

---

上银基金管理有限公司

上银鑫达灵活配置混合型证券投资基金

更新招募说明书

(2022 年第 1 号)

基金管理人：上银基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

---

## 重要提示

上银鑫达灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）的募集申请已于2016年6月3日获中国证监会证监许可【2016】1202号文注册，并于2016年12月8日获中国证监会证券基金机构监管部《关于上银鑫达灵活配置混合型证券投资基金延期募集备案的回函》（机构部函[2016]3126号）的许可延期募集。本基金的基金合同于2017年3月9日正式生效。

根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》的要求，经与基金托管人协商一致，基金管理人就《上银鑫达灵活配置混合型证券投资基金基金合同》以及《上银鑫达灵活配置混合型证券投资基金托管协议》相关条款进行修订并已履行向中国证券监督管理委员会上海监管局备案流程。修订后的合同以及托管协议已于2018年3月31日进行信息披露并正式生效。

根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的要求，经与基金托管人协商一致，基金管理人就《上银鑫达灵活配置混合型证券投资基金基金合同》以及《上银鑫达灵活配置混合型证券投资基金托管协议》相关条款进行修订并已履行向中国证券监督管理委员会上海监管局备案流程。修订后的合同以及托管协议已于2020年5月23日进行信息披露并正式生效。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，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。

投资有风险，投资者认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书，全面认识本基金产品的风险收益特征，充分考虑投资者自身的风险承受能力，并对于认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为做出独立决策。基金管理人提醒投资者基金投资要承担相应风险，包括市场风险、管理风险、流动性风险、本基金的特定风险和其他风险等。本基金是混合型证券投资基金，属于具有中高预期风险和预期收益的证券投资基金品种，预期风险与预期收益高于债券型基金及货币市场基金，但低于股票型基金。基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者根据所持有的基金份额享受基金收益，同时承担相应的投资风险。

基金管理人提醒投资人注意基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策

后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。

基金的过往业绩并不预示其未来表现，基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。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资产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。

基金管理人根据基金合同及托管协议中涉及增设C类基金份额相关条款及现行法律法规，对本招募说明书的相关信息进行了更新，更新生效日为2022年5月20日。本招募说明书有关财务数据和净值表现截止日为2021年3月31日（财务数据未经审计）。

## 目 录

|                        |     |
|------------------------|-----|
| 一、绪 言 .....            | 1   |
| 二、释 义 .....            | 2   |
| 三、基金管理人 .....          | 7   |
| 四、基金托管人 .....          | 16  |
| 五、相关服务机构 .....         | 20  |
| 六、基金的募集 .....          | 30  |
| 七、基金合同的生效 .....        | 31  |
| 八、基金份额的申购与赎回 .....     | 32  |
| 九、基金的投资 .....          | 44  |
| 十、基金的业绩 .....          | 59  |
| 十一、基金的财产 .....         | 61  |
| 十二、基金资产的估值 .....       | 62  |
| 十三、基金的收益分配 .....       | 68  |
| 十四、基金的费用与税收 .....      | 70  |
| 十五、基金的会计与审计 .....      | 73  |
| 十六、基金的信息披露 .....       | 74  |
| 十七、风险揭示 .....          | 82  |
| 十八、基金的终止与清算 .....      | 88  |
| 十九、基金合同的内容摘要 .....     | 90  |
| 二十、基金托管协议的内容摘要 .....   | 91  |
| 二十一、对基金份额持有人的服务 .....  | 92  |
| 二十二、其他披露事项 .....       | 95  |
| 二十三、招募说明书存放及查阅方式 ..... | 99  |
| 二十四、备查文件 .....         | 100 |

## 一、绪 言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《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》”）、《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》”）等相关法律法规和《上银鑫达灵活配置混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”或“《基金合同》”）编写。

本招募说明书阐述了上银鑫达灵活配置混合型证券投资基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资者投资决策有关的必要事项，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据《基金合同》编写，并经中国证监会注册。《基金合同》是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依《基金合同》取得基金份额，即成为基金份额持有人和《基金合同》的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对《基金合同》的承认和接受，并按照《基金法》、《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》。

## 二、释 义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

- 1、基金或本基金：指上银鑫达灵活配置混合型证券投资基金
- 2、基金管理人：指上银基金管理有限公司
- 3、基金托管人：指兴业银行股份有限公司
- 4、基金合同或《基金合同》：指《上银鑫达灵活配置混合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《上银鑫达灵活配置混合型证券投资基金托管协议》及对该《托管协议》的任何有效修订和补充
- 6、招募说明书：指《上银鑫达灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》及其更新
- 7、基金产品资料概要：指《上银鑫达灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要》及其更新
- 8、基金份额发售公告：指《上银鑫达灵活配置混合型证券投资基金基金份额发售公告》
- 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，2012 年 12 月 28 日经第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自 2013 年 6 月 1 日起实施，并经 2015 年 4 月 24 日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修正的《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 2020 年 8 月 28 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 12、《信息披露办法》：指中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1 日实施的，并经 2020 年 3 月 20 日中国证监会《关于修改部分证券期货规章的决

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

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

14、《流动性风险管理规定》：指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订

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/或中国银行保险监督管理委员会

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

20、合格境外投资者：指符合《合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者境内证券期货投资管理办法》（包括其不时修订）及相关法律法规规定使用来自境外的资金进行境内证券期货投资的境外机构投资者，包括合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者

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

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人

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

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

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

26、登记机构：指办理登记业务的机构。基金的登记机构为上银基金管理有限公司或接受上银基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构

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

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

29、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

30、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

31、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

32、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

33、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所及相关金融期货交易所的正常交易日

34、T 日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的工作日

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

36、开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

37、开放时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

38、《业务规则》：指《上银基金管理有限公司开放式基金业务规则》，是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金登记方面的业务规则，由基金管理人 and 投资者共同遵守

39、认购：指在基金募集期内，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申

请购买基金份额的行为

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

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

42、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其他基金基金份额的行为

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

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

45、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%

46、元：指人民币元

47、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

48、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

49、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

50、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

51、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

52、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

53、摆动定价机制：是指当开放式基金遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者合法权益不受损害并得到公平对待

54、规定媒介：指符合中国证监会规定条件的用以进行信息披露的全国性报刊及《信息披露办法》规定的互联网网站（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

55、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

56、A 类基金份额：指在投资人申购时收取申购费用，且不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额

57、C 类基金份额：指从本类别基金资产中计提销售服务费，且不收取申购费用的基金份额

58、不可抗力：指本基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件。

### 三、基金管理人

#### （一）基金管理人概况

本基金管理人为上银基金管理有限公司，基本信息如下：

名称：上银基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区秀浦路 2388 号 3 幢 528 室

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 1528 号陆家嘴基金大厦 9 层

法定代表人：汪明

设立日期：2013 年 8 月 30 日

组织形式：有限责任公司

注册资本：3 亿元人民币

存续期限：持续经营

联系人：敖玲

联系电话：（021）60232799

股权结构：本公司经中国证监会证监许可[2013]1114 号文批准成立，上海银行股份有限公司持有 90%股权；中国机械工业集团有限公司持有 10%股权。

#### （二）主要人员情况

##### 1、董事会成员：

汪明先生，董事长，复旦大学经济学学士。历任上海银行公司金融部副总经理、公司金融部副总经理兼重点客户部总经理，上海银行北京分行党委委员、纪委书记、副行长，上海银行同业金融部副总经理、公司业务部总经理，上海银行浦西分行党委书记、行长。现任上海银行党委委员、副行长、浦西分行党委书记，上银基金管理有限公司董事长。

武俊先生，董事，上海财经大学会计学博士研究生。历任上海银行资金营运中心总经理助理，金融市场部副总经理，投资银行部副总经理，金融市场部副总经理兼同业部总经理，金融市场部副总经理兼同业部总经理兼上海自贸试验区分行党委委员、副行长，金融市场部副总经理（主持工作）兼同业部总经理，金融市场部总经理兼资产管理部总经理等职务。现任上海银行金融市场部总经理，上银基金管理有限公司董事。

刘小鹏先生，董事、总经理，复旦大学金融学硕士研究生、中欧国际工商学院高级工商管理硕士。历任华一银行企业融资部经理、工会主席，上海银行浦东分行行长助理、上海银行总行授信审批中心副总经理、上海银行总行风险管理部授信审批部总经理、上海银行总行营业部副总经理（总经理级）、上海银行市南分行副行长（总经理级）、党委委员及工会主席等职务。现任上银基金管理有限公司董事、总经理。

徐筱凤女士，独立董事，复旦大学经济学硕士研究生，副教授，硕士生导师。历任复旦大学讲师、复旦大学经济学院学术期刊主编及编辑部主任。现任复旦大学经济学院副教授，复旦大学经济学院院长助理，上银基金管理有限公司独立董事。

晏小江先生，独立董事，上海理工大学系统工程硕士。历任建行上海分行部门副总经理，建新银行（香港）执行董事、副行长，建行南非分行行长，建行香港分行行长，建银国际（香港）行政总裁，香港大新银行执行董事，大新银行（中国）行长，复星保德信人寿保险公司独立董事。现任上银基金管理有限公司独立董事。

李德峰先生，独立董事，中央财经大学金融学专业博士研究生。历任山东省菏泽地区林业局办公室秘书，中央财经大学金融学院教师、外国语学院副书记兼副院长、金融学院副书记，中国证券业协会教材编写与命题委员会委员、培训委员会委员。现任中央财经大学金融学院副教授、研究生导师，中央财经大学金融学院中国城乡发展与金融研究中心主任，上银基金管理有限公司独立董事。

## 2、监事：

董建红女士，监事，西安理工大学管理工程专业硕士研究生。历任中国一拖集团有限公司计划处、财务处科员、副科长、科长，一拖股份公司财务部部长、总会计师，中国一拖集团财务部部长、财务总监，中国机械工业集团有限公司金融投资事业部总监，国机财务有限责任公司监事会主席，兼任中国一拖集团财务有限责任公司董事长，洛阳银行董事；现任国机融资租赁有限公司董事长，上银基金管理有限公司监事。

廖隽女士，职工监事，本科。历任农业银行上海普陀支行职员、上海银行总行公司业务部副主管、上海银行市南分行公司部副总经理、上海银行漕河泾支行

副行长等职务。现任上银基金管理有限公司职工监事、市场营销部总监，上银瑞金资本管理有限公司监事。

### 3、总经理及其他高级管理人员

刘小鹏先生，总经理。（简历请参见上述董事会成员介绍）

王玲女士，督察长，中国人民大学会计学博士研究生。曾长期任职于深圳证券交易所和北京市星石投资管理有限公司。

唐云先生，副总经理，上海财经大学经济学硕士。历任申银万国证券股份有限公司投资银行总部项目经理、执行副总经理、执行总经理、保荐代表人，中国银河证券股份有限公司投资银行总部执行总经理、保荐代表人，上银基金管理有限公司副总经理，上银瑞金资本管理有限公司总经理等职务。

