

---

万家添利分级债券型证券投资基金  
基金合同（更新）

【本基金已根据基金合同转换为万家添利债券型证券投资基金（LOF）】

基金管理人：万家基金管理有限公司

基金托管人：中国邮政储蓄银行股份有限公司

二零二三年十月修订

## 目 录

一、前言	3
二、释义	4
三、基金的基本情况	10
四、基金份额的分级	12
五、基金份额的发售	17
六、基金备案	19
七、基金份额的上市与交易	20
八、基金份额的申购与赎回	22
九、基金合同当事人及权利义务	30
十、基金份额持有人大会	37
十一、基金管理人、基金托管人的更换条件和程序	46
十二、基金的托管	49
十三、基金份额的登记、非交易过户、转托管、冻结与质押	50
十四、基金的投资	53
十五、基金的财产	62
十六、基金资产的估值	63
十七、基金的费用与税收	69
十八、基金的收益与分配	71
十九、基金的会计和审计	73
二十、封闭期届满与基金份额转换	74
二十一、基金的信息披露	76
二十二、基金合同的变更、终止与基金财产的清算	82
二十三、违约责任	85
二十四、争议的处理	86
二十五、基金合同的效力	87
二十六、其他事项	88
二十七、基金合同摘要	89

## 一、前言

### (一) 订立本基金合同的目的、依据和原则

1. 订立本基金合同的目的是保护投资者合法权益,明确基金合同当事人的权利义务,规范基金运作。

2. 订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》(以下简称“《合同法》”)、《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“《运作办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、《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》”)和其他有关法律法规。

3. 订立本基金合同的原则是平等自愿、诚实信用、充分保护投资者合法权益。

(二) 基金合同是规定基金合同当事人之间权利义务关系的基本法律文件,其他与基金相关的涉及基金合同当事人之间权利义务关系的任何文件或表述,如与基金合同有冲突,均以基金合同为准。基金合同当事人按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。

基金合同的当事人包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人。基金投资者自依本基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受。

(三) 万家添利分级债券型证券投资基金由基金管理人依照《基金法》、基金合同及其他有关规定募集,并经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)核准。

中国证监会对本基金募集的核准,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,但不保证投资于本基金一定盈利,也不保证最低收益。

(四) 基金管理人、基金托管人在本基金合同之外披露涉及本基金的信息,其内容涉及界定基金合同当事人之间权利义务关系的,如与基金合同有冲突,以基金合同为准。

（五）本基金合同约定的基金产品资料概要编制、披露与更新要求，自《信息披露办法》实施之日起一年后开始执行。

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

## 二、释义

在本基金合同中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

1. 基金或本基金：指万家添利分级债券型证券投资基金（已根据基金合同转换为万家添利债券型证券投资基金（LOF））
2. 基金管理人：指万家基金管理有限公司
3. 基金托管人：指中国邮政储蓄银行股份有限公司
4. 基金合同或本基金合同：指《万家添利分级债券型证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充
5. 托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《万家添利分级债券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：指《万家添利分级债券型证券投资基金招募说明书》及其更新
7. 基金份额发售公告：指《万家添利分级债券型证券投资基金基金份额发售公告》
8. 上市交易公告书：指《万家添利分级债券型证券投资基金之添利 B 基金份额上市交易公告书》
9. 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
10. 《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，自 2004 年 6 月 1 日起实施的《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

11. 《销售办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 25 日颁布、同年 7 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

12. 《信息披露办法》：指《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

13. 《运作办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 29 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《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

14. 《流动性风险管理规定》：指《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

15. 中国证监会：指中国证券监督管理委员会

16. 银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或国家金融监督管理总局等对银行业金融机构进行监督和管理的机构

17. 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

18. 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

19. 机构投资者：指依法可以投资开放式证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法注册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

20. 合格境外机构投资者：指符合现实有效的相关法律法规规定可以投资于中国境内证券市场的中国境外的机构投资者

21. 投资者：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者的合称

22. 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者

23. 基金份额分级：指本基金通过基金收益分配的安排，将基金份额分成预期收益与风险不同的两个级别，即稳健收益级基金份额和积极收益级基金份额

24. 添利 A：指本基金的稳健收益级基金份额

25. 添利 B：指本基金的积极收益级基金份额

26. 添利 A 的约定年收益率：指本基金在封闭期内为每份添利 A 份额所设定的每年应获得的收益率，添利 A 份额约定年基准收益率为一年期银行定期存款利率加上 1.1%

27. 添利 A 约定应得收益：指按照本基金的资产及收益分配规则，添利 A 份额在封闭期末应获得的约定基准收益的总金额

28. 添利 B 应得资产及收益：指在封闭期末，本基金净资产优先分配予添利 A 基金份额的本金及约定应得收益后的剩余净资产

29. 基金销售业务：指基金管理人或代销机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务

30. 销售机构：指直销机构和代销机构

31. 直销机构：指万家基金管理有限公司

32. 代销机构：指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金代销业务资格并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，其中深圳证券交易所交易系统办理本基金销售业务的机构必须是具有中国证监会认可的证券经营资格且具有基金代销业务资格、并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的深圳证券交易所会员单位

33. 基金销售网点：指直销机构的直销中心及代销机构的代销网点

34. 场外：指通过深圳证券交易所外的销售机构办理基金份额认购、申购和赎回等业务的场所

35. 场内：指通过深圳证券交易所内的会员单位利用交易所开放式基金交易系统办理基金份额认购、申购、赎回和上市交易的场所

36. 上市交易：指基金合同生效后投资者通过深圳证券交易所会员单位以集中竞价的方式买卖基金份额的行为

37. 注册登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资者基金账户的建立和管理、基金份额注册登记、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等

38. 注册登记机构：指办理注册登记业务的机构。基金的注册登记机构为万家基金管理有限公司或接受万家基金管理有限公司委托代为办理注册登记业务的机构

39. 证券登记结算系统：指中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记结算系统

40. 注册登记系统：指中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系

统

41. 基金账户：指注册登记机构为投资者开立的、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

42. 基金交易账户：指销售机构为投资者开立的、记录投资者通过该销售机构买卖本基金的基金份额变动及结余情况的账户

43. 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

44. 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

45. 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

46. 存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

47. 封闭期：指基金合同生效以后三年（含三年）的期间内，本基金采取封闭式运作，期间添利A基金份额持有人在本基金合同规定的开放日可申请申购、赎回本基金份额，添利B在此期间不开放申购、赎回业务

48. 开放期：指基金转换运作方式为上市开放式基金（LOF）后的存续期间

49. 工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

50. 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工作日

51. T+n日：指自T日起第n个工作日（不包含T日）

52. 开放日：指为基金投资者办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

53. 交易时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

54. 《业务规则》：指《万家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注册登记方面的业务规则，由基金管理人和投资者共同遵守

55. 认购：指在基金募集期内，投资者申请购买基金份额的行为

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

57. 赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同规定的条件要求将

## 基金份额兑换为现金的行为

58. 基金转换：指基金份额持有人按照本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、且由同一注册登记机构办理注册登记的其他基金基金份额的行为

59. 系统内转托管：指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（席位）之间进行转托管的行为

60. 跨系统转托管：指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统间进行转登记的行为

61. 定期定额投资计划：指投资者通过有关销售机构提出申请，约定每期扣款日、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者指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式

62. 基金份额转换日：为基金合同生效之日起至三年封闭期末对应日。如该对应日为非工作日，则封闭期到期日顺延到下一个工作日

63. 基金份额转换：指在封闭期末按照基金合同规定的份额转换规则，添利 A 和添利 B 基金份额在转换日自动转换为上市开放式基金（LOF）份额

64. 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%

65. 元：指人民币元

66. 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

67. 基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和

68. 基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

69. 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

70. 基金份额参考净值：在 T 日基金份额净值计算的基础上，采用“虚拟清算”原则，即假定 T 日为本基金在封闭期内的提前终止日，本基金按照基金合同约定的份额收益分配和资产分配规则进行资产分配从而计算得到 T 日本基金两级基金份额的估算价值。基金份额参考净值是对两类基金份额价值的一个估算，并不代



表基金份额持有人可获得的实际价值

71. 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

72. 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

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

73. 不可抗力：指本基金合同当事人无法预见、无法抗拒、无法避免且在本基金合同由基金管理人、基金托管人签署之日后发生的，使本基金合同当事人无法全部或部分履行本基金合同的任何事件，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、恐怖袭击、传染病传播、法律法规变化、突发停电或其他突发事件、证券交易所非正常暂停或停止交易

74. 基金产品资料概要：指《万家添利债券型证券投资基金（LOF）基金产品资料概要》及其更新

75. 侧袋机制：指将基金投资组合中的特定资产从原有账户分离至一个专门账户进行处置清算，目的在于有效隔离并化解风险，确保投资者得到公平对待，属于流动性风险管理工具。侧袋机制实施期间，原有账户称为主袋账户，专门账户称为侧袋账户

76. 特定资产：包括：（一）无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性的资产；（二）按摊余成本计量且计提资产减值准备仍导致资产价值存在重大不确定性的资产；（三）其他资产价值存在重大不确定性的资产

77. 销售服务费：指从基金财产中计提的，用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务的费用

### 三、基金的基本情况

#### （一）基金的名称

万家添利分级债券型证券投资基金

#### （二）基金的类别

债券型证券投资基金

#### （三）基金的运作方式

契约型。本基金合同生效后三年内（含三年）为封闭期。封闭期间，添利 A 自基金合同生效日起每满半年开放一次申购赎回，添利 B 在深圳证券交易所上市交易。封闭期届满后，本基金转为上市开放式基金（LOF）。

本基金管理人有权在封闭期届满前召集基金份额持有人大会，审议本基金是否在封闭期届满后延长封闭期及延长封闭期的期限，具体事项由基金管理人另行公告。

#### （四）基金的投资目标

在严格控制投资风险的基础上，追求当期较高收入和投资总回报。

#### （五）基金份额分级

本基金通过基金收益分配的安排，将基金份额分成预期收益与风险不同的两个级别，即稳健收益级基金份额（基金份额简称“添利 A”）和积极收益级基金份额（基金份额简称“添利 B”）。有关本基金基金份额分级的规定详见本基金合同第四章。

#### （六）基金募集份额目标上限

本基金的设立募集份额总额上限为 42 亿份（不包括利息折算的份额，下同），其中添利 A 和添利 B 的募集份额上限分别为 30 亿份和 12 亿份。

#### （七）基金份额面值和认购费用

基金份额的初始面值为人民币 1.00 元。

本基金的认购费率最高不超过 5%，具体费率情况由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。

#### （八）基金份额的申购赎回与上市交易

基金合同生效后，在三年封闭期内，基金投资者可在开放日申购或赎回添利 A 基金份额。

基金合同生效后，基金管理人可以根据有关规定，申请添利 B 基金份额上市交易。

在封闭期届满后，本基金转为上市开放式基金（LOF），添利 A 与添利 B 将分别以各自的份额净值为基础，按照基金份额转换日本基金的基金份额净值转换为同一上市开放式基金（LOF）份额，开放日常申购赎回，并继续在深圳证券交易所上市与交易。

#### （九）基金存续期限

不定期。

#### （十）基金份额的类别

本基金将基金份额分为不同的类别。在投资者申购基金时收取申购费用，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费，并不收取申购费用的基金份额，称为 C 类基金份额。相关费率及费率水平在招募说明书或相关公告中列示。

本基金各类基金份额分别设置代码，分别公布基金份额净值和基金份额累计净值。

投资者在申购基金份额时可自行选择基金份额类别。本基金 C 类基金份额可通过场内或场外两种方式办理申购与赎回，A 类基金份额可通过场外方式办理申购与赎回。本基金 C 类基金份额参与上市交易，A 类基金份额暂不参与上市交易。本基金不同基金份额类别之间的转换规定请见招募说明书和相关公告。

基金管理人可根据基金实际运作情况，在符合法律法规约定和《基金合同》约定且对基金份额持有人利益无实质不利影响的情况下，经与基金托管人协商一致，增加新的基金份额类别，或取消某基金份额类别，开通或取消现有份额类别通过场内方式办理申购与赎回，申请现有份额类别上市交易或终止上市，或对基金份额分类办法及规则进行调整并公告，不需召开基金份额持有人大会审议。

## 四、基金份额的分级

本基金已转为万家添利债券型证券投资基金 (LOF)，基金合同各章节中关于分级份额的内容已不适用。

### (一) 概要

本基金通过基金收益分配的安排，将基金份额分成预期收益与风险不同的两个级别，即稳健收益级基金份额（基金份额简称“添利 A”）和积极收益级基金份额（基金份额简称“添利 B”）。除收益分配、基金合同终止时的基金清算财产分配和基金转换运作方式时的基金份额折算外，每份添利 A 和每份添利 B 享有同等的权利和义务。此外，所有法律法规涉及的关于基金份额的占比的计算，包括但不限于认购或持有基金份额的上限、参加基金份额持有人大会各种表决计票等，两级基金的基金份额应单独进行计算，且两级基金在各自级别基金中的基金份额占比均满足条件方为有效。

添利 A 和添利 B 分别募集并按照基金合同约定的比例进行初始配比，所募集的两级基金的基金资产合并运作。

### (二) 基金份额的配比

添利 A 与添利 B 两级基金的基金份额的初始配比不高于 2.5: 1。

本基金基金合同生效后，添利 A 将每满半年开放一次，接受基金投资者的集中申购与赎回，具体规定详见本基金合同第八章。

两级基金的基金份额配比计算结果保留至小数点后第 9 位，小数点第 9 位以后的部分四舍五入。

### (三) 封闭期末添利 A 和添利 B 基金份额的收益分配规则

添利 A 和添利 B 基金在封闭期末具有不同的资产及收益分配安排，则添利 A 和添利 B 基金的风险和收益特性不同。

在封闭期末，本基金净资产优先分配添利 A 基金份额的本金及约定应得收益，即添利 A 为低风险且预期收益相对稳定的基金份额；本基金在优先分配添利 A 基金份额的本金及约定应得收益后的剩余净资产分配予添利 B 基金份额，即添利 B 为高风险且预期收益相对较高的基金份额。

添利 A 和添利 B 基金份额的资产及收益的分配规则如下：

1. 在封闭期内, 添利 A 基金份额约定年收益率为一年期银行定期存款利率加上 1.1%, 其中, 计算添利 A 首个约定年收益率的一年期银行定期存款利率指基金合同生效之日中国人民银行公布并执行的金融机构人民币一年期定期存款基准利率; 其后添利 A 每个开放日, 基金管理人将根据该日中国人民银行公布并执行的金融机构人民币一年期定期存款基准利率重新调整添利 A 的约定年收益率, 添利 A 的约定收益采用半年复利计算;

2. 在封闭期末, 本基金净资产优先分配予添利 A 基金份额的本金及添利 A 约定应得收益后的剩余净资产分配予添利 B 基金份额;

3. 在封闭期末, 如本基金净资产等于或低于添利 A 基金份额的本金及约定应得收益的总额, 则本基金净资产全部分配予添利 A 份额后, 仍存在额外未弥补的添利 A 份额本金及约定收益总额的差额, 不再进行弥补。

基金管理人并不承诺或保证封闭期满时添利 A 持有人的约定应得收益, 即如在封闭期末本基金资产出现极端损失情况下, 添利 A 仍可能面临无法取得约定应得收益乃至投资本金受损的风险。

在封闭期内本基金不对添利 A 和添利 B 基金份额进行收益分配。对投资者认购、申购或上市交易购买并持有到期的每一份添利 A 和添利 B 基金份额, 在本基金封闭期届满后, 按照基金合同所约定的资产收益分配规定分别计算添利 A 和添利 B 封闭期末的份额净值, 实现基金份额持有人的资产及收益分配。

#### (四) 本基金基金份额净值的计算

$T$  日基金份额净值 =  $T$  日闭市后的基金资产净值 /  $T$  日基金份额的余额数量

封闭期内,  $T$  日基金份额的余额数量为添利 A 和添利 B 的份额总额; 封闭期届满转为上市开放式基金(LOF)后,  $T$  日基金份额的余额数量为该上市开放式基金份额总额。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, 由此产生的误差计入基金财产。

