）	2019年6月27日

第二十三节 招募说明书的存放及查阅方式

本更新招募说明书、《基金合同》文本存放在本基金管理人、基金托管人、代销机构的办公场所，投资者可在办公时间免费查阅；也可按工本费购买本基金招募说明书复制件或复印件，但应以基金招募说明书正本为准。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

第二十四节 备查文件

投资者如果需要了解更详细的信息，可向基金管理人、基金托管人或代销机构申请查阅以下文件：

（一）中国证监会批准泰信先行策略开放式证券投资基金设立的文件

（二）《泰信先行策略开放式证券投资基金基金合同》

（三）《泰信先行策略开放式证券投资基金托管协议》

（四）《泰信先行策略开放式证券基金招募说明书》

（五）法律意见书

（六）基金管理人业务资格批件、营业执照

（七）基金托管人业务资格批件、营业执照

泰信基金管理有限公司

2019 年 8 月 10 日