尉迟平女士，副总经理兼固定收益部总监、固收投资总监兼研究总监，上海财经大学经济学硕士。历任上海银行股份有限公司总行金融市场部债券交易部高级经理助理、高级副经理、高级经理，金融市场部外汇与贵金属部高级经理，金融市场部见习总经理助理；上银基金总经理助理等职务。

衣宏伟女士，副总经理，华东师范大学经济学硕士。历任上海银行股份有限公司总行计划财务部统计部高级经理、信息中心副总经理，总行计划财务部总经理助理兼信息中心副总经理等职务。

陈士琛先生，首席信息官，北京师范大学工学硕士。历任北京师范大学讲师，中国工商银行数据中心（北京）系统部系统工程师、测试管理部副总经理、测试三部副总经理等职务，工银瑞信基金管理有限公司信息科技部总监。

### 4、基金经理：

#### （1）现任基金经理

赵治烨先生，北京大学微电子学士。历任中国银河证券北京中关村大街营业部理财分析师。现任上银基金投资副总监、上银新兴价值成长混合型证券投资基金基金经理、上银鑫达灵活配置混合型证券投资基金基金经理、上银未来生活灵活配置混合型证券投资基金基金经理、上银可转债精选债券型证券投资基金基金经理、上银内需增长股票型证券投资基金基金经理。

陈博先生，硕士研究生。历任上银基金研究员、基金经理助理等职务。现任上银鑫达灵活配置混合型证券投资基金基金经理、上银未来生活灵活配置混合型

证券投资基金基金经理、上银丰益混合型证券投资基金基金经理。

(2) 历任基金经理

常璐先生，管理时间为 2017 年 12 月 6 日至 2018 年 3 月 28 日。

5、投资决策委员会成员：

唐云先生（副总经理、投资决策委员会主席）；

尉迟平女士（副总经理兼固定收益部总监、固收投资总监兼研究总监）；

卢扬先生（权益投研部总监、投资总监兼研究总监、基金经理）；

吴伟先生（资产配置部副总监）；

赵治烨先生（投资副总监、基金经理）；

陈旭先生（量化投资部总监兼量化投资总监、基金经理）；

高永先生（固收投资副总监、基金经理）；

胡友群女士（固收研究副总监）。

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

(三) 基金管理人的职责

1、依法募集基金，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、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。

4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益。

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告。

6、编制季度报告、中期报告和年度报告。

7、计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回价格。

8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项。

9、召集基金份额持有人大会。

10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料。

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

## 12、中国证监会规定的其他职责。

### （四）基金管理人的承诺

1、基金管理人承诺严格遵守现行有效的相关法律法规、基金合同和中国证监会的有关规定，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反现行有效的有关法律法规、基金合同和中国证监会有关规定的行为发生。

#### 2、基金管理人承诺防止下列行为发生：

- （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）法律法规或中国证监会禁止的其他行为。

3、本基金管理人承诺加强人员管理，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，不从事以下活动：

- （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资料中弄虚作假；
- （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）违反现行有效的有关法律法规、基金合同和中国证监会的有关规定，泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密和尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；
- （8）违反证券交易场所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；
- （9）贬损同行，以抬高自己；
- （10）以不正当手段谋求业务发展；
- （11）有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；
- （12）在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；

(13) 其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

#### 4、基金经理的承诺

(1) 依照有关法律法规和基金合同的规定，本着谨慎勤勉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及其代理人、受雇人或任何第三人谋取利益。

(3) 不违反现行有效的有关法律法规、基金合同和中国证监会的有关规定，泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息。

(4) 不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

#### (五) 基金管理人的内部控制制度

##### 1、内部控制的原则

(1) 健全性原则：内部控制包括公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员，并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个环节。

(2) 有效性原则：通过科学的内控手段和方法，建立合理的内控程序，维护内控制度的有效执行。

(3) 独立性原则：公司各机构、部门和岗位职责保持相对独立，公司基金资产、自有资产、其它资产的运作分离。

(4) 相互制约原则：公司内部部门和岗位的设置权责分明、相互制衡。

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

##### 2、内部控制的基本要素

内部控制的基本要素包括控制环境、风险评估、控制活动、信息沟通（报告制度）、内部监控、监督和内部监察。

###### (1) 控制环境

控制环境构成公司内部控制的基础，控制环境包括经营理念和内控文化、公司治理结构、组织结构、员工道德素质等内容。

公司管理层贯彻内控优先和风险管理理念，培养全体员工的风险防范意识，营造浓厚的内控文化氛围，确保全体员工及时了解国家法律法规和公司规章制度

度，使风险意识贯穿到公司各个部门、各个岗位和各个环节。公司全体职工必须忠于职守勤勉尽责，严格遵守国家法规和公司各项规章制度。

公司完善法人治理结构，充分发挥独立董事和监事职能，严禁不正当关联交易、利益输送和内部人控制现象的发生，保护投资者利益和公司合法权益。

公司的组织结构体现职责明确、相互制约的原则，各部门有明确的授权分工，操作相互独立。公司建立决策科学、运营规范、管理高效的运行机制，包括民主、透明的决策程序和管理议事规则，高效、严谨的业务执行系统，以及健全、有效的内部监督和反馈系统。

内部组织结构监控防线。公司依据自身经营特点设立顺序递进、权责统一、严密有效的三道监控防线，即：以岗位目标责任制为基础的第一道监控防线；相关部门、相关岗位之间相互监督制衡的第二道监控防线；以督察长和监察稽核部对各岗位、各部门、各机构、各项业务全面实施监督反馈的第三道监控防线。

公司建立有效的人力资源管理制度，健全激励约束机制，确保公司人员具备与岗位要求相适应的职业操守和专业胜任能力。

## （2）风险评估

公司建立科学严密的风险评估体系，对公司内、外部风险进行识别、评估和分析，及时防范和化解风险。

各部门根据公司风险评估标准制定、修改本部门内控制度，提交监察稽核部，监察稽核部对各部门提交的内部控制制度进行复核，提交总经理办公会审议通过后发布实施。风险管理委员会负责评估公司内、外部风险，评价公司的基本管理制度以及提出改进方案，报公司董事会。

## （3）控制活动

① 授权控制。授权控制贯穿于公司经营活动的始终，授权控制的主要内容  
包括：股东会、董事会、监事和管理层应当充分了解和履行各自的职权，建立健全公司授权标准和程序，确保授权制度的贯彻执行；公司各业务部门、分支机构和公司员工应当在规定授权范围内行使相应的职责；公司重大业务的授权应当采取书面形式，授权书应当明确授权内容和时效；公司授权要适当，对已获授权的部门和人员应建立有效的评价和反馈机制，对已不适用的授权应及时修改或取消授权。

② 资产分离控制。基金资产、特定客户资产与公司资产、不同基金的资产和其他委托资产要实行独立运作，分别核算。

③ 业务隔离控制。基金资产的运作管理与公司自有资金，与特定客户委托资产实行独立隔离运作，在人员配置、岗位职责及其内部管理制度、业务规则与流程、有关银行存款账号、证券账号等分开设置，并分开核算。

④ 岗位隔离制度。公司推行内部工作的目标管理和规范的岗位责任制，各岗位人员各司其职、严格遵守操作程序和工作标准，限制越权、穿插、代理等行为，以便于各部门明确分工、各岗位相互监督；包括货币、有价证券的保管与账务相分离，重要空白凭证的保管与使用相分离，投资决策与具体交易操作相分离，前台交易与后台结算相分离，损失的确认与核销相分离，风险评定人员与业务办理岗位相分离，基金经理与办理特定客户资产管理业务的投资经理岗位相分离等。

⑤ 物理隔离制度。对于不同工作区划分不同的保密级别，基金投资、交易、研究、公司自有资金管理等相关部门，在空间上和制度上适当隔离。强调交易部门和财务部门的一级保密性，实行严格的门禁制度，并相应建立安全保障设施；对因业务需要知悉内幕信息的人员，制定严格的批准程序、保密守则和监督处罚措施。

⑥ 危机处理机制。公司制订切实有效的紧急情况处理制度，建立危机处理机制和程序，主要包括：紧急情况处理制度、灾难复原计划、资料备份和系统备份措施。灾难复原计划需要随着业务的改变而更新，每年测试及演习一次。

#### （4）信息沟通

为维护信息沟通渠道的畅通，建立清晰的报告机制，公司制定管理和业务报告制度，包括定期报告制度和临时报告制度。定期报告按照每日、每周、每月、每季度等不同的时间、频次进行报告。临时报告是指一旦出现报告事由后的及时报告。此外，公司制定针对违规及非法行为的举报机制。员工发现违规或非法行为出现时可视情况越级报告。

#### （5）内部监控

公司建立有效的内部监控制度，设置督察长和监察稽核部，对公司内部控制制度的执行情况进行持续的监督，保证内部控制制度落实。

公司定期评价内部控制的有效性，根据市场环境和新的法律法规等情况，适时改进。

#### （6）监督和内部监察

公司严格贯彻基金管理相关的法律法规，严格依法经营。督察长和监察稽核部负责确保公司运作和各项业务符合法律法规的要求。

各部门规章制度及对外提交材料在实施或提交前，均需经监察稽核部进行合法、合规审核；

督察长和监察稽核部负责监察各部门对法律法规、公司规章制度、基金合同的执行情况，着重于因违反法律法规等而产生的风险；

监察稽核部负责跟踪法律法规的变化和更新，对业务部门的运作提供监察标准和政策等方面的咨询及指引，提供监察方面的培训。

### 3、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变化及公司的发展不断完善内部控制制度。

## 四、基金托管人

### （一）基金托管人概况

#### 1、基本情况

名称：兴业银行股份有限公司（以下简称“兴业银行”）

注册地址：福州市湖东路 154 号

办公地址：上海市银城路 167 号

法定代表人：吕家进

成立时间：1988 年 8 月 22 日

批准设立机关和批准设立文号：中国人民银行总行，银复（1988）347 号

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基金字[2005]74 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：207.74 亿元人民币

存续期间：持续经营

#### 2、发展概况及财务状况

兴业银行成立于 1988 年 8 月，是经国务院、中国人民银行批准成立的首批股份制商业银行之一，总行设在福建省福州市，2007 年 2 月 5 日正式在上海证券交易所挂牌上市（股票代码：601166），注册资本 207.74 亿元。

开业二十多年来，兴业银行始终坚持“真诚服务，相伴成长”的经营理念，致力于为客户提供全面、优质、高效的金融服务。截至 2018 年 12 月 31 日，兴业银行资产总额达 6.71 万亿元，实现营业收入 1582.87 亿元，全年实现归属于母公司股东的净利润 606.20 亿元。

#### 3、托管业务部的部门设置及员工情况

兴业银行股份有限公司总行设资产托管部，下设综合管理处、市场处、委托资产管理处、产品管理处、稽核监察处、运行管理处、养老金管理中心等处室，共有员工 100 余人，业务岗位人员均具有基金从业资格。

#### 4、基金托管业务经营情况

兴业银行股份有限公司于 2005 年 4 月 26 日取得基金托管资格。基金托管业务批准文号：证监基金字[2005]74 号。截至 2020 年 3 月 31 日，我行共托管证券投资基金 293 只，托管基金的基金资产净值合计 13616.94 亿元，基金份额合计