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

#### (五) 添利 A 和添利 B 在封闭期末的基金份额净值计算

按照上述本基金资产及收益分配规则, 在封闭期末对添利 A 与添利 B 单独进行基金份额净值计算, 并按各自的基金份额净值进行资产分配。

假设 NAV 为本基金在封闭期截止当日  $T$  基金份额净值,  $N_A$  为封闭期截止当日  $T$

添利 A 的份额余额,  $NAV_A$  封闭期截止当日 T 添利 A 的基金份额净值,  $N_B$  为封闭期间添利 B 的份额余额,  $NAV_B$  封闭期截止当日 T 添利 B 的基金份额净值,  $N$  为封闭期截止当日 T 添利 A 和添利 B 的总份额,  $R_A$  为截至封闭期末当日 T 每份添利 A 基金份额约定应得收益,  $r_i$  为封闭期内第  $i-1$  个开放日至第  $i$  开放日间添利 A 的约定年收益率 (若  $i=1$  时, 第  $i-1$  个开放日指基金合同生效日, 下同), 则

$$r_i = 1.1\% + \text{第 } i-1 \text{ 个开放日 1 年期银行定期存款基准利率}$$

$$1 + R_A = 1.000 \times \prod_{i=1}^6 \left(1 + \frac{t_i}{T_i} r_i\right)$$

其中,  $t_i$  ( $i=1, \dots, 6$ ) 指自第  $i-1$  个开放日至第  $i$  个开放日实际运作天数,  $T_i$  ( $i=1, \dots, 6$ ) 为第  $i-1$  个开放日所在年度实际天数。

封闭期截止当日 T 添利 A 和添利 B 基金份额净值计算公式如下:

(1) 当  $NAV \leq (1+R_A) * N_A / N$  时, 则添利 A 和添利 B 截至封闭期末当日 T 基金份额净值:

$$NAV_A = NAV * N / N_A;$$

$$NAV_B = 0;$$

(2) 当  $NAV > (1+R_A) * N_A / N$  时, 则添利 A 和添利 B 截至封闭期末当日 T 基金份额净值:

$$NAV_A = 1 + R_A;$$

$$NAV_B = (NAV * N - NAV_A * N_A) / N_B;$$

在封闭期末计算添利 A 和添利 B 份额净值时, 各自保留小数点后 8 位, 小数点后第 9 位四舍五入, 由此产生的计算误差归入基金资产, 并由基金管理人通知基金托管人对账务进行调整。

#### (六) 添利 A 和添利 B 基金份额参考净值的计算

基金管理人在基金份额净值计算的基础上, 采用“虚拟清算”原则计算并公告添利 A 和添利 B 基金份额参考净值。封闭期间的基金份额参考净值是对两级基金份额价值的一个估算, 并不代表基金份额持有人可获得的实际价值。

添利 A 和添利 B 基金份额参考净值在当天收市后计算, 并在 T+1 日内与本基金基金份额净值一同公告。如遇特殊情况, 经中国证监会同意, 可以适当延迟计

算或公告。

设第 T 日为基金份额参考净值日, NAV 为本基金封闭期内第 T 日基金份额净值, NAV<sub>A</sub> 为封闭期内第 T 日添利 A 基金份额参考净值, N<sub>A</sub> 为为封闭期内第 T 日添利 A 的份额余额, NAV<sub>B</sub> 为封闭期内第 T 日添利 B 基金份额参考净值, N<sub>B</sub> 为封闭期间添利 B 的份额余额, N 为封闭期内第 T 日添利 A 和添利 B 的总份额, R<sub>T</sub> 封闭期内第 T 日每份添利 A 基金份额约定应得收益,  $r_i$  为封闭期内第 i-1 个开放日至第 i 开放日期间添利 A 的约定年收益率 (若 i=1 时, 第 i-1 个开放日指基金合同生效日, 下同), 则

$$1 + R_T = 1.000 \times \prod_{i=1}^n \left( 1 + \frac{t_i}{T_i} r_i \right)$$

其中, 基金合同生效日截至第 T 日已开放 n-1 次,  $t_i$  (i=1, …, n-1) 指自第 i-1 个开放日至第 i 个开放日实际运作天数,  $t_n$  指上一次开放日截至第 T 日期间实际运作天数,  $T_i$  为第 i-1 个开放日所在年度实际天数。

封闭期内第 T 日, 添利 A 和添利 B 基金份额参考净值的计算公式如下:

(1) 当  $NAV \leq (1 + R_T) * N_A / N$  时, 则添利 A 和添利 B 封闭期内第 T 日基金份额参考净值:

$$NAV_A = NAV * N / N_A;$$

$$NAV_B = 0;$$

(2) 当  $NAV > (1 + R_T) * N_A / N$  时, 则添利 A 和添利 B 封闭期内第 T 日基金份额参考净值:

$$NAV_A = 1 + R_T;$$

$$NAV_B = (NAV * N - NAV_A * N_A) / N_B;$$

添利 A 和添利 B 基金份额参考净值的计算, 保留到小数点后 4 位, 小数点后第 5 位四舍五入。

(七) 添利 A 和添利 B 基金份额净值转换

本基金封闭期届满, 本基金的两级基金份额将按约定的收益的分配规则进行净值计算, 并以各自的份额净值为基准转换为同一上市开放式基金 (LOF) 的份额, 并办理基金的申购、赎回业务。

---

添利 A 基金份额和添利 B 基金份额转换公式为：添利 A（或添利 B）转换后基金份额数 = 封闭期截止当日添利 A（或添利 B）基金份额数 × 封闭期截止当日添利 A（或添利 B）基金份额净值 / 1.000；转换后的上市开放式基金（LOF）在基金份额转换日当日份额净值为 1.000。

具体转换规则见基金合同第二十章及基金管理人届时发布的相关公告。



## 五、基金份额的发售

### (一) 基金份额的发售时间、发售方式、发售对象

#### 1. 发售时间

自基金份额发售之日起最长不得超过3个月,具体发售时间见基金份额发售公告。

#### 2. 发售方式

添利A通过场外发售机构公开发售、添利B通过场内、场外发售机构进行公开发售。场外发售机构为基金管理人的直销网点和场外代销机构的代销网点(具体名单参见基金份额发售公告);场内发售机构为通过深圳证券交易所内具有相应业务资格的会员单位发售(具体名单见基金份额发售公告)。通过场外认购的基金份额登记在注册登记系统基金份额持有人开放式基金账户下;通过场内认购的基金份额登记在证券登记结算系统基金份额持有人证券账户下。基金份额持有人可通过办理跨系统转托管业务实现基金份额在两个登记系统之间的转换。

本基金认购采取全额缴款认购的方式。基金投资者在募集期内可多次认购,认购一经受理不得撤销。

基金发售机构认购申请的受理并不代表该申请一定成功,而仅代表发售机构确实接收到认购申请。认购的确认以注册登记机构或基金管理公司的确认结果为准。

#### 3. 发售对象

符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者和机构投资者以及合格境外机构投资者。

### (二) 基金份额的认购

#### 1. 认购费用

本基金以认购金额为基数采用比例费率计算认购费用,认购费率不得超过5%。本基金的认购费率由基金管理人决定,并在招募说明书中列示。基金认购费用不列入基金财产,主要用于基金的市场推广、销售、注册登记等募集期间发生的各项费用。

#### 2. 募集份额目标上限

本基金的设立募集份额总额上限为 42 亿份（不包括利息折算的份额，下同），其中，添利 A 的募集份额上限为 30 亿份，添利 B 的募集份额上限为 12 亿份。

### 3. 募集期利息的处理方式

认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有或计入基金财产，场外认购利息折算的基金份额精确到小数点后 2 位，小数点 2 位以后部分截位，截位部分计入基金财产；场内认购利息折算的基金份额精确到整数位，小数点后部分截位，截位部分计入基金财产。若场内认购提前结束，认购截止日前（含该日）场内认购款项产生的利息折算成基金份额归投资者所有；该截止日次日至基金募集结束期间产生的利息计入基金财产。其中利息以注册登记机构的记录为准。

### 4. 基金认购份额的计算

基金认购份额具体的计算方法在招募说明书中列示。

### 5. 认购份额余额的处理方式

场外认购份额的计算保留到小数点后 2 位，小数点 2 位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。场内认购份额按整数申报（详见招募说明书），认购金额的计算保留到小数点后两位，小数点两位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。利息折算的份额保留至整数位（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。

## (三) 基金份额认购金额的限制

1. 投资者认购前，需按销售机构规定的方式全额缴款。

2. 投资者在募集期内可以多次认购基金份额，但已受理的认购申请不允许撤销。

3. 基金管理人可以对每个基金交易账户的单笔最低认购金额进行限制，具体限制请参看招募说明书。

4. 基金管理人可以对募集期间的单个投资者的累计认购金额进行限制，具体限制和处理方法请参看招募说明书。

## (四) 基金份额的比例确认

基金管理人对于两级份额的认购申请制定了比例确认方式，具体规则见相关的基金份额发售公告。

## 六、基金备案

### (一)基金备案的条件

1. 本基金自基金份额发售之日起3个月内, 添利A、添利B各自的募集份额不少于2亿份, 添利A、添利B各自的募集金额不少于2亿元人民币, 并且添利A、添利B各自的基金份额持有人的人数不少于200人的条件下, 基金募集期届满或基金管理人依据法律法规及招募说明书决定停止基金发售, 且基金募集达到基金备案条件, 基金管理人应当自基金募集结束之日起10日内聘请法定验资机构验资, 自收到验资报告之日起10日内, 向中国证监会提交验资报告, 办理基金备案手续。自中国证监会书面确认之日起, 基金备案手续办理完毕, 基金合同生效。

2. 基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日对基金合同生效事宜予以公告。

3. 本基金合同生效前, 投资者的认购款项只能存入专用账户, 任何人不得动用。认购资金在募集期形成的利息在本基金合同生效后折成投资者认购的基金份额归投资者所有或计入基金财产。利息转份额的具体数额以注册登记机构的记录为准。

### (二)基金募集失败

1. 基金募集期届满, 未达到基金备案条件, 则基金募集失败。

2. 如基金募集失败, 基金管理人应以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用, 在基金募集期届满后30日内退还投资者已缴纳的认购款项, 并加计银行同期存款利息。

3. 如基金募集失败, 基金管理人、基金托管人及代销机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和代销机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。

### (三)基金存续期内的基金份额持有人数量和资金数额

基金合同生效后的存续期内, 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, 基金管理人应当及时报告中国证监会; 基金份额持有人数量连续20个工作日达不到200人, 或连续20个工作日基金资产净值低于5000万元, 基金管理人应当向中国证监会说明出现上述情况的原因并提出解决方案。

## 七、基金份额的上市与交易

如无特别说明，本部分约定仅适用于本基金C类基金份额。未来，基金管理人在履行相关程序后也可申请本基金A类基金份额等其他份额类别上市交易，基金管理人可根据需要修改基金合同相关内容，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

### （一）上市交易的基金份额

基金合同生效后，在本基金符合法律法规和深圳证券交易所规定的上市条件的情况下，本基金在封闭期内，添利B份额申请上市与交易。在本基金封闭期届满，添利A与添利B将分别按照基金合同约定及深圳证券交易所规则转换为上市开放式基金（LOF）份额，转换后的基金份额继续在深圳证券交易所上市与交易。

### （二）上市交易的地点

深圳证券交易所

### （三）上市交易的时间

基金合同生效后三个月内添利B开始在深圳证券交易所上市交易。

在确定上市交易的时间后，基金管理人最迟在上市日前3个工作日在至少一种指定媒介上刊登公告。

基金份额（封闭期内添利B份额）上市后，登记在证券登记结算系统中的基金份额可直接在深圳证券交易所上市交易；登记在注册登记系统中的基金份额通过办理跨系统转托管业务将基金份额转至证券登记结算系统后，方可上市交易。

### （四）上市交易的规则

1. 本基金在封闭期内添利B上市首日的开盘参考价为前一交易日添利B的参考净值；

2. 本基金封闭期届满，添利A与添利B份额转换为上市开放式基金（LOF）基金份额后，本基金基金份额上市首日的开盘参考价为前一交易日的基金份额净值；

3. 本基金实行价格涨跌幅限制，涨跌幅比例为10%，自上市首日起实行；

4. 本基金买入申报数量为100份或其整数倍；

5. 本基金申报价格最小变动单位为0.001元人民币；

6. 本基金上市交易遵循《深圳证券交易所交易规则》、《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》、《深圳证券交易所上市开放式基金业务规则》及其更新以及其他有关规定。

(五) 上市交易的费用

本基金上市交易的费用按照深圳证券交易所的有关规定办理。

(六) 上市交易的行情揭示

本基金在深圳证券交易所挂牌交易，交易行情通过行情发布系统揭示。行情发布系统同时揭示基金前一交易日的基金份额净值（封闭期内为添利B前一交易日的基金份额参考净值）。

(七) 上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市

本基金的停复牌、暂停上市、恢复上市按照深圳证券交易所的相关业务规则执行。

(八) 终止上市的情形和处理方式：

发生下列情况之一时，本基金应终止上市交易：

1. 自暂停上市之日起半年内未能消除暂停上市原因；
2. 基金合同终止；
3. 基金份额持有人大会决定终止上市；
4. 深圳证券交易所认为须终止上市的其他情况。

发生上述终止上市情形时，由证券交易所终止其上市交易，基金管理人报经中国证监会备案后终止本基金的上市，并在至少一种指定报刊和网站媒体上刊登终止上市公告。

(九) 相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所对基金上市交易的规则等相关规定内容进行调整的，本基金合同相应予以修改，并按照新规定执行，且此项修改无须召集基金份额持有人大会。

## 八、基金份额的申购与赎回

基金合同生效后，基金投资者可在封闭期间的开放日申购或赎回添利 A 份额。封闭期届满后，添利 A 与添利 B 两类基金份额将按照基金合同约定转换为上市开放式基金（LOF）份额，并开放申购、赎回业务。申购、赎回规则具体如下：

### （一）申购与赎回的开放日

1. 在封闭期内添利 A 在基金合同生效后每满半年开放一次，接受投资者的集中申购与赎回。本基金办理添利 A 集中申购与赎回的开放日为基金合同生效后每满半年的最后一个工作日，例如基金合同于 4 月 1 日生效，则第一个开放日为当年的 9 月 30 日（如该日为非工作日，则为下一个工作日，下同），第二个开放日为次年的 3 月 31 日，其它开放日以此类推。因不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放申购与赎回的，开放日为不可抗力或其他情形影响因素消除之日的下一个工作日。

本基金在开放日办理添利 A 集中申购与赎回的具体事宜，参见基金管理人届时发布的相关公告。

2. 封闭期届满后，本基金转换运作方式为上市开放式基金（LOF），在本基金转换运作方式之日起不超过 3 个月开始办理日常申购、赎回。在确定申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应在申购、赎回开放日前依据《信息披露办法》的有关规定在至少一种指定媒介上公告。

### （二）申购和赎回场所

封闭期的开放日内，添利 A 的集中申购与赎回，通过基金管理人、场外代销机构柜台系统办理。

开放期，投资者可使用深圳证券账户，通过深圳证券交易所交易系统办理申购、赎回业务，场内代销机构为基金管理人指定的具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员单位。投资者还可使用开放式基金账户，通过基金管理人、场外代销机构柜台系统办理申购、赎回业务。

本基金 C 类基金份额可通过场内或场外两种方式办理申购与赎回，A 类基金份额仅可通过场外方式办理申购与赎回。

投资者应当在基金管理人和场内、场外代销机构办理基金申购、赎回业务的营业场所或按基金管理人和场内、场外代销机构提供的其他方式办理基金的申购和赎回。本基金场内、场外代销机构名单将由基金管理人在招募说明书、发售公告或其他公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减代销机构。若基金管理

人或其指定的代销机构开通电话、传真或网上等交易方式,投资者可以通过上述方式进行申购与赎回,具体办法由基金管理人或代销机构另行公告。

### (三) 申购与赎回的原则

1. “未知价”原则,即封闭期内的申购、赎回价格以开放日收市后计算的基金份额申购赎回价格为基准进行计算;封闭期届满后任一类基金份额的申购、赎回价格以申请当日收市后计算的该类基金份额申购赎回价格为基准进行计算;
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. 场外基金份额持有人在赎回基金份额时,赎回遵循“先进先出”原则,即按照投资者认购、申购的先后次序进行顺序赎回;
4. 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;
5. 投资者通过深圳证券交易所交易系统办理本基金的场内申购、赎回时,需遵守深圳证券交易所的相关业务规则。