13270.30 亿份。

## （二）基金托管人的内部控制制度

### 1、内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金资产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

### 2、内部控制组织结构

兴业银行基金托管业务内部风险控制组织结构由兴业银行风险管理部、法律与合规部、审计部、资产托管部内设稽核监察处及资产托管部各业务处室共同组成。总行风险管理部、法律与合规部、审计部对托管业务风险控制工作进行指导和监督；资产托管部内设独立、专职的稽核监察处，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，具有独立行使监督稽核工作职权和能力。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

### 3、内部控制原则

（1）全面性原则：风险控制必须覆盖基金托管部的所有处室和岗位，渗透各项业务过程和业务环节；风险控制责任应落实到每一业务部门和业务岗位，每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责。

（2）独立性原则：资产托管部设立独立的稽核监察处，该处室保持高度的独立性和权威性，负责对托管业务风险控制工作进行指导和监督。

（3）相互制约原则：各处室在内部组织结构的设计上要形成一种相互制约的机制，建立不同岗位之间的制衡体系。

（4）定性和定量相结合原则：建立完备的风险管理指标体系，使风险管理更具客观性和操作性。

（5）防火墙原则：托管部自身财务与基金财务严格分开；托管业务日常操作部门与行政、研发和营销等部门严格分离。

（6）有效性原则。内部控制体系同所处的环境相适应，以合理的成本实现内控目标，内部制度的制订应当具有前瞻性，并应当根据国家政策、法律及经营

管理的需要，适时进行相应修改和完善；内部控制应当具有高度的权威性，任何人不得拥有不受内部控制约束的权力，内部控制存在的问题应当能够得到及时反馈和纠正；

（7）审慎性原则。内控与风险管理必须以防范风险，审慎经营，保证托管资产的安全与完整为出发点；托管业务经营管理必须按照“内控优先”的原则，在新设机构或新增业务时，做到先期完成相关制度建设；

（8）责任追究原则。各业务环节都应有明确的责任人，并按规定对违反制度的直接责任人以及对负有领导责任的主管领导进行问责。

#### 4、内部控制制度及措施

（1）制度建设：建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度。

（2）建立健全的组织管理结构：前后台分离，不同部门、岗位相互牵制。

（3）风险识别与评估：稽核监察处指导业务处室进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施。

（4）相对独立的业务操作空间：业务操作区相对独立，实施门禁管理和音像监控。

（5）人员管理：进行定期的业务与职业道德培训，使员工树立风险防范与控制理念，并签订承诺书。

（6）应急预案：制定完备的《应急预案》，并组织员工定期演练；建立异地灾备中心，保证业务不中断。

#### （三）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

基金托管人负有对基金管理人的投资运作行使监督权的职责。根据《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定，托管人对基金的投资对象和范围、投资组合比例、投资限制、费用的计提和支付方式、基金会计核算、基金资产估值和基金净值的计算、收益分配、申购赎回以及其他有关基金投资和运作的事项，对基金管理人进行业务监督、核查。

基金托管人发现基金管理人违反《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。

基金托管人发现基金管理人有关重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时，通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。

基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。

## 五、相关服务机构

### （一）基金份额发售机构

#### 1、直销机构

##### （1）上银基金管理有限公司直销中心

地址：上海市浦东新区世纪大道 1528 号陆家嘴基金大厦 9 层

电话：（021）60232799

传真：（021）60232794

客服电话：（021）60231999

联系人：敖玲

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

#### 2、代销机构

本基金 A 类基金份额的代销机构：

##### （1）兴业银行股份有限公司

住所：福州市湖东路 154 号中山大厦

办公地址：上海市银城路 167 号

法定代表人：吕家进

电话：（021）52629999

联系人：李博

客服电话：95561

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

##### （2）上海银行股份有限公司

住所：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

电话：（021）68475888

传真：（021）68476111

联系人：王笑

客服电话：95594

公司网址：[www.bankofshanghai.com](http://www.bankofshanghai.com)

(3) 招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

办公地址：广东省深圳市深南大道 7088 号招银大厦 8 层

法定代表人：李建红

客服电话：95555

传真：0755-83195049

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

(4) 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：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：高国富

客服电话：95528

电话：021-61618888

传真：021-63604199

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

(5) 申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号世纪商贸广场 45 楼

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号世纪商贸广场 45 楼

法定代表人：李梅

电话：021-33389888

传真：021-33388224

联系人：黄莹

客服电话：95523、4008895523

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

(6) 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号

办公地址：上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903-906 室

法定代表人：杨文斌

电话：(021) 20613999

传真：(021) 68596919

联系人：王诗筠

客服电话：400-700-9665

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

（7）上海陆金所基金销售有限公司

住所：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 15 楼

法定代表人：胡学勤

电话：（021）20665952

传真：（021）22066653

联系人：程晨

客服电话：4008219031

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

（8）浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市文二西路 1 号元茂大厦 903

办公地址：浙江省杭州市西湖区翠柏路 7 号电子商务产业园 2 号楼 2 楼

法定代表人：凌顺平

联系人：李珍珍

电话：0571-88911818

传真：0571-86800423

客户服务电话：4008773772

官方网站（爱基金网）：[www.5ifund.com](http://www.5ifund.com)

（9）上海万得基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

办公地址：上海市浦东新区福山路 33 号 8 楼

法定代表人：王廷富

联系人：沈杰

电话：021-51327185

传真：021-50710161

客服电话：4008210203

（10）上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号东方财富大厦

法定代表人：其实

联系人：朱玉

电话：021-54509977

传真：021-54509981

客服电话：95021/4001818188

网址：[www.1234567.com.cn](http://www.1234567.com.cn)

（11）上海基煜基金销售有限公司

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

办公地址：上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 1503 室

法定代表人：王翔

联系人：吴鸿飞

电话：021-65370077

传真：021-55085991

客服电话：400-820-5369

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

（12）中泰证券股份有限公司

注册地址：山东省济南市市中区经七路 86 号

办公地址：上海市浦东新区花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 18 层

法定代表人：李玮

联系人：许曼华

电话：021-20315290

传真：021-20315137

客服电话：95538

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

（13）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文一西路 1218 号 1 栋 202 室

办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路 18 号黄龙时代广场

法定代表人：陈柏青

办公电话：0571-26888888

传真：0571-22905999

客服电话：4000766123

网址：[www.fund123.cn](http://www.fund123.cn)

（14）上海利得基金销售有限公司

注册地址：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室

办公地址：上海市浦东新区峨山路 91 弄 61 号 14 楼

法定代表人：李兴春

联系人：陈孜明

电话：021-61101796

传真：021-50583633

客服电话：4008210203

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

（15）江苏汇林保大基金销售有限公司

注册地址：南京市高淳区经济开发区古檀大道 47 号

办公地址：上海市黄浦区龙华东路 868 号绿地海外滩办公 A

法定代表人：吴言林

联系人：孙平

传 真：025-56663409

客服电话：025-66046166

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

（16）上海联泰基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室

办公地址：上海市长宁区福泉北路 518 号 8 号楼 3 层

法定代表人：燕斌

联系人：兰敏

电话：021-52822063

传真：021-52975270

客服电话：400-118-1188

网址: [www.66zichan.cn](http://www.66zichan.cn)

(17) 南京苏宁基金销售有限公司

注册地址: 江苏省南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

办公地址: 江苏省南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

法定代表人: 王锋

联系人: 冯鹏鹏

电话: 025-66996699

传真: 025-66996699

客服电话: 95177

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

(18) 北京汇成基金销售有限公司

注册地址: 北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108 号

办公地址: 北京市西城区西直门外大街 1 号院 2 号楼 19 层 19C13

法定代表人: 王伟刚

联系人: 宋子琪

电话: 010-62680527

传真: 010-62680827

客服电话: 400-619-9059

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

(19) 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

联系人: 戴珉微

电话: 021-33635338

传真: 021-33635338-201

客服电话: 021-33635338

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

(20) 民商基金销售(上海)有限公司

注册地址: 上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区(东座)6 楼 A31 室

办公地址：上海市浦东新区张杨路 707 号生命人寿大厦 32 楼

法定代表人：贲惠琴

联系人：林志枫

电话：021-50206003

传真：021-50206001

客服电话：021-50206003

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

（21）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路 1 号保利国际广场南塔 1201-1203 室

法定代表人：肖雯

电话：020-89629099

传真：020-89629011

联系人：王宇昕

客服电话：020-89629066

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

（22）京东肯特瑞基金销售有限公司

住所：北京市海淀区西三旗建材城中路 12 号 17 号平房 157

办公地址：北京市亦庄区经济技术开发区京东大厦 A 座 17 层

法定代表人：王苏宁

电话：95118

传真：010-89188000

联系人：李丹

客服电话：400 098 8511

网址：<http://kenterui.jd.com>

（23）北京度小满基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区西北旺东路 10 号院西区 4 号楼 1 层 103 室

办公地址：北京市海淀区西北旺东路 10 号院西区 4 号楼

法定代表人：葛新

电话：010-59403028

传真：010-59403027

客服电话：95055-4

联系人：宋刚

网址：www.baiyingfund.com

（24）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：任德奇

电话：021-58781234

传真：021-58408483

客服电话：95559

网址：www.bankcomm.com

（25）诺亚正行基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

办公地址：上海市杨浦区长阳路 1687 号 2 号楼

法定代表人：汪静波

电话：400-821-5399

传真：80358749

客服电话：400-821-5399

联系人：谭静怡

网址：www.noah-fund.com

（26）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 号陆家嘴金融服务广场二期 11 层

法定代表人：张跃伟

电话：021-20691935

传真：021-20691861

联系人：刘畅

客服电话：4008202899

网址：www.erichfund.com

（27）大连网金基金销售有限公司

注册地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号诺德大厦 2 层 202 室

办公地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号诺德大厦 2 层 202 室

法定代表人：樊怀东

办公电话：0411—39027807

客服电话：4000-899-100

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

（28）北京蛋卷基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区创远路 34 号院 6 号楼 15 层 1501 室

办公地址：北京市朝阳区创远路 34 号院融新科技中心 C 座 17 层

法定代表人：钟斐斐

电话：010-61840688

传真：010-84997571

客服电话：4001599288

联系人：王悦

网址：<https://danjuanapp.com/>

（29）宁波银行股份有限公司

注册地址：浙江省宁波市鄞州区宁东路 345 号

办公地址：浙江省宁波市鄞州区宁东路 345 号

法定代表人：陆华裕

传真：0574-81899111

客服电话：95574

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

基金管理人可以根据相关法律法规要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并在基金管理人网站公示。