基金管理人可根据基金运作的实际情况依法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

投资者必须根据销售机构及深圳证券交易所规定的程序,在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

投资者在提交申购申请时须按销售机构规定的方式备足申购资金,投资者在提交赎回申请时须持有足够的基金份额余额,否则所提交的申购、赎回申请无效。

#### 2. 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,本基金注册登记机构在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,投资者可在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。基金销售机构对申购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。申购的确认以注册登记机构或基金管理人的确认结果为准。

#### 3. 添利 A 申购和赎回申请的成交确认原则

在封闭期内的每一个开放日,本基金以基金合同生效日添利 A 的初始份额为上限对添利 A 的申购申请进行确认。

在每一个开放日,所有经确认有效的添利 A 的赎回申请全部予以成交确认。对于添利 A 的申购申请,如果对全部有效的添利 A 的申购申请予以成交确认后,添利 A 的份额余额大于基金合同生效日添利 A 的初始份额,则以经确认后添利 A 份额余额不超过基金合同生效日添利 A 的初始份额为限,对全部有效申购申请按比例进行成交确认;否则对有效申购申请全部予以成交确认。

#### 4. 申购和赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式,若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功。若申购不成功或无效,基金管理人或基金管理人指定的代销机构将投资者已缴付的申购款项退还给投资者。

投资者赎回申请成功后,基金管理人将在 T+7 日(包括该日)内支付赎回款项。在发生巨额赎回时,款项的支付办法参照本基金合同有关条款处理。

#### (五) 申购和赎回的金额

1. 基金管理人可以规定投资者首次申购和每次申购的最低金额以及每次赎回的最低份额,具体规定请参见招募说明书。

2. 基金管理人可以规定投资者每个基金交易账户的最低基金份额余额,具体规定请参见招募说明书。

3. 基金管理人可以规定单个投资者累计持有的基金份额上限,具体规定请参见招募说明书。

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,具体规定请参见招募说明书或相关公告。

5. 基金管理人可以根据市场情况,在法律法规允许的情况下,调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。

#### (六) 申购和赎回的价格、费用及其用途

1. 申购和赎回的价格:本基金在封闭期内,添利 A 在开放日的申购和赎回价格等于当日添利 A 的基金份额参考净值。封闭期届满后,本基金转为上市开放式基金 (LOF),各类基金份额的申购和赎回价格等于该类基金份额净值。本基金分为 A 类和 C 类基金份额,各类基金份额单独设置基金代码,分别计算和公告基金份额净值。



2. 申购份额的计算及余额的处理方式：本基金申购份额的计算详见招募说明书。本基金A类基金份额的申购费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。申购的有效份额为净申购金额除以当日的该类基金份额净值，有效份额单位为份。场外申购时，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。场内申购时，申购的有效份额为净申购金额除以当日的申购价格，计算结果采用截位的方法保留到整数位，不足一份基金份额部分对应的申购资金将由交易所会员返还给投资者。

3. 赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见招募说明书，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。

4. A类基金份额的申购费用由申购该类基金份额的投资者承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。C类基金份额不收取申购费用。

5. 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。其中对持续持有期少于7日的投资者收取不低于1.50%的赎回费并全额计入基金财产。对持续持有期不少于7日的投资者收取的赎回费用中，不低于赎回费总额的25%应归基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

6. 本基金的申购费率、赎回费率最高不超过5%。本基金A类基金份额的申购费率、申购份额具体的计算方法、各类基金份额的赎回费率、赎回金额具体的计算方法和收费方式由基金管理人根据基金合同的规定确定，并在招募说明书中列示。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。

7. 基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对以特定交易方式(如网上交易、电话交易等)等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率、基金赎回费率和销售服务费率。

#### (七) 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者的申购申请：

1. 因不可抗力导致基金无法正常运作。
2. 在封闭期的开放日内, 根据申购规则和程序导致部分或全部申购没有得到成交确认。
3. 证券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. 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况。
5. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构或注册登记机构因技术故障或异常情况导致基金销售系统、注册登记系统、基金会计系统或证券结算登记系统无法正常运行;
6. 基金管理人认为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。
7. 开放期内, 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。
8. 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数的比例达到或者超过基金份额总数的 50%, 或者有可能导致投资者变相规避前述 50%比例要求的情形时。
9. 当一笔新的申购申请被确认成功, 使本基金总规模超过基金管理人规定的本基金总规模上限时; 或使本基金单日申购金额或净申购比例超过基金管理人规定的当日申购金额或净申购比例上限时; 或该投资者累计持有的份额超过单个投资者累计持有的份额上限时; 或该投资者当日申购金额超过单个投资者单日申购金额上限时; 或该投资者单笔申购金额超过单个投资者单笔申购金额上限时。
10. 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。
11. 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、4、5、7、10、11 项情形之一且基金管理人决定暂停接受申购申请时, 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。如果投资者的申购申请被拒绝, 被拒绝的申购款项将退还给投资者。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。

#### (八) 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者的赎回申请或延缓支付赎回款项:

1. 因不可抗力导致基金无法正常运作。
2. 证券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。
3. 在封闭期的开放日内,添利 A 发生巨额赎回,导致本基金的现金支付出现困难;
4. 开放期内,连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。
5. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构或注册登记机构因技术故障或异常情况导致基金销售系统、注册登记系统、基金会计系统或证券结算登记系统无法正常运行;
6. 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况。
7. 当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时,经与基金托管人协商确认后,基金管理人应当采取暂停接受基金赎回申请或延缓支付赎回款项的措施。
8. 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形时,基金管理人应在当日报中国证监会备案,已接受的赎回申请,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,并以后续开放日的各类基金份额净值为依据计算赎回金额。若连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回,延期支付最长不得超过 20 个工作日,并在指定媒介上公告。投资者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予以公告。

#### (九)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者的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

(2) 部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资者的赎回申请有困难或认为因支付投资者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。若进行上述延期办理，对于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50%以上的部分，基金管理人有权进行延期办理。对于其余当日非自动延期办理的赎回申请，应当按单个账户非自动延期办理的赎回申请量占非自动延期办理的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，投资者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该类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。如投资者在提交赎回申请时未作明确选择，投资者未能赎回部分作自动延期赎回处理。

(3) 暂停赎回：开放期内连续2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

当发生上述延期赎回并延期办理时，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，并依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介刊登公告。

#### (十) 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日但少于2周，暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前2日在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，

并公告最近 1 个开放日的各类基金份额净值。

4. 如发生暂停的时间超过 2 周，暂停期间，基金管理人应每 2 周至少刊登暂停公告 1 次。暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 2 日在指定媒介上连续刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近 1 个开放日的各类基金份额净值。

#### （十一）基金转换

封闭期届满，本基金转为上市开放式基金（LOF）后，基金管理人可以根据相关法律法规以及本基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的、且由同一注册登记机构办理注册登记的其他基金之间的转换业务，基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及本基金合同的规定制定并公告，并提前告知基金托管人与相关机构。

#### （十二）定期定额投资计划

封闭期届满，本基金转为上市开放式基金（LOF）后，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。投资者在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额，每期扣款金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。

#### （十三）实施侧袋机制期间本基金的申购与赎回

本基金实施侧袋机制的，本基金的申购和赎回安排详见招募说明书或相关公告。

## 九、基金合同当事人及权利义务

### (一)基金管理人

名称：万家基金管理有限公司

住所、办公地址：中国（上海）自由贸易试验区浦电路 360 号 8 层（名义楼层 9 层）

邮政编码：200122

法定代表人：方一天

成立时间：2002 年 8 月 23 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字【2002】44 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：叁亿元人民币

存续期间：持续经营

### (二)基金托管人

名称：中国邮政储蓄银行股份有限公司(简称：中国邮储银行)

住所：北京市西城区金融大街 3 号

办公地址：北京市西城区金融大街 3 号 A 座

邮政编码：100808

法定代表人/负责人：刘建军

成立时间：2007 年 3 月 6 日

批准设立机关及批准设立文号：中国银监会银监复【2006】484 号

基金托管业务批准文号：证监许可【2009】673 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：923.84 亿元人民币

存续期间：持续经营

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑和贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱服务；经中

国银行业监督管理机构等监管部门批准的其他业务。

### (三) 基金份额持有人

投资者自依基金合同、招募说明书取得基金份额即成为基金份额持有人和基金合同当事人,直至其不再持有本基金的基金份额,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的完全承认和接受。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。

### (四) 基金管理人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规,基金管理人的权利为:

1. 自本基金合同生效之日起,依照有关法律法规和本基金合同的规定独立运用基金财产;
2. 依照基金合同获得基金管理费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入;
3. 发售基金份额;
4. 依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利;
5. 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、非交易过户、转托管等业务的规则,在法律法规和本基金合同规定的范围内决定和调整基金的除调高托管费率和管理费率之外的相关费率结构和收费方式;
6. 根据本基金合同及有关规定监督基金托管人,对于基金托管人违反了本基金合同或有关法律法规规定的行为,对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形,应及时呈报中国证监会,并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益;
7. 在基金合同约定的范围内,拒绝或暂停受理申购和赎回申请;
8. 在法律法规允许的前提下,为基金的利益依法为基金进行融资、融券;
9. 自行担任或选择、更换注册登记机构,获取基金份额持有人名册,并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查;
10. 选择、更换代销机构,并依据基金销售服务代理协议和有关法律法规,对其行为进行必要的监督和检查;
11. 选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构;
12. 在基金托管人更换时,提名新的基金托管人;
13. 依法召集基金份额持有人大会;
14. 法律法规和基金合同规定的其他权利。

### (五) 基金管理人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的义务为：

1. 依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
2. 办理基金备案手续；
3. 自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；
4. 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；
5. 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和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. 计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回价格；
9. 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；
10. 按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
11. 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
12. 编制季度报告、中期报告和年度报告；
13. 严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
14. 保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、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，不得向他人泄露；
15. 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；
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；
17. 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；
18. 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他



法律行为;

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

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

21. 基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时, 应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿;

22. 按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料;

23. 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;

24. 执行生效的基金份额持有人大会决议;

25. 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动;

26. 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, 不谋求对上市公司的控股和直接管理;

27. 法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

#### (六) 基金托管人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规, 基金托管人的权利为:

1. 依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收入;

2. 监督基金管理人对本基金的投资运作;

3. 自本基金合同生效之日起, 依法保管基金资产;

4. 在基金管理人更换时, 提名新任基金管理人;

5. 根据本基金合同及有关规定监督基金管理人, 对于基金管理人违反本基金合同或有关法律法规规定的行为, 对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的情形, 应及时呈报中国证监会, 并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益;

6. 依法召集基金份额持有人大会;

7. 按规定取得基金份额持有人名册资料;

8. 法律法规和基金合同规定的其他权利。

#### (七) 基金托管人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规, 基金托管人的义务为:

1. 安全保管基金财产;
2. 设立专门的基金托管部, 具有符合要求的营业场所, 配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员, 负责基金财产托管事宜;
3. 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;
4. 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外, 不得为自己及任何第三人谋取利益, 不得委托第三人托管基金财产;
5. 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证;
6. 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户;
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应予保密, 不得向他人泄露;
8. 对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告出具意见, 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;
9. 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料;
10. 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;
11. 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项;
12. 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、各类基金份额净值和基金份额申购、赎回价格;
13. 按照规定监督基金管理人的投资运作;
14. 按规定制作相关账册并与基金管理人核对;
15. 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项;
16. 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会;
17. 因违反基金合同导致基金财产损失, 应承担赔偿责任, 其赔偿责任不因其退任而免除;
18. 基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时, 应为基金向基金管理人追偿;
19. 参加基金财产清算小组, 参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;

20. 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业监督管理机构，并通知基金管理人；

21. 执行生效的基金份额持有人大会决议；

22. 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

23. 建立并保存基金份额持有人名册；

24. 法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

#### (八) 基金份额持有人的权利

同一类别的每份基金份额具有同等的合法权益。根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的权利为：

1. 分享基金财产收益；

2. 参与分配清算后的剩余基金财产；

3. 依法转让及根据基金合同约定申请赎回其持有的基金份额；

4. 按照规定要求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、基金份额发售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；

9. 法律法规和基金合同规定的其他权利。

每份基金份额具有同等的合法权益。

#### (九) 基金份额持有人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的义务为：

1. 遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；

2. 交纳基金认购、申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用；

3. 在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；

4. 不从事任何有损基金及其他基金份额持有人合法权益的活动；

5. 执行生效的基金份额持有人大会决议；

6. 返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人及基金管理人的代理人、基金托管人、代销机构、其他基金份额持有人处获得的不当得利；

7. 法律法规和基金合同规定的其他义务。

(十) 本基金合同当事各方的权利义务以本基金合同为依据, 不因基金财产账户名称而有所改变。

## 十、基金份额持有人大会

（一）基金份额持有人大会由基金份额持有人或基金份额持有人的合法授权代表共同组成。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

1. 在封闭期内，基金份额持有人大会的审议事项应分别由添利 A、添利 B 基金份额持有人独立进行表决。添利 A、添利 B 基金份额持有人持有的每一份基金份额在其份额类别内拥有同等的投票权。

2. 封闭期届满，本基金转为上市开放式基金（LOF）。基金份额持有人将按其所持上市开放式基金的每一基金份额享有相应的投票权。

### （二）召集事由

1. 当出现或需要决定下列事由之一的，应当召集基金份额持有人大会：

（1）终止基金合同；

（2）转换基金运作方式，但本基金封闭期到期后转为上市开放式基金（LOF）除外；

（3）变更基金类别；

（4）变更基金投资目标、投资范围或投资策略（法律法规、基金合同和中国证监会另有规定的除外）；

（5）变更基金份额持有人大会程序；

（6）更换基金管理人、基金托管人；

（7）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准或提高销售服务费率，但法律法规要求提高该等报酬标准的除外；

（8）本基金与其他基金的合并；

（9）终止基金上市，但因本基金不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市的除外；

（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%，下同）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（在封闭期内，依据本基金合同享有基金份额持有人大会召集提议权、自行召集权、提案权、新任基金管理人和基金托管人提名

权的单独或合计持有本基金总份额 10%以上基金份额的基金份额持有人或类似表述均指“单独或合计持有添利 A 和添利 B 各自的基金总份额 10%以上基金份额的基金份额持有人”);

(13)对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项;

(14)法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

2. 出现以下情形之一的, 可由基金管理人和基金托管人协商后修改基金合同, 不需召集基金份额持有人大会:

(1)调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用;

(2)在法律法规和本基金合同规定的范围内调低全部或部分份额类别的赎回费率、销售服务费率, 或调整全部或部分份额类别的申购费率;

(3)因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改;

(4)对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化;

(5)基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响;

(6)按照法律法规或本基金合同规定不需召集基金份额持有人大会的其他情形。

### (三)召集人和召集方式

1. 除法律法规或本基金合同另有约定外, 基金份额持有人大会由基金管理人召集。基金管理人未按规定召集或者不能召集时, 由基金托管人召集。

2. 基金托管人认为有必要召集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 日内召集; 基金管理人决定不召集, 基金托管人仍认为有必要召集的, 应当自行召集。

3. 代表基金份额 10%以上的基金份额持有人认为有必要召集基金份额持有人大会的, 应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集, 并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的, 应当自出具书面决定之日起 60 日内召集; 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集的, 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 日内召集。

4. 代表基金份额 10%以上的基金份额持有人就同一事项要求召集基金份额持有人大会,而基金管理人、基金托管人都不召集的,代表基金份额 10%以上的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会,但应当至少提前 30 日向中国证监会备案。

5. 基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的,基金管理人、基金托管人应当配合,不得阻碍、干扰。

#### (四) 召集基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1. 基金份额持有人大会的召集人(以下简称“召集人”)负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。召集基金份额持有人大会,召集人必须于会议召集日前 30 日在指定媒介公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容:

(1) 会议召集的时间、地点和出席方式;

(2) 会议拟审议的主要事项;

(3) 会议形式;

(4) 议事程序;

(5) 有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人权益登记日;

(6) 代理投票的授权委托书的内容要求(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;

(7) 表决方式;

(8) 会务常设联系人姓名、电话;

(9) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续;

(10) 召集人需要通知的其他事项。

2. 采用通讯方式开会并进行表决的情况下,由召集人决定通讯方式和书面表决方式,并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、书面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书面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书面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书面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书面表决意见的计票进行监督的,

不影响计票和表决结果。

#### (五) 基金份额持有人出席会议的方式

##### 1. 会议方式

(1) 基金份额持有人大会的召集方式包括现场开会和通讯方式开会。

(2) 现场开会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, 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, 如基金管理人或基金托管人拒不派代表出席的, 不影响表决效力。

(3) 通讯方式开会指按照本基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。

(4) 会议的召集方式由召集人确定。

##### 2. 召集基金份额持有人大会的条件

###### (1) 现场开会方式

在同时符合以下条件时, 现场会议方可举行:

1) 对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示, 全部有效凭证所对应的基金份额应占权益登记日基金总份额的 50%以上(含 50%, 下同);

2) 到会的基金份额持有人身份证明及持有基金份额的凭证、代理人身份证明、委托人持有基金份额的凭证及授权委托代理手续完备, 到会者出具的相关文件符合有关法律法规和基金合同及会议通知的规定, 并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的注册登记资料相符。

###### (2) 通讯开会方式

在同时符合以下条件时, 通讯会议方可举行:

1) 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;

2) 召集人按基金合同规定通知基金托管人或/和基金管理人(分别或共同称为“监督人”)到指定地点对书面表决意见的计票进行监督;

3) 召集人在监督人和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的书面表决意见, 如基金管理人或基金托管人经通知拒不到场监督的, 不影响表决效力;

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

5) 直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理



人提交的持有基金份额的凭证、授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定,并与注册登记机构记录相符。

## (六) 议事内容与程序

### 1. 议事内容及提案权

(1) 议事内容为本基金合同规定的召集基金份额持有人大会事由所涉及的内容。

(2) 基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日本基金总份额 10% 以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前就召集事由向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案。

(3) 对于基金份额持有人提交的提案,大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核:

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解释和说明。

程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题做出决定。如将其提案进行分拆或合并表决,需征得原提案人同意;原提案人不同意变更的,大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会做出决定,并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

(4) 单独或合并持有权益登记日基金总份额 10% 以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案,基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案,未获基金份额持有人大会审议通过,就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议,其时间间隔不少于 6 个月。法律法规另有规定的除外。

(5) 基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后,如果需要对原有提案进行修改,应当在基金份额持有人大会召集前 30 日及时公告。否则,会议的召集日期应当顺延并保证至少与公告日期有 30 日的间隔期。

### 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, 经合法执业的律师见证后形成大会决议。

大会由召集人授权代表主持。基金管理人为召集人的, 其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和代理人以所代表的基金份额 50%以上多数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、持有或代表有表决权的基金份额数量、委托人姓名(或单位名称)等事项。

## (2) 通讯方式开会

在通讯表决开会的方式下, 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第 2 个工作日在公证机关及监督人的监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。如监督人经通知但拒绝到场监督, 则在公证机关监督下形成的决议有效。

3. 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。

## (七) 决议形成的条件、表决方式、程序

1. 基金份额持有人所持每一基金份额享有平等的表决权。在封闭期内, 基金份额持有人大会的审议事项应分别由添利 A、添利 B 基金份额持有人独立进行表决, 且添利 A、添利 B 基金份额持有人持有的每一份基金份额在其份额类别内拥有同等的投票权。

2. 基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议:

### (1) 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 50%以上通过方为有效, 除下列(2)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。但在封闭期内, 一般决议须同时经参加大会的添利 A、添利 B 各自的基金份额持有人(或其代理人)所持表决权的 50%以上通过方为有效;

### (2) 特别决议

特别决议须经出席会议的基金份额持有人(或其代理人)所持表决权的三分之二以上(含三分之二, 下同)通过方为有效; 涉及更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式(本基金依据本基金合同的约定直接转换运作方式的除外)、终

止基金合同等重大事项必须以特别决议通过方为有效。但在封闭期内,特别决议须同时经过参加大会的添利 A、添利 B 各自的基金份额持有人(或其代理人)所持表决权的三分之二以上通过方为有效。

3. 基金份额持有人大会决定的事项,应当依法报中国证监会核准或者备案,并予以公告。

4. 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弃权表决,但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

5. 基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

6. 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。

#### (八) 计票

##### 1. 现场开会

(1) 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推举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人;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推举两名基金份额持有人代表与基金管理人、基金托管人授权的一名监督员共同担任监票人;但如果基金管理人和基金托管人的授权代表未出席,则大会主持人可自行选举三名基金份额持有人代表担任监票人。

(2) 监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点,由大会主持人当场公布计票结果。

(3) 如大会主持人对于提交的表决结果有异议,可以对投票数进行重新清点;如大会主持人未进行重新清点,而出席大会的基金份额持有人或代理人对大会主持人宣布的表决结果有异议,其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点,大会主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

##### 2. 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票人在

监督人派出的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；如监督人经通知但拒绝到场监督，则大会召集人可自行授权3名监票人进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

(九)基金份额持有人大会决议报中国证监会核准或备案后的公告时间、方式

1. 基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议，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。关于本章第(二)条所规定的第(1)-(11)项召集事由的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准生效后方可执行，关于本章第(二)条所规定的第(12)、(13)项召集事由的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准或出具无异议意见后方可执行。

2. 生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会决议。

3. 基金份额持有人大会决议应自生效之日起2日内在指定媒介公告。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。

(十) 实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定

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

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

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

3、通讯开会的直接出具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相关基金份额的二分之一(含二分之一)；

4、当参与基金份额持有人大会投票的基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日相关基金份额的二分之一，召集人在原公告的基金份额持有人大会

召开时间的3个月以后、6个月以内就原定审议事项重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上(含三分之一)相关基金份额的持有人参与或授权他人参与基金份额持有人大会投票;

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

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

7、特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上(含三分之二)通过。

同一主侧袋账户内的每份基金份额具有平等的表决权。

(十一)法律法规或监管部门对基金份额持有人大会另有规定的,从其规定。

## 十一、基金管理人、基金托管人的更换条件和程序

### (一) 基金管理人的更换

#### 1. 基金管理人的更换条件

有下列情形之一的，经中国证监会核准，基金管理人职责终止：

- (1) 被依法取消基金管理资格；
- (2) 依法解散、依法被撤销或被依法宣告破产；
- (3) 被基金份额持有人大会解任；
- (4) 法律法规和基金合同规定的其他情形。

基金管理人职责终止时，应当依照基金合同的规定在六个月内召开基金份额持有人大会，选任新的基金管理人；新基金管理人产生前由中国证监会指定临时基金管理人。

#### 2. 基金管理人的更换程序

更换基金管理人必须依照如下程序进行：

(1) 提名：新任基金管理人由基金托管人或由单独或合计持有代表添利 A 和添利 B 各自的基金总份额 10% 以上（含 10%，下同）基金份额的基金份额持有人提名；

(2) 决议：基金份额持有人大会对更换基金管理人形成决议；

(3) 临时基金管理人：新任基金管理人产生之前，由中国证监会指定临时基金管理人；

(4) 核准并公告：上述基金份额持有人大会决议自通过之日起 5 日内，由大会召集人报中国证监会核准，经中国证监会核准生效后方可执行。基金托管人在中国证监会核准后按《信息披露办法》等有关规定在指定媒介上公告。

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

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

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

### (二) 基金托管人的更换

### 1. 基金托管人的更换条件

有下列情形之一的，经中国证监会核准，基金托管人职责终止：

- (1) 被依法取消基金托管资格；
- (2) 依法解散、依法被撤销或被依法宣告破产；
- (3) 被基金份额持有人大会解任；
- (4) 法律法规和基金合同规定的其他情形。

### 2. 基金托管人的更换程序

(1) 提名：新任基金托管人由基金管理人或由单独或合计持有代表添利 A 和添利 B 各自的基金总份额 10%以上基金份额的基金份额持有人提名。

(2) 决议：基金份额持有人大会对更换基金托管人形成决议。

(3) 临时基金托管人：新任基金托管人产生之前，由中国证监会指定临时基金托管人；

(4) 核准并公告：上述更换基金托管人的基金份额持有人大会决议自通过之日起 5 日内，由大会召集人报中国证监会核准，经中国证监会核准生效后按《信息披露办法》等有关规定在指定媒介上公告；

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

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

### 3. 基金管理人与基金托管人同时更换

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

(2) 决议：基金份额持有人大会对同时更换基金管理人和基金托管人形成决议；

(3) 临时基金管理人和临时基金托管人：新任基金管理人和新任基金托管人产生之前，由中国证监会指定临时基金管理人和临时基金托管人；

(4) 核准并公告：上述基金份额持有人大会决议自通过之日起 5 日内，由大会召集人报中国证监会核准。新任基金管理人和新任基金托管人在获得中国证监会

核准后应按《信息披露办法》等有关规定在指定媒介上联合公告。

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

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

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

(三) 新基金管理人接受基金管理或新基金托管人或接受基金财产和基金托管业务前，原基金管理人或基金托管人应继续履行相关职责，并保证不对基金份额持有人的利益造成损害。



## 十二、基金的托管

基金财产由基金托管人保管。基金管理人应与基金托管人按照《基金法》、基金合同及有关规定订立《万家添利分级债券型证券投资基金托管协议》。订立托管协议的目的是明确基金托管人与基金管理人之间在基金份额持有人名册登记、基金财产的保管、基金财产的管理和运作及相互监督等相关事宜中的权利义务及职责，确保基金财产的安全，保护基金份额持有人的合法权益。

### 十三、基金份额的登记、非交易过户、转托管、冻结与质押

#### (一) 基金份额的注册登记

1. 本基金的注册登记业务指基金登记、存管、清算和结算业务, 具体内容包括投资者基金账户建立和管理、基金份额注册登记、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等。

2. 本基金的份额采用分系统登记的原则。场内认(申)购或上市交易买入的基金份额登记在证券登记结算系统基金份额持有人深圳证券账户下; 场外认(申)购的基金份额登记在注册登记系统基金份额持有人基金账户下。

3. 本基金的注册登记业务由基金管理人或基金管理人委托的其他符合条件的机构负责办理。基金管理人委托其他机构办理本基金注册登记业务的, 应与代理人签订委托代理协议, 以明确基金管理人和代理机构在注册登记业务中的权利义务, 保护基金份额持有人的合法权益。

4. 注册登记机构享有如下权利:

- (1) 建立和管理投资者基金账户;
- (2) 取得注册登记费;
- (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, 制定和调整注册登记业务的相关规则;
- (5) 法律法规规定的其他权利。

5. 注册登记机构承担如下义务:

- (1) 配备足够的专业人员办理本基金的注册登记业务;
- (2) 严格按照法律法规和基金合同规定的条件办理基金的注册登记业务;
- (3) 保存基金份额持有人名册及相关的申购、赎回业务记录 15 年以上;
- (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除外;
- (5) 按基金合同和招募说明书规定为投资者办理非交易过户等业务, 并提供其他必要服务;
- (6) 接受基金管理人的监督;
- (7) 法律法规规定的其他义务。

## (二) 基金的非交易过户

基金的非交易过户是指基金注册登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行而产生的非交易过户以及注册登记机构认可、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者。

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注册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注册登记机构的规定办理,并按基金注册登记机构规定的标准收费。

## (三) 基金的转托管

### 1. 系统内转托管

(1) 系统内转托管是指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构(网点)之间或证券登记结算系统内不同会员单位(席位)之间进行转托管的行为。

(2) 基金份额登记在证券登记结算系统的基金份额持有人在变更办理上市交易的会员单位(席位)时,可办理已持有基金份额的系统内转托管。

具体办理方法参照《业务规则》的有关规定以及基金代销机构的业务规则。

### 2. 跨系统转托管

(1) 跨系统转托管是指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统间进行转托管的行为。

(2) 本基金跨系统转托管的具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司的相关规定办理。

基金份额持有人办理上述业务时,基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。

## (四) 基金的冻结和解冻

基金注册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,以及注册登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻,并收取一定的手续费用。

(五)基金注册登记机构可依据其业务规则,受理基金份额的质押等业务,并收取一定的手续费用。

## 十四、基金的投资

### (一) 投资目标

在严格控制投资风险的基础上,追求当期较高收入和投资总回报。

### (二) 投资理念

把握价值发现过程,谋求价值最优实现。以价值分析为基础,通过管理实现基金资产可持续的稳定增值。

### (三) 投资范围

本基金投资于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、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、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的相关规定)。

本基金主要投资于国内依法发行上市的国家债券、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、公司债券、短期融资券、资产证券化产品、可转换债券、可分离债券和回购等金融工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益证券品种。本基金投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的80%。

本基金还可以参与一级市场新股申购或增发新股,并可持有因可转债转股所形成的股票、因所持股票所派发的权证以及因投资可分离债券而产生的权证等以及法律法规或中国证监会允许投资的其他非固定收益类品种,但不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产。本基金在封闭运作期间,投资于非固定收益类资产的比例不高于基金资产的20%;开放期间,投资于非固定收益类资产的比例不高于基金资产的20%,其中,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。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。

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。

### (四) 投资策略

#### 1. 资产配置策略

本基金管理人在充分研究宏观市场形势以及微观市场主体的基础上,采取积

极主动地投资管理策略,通过定性与定量分析,对利率变化趋势、债券收益率曲线移动方向、信用利差等影响债券价格的因素进行评估,对不同投资品种运用不同的投资策略,并充分利用市场的非有效性,把握各类套利的机会。在风险可控的前提下,充分发挥在封闭期内基金规模稳定的优势,寻求组合流动性与收益的最佳配比,实现基金收益的最大化。

## 2. 利率预期策略

利率变化是影响债券价格的最重要的因素,利率预期策略是本基金的基本投资策略。本基金通过对宏观经济、金融政策、市场供需、市场结构变化等因素的分析,采用定性分析与定量分析相结合的方法,形成对未来利率走势的判断,并在此基础上对债券组合的久期结构进行有效配置,以达到降低组合利率风险,获取较高投资收益的目的。

## 3. 期限结构配置策略

利率期限结构表明了债券的到期收益率与到期期限之间的关系。本基金通过数量化方法对利率进行建模,在各种情形、各种假设下对未来利率期限结构变动进行模拟分析,并在运作中根据期限结构不同变动情形在子弹式组合、梯式组合和杠铃式组合当中进行选择适当的配置策略。

## 4. 属类配置策略

不同类型的债券在收益率、流动性和信用风险上存在差异,债券资产有必要配置于不同类型的债券品种以及在不同市场上进行配置,以寻求收益性、流动性和信用风险补偿间的最佳平衡点。本基金将综合信用分析、流动性分析、税收及市场结构等因素分析的结果来决定投资组合的类别资产配置策略。

## 5. 债券品种选择策略

在上述债券投资策略的基础上,本基金对个券进行定价,充分评估其到期收益率、流动性溢价、信用风险补偿、税收、含权等因素,选择那些定价合理或价值被低估的债券进行投资。

具有以下一项或多项特征的债券,将是本基金债券投资重点关注的对象:

- (1)符合前述投资策略;
- (2)短期内价值被低估的品种;
- (3)具有套利空间的品种;
- (4)符合风险管理指标;

(5) 双边报价债券品种；

(6) 市场流动性高的债券品种。

本基金的一个投资重点为信用债券，对信用利差的评估直接决定了对信用债券的定价结果。信用利差应当是信用债券相对于可比国债在信用利差扩大风险和到期兑付违约风险上的补偿。信用利差的变化受经济周期、行业周期和发行主体财务状况等综合因素的影响。本基金围绕上述因素综合评估发行主体的信用风险，确定信用债券的信用利差，有效管理组合的整体信用风险。

在信息反映充分的债券市场中，信用利差的变化有规律可循且在一定时期内较为稳定。当债券收益率曲线上移时，信用利差通常会扩大，而在债券收益率曲线下移的过程中，信用利差会收窄；行业盈利增加、处于上升周期中，信用利差会缩小，行业盈利缩减、处于下降周期中，信用利差会扩大。提前预测并制定相应投资策略，就可能获得收益或者减少损失。本基金将通过定性与定量相结合的方式，综合考虑监管环境、市场供求关系、行业分析，并运用财务数据统计模型和现金流分析模型等对整个市场的信用利差结构进行全面分析，在有效控制整个组合信用风险的基础上，采取积极的投资策略，发现价值被低估的信用类债券产品，挖掘投资机会，获取超额收益。