本基金 C 类基金份额暂无代销机构。如有其他销售机构新增办理本基金 C 类份额的申购赎回等业务，请以本公司届时发布的相关业务公告或本公司网站公示为准。

（二）登记机构

名称：上银基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区秀浦路 2388 号 3 幢 528 室

地址：上海市浦东新区世纪大道 1528 号陆家嘴基金大厦 9 层

电话：（021）60232799

传真：（021）60232779

客服电话：（021）60231999

联系人：刘漠

网址：www.boscam.com.cn

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称：远闻（上海）律师事务所

办公地址：上海市浦东新区浦电路 438 号双鸽大厦 18G

负责人：奚正辉

电话：（021）50366223

传真：（021）50366733

联系人：孙贤

经办律师：屠颢、孙贤

（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（特殊普通合伙）

住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 507  
单元 01 室

办公地址：上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11  
楼

法定代表人：李丹

电话：（021）23238888

联系人：陈轶杰

经办注册会计师：薛竞、陈轶杰

## 六、基金的募集

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定，并经中国证监会证监许可[2016]1202号文注册募集、中国证监会机构部函【2016】3126号文延期募集。募集期为2017年2月3日至2017年3月3日。

经毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）验资，募集的净认购金额为389,906,375.05元人民币。募集有效认购总户数为4,423户，按照每份基金份额1.00元计算，设立期间募集的有效总份额为389,906,375.05份基金份额。利息结转的基金份额为56,843.41份基金份额。两项合计共389,963,218.46份基金份额，已全部计入投资人基金账户，归投资人所有。

## 七、基金合同的生效

### （一）基金备案的条件

本基金基金合同已于 2017 年 3 月 9 日正式生效。

### （二）基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

《基金合同》生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。法律法规另有规定时，从其规定。

## 八、基金份额的申购与赎回

### （一）申购与赎回场所

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

### （二）申购与赎回的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

基金合同生效后，若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

#### 2、申购、赎回开始日及业务办理时间

基金管理人自基金合同生效之日起不超过3个月内开始办理申购，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。

基金管理人自基金合同生效之日起不超过3个月内开始办理赎回，具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。

在确定申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告申购与赎回的开始时间。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的，其基金份额申购、赎回价格为下一开放日该类基金份额申购、赎回的价格。

### （三）申购与赎回的原则

#### 1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的该类基金

份额净值为准进行计算；

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；

4、赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人认购、申购的先后次序进行顺序赎回。

5、基金管理人有权决定本基金的总规模限额和单个基金份额持有人持有本基金的最高限额，但应最迟在新的限额实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

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

#### （四）申购与赎回的程序

##### 1、申购和赎回的申请方式

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

##### 2、申购和赎回的款项支付

投资人申购基金份额时，必须在规定的时间内全额交付申购款项，否则所提交的申购申请无效。投资者在提交赎回申请时须持有足够的基金份额，否则所提交的赎回申请无效。投资人交付申购款项，申购成立；登记机构确认基金份额时，申购生效。

基金份额持有人在规定的时间内提交赎回申请，赎回成立；登记机构确认赎回时，赎回生效。投资人赎回申请成功后，基金管理人将在 T+7 日（包括该日）内支付赎回款项。遇交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、数据交换系统故障或其它非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程，则赎回款顺延至上述情形消除后的下一个工作日划往投资者银行账户。在发生巨额赎回时或本基金合同载明的其他暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付办法参照本基金合同有关条款处理。

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

定媒介上公告。

### 3、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日（T 日），在正常情况下，本基金登记机构在 T+1 日内对该交易的有效性进行确认。T 日提交的有效申请，投资人可在 T+2 日后（包括该日）到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功，则申购款项退还给投资人。

销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申购、赎回申请。申购、赎回的确认以登记机构的确认结果为准。对于申购申请及申购份额的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利。

### （五）申购与赎回的数量限制

（1）本基金在代销网点申购以金额申请，单笔最低申购金额为 1 元（含认购费），追加申购的最低金额为 1 元，累计申购金额不设上限。各代销机构对最低申购限额及投资金额级差有其他规定的，以各代销机构的业务规定为准。在直销机构（柜台方式）申购的最低金额为 1 元（含申购费），追加申购的最低金额为 1 元，累计申购金额不设上限。基金管理人可根据市场状况和投资者需求调整直销机构（柜台方式）的最低申购标准。已有认购本基金记录的投资者不受首次申购最低金额的限制，但受追加申购最低金额的限制。

投资人可多次申购，对单个投资人累计持有份额不设上限限制。法律法规、中国证监会另有规定的除外。

（2）基金份额持有人在销售机构赎回时，每笔赎回申请不得低于 1 份基金份额；基金份额持有人赎回时或赎回后将导致在销售机构（网点）保留的基金份额余额不足 1 份的，需一并全部赎回。

（3）本基金基金份额持有人每个交易账户的最低份额余额为 1 份。基金份额持有人因赎回、转换等原因导致其单个基金账户内剩余的基金份额低于 1 份时，注册登记系统可对该剩余的基金份额自动进行强制赎回处理。

（4）基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定

在规定媒介上公告。

(5) 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。具体见基金管理人相关公告。

#### (六) 申购费用和赎回费用

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

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

#### 3、申购费用

本基金在投资人申购 A 类基金份额时收取申购费，C 类基金份额不收取申购费用。A 类基金份额的申购费率如下：

| 申购金额 (M)            | 费率            |
|---------------------|---------------|
| M < 50 万元           | 1.2%          |
| 50 万元 ≤ M < 100 万元  | 0.8%          |
| 100 万元 ≤ M < 500 万元 | 0.4%          |
| M ≥ 500 万元          | 按笔收取每笔 1000 元 |

#### 4、赎回费用

(1) 本基金 A 类基金份额对持续持有期少于 7 日的投资人收取 1.50% 的赎回费，对持续持有期少于 30 日的投资人收取 0.75% 的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产；对持续持有期长于 30 日但少于 3 个月的投资人收取 0.5% 的赎回费，并将赎回费总额的 75% 计入基金财产；对持续持有期长于 3 个月但少于 6 个月的投资人收取 0.5% 的赎回费，并将赎回费总额的 50% 计入基金财产；对持续持有期长于 6 个月的投资人，不收取赎回费。A 类基金份额的赎回费率如下：

| 持有期限 (N)        | 赎回费率  |
|-----------------|-------|
| N < 7 日         | 1.50% |
| 7 日 ≤ N < 30 日  | 0.75% |
| 30 日 ≤ N < 6 个月 | 0.50% |
| N ≥ 6 个月        | 0     |

(2) 本基金 C 类基金份额对于持续持有期少于 30 日的基金份额持有人收

取赎回费，赎回费用全额计入基金财产。C 类基金份额的赎回费率最高不超过 1.50%，且随基金份额的持有期限的增加而递减。C 类基金份额的赎回费率如下：

| 持有期限（N）    | 赎回费率  |
|------------|-------|
| N<7 日      | 1.50% |
| 7 日≤N<30 日 | 0.50% |
| N≥30 日     | 0.00% |

5、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》的有关规定在规定媒介上公告。

6、基金管理人及其他销售机构可以根据市场情况对基金销售费用实行一定的优惠，并履行必要的报备和信息披露手续。

7、当基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性，基金管理人须在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

#### （七）申购份额与赎回金额的计算

##### 1、申购份额的计算：

##### （1）申购 A 类基金份额的计算：

申购的有效份额为净申购金额除以当日的 A 类基金份额净值，有效份额单位为份，其中：

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} / (1 + \text{申购费率})$$

（注：对于适用固定金额申购费的认购，净申购金额 = 申购金额 - 固定申购费金额）

$$\text{申购费用} = \text{申购金额} - \text{净申购金额}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{T 日 A 类基金份额净值}$$

上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

例：某投资者投资 5,000 元申购本基金 A 类基金份额，对应费率为 1.2%，假设申购当日 A 类基金份额净值为 1.1283 元，则其可得到的 A 类基金份额为：

$$\text{净申购金额} = 5,000 / (1 + 1.2\%) = 4,940.71 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 5,000 - 4,940.71 = 59.29 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 4,940.71 / 1.1283 = 4,378.90 \text{ 份}$$

即：该投资人投资 5,000 元申购本基金 A 类基金份额，假设申购当日 A 类基金份额净值为 1.1283 元，则可得到 4,378.90 份 A 类基金份额。

(2) 申购 C 类基金份额的计算：

申购份额=申购金额/T 日 C 类基金份额净值

上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

例：某投资者投资 5,000 元申购本基金 C 类基金份额，假设申购当日 C 类基金份额净值为 1.1283 元，则可得到的 C 类基金份额为：

申购份额=5,000/1.1283=4,431.45 份

即：该投资人投资 5,000 元申购本基金 C 类基金份额，假设申购当日 C 类基金份额净值为 1.1283 元，可得到 4,431.45 份 C 类基金份额。

2、本基金赎回金额的计算：

赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日该类基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元，计算公式：

赎回总金额=赎回份额×T 日该类基金份额净值

赎回费用=赎回总金额×赎回费率

净赎回金额=赎回总金额-赎回费用

上述计算结果均按四舍五入，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

例：某基金份额持有人持有本基金 10,000 份 A 类基金份额 2 个月后（未满 6 个月）决定赎回，对应的赎回费率为 0.5%，假设赎回当日 A 类基金份额净值是 1.1486 元，则可得到的净赎回金额为：

赎回总金额=10,000×1.1486=11,486 元

赎回费用=11,486×0.5%=57.43 元

净赎回金额=11,486-57.43=11,428.57 元

即：该基金份额持有人持有 10,000 份本基金 A 类基金份额 2 个月后（未满 6 个月）赎回，假设赎回当日本基金 A 类基金份额净值是 1.1486 元，则可得到的净赎回金额为 11,428.57 元。

例：某基金份额持有人赎回 10 万份 C 类基金份额，份额持有期限为 30 日，

对应赎回费率为 0%，假设赎回当日 C 类基金份额净值是 1.1000 元，则其可得到的净赎回金额为：

$$\text{赎回金额} = 100,000.00 \times 1.1000 = 110,000.00 \text{ 元}$$

$$\text{赎回费用} = 110,000.00 \times 0.00\% = 0.00 \text{ 元}$$

$$\text{净赎回金额} = 110,000.00 - 0.00 = 110,000.00 \text{ 元}$$

即：该基金份额持有人赎回 10 万份 C 类基金份额，份额持有期限为 30 日，对应赎回费率为 0.00%，假设赎回当日 C 类基金份额净值是 1.1000 元，则其可得到的净赎回金额为 110,000.00 元。

### 3、本基金基金份额净值的计算：

本基金分为 A 类和 C 类基金份额，两类基金份额单独设置基金代码，分别计算和公告基金份额净值。本基金各类基金份额净值的计算，均保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T 日的各类基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

### （八）申购和赎回的登记

投资者申购基金成功后，登记机构在 T+1 日为投资者登记权益并办理登记手续，投资者自 T+2 日（含该日）后有权赎回该部分基金份额。

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

基金管理人可以在法律法规允许的范围内，对上述登记办理时间进行调整，但不得实质影响投资者的合法权益，并最迟于开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

### （九）拒绝或暂停申购的情形及处理方式

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

- 1、因不可抗力导致基金无法正常运作。
- 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。

3、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。

4、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。

5、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。

6、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。

7、基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术故障等异常情况导致基金销售系统或基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。

8、申请超过基金管理人设定的基金总规模、单日净申购比例上限、单个投资人单日或单笔申购金额上限的。

9、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。

10、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第 1、2、3、5、6、7、8、9、10 项暂停申购情形时，基金管理人应当根据有关规定在规定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项本金将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