#### 6. 可转换债券投资策略

可转换债券（含可分离转债）兼具权益类证券与固定收益类证券的特性，具有抵御下行风险、分享股票价格上涨收益的特点。本基金在对可转换债券条款和发行债券公司基本面进行深入分析研究的基础上，通过考察利率水平、票息率、付息频率、信用风险及流动性等因素判断其债券价值；采用市场公认的多种期权定价模型以及研究人员对包括对应公司基本面等不同变量的预测确定其转换权价格。投资具有较高安全边际和良好流动性的可转换公司债券，获取稳健的投资回报。

#### 7. 股票等权益类资产投资策略

在股票发行市场上，股票供求关系不平衡经常导致股票发行价格与二级市场价格之间存在一定的价差，从而使得新股申购成为一种风险较低的投资方式。本基金将研究首次发行（IPO）股票及增发新股的上市公司基本面因素，根据股票市场整体定价水平，估计新股上市交易的合理价格，同时参考一级市场资金供求关系，从而制定相应的新股申购策略。本基金对于通过新股认购等方式所获得的股票，将根据其市场价格相对于其合理内在价值的高低，在上市交易后 90 个交易日

内选择合适的时机卖出。

本基金不主动进行二级市场的权证投资，对于通过可分离交易可转债中分离交易等方式获得的权证，本基金将依据权证估值模型及研究人员对包括对应公司基本面等不同变量的预测确定权证合理定价，在上市交易后 90 个交易日内选择合适的时机卖出。

#### 8. 信用债券投资的风险管理

本基金采取内部评级与外部评级相结合的办法，对信用债券面临的信用风险进行综合评估。通过参考外部评级筛选出信用债券的研究库，对进入研究库中的信用债券通过内部信用评级，运用定性和定量相结合、动态和静态相结合的方法，建立信用债券的投资库，在具体操作上，采用指标定量打分制，对债券发行人所处考虑行业经济特点以及企业属性和经营状况、融资的便利性、财务状况等指标，对债券发行人进行综合打分评级，并动态跟踪债券发行人的状况，建立相应预警指标，及时对信用债券的投资库进行更新维护。在投资操作中，结合适度分散的投资策略，适时调整投资组合，降低信用债券投资的信用风险。

#### (五) 投资决策

##### 1. 决策依据

(1) 国家有关法律法规、监管规定和基金合同的有关规定；

(2) 宏观经济、微观经济运行状况，货币政策和财政政策执行状况，货币市场和证券市场运行状况；

(3) 投研团队提供的宏观经济分析报告、策略分析报告、行业分析报告、上市公司分析报告、固定收益类债券分析报告、风险测算报告等。

##### 2. 决策程序

本基金采用投资决策委员会领导下的基金经理负责制。基金管理人选择具有丰富证券投资经验的人员担任基金经理。本基金的投资管理程序如下：

##### (1) 利率分析师开展研究分析并撰写研究报告

利率分析师将广泛参考和利用公司外部研究成果，尤其是研究实力雄厚的证券经营机构提供的研究报告，并经常拜访国家有关部委，了解国家宏观经济政策及行业发展状况；经过筛选、归纳、整理，定期撰写并向投资决策委员会和基金经理提供宏观经济分析报告和债市市场投资策略报告。研究报告是投资决策委员会和基金经理进行投资决策的主要依据之一。



(2) 信用分析师对信用债券的信用风险和信用利差做出评估。

信用分析师首先借助卖方研究机构的研究报告和中介评级机构的结论构建信用债券研究库，然后在研究库范围内基于宏观经济、行业周期、企业财务状况等因素对信用债券进行综合评估，得出信用利差及信用风险的研究结论，从而形成信用债券投资库。基金对于信用债券的投资仅限于投资库内获得投资评级的债券。

(3) 基金经理制定具体的投资组合方案

基金总体投资计划的拟定，由基金经理根据公司投研团队撰写的宏观经济、行业、上市公司分析报告、策略研究报告、债券研究报告等拟定。

该基金总体投资计划包括资产配置方案（即投资组合中股票、债券和现金类资产的配置比例）、债券组合久期等。

如果基金经理认为影响市场的因素产生了重大变化，还可以临时提出新的总体投资计划，并报投资决策委员会审批。

(4) 投资决策委员会审议并决定基金的总体投资计划

投资决策委员会将定期分析投资研究团队所提供的研究报告，根据基金的投资目标、投资范围和投资策略，确定基金的总体投资计划，包括在无信用风险债券、信用类债券及现金等大类资产之间的资产配置范围比例等。

(5) 投资指令的下达与执行及反馈

基金经理根据投资组合方案制订具体的操作计划，并以投资指令的形式下达至集中交易室。集中交易室依据投资指令具体执行买卖操作，并将指令的执行情况反馈给基金经理并提供建议，以便基金经理及时调整交易策略。

(6) 投资组合监控与评估

监察稽核部对基金总体投资计划的执行进行日常监督和实时风险控制，并定期或不定期地提供风险分析报告。公司风险控制委员会根据市场变化对基金投资组合进行风险评估，提出风险防范措施。

监察稽核部定期对基金投资组合进行投资绩效评估，研究在一段时期内基金投资组合的变化及由此带来的收益与损失，并对基金业绩进行有效分解，以便能更好地评估资产配置，并对基金经风险调整后的业绩进行评估，定期或不定期地提供绩效评估报告。

(7) 基金经理对组合进行调整

基金经理根据证券市场变化、基金申购、赎回现金流情况，以及风险监控和

风险评估结果、绩效评估报告对组合进行动态调整。

#### (六) 业绩比较基准

本基金业绩比较基准为：中国债券总指数

中国债券总指数由中央国债登记结算公司编制，并在中国债券网(www.chinabond.com.cn)公开发布，具有较强的权威性和市场影响力；该指数的样本券涵盖面广，能较好地反映债券市场的整体收益。本基金是债券型基金，主要投资于固定收益类金融工具，强调基金资产的稳定增值，为此，本基金选取中国债券总指数作为本基金的业绩比较基准。

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基准的指数时，本基金管理人可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告，但不需要召集基金份额持有人大会。

#### (七) 风险收益特征

本基金是债券型证券投资基金，属于具有中低风险收益特征的基金品种，其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金。

从投资者具体持有的基金份额来看，由于基金收益分配的安排，封闭期内，添利A份额将表现出低风险、低收益的明显特征，其预期收益和预期风险要低于普通的债券型基金份额；添利B份额则表现出高风险、高收益的显著特征，其预期收益和预期风险要高于普通的债券型基金份额。

#### (八) 投资组合限制

1. 本基金对固定收益类资产的投资比例不得低于基金资产的80%；
2. 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%；
3. 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%；
4. 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的10%；
5. 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的20%；
6. 本基金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%；

7. 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个月内全部予以卖出;

8. 本基金参与股票发行申购时, 申报的金额不得超过本基金的总资产, 申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;

9. 本基金持有一家上市公司的股票, 其市值不得超过基金资产净值的10%;

10. 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%;

11. 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%;

12. 封闭期后, 本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券不得低于基金资产净值的5%, 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;

13. 本基金管理人管理的全部基金持有一家上市公司发行的证券, 不超过该证券的10%;

14. 本基金持有的所有流通受限证券, 其公允价值不得超过基金资产净值的10%; 本基金投资流通受限的单只证券, 锁定期在3个月以内(含3个月)的流通受限证券, 投资金额不得超过基金资产净值的7%; 锁定期在3个月至1年(含1年)的流通受限证券, 投资金额不得超过基金资产净值的5%; 经基金管理人和基金托管人协商可对以上比例进行调整;

15. 本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)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%;

16. 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前述所规定比例限制的, 基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;

17. 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;

18. 如果法律法规对基金合同约定的组合限制进行变更的, 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, 在履行适当程序后,

本基金投资不再受相关限制。

除上述第7、12、16、17项外，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述组合限制的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整。

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。基金托管人对基金投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

#### (九) 禁止行为

本基金禁止以下投资行为：

1. 承销证券；
2. 将基金财产向他人贷款或提供担保；
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. 向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
6. 买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、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. 法律法规、中国证监会及基金合同禁止的其他活动。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，本基金管理人在履行适当程序后，则本基金不受上述规定的限制。

#### (十) 基金管理人代表基金行使股东及债权人权利的处理原则及方法

1. 基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东及债权人权利，保护基金份额持有人的利益；
2. 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；
3. 有利于基金财产的安全与增值；
4. 不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

#### (十一) 基金的融资、融券

本基金可以按照国家的有关规定进行融资、融券。

## (十二) 侧袋机制的实施和投资运作安排

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

侧袋机制实施期间,本部分约定的投资组合比例、投资策略、组合限制、业绩比较基准、风险收益特征等约定仅适用于主袋账户。

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

## 十五、基金的财产

### (一) 基金资产总值

基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款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负债后的价值。

### (三) 基金财产的账户

本基金财产以基金名义开立银行存款账户,以基金托管人的名义开立证券交易清算资金的结算备付金账户,以基金托管人和本基金联名的方式开立基金证券账户,以本基金的名义开立银行间债券托管账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和注册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) 基金财产的处分

基金财产独立于基金管理人、基金托管人和代销机构的固有财产,并由基金托管人保管。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。基金管理人、基金托管人可以按基金合同的约定收取管理费、托管费以及其他基金合同约定的费用。基金财产的债权、不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债务相抵销,不同基金财产的债权债务,不得相互抵销。基金管理人、基金托管人以其自有资产承担法律责任,其债权人不得对基金财产行使请求冻结、扣押和其他权利。

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。

除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定处分外,基金财产不得被处分。非因基金财产本身承担的债务,不得对基金财产强制执行。

## 十六、基金资产的估值

### (一) 估值日

本基金的估值日为本基金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。

### (二) 估值方法

#### 1. 股票估值方法

(1) 上市流通股票按估值日其所在证券交易场所的收盘价估值；估值日无交易的，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，以最近交易日的收盘价估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。如有充足证据表明最近交易日收盘价不能真实地反映公允价值的，应对最近交易日的收盘价进行调整，确定公允价值进行估值。

#### (2) 未上市股票的估值：

1) 首次发行的股票，采用估值技术确定公允价值进行估值，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) 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，按估值日其所在证券交易所上市的同一种股票以第(1)条确定的估值价格进行估值。

3) 送股、转增股、配股和公开增发新股等方式发行的股票，按估值日该上市公司在证券交易所挂牌的同一种流通股票以第(1)条确定的估值价格进行估值。

#### 4) 非公开发行有明确锁定期的股票按如下方法进行估值：

① 估值日在证券交易所上市交易的同一股票以第(1)条确定的估值价格低于非公开发行股票初始取得成本时，应采用在证券交易所上市交易的同一股票以第(1)条确定的估值价格作为估值日该非公开发行股票的价值；

② 估值日在证券交易所上市交易的同一股票以第(1)条确定的估值价格高于非公开发行股票初始取得成本时，应按下列公式确定估值日该非公开发行股票的价值：

$$FV=C+(P-C)\times(D1-Dr)/D1$$
 (FV为估值日该非公开发行股票的价值；C为该非公开发行股票初始取得成本(因权益业务导致市场价格除权时，应于除权日对其

初始取得的成本作相应调整); P 为估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价; D1 为该非公开发行股票锁定期所含的交易所的交易天数; Dr 为估值日剩余锁定期, 即估值日至锁定期结束所含的交易所的交易天数, 不含估值日当天。

(3) 国家有最新规定的, 按其规定进行估值。

## 2. 债券估值方法

(1) 在证券交易所市场挂牌交易的实行净价交易的债券按估值日收盘价估值, 估值日无交易的, 但最近交易日后经济环境未发生重大变化的, 以最近交易日的收盘价估值; 估值日无交易, 且最近交易日后经济环境发生了重大变化的, 将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素, 调整最近交易日收盘价, 确定公允价值进行估值。如有充足证据表明最近交易日收盘价不能真实地反映公允价值的, 应对最近交易日的收盘价进行调整, 确定公允价值进行估值。

(2) 在证券交易所市场挂牌交易的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, 估值日无交易的, 但最近交易日后经济环境未发生重大变化的, 按最近交易日债券收盘价减去所含的最近交易日债券应收利息后的净价进行估值; 估值日无交易, 且最近交易日后经济环境发生了重大变化的, 将参考类似投资品种的现行市价(净价)及重大变化因素, 调整最近交易日收盘价(净价), 确定公允价值进行估值。如有充足证据表明最近交易日收盘价(净价)不能真实地反映公允价值的, 应对最近交易日的收盘价(净价)进行调整, 确定公允价值进行估值。

(3) 首次发行未上市债券采用估值技术确定的公允价值进行估值, 在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下, 按成本估值。

(4) 在银行间债券市场交易的债券根据行业协会指导的处理标准或意见并综合考虑市场成交价、市场报价、流动性及收益率曲线等因素确定其公允价值进行估值。

(5) 国家有最新规定的, 按其规定进行估值。

## 3. 权证估值方法:

### (1) 配股权证的估值:

因持有股票而享有的配股权, 类同权证处理方式的, 采用估值技术进行估值。

### (2) 认沽/认购权证的估值:

从持有确认日起到卖出日或行权日止, 上市交易的认沽/认购权证按估值日的



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；未上市交易的认沽/认购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的情况下，按成本估值；因持有股票而享有的配股权，停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值。

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

5. 本基金持有的银行存款和备付金余额以本金列示，按相应利率逐日计提利息。

6. 在任何情况下，基金管理人如采用上述估值方法对基金财产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如基金管理人认为上述估值方法对基金财产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人在综合考虑市场各因素的基础上，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。

基金管理人、基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序以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，发现方应及时通知对方，以约定的方法、程序和相关法律法规的规定进行估值，以维护基金份额持有人的利益。

根据《基金法》，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，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。

### (三) 估值对象

基金依法拥有的股票、债券、权证及其他基金资产。

### (四) 估值程序

1. 各类基金份额净值是按照每个工作日闭市后，各类基金份额的基金资产净值分别除以当日该类基金份额的余额数量计算，均精确到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。

本基金封闭期间，基金管理人在基金份额净值计算的基础上，按照基金合同的规定采用“虚拟清算”原则计算并公告添利A和添利B基金份额参考净值。封闭期间的基金份额参考净值是对两级基金份额价值的一个估算，并不代表基金份额持

有人可获得的实际价值。添利 A 和添利 B 基金份额参考净值的计算,保留到小数点后 4 位,小数点后第 5 位四舍五入。

封闭期届满,按照基金合同的规定对添利 A 和添利 B 分别进行基金份额净值计算,并按各自的基金份额净值进行资产及收益的分配及份额转换。添利 A 和添利 B 封闭期末基金份额参考净值的计算,各自保留小数点后 8 位,小数点后第 9 位四舍五入。

每个工作日计算基金资产净值、各类基金份额净值及两级基金的基金份额参考净值,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。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。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。

#### (五) 估值错误的处理

当基金财产的估值导致任一类基金份额净值小数点后四位内(含第四位)发生差错时,视为该类基金份额净值估值错误。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财产估值的准确性、及时性。当估值或基金份额净值计价出现错误时,基金管理人应当立即予以纠正,并采取合理的措施防止损失进一步扩大;当计价错误达到或超过该类基金份额基金资产净值的 0.25% 时,基金管理人应通报基金托管人,并报告中国证监会;计价错误达到该类基金份额基金资产净值的 0.5% 时,基金管理人应通报基金托管人,按基金合同的规定进行公告,并报中国证监会备案。

#### 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、或代销机构、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当事人(“受损方”)的直接损失按下述“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不能预见、不能避免、不能克服,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

当基金资产净值、各类基金份额净值、两级基金的基金份额参考净值计算差错给基金和基金份额持有人造成损失需要进行赔偿时,基金管理人和基金托管人应根据实际情况界定双方承担的责任,经确认后按以下条款进行赔偿:

(1) 本基金的基金会计责任方由基金管理人担任。与本基金有关的会计问题,如经双方在平等基础上充分讨论后,尚不能达成一致时,按基金会计责任方的建议执行,由此给基金份额持有人和基金造成的损失,由基金管理人负责赔付。

(2) 若基金管理人计算的基金资产净值、各类基金份额净值、两级基金的基金份额参考净值已由基金托管人复核确认后公告,而且基金托管人未对计算过程提出疑义或要求基金管理人书面说明,份额净值出错且造成基金份额持有人损失的,应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金,就实际向投资者或基金支付的赔偿金额,基金管理人与基金托管人各自承担相应的责任。

(3) 如基金管理人和基金托管人对基金资产净值、各类基金份额净值、两级基金的基金份额参考净值的计算结果,虽然多次重新计算和核对,尚不能达成一致时,为避免不能按时公布基金资产净值、各类基金份额净值、两级基金的基金份额参考净值的情形,以基金管理人的计算结果对外公布,由此给基金份额持有人和基金造成的损失,由基金管理人负责赔付。

## 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。

## (六) 暂停估值的情形

1. 基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;
2. 因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时;
3. 占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变,而基金管理人为保障基金份额持有人的利益,已决定延迟估值时;
4. 出现基金管理人认为属于紧急事故的情况,导致基金管理人不能出售或评估基金资产时;
5. 当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上的,经与基金托管人协商确认后,基金管理人应当暂停估值;
6. 中国证监会和基金合同认定的其他情形。

#### (七)基金净值的确认

用于基金信息披露的基金资产净值、各类基金份额净值、添利 A 和添利 B 基金份额参考净值、封闭期末添利 A 和添利 B 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各类基金份额净值计算结果并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人,由基金管理人对基金净值予以公布。

#### (八)实施侧袋机制期间的基金资产估值

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

#### (九)特殊情况的处理

1. 基金管理人或基金托管人按估值方法的第 6 条进行估值时,所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。
2. 由于不可抗力原因,或由于证券交易所及注册登记机构发送的数据错误,或国家会计政策变更、市场规则变更等,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。但基金管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

## 十七、基金的费用与税收

### (一) 基金费用的种类

1. 基金管理人的管理费；
2. 基金托管人的托管费；
3. 基金上市费用；
4. 基金财产划拨支付的银行费用；
5. 基金合同生效后的基金信息披露费用；
6. 基金份额持有人大会费用；
7. 基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
8. 基金的证券交易费用；
9. 基金销售服务费；
10. 依法可以在基金财产中列支的其他费用。

(二) 上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

### (三) 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

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 0.40% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费自基金合同生效之日起每日计提，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，基金托管人复核无误后于次月首日起 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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

#### 2. 基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 年费率计提。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 为前一日基金资产净值

基金托管费自基金合同生效之日起每日计提,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,基金托管人复核无误后于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至最近可支付日支付。

### 3. 基金销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费,C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.35%。基金销售服务费用于支付销售机构佣金、基金的营销费用以及基金份额持有人服务费等。本基金 C 类基金份额的基金销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.35% 年费率计提。计算方法如下:

$$H=E \times 0.35\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费自基金合同生效之日起每日计提,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销售服务费划付指令,基金托管人复核无误后于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至最近可支付日支付。

(四)基金合同生效以后的与基金相关的信息披露费用、基金份额持有人大会费用、基金合同生效以后的与基金相关的会计师费和律师费和基金上市初费及年费、基金银行汇划费用以及按照国家有关规定可以列入的其他费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定,列入或摊入当期基金费用。

### (五)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财产的损失,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。基金合同生效之前的律师费、会计师费和信息披露费用等不得从基金财产中列支。

### (六)基金管理费、基金托管费和基金销售服务费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情降低基金管理费、基金托管费和基金销售服务费费率,此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率实施日前在指定媒介刊登公告。

### (七)实施侧袋机制期间的基金费用

本基金实施侧袋机制的,与侧袋账户有关的费用可以从侧袋账户中列支,但

应待侧袋账户资产变现后方可列支,有关费用可酌情收取或减免,但不得收取管理费,详见招募说明书的规定或相关公告。

#### (八) 基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定,履行纳税义务。

## 十八、基金的收益与分配

### (一) 基金收益的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额,基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

### (二) 基金收益分配的原则

基金收益分配应遵循下列原则:

1. 本基金在封闭期内及封闭期届满时,收益分配应遵循下列原则:

(1) 在封闭期内,本基金不单独对添利 A 与添利 B 基金份额进行收益分配;

(2) 在封闭期届满,按照基金合同第四章关于封闭期末收益分配规则与封闭期末基金份额净值计算的约定,单独计算出添利 A 与添利 B 份额各自的份额净值并转换为上市开放式基金(LOF)份额,基金份额持有人可通过赎回基金份额实现应得收益;

(3) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

2. 本基金封闭期届满并转换为上市开放式基金(LOF)后,本基金收益分配应遵循下列原则:

(1) 基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式(指将现金红利按除息日除权后的该类基金份额净值为计算基准自动转为相应类别的基金份额进行再投资),基金份额持有人可选择现金方式或红利再投资方式,且基金份额持有人可对 A 类、C 类基金份额分别选择不同的分红方式。若基金份额持有人事先未做出选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红,若基金份额持有人选择红利再投资,红利再投资的份额免收申购费用;登记在深圳证券账户的基金份额的收益分配只能采取现金红利方式,不能选择红利再投资;

(2) 本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权;

(3) 在符合有关基金分红条件的前提下,基金收益每年最多分配12次,每次基金收益分配比例不低于期末可供分配利润的20%(期末可供分配利润指期末资产负债表未分配利润与未分配利润中已实现收益孰低数);

(4) 基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去该类每单位基金份额收益分配净额后不能低于面值;

(5) 分红权益登记日申请申购的基金份额不享受当次分红,分红权益登记日申请赎回的基金份额享受当次分红;

(6) 基金红利发放日距离收益分配基准日(即期末可供分配利润计算截至日)的时间不得超过15个工作日;

(7) 法律法规或监管机构另有规定的,从其规定。

### (三) 收益分配方案

基金收益分配方案中应载明基金期末可供分配利润、基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式、支付方式等内容。

### (四) 收益分配的时间和程序

1. 本基金收益分配方案由基金管理人拟订,由基金托管人复核,依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告;

2. 在收益分配方案公告后,基金管理人依据具体方案的规定就支付的现金红利向基金托管人发送划款指令,基金托管人按照基金管理人的指令及时进行分红的划付。

### (五) 实施侧袋机制期间的收益分配

本基金实施侧袋机制的,侧袋账户不进行收益分配,详见招募说明书的规定或相关公告。



## 十九、基金的会计和审计

### (一) 基金的会计政策

1. 基金管理人为本基金的会计责任方;
2. 本基金的会计年度为公历每年的1月1日至12月31日;
3. 本基金的会计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的会计制度;
5. 本基金独立建账、独立核算;
6. 基金管理人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. 基金托管人定期与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并书面确认。

### (二) 基金的审计

1. 基金管理人聘请具有从事证券、期货相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金年度财务报表及其他规定事项进行审计。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。
2. 会计师事务所更换经办注册会计师时,应事先征得基金管理人同意。
3. 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,需经基金托管人(或基金管理人)同意。就更换会计师事务所,基金管理人应当依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

## 二十、封闭期届满与基金份额转换

### （一）封闭期届满后基金的存续形式

本基金合同生效后三年封闭期届满，在满足基金合同约定的存续条件下，本基金无需召开基金份额持有人大会，自动转换为上市开放式基金（LOF），基金名称变更为“万家添利债券型证券投资基金（LOF）”。添利 A、添利 B 基金份额将以各自的份额净值为基准转换为同一上市开放式基金（LOF）的份额。

本基金份额转换为上市开放式基金（LOF）份额后，基金份额仍将在深圳证券交易所上市交易。

### （二）封闭期届满时添利 A 的处理方式

本基金合同生效后三年封闭期届满，添利 A 基金份额持有人可选择将其持有的添利 A 份额赎回，若基金份额持有人在规定时间内未提出赎回申请，其持有的添利 A 份额将被默认为转入万家添利债券型证券投资基金（LOF）份额。

本基金封闭期届满日前，基金管理人将就接受添利 A 赎回申请的时间等相关事宜进行公告。

### （三）封闭期届满时的份额转换规则

#### 1. 基金份额转换日的确定

添利 A 和添利 B 基金份额转换日为基金合同生效之日起至三年封闭期末对应日。如该对应日为非工作日，则封闭期到期日顺延到下一个工作日。基金份额转换日确定日期，届时见基金管理人公告。

#### 2. 基金份额转换方式及份额计算

本基金基金份额转换日日终，基金管理人将根据添利 A 和添利 B 基金份额转换比例对基金份额持有人基金份额转换日登记在册的基金份额实施转换。添利 A、添利 B 的场外份额将转换为上市开放式基金（LOF）场外份额，添利 B 的场内份额将转换为上市开放式基金（LOF）场内份额。转换后，基金份额持有人持有的基金份额数将按照转换规则将相应增加或减少。本基金封闭期末截止日 T 的份额净值计算见基金合同第四章。

添利 A 基金份额和添利 B 基金份额转换公式为：

添利 A 转换后基金份额数 = 转换前添利 A 基金份额数 × T 日添利 A 基金份额净

值/1.000

添利 B 转换后基金份额数 = 转换前添利 B 基金份额数 × T 日添利 B 基金份额净值/1.000

添利 A、添利 B 份额的转换比例、添利 A、添利 B 基金份额持有人持有的转换后上市开放式基金（LOF）份额数的具体计算见基金管理人届时发布的相关公告。

### 3. 基金份额转换日当日及后续申购与赎回的计算

在基金份额转换日后不超过 30 天内，本基金上市交易，并开放场内与场外日常申购、赎回业务。份额转换后的本基金上市交易、开始办理申购与赎回的具体日期，见基金管理人届时发布的相关公告。

在基金份额转换日当日，本基金转换成上市开放式基金（LOF）后的基金份额净值调整为 1.000。基金份额转换日后，基金份额净值将在此基础上变动，投资者申购、赎回价格将以当日基金份额净值计算。

#### （四）封闭期届满后基金的投资管理

封闭期届满，如本基金继续存续并转换为上市开放式基金（LOF）后，则本基金的投资目标、投资理念、投资范围、投资策略、投资管理程序不变，有关投资限制继续符合基金合同的约定，并符合相关法律法规的规定。

#### （五）封闭期届满的公告

1. 封闭期届满时，在符合本基金存续条件下，本基金将转换为上市开放式基金（LOF）。基金管理人将依照相关法律法规的规定就本基金进行基金份额转换的相关事宜进行公告，并报中国证监会备案。

2. 本基金实施基金份额转换后，基金管理人将在 5 日内对转换比例及转换后基金份额数的具体计算进行公告，并报中国证监会备案。

3. 在封闭期届满前 30 个工作日，基金管理人还将就本基金进行基金份额转换的相关事宜进行提示性公告。

## 二十一、基金的信息披露

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。

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、法人和非法人组织。

本基金信息披露义务人以保护基金份额持有人利益为根本出发点,按照法律法规和中国证监会的规定披露基金信息,并保证所披露信息的真实性、准确性、完整性、及时性、简明性和易得性。

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内,将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的全国性报刊(以下简称“指定报刊”)及指定互联网网站(以下简称“指定网站”)等媒介披露,并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

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、法人和非法人组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字;
6. 中国证监会禁止的其他行为。

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不同文本的内容一致。不同文本之间发生歧义的,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。

公开披露的基金信息包括:

### (一) 招募说明书、基金产品资料概要

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

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

## (二)基金合同、托管协议

基金管理人应在基金份额发售的3日前,将基金合同摘要登载在指定报刊和网站上;基金管理人、基金托管人应将基金合同、托管协议登载在各自网站上。

## (三)基金份额发售公告

基金管理人将按照《基金法》、《信息披露办法》的有关规定,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。

## (四)基金合同生效公告

基金管理人将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。基金合同生效公告中将说明基金募集情况。

## (五)基金份额上市交易公告书

添利B基金份额获准在证券交易所上市交易的,基金管理人应当在基金份额上市交易的三个工作日前,将基金份额上市交易公告书登载在指定报刊和网站上。

## (六)两级基金的基金份额配比

在基金定期报告中,基金管理人应当计算并公告两级基金的基金份额配比。

## (七)基金净值信息、两级基金的基金份额参考净值

1. 本基金的基金合同生效后,在添利B份额上市交易前,基金管理人将至少每周公告一次基金资产净值、基金份额净值和两级基金的基金份额参考净值;

2. 在添利B份额上市交易后,基金管理人将在每个交易日的次日,通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介,披露基金资产净值、基金份额净值和两级基金

的基金份额参考净值；

3. 基金管理人将公告半年度和年度最后一个市场交易日的基金资产净值、基金份额净值和两级基金的基金份额参考净值。基金管理人应当在上述市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和两级基金的基金份额参考净值登载在指定报刊和网站上；

4. 基金托管人对添利 A 和添利 B 的基金份额参考净值、封闭期届满时基金份额净值及相关披露内容进行复核；

5. 在本基金封闭期届满并转换为上市开放式基金（LOF）后：

在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周在指定网站披露一次基金份额净值和基金份额累计净值。

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

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

#### （八）基金份额申购、赎回价格公告

基金管理人应当在本基金的基金合同、招募说明书等信息披露文件上载明各类基金份额申购、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销售机构网站或营业网点查阅或者复制前述信息资料。

#### （九）基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告

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

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

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

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

5. 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本基金的特定风险,中国证监会认定的特殊情形除外。

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

#### (十) 临时报告

本基金发生重大事件,有关信息披露义务人应当按照《信息披露办法》有关规定编制临时报告书,并登载在指定报刊和指定网站上。

前款所称重大事件,是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件:

1. 基金份额持有人大会的召开及决定的事项;
2. 《基金合同》终止、基金清算;
3. 转换基金运作方式、基金合并;
4. 更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构,基金改聘会计师事务所;
5. 基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项,基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项;
6. 基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更;
7. 基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、变更基金管理人的实际控制人;
8. 基金募集期延长或提前结束募集;
9. 基金管理人高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动;
10. 基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十;
11. 基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十;
12. 涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁;
13. 基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚,基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业

务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；

14. 基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易事项，中国证监会另有规定的情形除外；

15. 基金收益分配事项；

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

17. 任一类基金份额净值计价错误达该类基金份额净值百分之零点五；

18. 本基金开始办理申购、赎回；

19. 本基金发生巨额赎回并延期办理；

20. 本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；

21. 本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；

22. 基金份额暂停上市、恢复上市或终止上市；

23. 发生涉及本基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；

24. 调整基金份额类别设置；

25. 基金信息披露义务人认为可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的其他事项或中国证监会规定的其他事项。

#### (十一) 澄清公告

在《基金合同》期限内，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，以及可能损害基金份额持有人权益的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会、基金上市交易的证券交易所。

#### (十二) 清算报告

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

#### (十三) 实施侧袋机制期间的信息披露

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

#### (十四) 中国证监会规定的其他信息



### (十五) 信息披露事务管理

基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度,指定专门部门及高级管理人员负责管理信息披露事务。

基金信息披露义务人公开披露基金信息,应当符合中国证监会相关基金信息披露内容与格式准则等法规的规定。

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定,对基金管理人编制的基金资产净值、各类基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告、更新的招募说明书、基金产品资料概要、基金清算报告等公开披露的相关基金信息进行复核、审查,并向基金管理人进行书面或电子确认。

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

基金管理人、基金托管人除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、基金上市交易的证券交易所网站披露信息,并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

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

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。

### (十六) 信息披露文件的存放与查阅

依法必须披露的信息发布后,基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于公司住所、基金上市交易的证券交易所,供社会公众查阅、复制。投资者在支付工本费后,可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。

投资者也可在基金管理人指定的网站上进行查阅。本基金的信息披露事项将在指定媒介上公告。

(十七) 本基金信息披露事项以法律法规规定及本章节约定的内容为准。

## 二十二、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### (一) 基金合同的变更

1. 基金合同变更内容对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的,应召集基金份额持有人大会,基金合同变更的内容应经基金份额持有人大会决议同意。

(1) 终止基金合同;

(2) 转换基金运作方式,但本基金封闭期届满转为上市开放式基金(LOF)除外;

(3) 变更基金类别;

(4) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略(法律法规、基金合同和中国证监会另有规定的除外);

(5) 变更基金份额持有人大会程序;

(6) 更换基金管理人、基金托管人;

(7) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准,但法律法规要求提高该等报酬标准的除外;

(8) 本基金与其他基金的合并;

(9) 终止基金上市,但因本基金不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市的除外;

(10) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项;

(11) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

但出现下列情况时,可不经基金份额持有人大会决议,由基金管理人和基金托管人同意后公布,并报中国证监会备案:

(1) 调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用;

(2) 在法律法规和本基金合同规定的范围内变更基金的申购费率、赎回费率或收费方式;

(3) 因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改;

(4) 对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化;

(5) 基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响;

(6) 按照法律法规或本基金合同规定不需召集基金份额持有人大会的其他情形。

2. 关于变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案, 并自决议生效后依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

### (二) 本基金合同的终止

有下列情形之一的, 本基金合同经中国证监会核准后将终止:

1. 基金份额持有人大会决定终止的;
2. 基金管理人因解散、破产、撤销等事由, 不能继续担任基金管理人的职务, 而在 6 个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务;
3. 基金托管人因解散、破产、撤销等事由, 不能继续担任基金托管人的职务, 而在 6 个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务;
4. 法律法规、中国证监会规定的其他情况。

### (三) 基金财产的清算

1. 基金合同终止, 应当按法律法规和基金合同的有关规定对基金财产进行清算。

#### 2. 基金财产清算组

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

(2) 基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、基金注册登记机构、具有从事证券、期货相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

(3) 基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算组可以依法进行必要的民事活动。

#### 3. 清算程序

- (1) 基金合同终止后, 由基金财产清算组统一接管基金财产;
- (2) 基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限;
- (3) 基金财产清算组对基金财产进行清理和确认;
- (4) 对基金财产进行评估和变现;
- (5) 基金清算组做出清算报告;
- (6) 会计师事务所对清算报告进行审计;
- (7) 律师事务所对清算报告出具法律意见书;

(8) 将基金清算结果报告中国证监会；

(9) 公布基金清算公告；

(10) 对基金剩余财产进行分配。

#### 4. 清算费用

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

#### 5. 基金财产清算剩余资产的分配

若在封闭期届满前基金合同终止，则本基金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，根据基金合同“虚拟清算”的原则计算并确定添利 A 和添利 B 基金份额持有人分别应得的剩余资产比例，并据此比例对添利 A 和添利 B 的基金份额持有人进行剩余基金资产的分配。

若在封闭期届满，即本基金转为上市开放式基金（LOF）后基金合同终止，则本基金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。

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

#### 7. 基金财产清算账册及文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 二十三、违约责任

(一)基金管理人、基金托管人在履行各自职责的过程中,违反《基金法》规定或者本基金合同约定,给基金财产或者基金份额持有人造成损害的,应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任;因共同行为给基金财产或者基金份额持有人造成损害的,应当承担连带赔偿责任。但是发生下列情况的,当事人可以免责:

1. 不可抗力;

2. 基金管理人和/或基金托管人按照当时有效的法律法规或中国证监会的规定作为或不作为而造成的损失等;

3. 基金管理人由于按照基金合同规定的投资原则行使或不行使其投资权而造成的损失等。

(二)基金合同当事人违反基金合同,给其他当事人造成经济损失的,应当承担赔偿责任。在发生一方或多方违约的情况下,基金合同能继续履行的,应当继续履行。

(三)本基金合同一方当事人造成违约后,其他当事人应当采取适当措施防止损失的扩大;没有采取适当措施致使损失扩大的,不得就扩大的损失要求赔偿。守约方因防止损失扩大而支出的合理费用由违约方承担。

(四)因一方当事人违约而导致其他当事人损失的,基金份额持有人应先于其他受损方获得赔偿。

(五)由于基金管理人、基金托管人不可控制的因素导致业务出现差错,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,但是未能发现错误的,由此造成基金财产或投资者损失,基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但是基金管理人和基金托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

## 二十四、争议的处理

对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，基金合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本基金合同受中国法律管辖。

## 二十五、基金合同的效力

基金合同是约定基金当事人之间、基金与基金当事人之间权利义务关系的法律文件。

(一)本基金合同经基金管理人和基金托管人加盖公章以及双方法定代表人或授权代表签字,在基金募集结束,基金备案手续办理完毕,并获中国证监会书面确认后生效。基金合同的有效期限自其生效之日起至该基金财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止。

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

(三)本基金合同正本一式八份,除中国证监会和银行业监督管理机构各持两份外,基金管理人和基金托管人各持有两份。每份均具有同等的法律效力。

(四)本基金合同可印制成册,供投资者在基金管理人、基金托管人、代销机构和注册登记机构办公场所查阅,但其效力应以基金合同正本为准。

## 二十六、其他事项

本基金合同如有未尽事宜，由本基金合同当事人各方按有关法律法规和规定协商解决。



## 二十七、基金合同摘要

(一) 基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

### 1. 基金份额持有人的权利与义务

同一类别的每份基金份额具有同等的合法权益。根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的权利为：

- (1) 分享基金财产收益；
- (2) 参与分配清算后的剩余基金财产；
- (3) 依法转让及根据基金合同约定申请赎回其持有的基金份额；
- (4) 按照规定要求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、基金份额发售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；
- (9) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的义务为：

- (1) 遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；
- (2) 交纳基金认购、申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用；
- (3) 在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；
- (4) 不从事任何有损基金及其他基金份额持有人合法权益的活动；
- (5) 执行生效的基金份额持有人大会决议；
- (6) 返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人及基金管理人的代理人、基金托管人、代销机构、其他基金份额持有人处获得的不当得利；
- (7) 法律法规和基金合同规定的其他义务。

### 2. 基金管理人的权利与义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的权利为：

- (1) 自本基金合同生效之日起，依照有关法律法规和本基金合同的规定独立运

用基金财产;

(2) 依照基金合同获得基金管理费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入;

(3) 发售基金份额;

(4) 依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利;

(5) 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、非交易过户、转托管等业务的规则, 在法律法规和本基金合同规定的范围内决定和调整基金的除调高托管费率和管理费率之外的相关费率结构和收费方式;

(6) 根据本基金合同及有关规定监督基金托管人, 对于基金托管人违反了本基金合同或有关法律法规规定的行为, 对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形, 应及时呈报中国证监会, 并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益;

(7) 在基金合同约定的范围内, 拒绝或暂停受理申购和赎回申请;

(8) 在法律法规允许的前提下, 为基金的利益依法为基金进行融资、融券;

(9) 自行担任或选择、更换注册登记机构, 获取基金份额持有人名册, 并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查;

(10) 选择、更换代销机构, 并依据基金销售服务协议和有关法律法规, 对其行为进行必要的监督和检查;

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

(12) 在基金托管人更换时, 提名新的基金托管人;

(13) 依法召集基金份额持有人大会;

(14) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

根据《基金法》及其他有关法律法规, 基金管理人的义务为:

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

(2) 办理基金备案手续;

(3) 自基金合同生效之日起, 以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产;

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

(5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度, 保证

所管理的基金财产和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) 计算并公告基金净值信息, 确定基金份额申购、赎回价格;

(9) 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;

(10) 按规定受理申购和赎回申请, 及时、足额支付赎回款项;

(11) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;

(12) 编制季度报告、中期报告和年度报告;

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

(14) 保守基金商业秘密, 不得泄露基金投资计划、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, 不得向他人泄露;

(15) 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;

(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;

(17) 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;

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

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

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

(21) 基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时, 应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿;

(22) 按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料;

(23) 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；

(24) 执行生效的基金份额持有人大会决议；

(25) 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

(26) 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，不谋求对上市公司的控股和直接管理；

(27) 法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

### 3. 基金托管人的权利与义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的权利为：

(1) 依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收入；

(2) 监督基金管理人对本基金的投资运作；

(3) 自本基金合同生效之日起，依法保管基金资产；

(4) 在基金管理人更换时，提名新任基金管理人；

(5) 根据本基金合同及有关规定监督基金管理人，对于基金管理人违反本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；

(6) 依法召集基金份额持有人大会；

(7) 按规定取得基金份额持有人名册资料；

(8) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的义务为：

(1) 安全保管基金财产；

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

(3) 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；

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

(5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

(6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；

(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应予保密,不得向他人泄露;

(8)对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告出具意见,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;

(9)保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料;

(10)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;

(11)办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项;

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

(13)按照规定监督基金管理人的投资运作;

(14)按规定制作相关账册并与基金管理人核对;

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

(16)按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会;

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

(18)基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时,应为基金向基金管理人追偿;

(19)参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;

(20)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业监督管理机构,并通知基金管理人;

(21)执行生效的基金份额持有人大会决议;

(22)不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动;

(23)建立并保存基金份额持有人名册;

(24)法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

## (二)基金份额持有人大会

1.基金份额持有人大会由基金份额持有人或基金份额持有人的合法授权代表共同组成。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

(1) 在封闭期内, 基金份额持有人大会的审议事项应分别由添利 A、添利 B 基金份额持有人独立进行表决。添利 A、添利 B 基金份额持有人持有的每一份基金份额在其份额类别内拥有同等的投票权。

(2) 封闭期届满, 本基金转为上市开放式基金 (LOF)。基金份额持有人将按其所持上市开放式基金的每一基金份额享有相应的投票权。

## 2. 召集事由

当出现或需要决定下列事由之一的, 应当召集基金份额持有人大会:

(1) 终止基金合同;

(2) 转换基金运作方式, 但本基金封闭期到期后转为上市开放式基金 (LOF) 除外;

(3) 变更基金类别;

(4) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略 (法律法规、基金合同和中国证监会另有规定的除外);

(5) 变更基金份额持有人大会程序;

(6) 更换基金管理人、基金托管人;

(7) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准或提高销售服务费率, 但法律法规要求提高该等报酬标准的除外;

(8) 本基金与其他基金的合并;

(9) 终止基金上市, 但因本基金不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市的除外;

(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%, 下同) 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 (在封闭期内, 依据本基金合同享有基金份额持有人大会召集提议权、自行召集权、提案权、新任基金管理人和基金托管人提名权的单独或合计持有本基金总份额 10% 以上基金份额的基金份额持有人或类似表述均指“单独或合计持有添利 A 和添利 B 各自的基金总份额 10% 以上基金份额的基金份额持有人”);

(12) 对基金合同当事人权利、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情形。

出现以下情形之一的,可由基金管理人和基金托管人协商后修改基金合同,不需召集基金份额持有人大会:

- (1) 调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用;
- (2) 在法律法规和本基金合同规定的范围内调低全部或部分份额类别的赎回费率、销售服务费率,或调整全部或部分份额类别的申购费率;
- (3) 因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改;
- (4) 对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化;
- (5) 基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响;
- (6) 按照法律法规或本基金合同规定不需召集基金份额持有人大会的其他情形。

### 3. 召集人和召集方式

(1) 除法律法规或本基金合同另有约定外,基金份额持有人大会由基金管理人召集。基金管理人未按规定召集或者不能召集时,由基金托管人召集。

(2) 基金托管人认为有必要召集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 日内召集;基金管理人决定不召集,基金托管人仍认为有必要召集的,应当自行召集。

(3) 代表基金份额 10%以上的基金份额持有人认为有必要召集基金份额持有人大会的,应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集,并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的,应当自出具书面决定之日起 60 日内召集;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集的,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 日内召集。

(4) 代表基金份额 10%以上的基金份额持有人就同一事项要求召集基金份额持有人大会,而基金管理人、基金托管人都不召集的,代表基金份额 10%以上的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会,但应当至少提前 30 日向中国证监会备案。

(5) 基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的, 基金管理人、基金托管人应当配合, 不得阻碍、干扰。

#### 4. 召集基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

基金份额持有人大会的召集人(以下简称“召集人”)负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。召集基金份额持有人大会, 召集人必须于会议召集日前 30 天在指定媒介公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容:

- (1) 会议召集的时间、地点和出席方式;
- (2) 会议拟审议的主要事项;
- (3) 会议形式;
- (4) 议事程序;
- (5) 有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人权益登记日;
- (6) 代理投票的授权委托书的内容要求(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;
- (7) 表决方式;
- (8) 会务常设联系人姓名、电话;
- (9) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续;
- (10) 召集人需要通知的其他事项。

采用通讯方式开会并进行表决的情况下, 由召集人决定通讯方式和书面表决方式, 并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、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。

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书面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书面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书面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书面表决意见的计票进行监督的, 不影响计票和表决结果。

#### 5. 基金份额持有人出席会议的方式

##### (1) 会议方式

- 1) 基金份额持有人大会的召集方式包括现场开会和通讯方式开会。
- 2) 现场开会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,



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，如基金管理人或基金托管人拒不派代表出席的，不影响表决效力。

3) 通讯方式开会指按照本基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。

4) 会议的召集方式由召集人确定。

(2) 召集基金份额持有人大会的条件

1) 现场开会方式

在同时符合以下条件时，现场会议方可举行：

① 对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示，全部有效凭证所对应的基金份额应占权益登记日基金总份额的 50%以上(含 50%，下同)；

② 到会的基金份额持有人身份证明及持有基金份额的凭证、代理人身份证明、委托人持有基金份额的凭证及授权委托代理手续完备，到会者出具的相关文件符合有关法律法规和基金合同及会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的注册登记资料相符。

2) 通讯方式开会

在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

① 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；

② 召集人按基金合同规定通知基金托管人或/和基金管理人(分别或共同称为“监督人”)到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；

③ 召集人在监督人和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的书面表决意见，如基金管理人或基金托管人经通知拒不到场监督的，不影响表决效力；

④ 本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的 50%以上；

⑤ 直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人提交的持有基金份额的凭证、授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与注册登记机构记录相符。

6. 议事内容与程序

(1) 议事内容及提案权

1) 议事内容为本基金合同规定的召集基金份额持有人大会事由所涉及的内容。

2) 基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日本基金总份额 10% 以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前就召集事由向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案。

3) 对于基金份额持有人提交的提案，大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

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解释和说明。

程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题做出决定。如将其提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会做出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

4) 单独或合并持有权益登记日基金总份额 10% 以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于 6 个月。法律法规另有规定的除外。

5) 基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，如果需要对原有提案进行修改，应当在基金份额持有人大会召集前 30 日及时公告。否则，会议的召集日期应当顺延并保证至少与公告日期有 30 日的间隔期。

## (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，经合法执业的律师见证后形成大会决议。

大会由召集人授权代表主持。基金管理人为召集人的，其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和代理人以所代表的基金份额 50% 以上多数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、持有或代表有表决权的基金份额数量、委托人姓名(或单位名称)等事项。

## 2) 通讯方式开会

在通讯表决开会的方式下,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第2个工作日在公证机关及监督人的监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。如监督人经通知但拒绝到场监督,则在公证机关监督下形成的决议有效。

(3) 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。

## 7. 决议形成的条件、表决方式、程序

(1) 基金份额持有人所持每一基金份额享有平等的表决权。在封闭期内,基金份额持有人大会的审议事项应分别由添利A、添利B基金份额持有人独立进行表决,且添利A、添利B基金份额持有人持有的每一份基金份额在其份额类别内拥有同等的投票权。

(2) 基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议:

### 1) 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50%以上通过方为有效,除下列2)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。但在封闭期内,一般决议须同时经参加大会的添利A、添利B各自的基金份额持有人(或其代理人)所持表决权的50%以上通过方为有效;

### 2) 特别决议

特别决议须经出席会议的基金份额持有人(或其代理人)所持表决权的三分之二以上(含三分之二,下同)通过方为有效;涉及更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式(本基金依据本基金合同的约定直接转换运作方式的除外)、终止基金合同等重大事项必须以特别决议通过方为有效。但在封闭期内,特别决议须同时经过参加大会的添利A、添利B各自的基金份额持有人(或其代理人)所持表决权的三分之二以上通过方为有效。

(3) 基金份额持有人大会决定的事项,应当依法报中国证监会核准或者备案,并予以公告。

(4) 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弃权表决, 但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

(5) 基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

(6) 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。

## 8. 计票

### (1) 现场开会

1) 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推举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人; 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推举两名基金份额持有人代表与基金管理人、基金托管人授权的一名监督员共同担任监票人; 但如果基金管理人和基金托管人的授权代表未出席, 则大会主持人可自行选举三名基金份额持有人代表担任监票人。

2) 监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点, 由大会主持人当场公布计票结果。

3) 如大会主持人对于提交的表决结果有异议, 可以对投票数进行重新清点; 如大会主持人未进行重新清点, 而出席大会的基金份额持有人或代理人对大会主持人宣布的表决结果有异议, 其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点, 大会主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

### (2) 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票人在监督人派出的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; 如监督人经通知但拒绝到场监督, 则大会召集人可自行授权 3 名监票人进行计票, 并由公证机关对其计票过程予以公证。