#### （十）暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。

3、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金赎回申请或延缓支付赎回款项。

4、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。

5、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

6、若继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时，可暂停接受投资人的赎回申请。

7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述 1、2、3、4、6、7 情形之一且基金管理人决定暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付，并以后续开放日的基金份额净值为依据计算赎回金额。若出现上述第 5 项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

#### （十一）巨额赎回的情形及处理方式

##### 1、巨额赎回的认定

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

##### 2、巨额赎回的处理方式

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

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

（2）部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额 10% 的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回

申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的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。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

当基金发生巨额赎回，在单个基金份额持有人超过基金总份额 20%以上的赎回申请情形下，基金管理人应当延期办理赎回申请。基金管理人只接受其小于等于基金总份额 20%部分作为当日有效赎回申请，对于该基金份额持有人当日有效赎回申请，基金管理人可以根据前述“（1）全额赎回”或“（2）部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。对单个基金份额持有人超过基金总份额 20%以上的赎回申请延期赎回。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。延期部分如选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

（3）暂停赎回：连续 2 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，并应当在规定媒介上进行公告。

### 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 日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在规定媒介上刊登公告。

## （十二）暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

1、发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人应在规定期限内在规定媒介上刊登公告。

2、如发生暂停的时间为 1 日，基金管理人应于重新开放日，在规定媒介上

刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近一个开放日的各类基金份额净值。

3、如果发生暂停的时间超过1日，基金管理人可以根据暂停申购或赎回的时间，依照《信息披露办法》的有关规定，最迟于重新开放日在规定媒介上刊登重新开放申购或赎回的公告，或根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间，届时可不再另行发布重新开放的公告。

### （十三）基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及本基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换业务，基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及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。

### （十四）基金的非交易过户

基金的非交易过户是指基金登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资人。

继承是指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；捐赠指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体；司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供基金登记机构要求提供的相关资料，对于符合条件的非交易过户申请按基金登记机构的规定办理，并按基金登记机构规定的标准收费。

### （十五）基金的转托管

基金份额持有人可办理已持有基金份额在不同销售机构之间的转托管，基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。

#### （十六）定期定额投资计划

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

#### （十七）基金的冻结和解冻与质押

基金登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻，以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益按照我国法律法规、监管规章以及国家有权机关的要求来决定是否冻结。在国家有权机关作出决定之前，被冻结部分产生的权益先行一并冻结。被冻结部分份额仍然参与收益分配。

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

#### （十八）基金份额的转让

在法律法规允许且条件具备的情况下，基金管理人可受理基金份额持有人通过中国证监会认可的交易场所或者交易方式进行份额转让的申请并由登记机构办理基金份额的过户登记。基金管理人拟受理基金份额转让业务的，将提前公告，基金份额持有人应根据基金管理人公告的业务规则办理基金份额转让业务。

## 九、基金的投资

### （一）投资目标

本基金通过灵活运用股票与债券等资产配置策略，充分挖掘和利用各大类资产潜在的投资机会，追求基金资产长期稳定增值。

### （二）投资理念

本基金坚持价值投资理念，深入挖掘大类资产的投资价值，动态把握大类资产之间的适度配置，实现基金资产的长期持续稳定增长。

### （三）投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转债（含可分离交易可转换债券）、次级债、短期融资券、中期票据、中小企业私募债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货、国债期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为 0% - 95%，权证投资占基金资产净值的比例为 0% - 3%，每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金将根据基金管理人的净资本规模，以及本基金的投资风格和流动性特点，兼顾基金投资的安全性、流动性和收益性，合理控制基金投资流通受限证券的比例。

如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。

#### （四）投资策略

本基金的投资策略包括类别资产配置策略、股票精选策略、折价与套利策略、债券投资策略等。

##### 1、资产配置策略

本基金通过定性与定量研究相结合的方法，确定投资组合中权益类资产和固定收益类资产的配置比例。

本基金通过动态跟踪海内外主要经济体的 GDP、CPI、利率等宏观经济指标，以及估值水平、盈利预期、流动性、投资者心态等市场指标，确定未来市场变动趋势。本基金通过全面评估上述各种关键指标的变动趋势，对股票、债券等大类资产的风险和收益特征进行预测。根据上述定性和定量指标的分析结果，运用资产配置优化模型，在目标收益条件下，追求风险最小化目标，最终确定各大类资产投资权重，实现资产合理配置。

##### 2、股票投资策略

本基金股票投资采用“自上而下”与“自下而上”相结合的研究方法，利用基金管理人投资研究团队的资源，对企业内在价值进行深入细致的分析，并进一步挖掘出价格低估、质地优良、未来成长性良好的上市公司股票进行投资。采用实地调研、案头研究以及电话访谈等多种方式对上市公司进行调研，寻找备选企业能够在所处行业生存并不断发展的根本驱动要素，从而为研究员进行业绩预测和估值提供依据。股票研究的过程及框架如下：

###### （1）案头研究，具体又分为：

1）行业研究：公司所处行业的发展空间、所处的周期阶段、行业内的竞争结构分析；

2）公司研究：分析内容包括公司历史沿革、定期财务报表、竞争劣势、核心竞争力、核心管理团队、以及公司治理。案头研究一般会产生调研提纲以及初步的估值模型，作为下一步研究的基础。

（2）实地调研，包括对公司核心管理团队的拜访，对公司生产车间的实地调研，对上下游环节以及竞争对手的调研。

（3）估值模型的完善，通过调研对核心假设进行修正，从而获得对公司价值的全面认识并在日后的跟踪中不断完善。

具体来讲，基金管理人采用如下方法对股票进行评估：

(1) 主要财务评估：

1) ROE 质量分析

ROE 是全面分析公司业绩的起点和根本，它表明管理层运用公司股东投入的资金创造收益的好坏程度。从长期看，公司股票价值取决于公司 ROE 与公司权益资本成本之间的关系。ROE 分析也有助于权衡提高未来盈利的途径。如果缺乏有效的进入壁垒，持续超常的盈利能力将引进竞争。偏离“正常”水平一般有两个原因：一是行业环境和竞争战略促使公司至少在短期内创造出正的超常（或负的超常）经济收益，一是会计造成的歪曲。

ROE 传统上可以分解为资产收益率（ROA）和一个财务杠杆衡量指标，如下所示：

$$ROE = ROA \times \text{财务杠杆} = (\text{净资产} / \text{资产}) \times (\text{资产} / \text{股东权益})$$

$$ROA = (\text{净收益} / \text{销售收入}) \times (\text{销售收入} / \text{资产}) = \text{销售净利率} \times \text{资产周转率}$$

尽管上述方法在分解公司 ROE 时被普遍使用，但它也有一些局限性。有时我们采用替代方法分解 ROE：

$$\begin{aligned} ROE &= (\text{税后净营业利润} / \text{股东权益}) - (\text{税后净利息费用} / \text{股东权益}) \\ &= (\text{税后净营业利润} / \text{净资产}) \times [1 + (\text{净债务} / \text{股东权益})] - (\text{税后净利息费用} / \text{净债务}) \times (\text{净债务} / \text{股东权益}) \\ &= \text{营业资产收益率} + (\text{营业资产收益率} - \text{税后实际利息率}) \times \text{净财务杠杆} \end{aligned}$$

2) EPS 增长质量分析

这里主要考虑 EPS 增长的质量和可持续性，同时判断增长的原因与公司战略的吻合度，由于中小企业的业绩基数比较低，判断每股收益的增长质量尤为重要。通过分解损益表的成份，量化归因分析不同因子对个股利润的影响程度，经过实证验证，研究 EPS 增长需要考虑的因素包括：主营销售增长，毛利率变动，其他利润增长，三项费用变动，非营业利润增长情况，税率变动情况，经营活动现金流量变化等。

3) 估值与市场预期分析

基金管理人使用逆向思维来考察市场价格反映了企业多少成长性，然后通

过基本面来判断这种成长性是否合理。另外的估值手段是通过历史和目前 ROE 与市场认为的 P/B, P/E 比较来发现定价缺陷与机会。

#### 4) 企业特质分析

企业特质指企业的一些重要特性, 对股票性质起到了决定性作用, 比如收益变化幅度大的公司其股票价格波动也较大。通过实证分析, 我们考虑以下几个因素:

A. 企业规模: 采用 BV, CAP 和总资产。一般说来, 考察成长型企业, 规模也是一个有价值的参考指标。

B. 杠杆比率: 一般说来, 财务杠杆越高, 运营杠杆越高, 股票波动越大。

C. 成长性: 采用收入的增长和利润的增长。

D. 股利: 采用支付比率与股利率, 一般来说, 企业成长初期, 股利支付不是一个关键因素。

E. 收益的变化性: 采用利润、收入与每股经营现金流的变化性, 一般来说, 业绩波动越大, 股票价格波动越大。

F. 业务分布: 采用市场分布、产品分布和行业分布数据。

G. 生产力: 采用折旧 / 收入和资本支出 / 收入数据。

#### 5) 财务健康度分析

通过研究财务数据, 来判别企业风险, 数据采用三年财务报告数据; 指标选择选取反映公司收益、市场比率、成长、效率和风险的五大类指标。

#### (2) 价值评估

研究员通过上述财务指标分析、结合定性方法, 分析公司盈利稳固性, 判断相对投资价值。主要指标包括: EV/EBITDA、EV/Sales、P/E、P/B、P/RNAV、股息率、ROE、经营利润率和净利润率等。

(3) 成长性评估。主要基于收入、EBITDA、净利润等的预期增长率来评价公司盈利的持续增长前景。

(4) 现金流预测。通过对影响公司现金流各因素的前瞻性估计, 得到公司未来自由现金流量。进而通过现金流贴现模型进行估值。买入估值更具吸引力的股票, 卖出估值吸引力下降的股票, 构建股票投资组合, 并对其进行调整。

### 3、债券投资策略

### （1）平均久期配置

本基金通过对宏观经济形势和宏观经济政策进行分析，预测未来的利率趋势，并据此积极调整债券组合的平均久期，在控制债券组合风险的基础上提高组合收益。当预期市场利率上升时，本基金将缩短债券投资组合久期，以规避债券价格下跌的风险。当预期市场利率下降时，本基金将拉长债券投资组合久期，以更大程度的获取债券价格上涨带来的价差收益。

### （2）期限结构配置

结合对宏观经济形势和政策的判断，运用统计和数量分析技术，本基金对债券市场收益率曲线的期限结构进行分析，预测收益率曲线的变化趋势，制定组合的期限结构配置策略。在预期收益率曲线趋向平坦化时，本基金将采取哑铃型策略，重点配置收益率曲线的两端。当预期收益率曲线趋向陡峭化时，采取子弹型策略，重点配置收益率曲线中部。当预期收益率曲线不变或平行移动时，则采取梯形策略，债券投资资产在各期限间平均配置。

### （3）类属配置

本基金对不同类型债券的信用风险、流动性、税赋水平等因素进行分析，研究同期限的国债、金融债、央票、企业债、公司债、短期融资券之间的利差和变化趋势，制定债券类属配置策略，确定组合在不同类型债券品种上的配置比例。根据中国债券市场存在市场分割的特点，本基金将考察相同债券在交易所市场和银行间市场的利差情况，结合流动性等因素的分析，选择具有更高投资价值的市场进行配置。

对于中小企业私募债，本基金将重点关注发行人财务状况、个券增信措施等因素，以及对基金资产流动性的影响，在充分考虑信用风险、流动性风险的基础上，进行投资决策。

对于资产支持证券，其定价受市场利率、发行条款、标的资产的构成及质量、提前偿还率等多种因素影响。本基金将在基本面分析和债券市场宏观分析的基础上，以数量化模型确定其内在价值。

### （4）回购套利

本基金将在相关法律法规以及基金合同限定的比例内，适时适度运用回购交易套利策略以增强组合的收益率，比如运用回购与现券之间的套利、不同回

购期限之间的套利进行低风险的套利操作。

#### 4、金融衍生品投资策略

##### （1）股指期货投资策略

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，选择流动性好、交易活跃的期货合约，并根据对证券市场和期货市场运行趋势的研判，以及对股指期货合约的估值定价，与股票现货资产进行匹配，实现多头或空头的套期保值操作，由此获得股票组合产生的超额收益。本基金在运用股指期货时，将充分考虑股指期货的流动性及风险收益特征，对冲系统性风险以及特殊情况下的流动性风险，以改善投资组合的风险收益特性

##### （2）权证投资策略

本基金将按照相关法律法规通过利用权证进行套利、避险交易，控制基金组合风险，获取超额收益。本基金进行权证投资时，将在对权证标的证券进行基本面研究及估值的基础上，结合股价波动率等参数，运用数量化期权定价模型，确定其合理内在价值，从而构建套利交易或避险交易组合。未来，随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等，基金还将积极寻求其他投资机会，履行适当程序后更新和丰富组合投资策略。

##### （3）国债期货投资策略

为更好地实现投资目标，本基金在注重风险管理的前提下，以套期保值为目的，适度运用国债期货。本基金利用国债期货流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点，通过国债期货提高投资组合的运作效率。

#### （五）投资决策程序

公司基金的投资决策实行投资总监领导下的基金经理负责制。投资决策流程如下：

- 1、投资总监监控基金投资组合的运行情况，并结合风控提出调整建议；
- 2、基金经理根据投资总监要求，结合股票池及有关研究报告，负责制定具体的投资组合方案；
- 3、根据有限授权原则，基金经理在授权范围内的投资组合方案可直接进入执行程序；超出基金经理授权权限经审批后方可进入执行程序；

4、金融工程、监察稽核基于一套数量化系统，对基金的投资组合进行日常性的风险测量与绩效评估。

#### （六）投资限制

##### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

- （1）本基金股票投资占基金资产的比例为 0% - 95%；
- （2）本基金每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的保证金以后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券；
- （3）本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；
- （4）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；
- （5）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；
- （6）本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；
- （7）本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；
- （8）本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；
- （9）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；
- （10）本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；
- （11）本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；
- （12）本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，

应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出；

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

（14）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%；本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年，债券回购到期后不得展期；

（15）本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的140%；

（16）本基金持有单只中小企业私募债券，其市值不得超过本基金资产净值的10%；

（17）本基金投资中小企业私募债的合计市值比例不超过基金资产净值的10%；

（18）本基金参与股指期货交易依据下列标准建构组合：

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

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

C. 本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过本基金持有的股票总市值的20%；

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

E. 本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%；

（19）本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的15%；持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的30%；本基金所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定。本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的国

债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 30%；

（20）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%；

（21）本基金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被动超过前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

（22）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；

（23）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述第（2）、（12）、（21）、（22）项另有约定外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定时，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。期间，本基金的投资范围、投资策略应当符合本基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

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

法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 向基金管理人、基金托管人出资；
- (5) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (6) 买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；
- (7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

## (七) 业绩比较基准

### 1、业绩比较基准

本基金业绩比较基准为：中证 800 指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50%。

### 2、选择比较基准的理由

中证 800 指数是由中证指数有限公司编制，由中证 500 和沪深 300 成份股一起构成，综合反映沪深证券市场内大中小市值公司的整体状况。上证国债指数是以上海证券交易所上市的所有固定利率国债为样本，按照国债发行量加权而成。上证国债指数是上证指数系列的第一只债券指数，它的推出使我国证券市场股票、债券、基金三位一体的指数体系基本形成。

随着市场环境的变化，或因指数编制及发布等方面的原因，如果上述业绩比较基准不适用本基金，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时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。调整业绩比较基准无需召开基金持有人大会，但应经基金托管人同意，报中国证监会备案，基金管理人应在调整前

在中国证监会规定媒介上刊登公告。

#### （八）风险收益特征

本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金，属于中高风险、中高收益的基金品种。

#### （九）基金管理人代表基金行使相关权利的处理原则及方法

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

#### （十）基金投资组合报告

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

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 4 月 21 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。

本投资组合报告所载数据截至 2021 年 3 月 31 日，报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 2021 年 3 月 31 日，本报告中所列财务数据未经审计。

##### 1、报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目     | 金额(元)          | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|--------|----------------|---------------|
| 1  | 权益投资   | 232,940,874.84 | 74.26         |
|    | 其中：股票  | 232,940,874.84 | 74.26         |
| 2  | 基金投资   | -              | -             |
| 3  | 固定收益投资 | 25,533,704.40  | 8.14          |
|    | 其中：债券  | 25,533,704.40  | 8.14          |
|    | 资产支持证券 | -              | -             |

书

|   |                   |                |        |
|---|-------------------|----------------|--------|
| 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      | 53,953,869.03  | 17.20  |
| 8 | 其他资产              | 1,243,814.15   | 0.40   |
| 9 | 合计                | 313,672,262.42 | 100.00 |

注：本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

## 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

### （1）报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）        | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|----------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -              | -            |
| B  | 采矿业              | -              | -            |
| C  | 制造业              | 152,355,435.97 | 48.73        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 9,725,760.12   | 3.11         |
| E  | 建筑业              | -              | -            |
| F  | 批发和零售业           | 23,456.40      | 0.01         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 490,276.80     | 0.16         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -              | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 208,320.73     | 0.07         |
| J  | 金融业              | 51,938,847.40  | 16.61        |
| K  | 房地产业             | 10,048,200.30  | 3.21         |
| L  | 租赁和商务服务业         | -              | -            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | -              | -            |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 33,594.12      | 0.01         |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -              | -            |
| P  | 教育               | -              | -            |
| Q  | 卫生和社会工作          | -              | -            |

书

|   |           |                |       |
|---|-----------|----------------|-------|
| R | 文化、体育和娱乐业 | 8,116,983.00   | 2.60  |
| S | 综合        | -              | -     |
|   | 合计        | 232,940,874.84 | 74.50 |

## (2) 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

### 3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）     | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|-----------|---------------|--------------|
| 1  | 600036 | 招商银行 | 542,112   | 27,701,923.20 | 8.86         |
| 2  | 600519 | 贵州茅台 | 12,869    | 25,853,821.00 | 8.27         |
| 3  | 000333 | 美的集团 | 303,961   | 24,994,713.03 | 7.99         |
| 4  | 601318 | 中国平安 | 307,966   | 24,236,924.20 | 7.75         |
| 5  | 002372 | 伟星新材 | 592,557   | 14,967,989.82 | 4.79         |
| 6  | 002867 | 周大生  | 399,449   | 13,972,726.02 | 4.47         |
| 7  | 603180 | 金牌厨柜 | 182,172   | 13,223,865.48 | 4.23         |
| 8  | 603886 | 元祖股份 | 661,600   | 11,617,696.00 | 3.72         |
| 9  | 000002 | 万科A  | 334,600   | 10,038,000.00 | 3.21         |
| 10 | 600025 | 华能水电 | 1,675,600 | 9,701,724.00  | 3.10         |

### 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      | -       | -            |
|    | 其中：政策性金融债 | -       | -            |
| 4  | 企业债券      | -       | -            |

书

|    |           |               |      |
|----|-----------|---------------|------|
| 5  | 企业短期融资券   | -             | -    |
| 6  | 中期票据      | -             | -    |
| 7  | 可转债（可交换债） | 25,533,704.40 | 8.17 |
| 8  | 同业存单      | -             | -    |
| 9  | 其他        | -             | -    |
| 10 | 合计        | 25,533,704.40 | 8.17 |

#### 5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 数量（张）   | 公允价值(元)       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 113044 | 大秦转债 | 208,560 | 21,385,742.40 | 6.84         |
| 2  | 128107 | 交科转债 | 37,985  | 4,147,962.00  | 1.33         |

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

#### 10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

#### 11、投资组合报告附注

(1) 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查的情形。本基金投资的前十名证券的发行主体在报告编制日前一年内没有受到公开谴责和处罚的情形。

(2) 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

(3) 其他资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额           |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | 74,984.56    |
| 2  | 应收证券清算款 | 200,392.79   |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 27,887.24    |
| 5  | 应收申购款   | 940,549.56   |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 其他      | -            |
| 8  | 合计      | 1,243,814.15 |

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|--------------|--------------|
| 1  | 128107 | 交科转债 | 4,147,962.00 | 1.33         |

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

(6) 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中分项之和与合计可能存在尾差。

## 十、基金的业绩

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。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）本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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   |
|----------------------------------|---------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 2017年3月9日-2017年12月31日            | 11.27%  | 0.61%     | 5.58%      | 0.34%         | 5.69%  | 0.27% |
| 2018年1月1日-2018年12月31日            | -20.95% | 1.36%     | -11.93%    | 0.67%         | -9.02% | 0.69% |
| 2019年1月1日-2019年12月31日            | 61.39%  | 1.21%     | 18.70%     | 0.63%         | 42.69% | 0.58% |
| 2020年1月1日-2020年12月31日            | 46.44%  | 1.24%     | 14.95%     | 0.72%         | 31.49% | 0.52% |
| 2021年1月1日-2021年3月31日             | 7.05%   | 1.05%     | -0.87%     | 0.74%         | 7.92%  | 0.31% |
| 自基金合同生效起至今（2017年3月9日-2021年3月31日） | 122.54% | 1.16%     | 25.78%     | 0.63%         | 96.76% | 0.53% |

注：本基金的业绩比较基准为中证800指数收益率×50%+上证国债指数收益率

书

×50%。

(二) 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：本基金合同生效日为2017年3月9日，自基金合同生效日起6个月内为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

## 十一、基金的财产

### （一）基金资产总值

基金资产总值是指购买的各类证券及票据价值、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。

### （二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### （三）基金财产的账户

基金托管人根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立资金账户、证券账户以及投资所需的其他专用账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

### （四）基金财产的保管和处分

本基金财产独立于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人、基金登记机构和基金销售机构以其自有的财产承担其自身的法律责任，其债权人不得对本基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。除依法律法规和《基金合同》的规定处分外，基金财产不得被处分。

基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。基金管理人管理运作基金财产所产生的债权，不得与其固有资产产生的债务相互抵销；基金管理人管理运作不同基金的基金财产所产生的债权债务不得相互抵销。