## 9. 基金份额持有人大会决议报中国证监会核准或备案后的公告时间、方式

(1) 基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议, 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。关于本章第 2 条所规定的第(1)-(11)项召集事由的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准生效后方可执行,关于本章第 2 条所规定的第(12)、(13)项召集事由的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准或出具无异议意见后方可执行。

(2)生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会决议。

(3)基金份额持有人大会决议应自生效之日起 2 日内在指定媒介公告。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。

#### 10. 实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定

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

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

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

(3)通讯开会的直接出具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相关基金份额的二分之一(含二分之一);

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

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

(6)一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分

之一以上(含二分之一)通过;

(7) 特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上(含三分之二)通过。

同一主侧袋账户内的每份基金份额具有平等的表决权。

11. 法律法规或监管部门对基金份额持有人大会另有规定的,从其规定。

(三) 基金收益分配原则、执行方式

1. 基金收益的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额,基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

2. 基金收益分配的原则

基金收益分配应遵循下列原则:

(1) 本基金在封闭期内及封闭期届满时,收益分配应遵循下列原则:

1) 在封闭期内,本基金不单独对添利 A 与添利 B 基金份额进行收益分配;

2) 在封闭期届满,按照基金合同第四章关于封闭期末收益分配规则与封闭期末基金份额净值计算的约定,单独计算出添利 A 与添利 B 份额各自的份额净值并转换为上市开放式基金(LOF)份额,基金份额持有人可通过赎回基金份额实现应得收益;

3) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

(2) 本基金封闭期届满并转换为上市开放式基金(LOF)后,本基金收益分配应遵循下列原则:

1) 基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式(指将现金红利按除息日除权后的该类基金份额净值为计算基准自动转为相应类别的基金份额进行再投资),基金份额持有人可选择现金方式或红利再投资方式,且基金份额持有人可对 A 类、C 类基金份额分别选择不同的分红方式。若基金份额持有人事先未做出选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红,若基金份额持有人选择红利再投资,红利再投资的份额免收申购费用;登记在深圳证券账户的基金份额的收益分配只能采取现金红利方式,不能选择红利再投资;

2) 本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权;

3) 在符合有关基金分红条件的前提下, 基金收益每年最多分配 12 次, 每次基金收益分配比例不低于期末可供分配利润的 20% (期末可供分配利润指期末资产负债表末未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数);

4) 基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去该类每单位基金份额收益分配净额后不能低于面值;

5) 分红权益登记日申请申购的基金份额不享受当次分红, 分红权益登记日申请赎回的基金份额享受当次分红;

6) 基金红利发放日距离收益分配基准日 (即期末可供分配利润计算截至日) 的时间不得超过 15 个工作日;

7) 法律法规或监管机构另有规定的, 从其规定。

### 3. 收益分配方案

基金收益分配方案中应载明基金期末可供分配利润、基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式、支付方式等内容。

### 4. 收益分配的时间和程序

(1) 本基金收益分配方案由基金管理人拟订, 由基金托管人复核, 依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告;

(2) 在收益分配方案公告后, 基金管理人依据具体方案的规定就支付的现金红利向基金托管人发送划款指令, 基金托管人按照基金管理人的指令及时进行分红资金的划付。

### 5. 实施侧袋机制期间的收益分配

本基金实施侧袋机制的, 侧袋账户不进行收益分配, 详见招募说明书的规定或相关公告。

## (四) 与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例

### 1. 基金费用的种类

- (1) 基金管理人的管理费;
- (2) 基金托管人的托管费;
- (3) 基金上市费用;
- (4) 基金财产拨划支付的银行费用;
- (5) 基金合同生效后的基金信息披露费用;
- (6) 基金份额持有人大会费用;

(7) 基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费;

(8) 基金的证券交易费用;

(9) 基金销售服务费;

(10) 依法可以在基金财产中列支的其他费用。

2. 上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内按照公允的市场价格确定, 法律法规另有规定时从其规定。

### 3. 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

在通常情况下, 基金管理费按前一日基金资产净值的 0.40% 年费率计提。计算方法如下:

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费自基金合同生效之日起每日计提, 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, 基金托管人复核无误后于次月首日起 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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的, 顺延至最近可支付日支付。

#### (2) 基金托管人的托管费

在通常情况下, 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 年费率计提。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 为前一日基金资产净值

基金托管费自基金合同生效之日起每日计提, 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, 基金托管人复核无误后于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的, 顺延至最近可支付日支付。

#### (3) 基金销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费, C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.35%。基金销售服务费用于支付销售机构佣金、基金的营销费用以及基金份额持有人服务费等。本基金 C 类基金份额的基金销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.35% 年费率计提。计算方法如下:

$$H = E \times 0.35\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值



基金销售服务费自基金合同生效之日起每日计提,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销售服务费划付指令,基金托管人复核无误后于次月首日起5个工作日内从基金资产中一次性支付给基金销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至最近可支付日支付。

4. 基金合同生效以后的与基金相关的信息披露费用、基金份额持有人大会费用、基金合同生效以后的与基金相关的会计师费和律师费和基金上市初费及年费、基金银行汇划费用以及按照国家有关规定可以列入的其他费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定,列入或摊入当期基金费用。

#### 5. 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财产的损失,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。基金合同生效之前的律师费、会计师费和信息披露费用等不得从基金财产中支付。

### (五) 基金财产的投资范围和投资限制

#### 1. 投资范围

本基金投资于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、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规获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的相关规定)。

本基金主要投资于国内依法发行上市的国家债券、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、公司债券、短期融资券、资产证券化产品、可转换债券、可分离债券和回购等金融工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益证券品种。本基金投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的80%。

本基金还可以参与一级市场新股申购或增发新股,并可持有因可转债转股所形成的股票、因所持股票所派发的权证以及因投资可分离债券而产生的权证等以及法律法规或中国证监会允许投资的其他非固定收益类品种,但不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产。本基金在封闭运作期间,投资于非固定收益类资产的比例不高于基金资产的20%;开放期间,投资于非固定收益类资产的比例不高于基金资产的20%,其中,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。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。

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。

#### 2. 投资组合限制

(1) 本基金对固定收益类资产的投资比例不得低于基金资产的80%;

(2) 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%;

(3) 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%;

(4) 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的 10%;

(5) 本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的 20%;

(6) 本基金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%;

(7) 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 个月内全部予以卖出;

(8) 本基金参与股票发行申购时,申报的金额不得超过本基金的总资产,申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;

(9) 本基金持有一家上市公司的股票,其市值不得超过基金资产净值的 10%;

(10) 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%;

(11) 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%;

(12) 封闭期后,本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券不得低于基金资产净值的 5%,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;

(13) 本基金管理人管理的全部基金持有一家上市公司发行的证券,不超过该证券的 10%;

(14) 本基金持有的所有流通受限证券,其公允价值不得超过基金资产净值的 10%;本基金投资流通受限的单只证券,锁定期在 3 个月以内(含 3 个月)的流通受限证券,投资金额不得超过基金资产净值的 7%;锁定期在 3 个月至 1 年(含 1 年)的流通受限证券,投资金额不得超过基金资产净值的 5%;经基金管理人和基金托管人协商可对以上比例进行调整;

(15) 本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股,不得超过该上市公司可流通股股票的 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,不得超过该上市公司可流通股股票的 30%;

(16) 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前述所规定比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受

限资产的投资;

(17) 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;

(18) 如果法律法规对基金合同约定的组合限制进行变更的,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,在履行适当程序后,本基金投资不再受相关限制。

除上述第(7)、(12)、(16)、(17)项外,因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述组合限制的,基金管理人应当在10个交易日内进行调整。

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。基金托管人对基金投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

### 3. 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) 将基金财产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基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券;

(6) 买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、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) 法律法规、中国证监会及基金合同禁止的其他活动。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定,本基金管理人在履行适当程序后,则本基金投资不受上述规定的限制。

### (六) 基金资产净值的计算方法和基金净值信息公告方式

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款以及其他资产的价值总和。

本基金的估值对象为基金依法拥有的股票、债券、权证及其他基金资产。

本基金的估值日为本基金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。

本基金的估值方法:

## 1. 股票估值方法

(1) 上市流通股按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，以最近交易日的收盘价估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。如有充足证据表明最近交易日收盘价不能真实地反映公允价值的，应对最近交易日的收盘价进行调整，确定公允价值进行估值。

(2) 未上市股票的估值：

1) 首次发行的股票，采用估值技术确定公允价值进行估值，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) 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，按估值日其所在证券交易所上市的另一股票以第(1)条确定的估值价格进行估值。

3) 送股、转增股、配股和公开增发新股等方式发行的股票，按估值日该上市公司在证券交易所挂牌的同一流通股票以第(1)条确定的估值价格进行估值。

4) 非公开发行有明确锁定期的股票按如下方法进行估值：

① 估值日在证券交易所上市交易的同一股票以第(1)条确定的估值价格低于非公开发行股票初始取得成本时，应采用在证券交易所上市交易的同一股票以第(1)条确定的估值价格作为估值日该非公开发行股票的价值；

② 估值日在证券交易所上市交易的同一股票以第(1)条确定的估值价格高于非公开发行股票初始取得成本时，应按下列公式确定估值日该非公开发行股票的价值：

$$FV=C+(P-C) \times (D1-Dr)/D1$$
 (FV 为估值日该非公开发行股票的价值；C 为该非公开发行股票的初始取得成本（因权益业务导致市场价格除权时，应于除权日对其初始取得的成本作相应调整）；P 为估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价；D1 为该非公开发行股票锁定期所含的交易所的交易天数；Dr 为估值日剩余锁定期，即估值日至锁定期结束所含的交易所的交易天数，不含估值日当天。

(3) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

## 2. 债券估值方法

(1) 在证券交易所市场挂牌交易的实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日无交易的，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，以最近交易日的收盘价估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。如有充足证据表明最近交易日收盘价不能真实地反映公允价值的，应对最近交易日的收盘价进行调整，确定公允价值进行估值。

(2) 在证券交易所市场挂牌交易的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, 估值日无交易的, 但最近交易日后经济环境未发生重大变化的, 按最近交易日债券收盘价减去所含的最近交易日债券应收利息后的净价进行估值; 估值日无交易, 且最近交易日后经济环境发生了重大变化的, 将参考类似投资品种的现行市价(净价)及重大变化因素, 调整最近交易日收盘价(净价), 确定公允价值进行估值。如有充足证据表明最近交易日收盘价(净价)不能真实地反映公允价值的, 应对最近交易日的收盘价(净价)进行调整, 确定公允价值进行估值。

(3) 首次发行未上市债券采用估值技术确定的公允价值进行估值, 在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下, 按成本估值。

(4) 在银行间债券市场交易的债券根据行业协会指导的处理标准或意见并综合考虑市场成交价、市场报价、流动性及收益率曲线等因素确定其公允价值进行估值。

(5) 国家有最新规定的, 按其规定进行估值。

### 3. 权证估值方法:

#### (1) 配股权证的估值:

因持有股票而享有的配股权, 类同权证处理方式的, 采用估值技术进行估值。

#### (2) 认沽/认购权证的估值:

从持有确认日起到卖出日或行权日止, 上市交易的认沽/认购权证按估值日的收盘价估值, 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; 未上市交易的认沽/认购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的情况下, 按成本估值; 因持有股票而享有的配股权, 停止交易、但未行权的权证, 采用估值技术确定公允价值。

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

5. 本基金持有的银行存款和备付金余额以本金列示, 按相应利率逐日计提利息。

6. 在任何情况下, 基金管理人如采用上述估值方法对基金财产进行估值, 均应被认为采用了适当的估值方法。但是, 如基金管理人认为上述估值方法对基金财产进行估值不能客观反映其公允价值的, 基金管理人在综合考虑市场各因素的基础上, 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。

基金管理人、基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序以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, 发现方应及

时通知对方，以约定的方法、程序和相关法律法规的规定进行估值，以维护基金份额持有人的利益。

根据《基金法》，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，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。

7. 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。

#### 8. 特殊情形的处理

(1) 基金管理人或基金托管人按估值方法的第 6 条进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

(2) 由于不可抗力原因，或由于证券交易所及注册登记机构发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等，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。但基金管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

基金净值信息的公告方式：

(1) 本基金的基金合同生效后，在添利 B 份额上市交易前，基金管理人将至少每周公告一次基金资产净值、基金份额净值和两级基金的基金份额参考净值；

(2) 在添利 B 份额上市交易后，基金管理人将在每个交易日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露基金资产净值、基金份额净值和两级基金的基金份额参考净值；

(3) 基金管理人将公告半年度和年度最后一个市场交易日的基金资产净值、基金份额净值和两级基金的基金份额参考净值。基金管理人应当在上述市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和两级基金的基金份额参考净值登载在指定报刊和网站上；

(4) 基金托管人对添利 A 和添利 B 的基金份额参考净值、封闭期届满时基金份额净值及相关披露内容进行复核；

(5) 在本基金封闭期届满并转换为上市开放式基金（LOF）后：

在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周在指定网站披露一次基金份额净值和基金份额累计净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在不晚于每个开放日

的次日,通过指定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日的各类基金份额净值和基金份额累计净值。

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

(七)基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

1. 基金合同的变更

(1)基金合同变更内容对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的,应召集基金份额持有人大会,基金合同变更的内容应经基金份额持有人大会决议同意。

1) 终止基金合同;

2) 转换基金运作方式,但本基金封闭期届满转为上市开放式基金(LOF)除外;

3) 变更基金类别;

4) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略(法律法规、基金合同和中国证监会另有规定的除外);

5) 变更基金份额持有人大会程序;

6) 更换基金管理人、基金托管人;

7) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准,但法律法规要求提高该等报酬标准的除外;

8) 本基金与其他基金的合并;

9) 终止基金上市,但因本基金不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市的除外;

10) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项;

11) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

但出现下列情况时,可不经基金份额持有人大会决议,由基金管理人和基金托管人同意变更后公布,并报中国证监会备案:

1) 调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用;

2) 在法律法规和本基金合同规定的范围内变更基金的申购费率、赎回费率或收费方式;

3) 因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改;

4) 对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化;

5) 基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响;

6)按照法律法规或本基金合同规定不需召集基金份额持有人大会的其他情形。

(2)关于变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案,并自决议生效后依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

## 2. 基金合同的终止

有下列情形之一的,本基金合同经中国证监会核准后将终止:

(1)基金份额持有人大会决定终止的;

(2)基金管理人因解散、破产、撤销等事由,不能继续担任基金管理人的职务,而在6个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务;

(3)基金托管人因解散、破产、撤销等事由,不能继续担任基金托管人的职务,而在6个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务;

(4)法律法规、中国证监会规定的其他情况。

## 3. 基金财产的清算

(1)基金合同终止,应当按法律法规和基金合同的有关规定对基金财产进行清算。

### (2) 基金财产清算组

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

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

3)基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算组可以依法进行必要的民事活动。

### (3) 基金财产清算程序

1)基金合同终止后,由基金财产清算组统一接管基金财产;

2)基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限;

3)基金财产清算组对基金财产进行清理和确认;

(4)对基金财产进行评估和变现;

5)基金清算组做出清算报告;

6)会计师事务所对清算报告进行审计;



- 7) 律师事务所对清算报告出具法律意见书;
- 8) 将基金清算结果报告中国证监会;
- 9) 公布基金清算公告;
- 10) 对基金剩余财产进行分配。

#### (4) 清算费用

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

#### (5) 基金财产清算剩余资产的分配

若在封闭期届满前基金合同终止, 则本基金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, 根据基金合同“虚拟清算”的原则计算并确定添利 A 和添利 B 基金份额持有人分别应得的剩余资产比例, 并据此比例对添利 A 和添利 B 的基金份额持有人进行剩余基金资产的分配。

若在封闭期届满, 即本基金转为上市开放式基金 (LOF) 后基金合同终止, 则本基金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。

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

(7) 基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

#### (八) 争议的解决方式

对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议, 基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的, 任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会, 按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的, 对各方当事人均有约束力, 仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间, 基金合同当事人应恪守各自的职责, 继续忠实、勤勉、尽责

---

地履行基金合同规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本基金合同受中国法律管辖。

(九)基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

本基金合同可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、代销机构和注册登记机构办公场所查阅，但其效力应以基金合同正本为准。投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。