## 十二、基金资产的估值

### （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交易日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非交易日。

### （二）估值对象

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

### （三）估值方法

#### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

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

（2）交易所上市实行净价交易的债券按估值日第三方估值机构提供的相应品种的净价进行估值；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，确定公允价值；

（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，确定公允价值；经与托管人协商一致，基金管理人可采用第三方估值机构提供的相关数据作为估值依据；

（4）交易所上市不存在活跃市场的非固定收益类有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估

值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

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

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

3、金融衍生品的估值

（1）评估金融衍生品价值时，应当采用市场公认或者合理的估值方法确定公允价值；

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

4、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、对只在上海证券交易所固定收益平台或只在深圳证券交易所综合协议平台进行交易的债券，采用估值技术确定公允价值或按成本法进行估值。

6、中小企业私募债采用估值技术确定公允价值或按成本法进行估值。

7、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。

8、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。

9、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。

10、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。

11、当发生大额申购或赎回情形时基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。

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

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

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

#### （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，该类基金资产净值除以当日该类基金份额的余额数量计算，精确到 0.0001 元，小数点后第五位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

每个工作日计算基金资产净值及各类基金份额净值，并按规定公告。

2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或本基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将各类基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

#### （五）估值错误的确认与处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当任一类基金份额净值小数点后 4 位以内（含第 4 位）发生估值错误时，视为该类基金份额净值错误。

基金合同的当事人应按照以下约定处理：

##### 1、估值错误类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或登记机构、或销

售机构、或投资人自身的过错造成估值错误，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该估值错误遭受损失当事人（“受损方”）的直接损失按下述“估值错误处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

上述估值错误的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等。

## 2、估值错误处理原则

（1）估值错误已发生，但尚未给当事人造成损失时，估值错误责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正估值错误发生的费用由估值错误责任方承担；由于估值错误责任方未及时更正已产生的估值错误，给当事人造成损失的，由估值错误责任方对直接损失承担赔偿责任；若估值错误责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责任。估值错误责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保估值错误已得到更正。

（2）估值错误的责任方对有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对估值错误的有关直接当事人负责，不对第三方负责。

（3）因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但估值错误责任方仍应对估值错误负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失（“受损方”），则估值错误责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给估值错误责任方。

（4）估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

## 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

（1）查明估值错误发生的原因，列明所有的当事人，并根据估值错误发生的原因确定估值错误的责任方；

（2）根据估值错误处理原则或当事人协商的方法对因估值错误造成的损失进行评估；

(3) 根据估值错误处理原则或当事人协商的方法由估值错误的责任方进行更正和赔偿损失；

(4) 根据估值错误处理的方法，需要修改基金登记机构交易数据的，由基金登记机构进行更正，并就估值错误的更正向有关当事人进行确认。

#### 4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

(1) 基金份额净值计算出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

(2) 错误偏差达到该类基金份额净值的 0.25% 时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到该类基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应当公告。

(3) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

#### (六) 暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

3、当前一估值日基金资产净值 50% 以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，且经与基金托管人协商确认后应当暂停基金估值；

4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

#### (七) 基金净值的确认

用于基金信息披露的基金资产净值和各类基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的基金资产净值和各类基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金净值予以公布。

#### (八) 特殊情形的处理

1、基金管理人按本部分第三款有关估值方法规定的第 10 项条款进行估值

时，所造成的误差不作为基金份额估值错误处理。

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

### 十三、基金的收益分配

#### （一）基金利润的构成

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

#### （二）基金可供分配利润

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

#### （三）基金收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值。

4、由于本基金A类基金份额不收取销售服务费，而C类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### （四）收益分配方案

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

#### （五）收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，依据相关规定进行公告。

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

#### （六）基金收益分配中发生的费用

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

## 十四、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、从 C 类基金份额基金财产中计提的销售服务费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费或仲裁费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券、期货交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、基金的账户开户费用、账户维护费用；
- 10、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

### （二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.20% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月第 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月第 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

### 3、C 类基金份额的销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值的 0.60% 年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金管理人在次月第 2-5 个工作日内从基金财产中支付。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

销售服务费可用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。

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

### （三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、《基金合同》生效前的相关费用；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

#### （四）费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后，可按照基金发展情况，并根据法律法规规定和基金合同约定调低基金管理费率、基金托管费率或销售服务费率。

基金管理人必须于新的费率实施日前按照《信息披露办法》的规定在规定媒介上公告。

#### （五）基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## 十五、基金的会计与审计

### （一）基金的会计政策

- 1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；
- 2、基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日；基金首次募集的会计年度按如下原则：如果《基金合同》生效少于2个月，可以并入下一个会计年度；
- 3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
- 4、会计制度执行国家有关会计制度；
- 5、本基金独立建账、独立核算；
- 6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；
- 7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

### （二）基金的年度审计

- 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意。
- 3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所需在2日内在规定媒介公告。

## 十六、基金的信息披露

（一）本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《基金合同》及其他有关规定。相关法律法规对信息披露的披露方式、登载媒介、报备方式等规定发生变化时，本基金从其最新规定。

### （二）信息披露义务人

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

本基金信息披露义务人以保护基金份额持有人利益为根本出发点，按照法律、行政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符合中国证监会规定条件的全国性报刊（以下简称“规定报刊”）及《信息披露办法》规定的互联网网站（以下简称“规定网站”）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。

（三）本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

- 1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；
- 2、对证券投资业绩进行预测；
- 3、违规承诺收益或者承担损失；
- 4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构；
- 5、登载任何自然人、法人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。

（四）本基金公开披露的信息应采用中文文本。如同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证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。

#### （五）公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

##### 1、基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议、基金产品资料概要

（1）《基金合同》是界定《基金合同》当事人的各项权利、义务关系，明确基金份额持有人大会召开的规则及具体程序，说明基金产品的特性等涉及基金投资者重大利益的事项的法律文件。

（2）基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。《基金合同》生效后，基金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规定网站上；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。《基金合同》终止的，基金管理人不再更新基金招募说明书。

（3）基金托管协议是界定基金托管人和基金管理人在基金财产保管及基金运作监督等活动中的权利、义务关系的法律文件。

（4）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，并登载在规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。基金合同终止的，基金管理人不再更新基金产品资料概要。

基金募集申请经中国证监会注册后，基金管理人在基金份额发售的3日前，将基金招募说明书、《基金合同》摘要登载在规定媒介上；基金管理人、基金托管人应当将《基金合同》、基金托管协议登载在网站上。

##### 2、基金份额发售公告

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

### 3、《基金合同》生效公告

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

### 4、基金净值信息

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

在开始办理基金份额申购或者赎回后, 基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日, 通过规定网站、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各类基金份额累计净值。

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

### 5、基金份额申购、赎回价格

基金管理人应当在《基金合同》、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率, 并保证投资者能够在基金销售机构网站或营业网点查阅或者复制前述信息资料。

### 6、基金定期报告, 包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告

基金管理人应当在每年结束之日起三个月内, 编制完成基金年度报告, 并将年度报告登载在规定网站上, 将年度报告提示性公告登载在规定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计。

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, 并将中期报告登载在规定网站上, 将中期报告提示性公告登载在规定报刊上。

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, 并将季度报告登载在规定网站上, 将季度报告提示性公告登载在规定报刊上。

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

如报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额 20% 的情形, 为保障其他投资者利益, 基金管理人至少应当在定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期

内持有份额变化情况及本基金的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

本基金持续运作过程中，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。

## 7、临时报告

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，并登载在规定报刊和规定网站上。

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）基金扩募、延长基金合同期限；
- （4）转换基金运作方式、基金合并；
- （5）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；
- （6）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；
- （7）基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- （8）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；
- （9）基金募集期延长或提前结束募集；
- （10）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；
- （11）基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十，基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十；
- （12）涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或者仲裁；
- （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，但中国证监会另有规定的除外；

(15) 基金收益分配事项；

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

(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) 本基金推出新业务或服务；

(23) 发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；

(24) 基金管理人采用摆动定价机制进行估值；

(25) 调整基金份额类别；

(26) 本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。

## 8、澄清公告

在《基金合同》存续期限内，任何公共媒介中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动，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。

## 9、基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

## 10、投资中小企业私募债信息披露

基金管理人在本基金投资中小企业私募债券后两个交易日内，在中国证监会规定媒介披露所投资中小企业私募债券的名称、数量、期限、收益率等信息。

本基金应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更

新)等文件中披露中小企业私募债券的投资情况。

#### 11、投资股指期货信息披露

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

#### 12、投资国债期货信息披露

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

#### 13、投资资产支持证券信息披露

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

#### 14、投资非公开发行股票的相关披露

基金管理人在本基金投资非公开发行股票后2个交易日内,在中国证监会规定媒介披露所投资非公开发行股票的名称、数量、总成本、账面价值,以及总成本和账面价值占基金资产净值的比例、锁定期等信息。

#### 15、清算报告

基金合同终止的,基金管理人应当依法组织清算组对基金财产进行清算并作出清算报告。清算报告应当经过符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计,并由律师事务所出具法律意见书。清算组应当将清算报告登载在规定网站上,并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

#### 16、中国证监会规定的其他信息。

### (六) 信息披露事务管理

基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度，指定专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、基金托管人应当在规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规定媒介上披露信息外，还可以根据需要其他公共媒介披露信息，但是其他公共媒介不得早于规定媒介披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

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》终止后十年。

#### （七）信息披露文件的存放与查阅

依法必须披露的信息发布后，基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于各自住所，供社会公众查阅、复制。

#### （八）暂停或延迟披露基金信息的情形

当出现下述情况时，基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金信息：

- 1、不可抗力；

2、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

3、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 不确定时，经与基金托管人协商一致暂停估值的；

4、法律法规、基金合同或中国证监会规定的情况。

## 十七、风险揭示

### （一）投资于本基金的风险

#### 1、市场风险

基金主要投资于证券市场，而证券市场价格因受到经济因素、政治因素、投资者心理和交易制度等各种因素的影响而产生波动，从而导致基金收益水平发生变化，产生风险。主要包括：

（1）政策风险。因国家宏观政策（如货币政策、财政政策、行业政策、地区发展政策等）发生变化，导致市场价格波动而产生风险。

（2）经济周期风险。随经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化，基金投资的收益水平也会随之变化，从而产生风险。

（3）利率风险。金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着债券的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。基金投资于债券和股票，其收益水平可能会受到利率变化的影响。

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

（5）购买力风险。基金份额持有人收益将主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀因素而使其购买力下降，从而使基金的实际收益下降。

（6）再投资风险。再投资风险反映了利率下降对固定收益证券利息收入再投资时的收益率的影响。具体为当利率下降时，基金从投资的固定收益证券所得的利息收入进行再投资时，将获得较以前低的收益率。

（7）上市公司经营风险。上市公司的经营状况受多种因素的影响，如管理能力、行业竞争、市场前景、技术更新、新产品研究开发等都会导致公司盈利发生变化。如果基金所投资的上市公司经营不善，其股票价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，使基金投资收益下降。虽然基金可以通过投资多样化来分散这种非系统风险，但不能完全避免。

#### 2、管理风险

（1）在基金管理运作过程中基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的占有和对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金

收益水平。

(2) 基金管理人和基金托管人的管理水平、管理手段和管理技术等因素的变化也会影响基金收益水平。

### 3、流动性风险

基金的流动性风险主要表现在两方面：一是基金管理人建仓时或为实现投资收益而进行组合调整时，可能会由于个股的市场流动性相对不足而无法按预期的价格将股票或债券买进或卖出；二是为应付投资者的赎回，当个股的流动性较差时，基金管理人被迫在不适当的价格大量抛售股票或债券。两者均可能使基金净值受到不利影响。

### 4、操作和技术风险

基金的相关当事人在各业务环节的操作过程中，可能因内部控制不到位或者人为因素造成操作失误或违反操作规程而引致风险，如越权违规交易、内幕交易、交易错误和欺诈等。

此外，在基金的后台运作中，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甚至导致基金份额持有人利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理人、基金托管人、注册登记机构、销售机构、证券交易所和证券登记结算机构等。

### 5、合规性风险

指基金管理或运作过程中，违反国家法律、法规的规定，或者基金投资违反法规及《基金合同》有关规定的风险。

### 6、本基金特有风险

#### (1) 投资策略相关风险

本基金在把握经济结构调整和产业升级的发展趋势基础上，充分挖掘新兴产业发展中的投资机会，重点关注新兴产业中的优质上市公司，以及传统产业中具备新成长动力和价值的上市公司进行投资，因此本基金的投资策略相关风险主要来自两方面：一是对经济结构调整和产业升级的理解偏差导致对行业和个股的判断不够准确；二是对上市公司的基本面研究不够深入导致个股选择失误。

#### (2) 股指期货投资风险

本基金可投资于股指期货，股指期货作为一种金融衍生品，其所面临

的风险如下：

① 杠杆风险

股指期货交易采用保证金交易方式，由于高杠杆特征，当出现不利行情时，股价指数微小的变动就可能会使本基金遭受较大损失。

② 强制平仓的风险

如果市场走势对本基金持有的期货合约不利从而导致账户保证金不足时，期货公司会按照期货经纪合同约定的时间和方式通知追加保证金，以使本基金能继续持有未平仓合约。如未于规定时间内存入所需保证金，本基金持有的未平仓合约将可能在亏损的情况下被强行平仓，本基金必须承担由此导致的一切损失。

③ 无法平仓的风险

在市场剧烈变化的情况下，基金管理人可能难以或无法将持有的未平仓合约平仓。这类情况将导致保证金有可能无法弥补全部损失，本基金必须承担由此导致的全部损失。同时本基金将面临股指期货无法当天平仓而价格变动的风险。

④ 强行减仓的风险

在极端情况下，本基金持有的期货合约可能被期货交易所强行减仓，从而使本基金无法继续持有期货合约，从而导致交易价格的不确定性或者策略失败。

⑤ 政策变化的风险

由于国家法律、法规、政策的变化、期货交易所交易规则的修改、紧急措施的出台等原因导致未平仓合约可能无法继续持有从而导致损失。

⑥ 连带风险

为委托财产进行结算的结算会员或该结算会员下的其他投资者出现保证金不足、又未能在规定的时间内补足，或因其他原因导致中金所对该结算会员下的经纪账户强行平仓时，委托财产的资产可能因被连带强行平仓而遭受损失。

⑦ 合作方风险

本基金管理人运用委托财产投资于股指期货时，会尽力选择资信状况优良、风险控制能力强的期货公司作为经纪商，但不能杜绝在极端情况下，所选择的期货公司在交易过程中存在违法、违规经营行为或破产清算导致委托财产遭受损失。

（3）国债期货的投资风险

本基金可投资于国债期货，国债期货作为一种金融衍生品，其所面临的风险如下：

① 流动性风险。

若国债期货市场流动性较差，交易难以迅速、及时、方便地成交，将产生流动性风险。

② 保证金管理风险。

期货交易采用保证金制度，每日进行结算，保证金预留过多会导致资金运用效率过低，减少预期收益。保证金不足将有被强行平仓的风险，使得原有的投资策略不能得以实现。

③ 价差风险。

对于通过价差的变动获利的套利策略，价差往不利方向运行将可能造成策略失效并招致损失。

④ 研判失误风险。

套利策略成功的核心在于通过历史数据分析和投资品种的基本面分析，发掘套利机会，资产管理人的判断错误将导致策略失效，带来损失。

⑤ 执行风险。

一般情况下很难在同一时间执行套利策略的两端交易，因此存在一端交易已经执行，而由于价格的快速波动导致另一端交易执行后获利低于预期甚至造成损失的可能性。

⑥ 基差风险。

由于期货价格和现货价格都是波动的，基差的不确定性被称为基差风险。基差的波动给套期保值者带来了无法回避的风险，直接影响套期保值效果。

⑦ CTD 券对应的国债品种发生变化的风险。

国债期货采用实物交割形式，国债期货的标的物是虚拟债券，CTD 券对应的国债品种可能发生变化，存在基差扩大的风险。

⑧ 展期风险。

持有期货合约交割期限短于合同的到期日而需要将期货合约向前延展时，合约平仓时的价格与下一个新合约开仓时的价格之差存在着不确定性，存在多次的基差风险。

⑨ 杠杆风险。

期货交易采用保证金交易方式，潜在损失可能成倍放大。

(4) 中小企业私募债券的投资风险

中小企业私募债券的投资在增加预期收益的同时可能会增加本基金的流动性风险和信用风险。

中小企业私募债券的规模一般小额零散，主要通过固定收益证券综合电子平台、综合协议交易平台或证券公司进行转让，难以进行更广泛估值和询价，因此中小企业私募债券的估值价格可能与实际变现的市场价格有一定的偏差而对本基金资产净值产生影响。同时中小企业私募债券流动性可能比较匮乏，因此可能面临较高的流动性风险，以及由流动性较差变现成本较高而使基金净值受损的风险。

目前主要是非上市公司发行私募债券，发行人可得信息较少，对信用风险评价的难度更高。资产管理人虽会通过建立系统的信用评级体系对信用风险进行研究分析，仍可能使本基金承受中小企业私募债券信用风险所带来的损失。

7、其他风险

(1) 在符合本基金投资理念的新型投资工具出现和发展后，如果投资于这些工具，基金可能会面临一些特殊的风险；

(2) 因技术因素而产生的风险，如计算机系统不可靠产生的风险；

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

(4) 因人为因素而产生的风险，如内幕交易、欺诈行为等产生的风险；

(5) 对主要业务人员如基金经理的依赖可能产生的风险；

(6) 战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金资产的损失，影响基金收益水平，从而带来风险；

(7) 其他意外导致的风险。

(二) 声明

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

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

## 十八、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### （一）《基金合同》的变更

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

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议应当报中国证监会备案，自决议通过之日起生效，且自决议生效后两日内在规定媒介公告。

### （二）《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

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

### （三）基金财产的清算

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

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、符合《中华人民共和国证券法》规定的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

4、基金财产清算程序：

- （1）《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；
- （2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；

- (3) 对基金财产进行估值和变现；
  - (4) 制作清算报告；
  - (5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
  - (6) 将清算报告报中国证监会备案并公告。
  - (7) 对基金剩余财产进行分配；
- 5、基金财产清算的期限为 6 个月。

#### (四) 清算费用

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

#### (五) 基金财产清算剩余资产的分配

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

#### (六) 基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。基金财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

#### (七) 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存不少于法律法规规定的最低年限。

## 十九、基金合同的内容摘要

基金合同的内容摘要见附件 1。

## 二十、基金托管协议的内容摘要

基金托管协议的内容摘要见附件 2。

## 二十一、对基金份额持有人的服务

对于基金份额持有人和潜在投资者，基金管理人将根据具体情况提供一系列的服务，并将根据基金份额持有人的需要和市场的变化，增加或变更服务项目。主要服务内容如下：

### （一）基金份额持有人注册登记服务

基金管理人为基金份额持有人提供注册登记服务。基金管理人将配备安全、完善的信息系统，准确、及时地为基金投资者办理基金账户、基金份额的登记、管理、托管与转托管；基金转换和非交易过户；基金份额持有人名册的管理；权益分配时红利的登记派发；基金交易份额的清算过户和基金交易资金的交收等服务。

### （二）交易资料寄送服务

1、账户资料：基金投资者开户申请被受理的2个工作日后（T+2日后），可以到销售网点查询和打印基金账户开户确认资料。基金成立后的30个工作日内，基金管理人将向投资者寄送包含基金账户信息在内的对账单。

2、基金交易确认查询服务：基金投资者在交易申请被受理的2个工作日后（T+2日后），可以到销售网点查询和打印该项交易的确认资料。基金成立后的30个工作日内，基金管理人将向投资者寄送包含基金认购确认信息在内的对账单。

3、基金管理人可以视情况根据持有人账单订制情况向账单期内发生交易或账单期末仍持有本公司基金份额的基金份额持有人定期或不定期发送电子对账单。由于基金份额持有人提供的手机号码、电子邮箱不详、错误、未及时变更等原因有可能造成对账单无法按时或准确送达。因上述原因无法正常收取对账单的投资者，敬请及时通过本公司网站，或拨打本公司客服热线查询、核对、变更您的预留联系方式。若基金份额持有人需要获取指定期间的纸质对账单，可拨打本公司客服电话（021）60231999 进行申请，提供姓名、开户证件号码或基金账号、邮寄地址、邮政编码、联系电话等，经本公司客服人员核实相关信息并同意后，可以为基金份额持有人免费邮寄纸质对账单。

### （三）客户服务中心电话服务

客户服务中心提供24小时自动语音查询服务。持有人可进行基金账户余额、申购与赎回交易情况查询与基金产品等信息的查询。

客户服务中心提供每周五天，每天不少于8小时的人工热线咨询服务。持有人可通过客服热线电话：拨打（021）60231999享受业务咨询、信息查询、服务投诉、信息定制、对账单寄送地址资料修改等专项服务。

### （四）网上交易服务

基金管理人已开通个人投资者网上交易业务。个人投资者通过基金管理人网上交易平台可以办理基金认购、申购、赎回、分红方式修改、账户资料修改、交易密码修改、交易申请查询和账户资料查询等各类业务。

### （五）定期定额投资计划

基金管理人可通过基金管理人网站[www.boscam.com.cn](http://www.boscam.com.cn)和销售机构为投资者提供定期定额投资服务。通过定期定额投资计划，投资者可以通过销售渠道定期定额申购基金份额。定期定额投资计划的有关规则另行公告。

### （六）信息定制服务

基金持有人可以登录拨打客服热线电话提交信息定制申请。基金管理人通过手机短信、电子邮件或其他方式按持有人的定制提供信息。可定制的信息包括：每周基金净值、交易确认信息、投资者服务刊物、分红公告、公司公告等。基金管理人可以根据实际业务需要，调整定制信息的条件、方式和内容。

### （七）投资者投诉受理服务

投资者可以通过代销机构网点或基金管理人客服热线电话、信函及电子邮件等形式对基金管理人或销售网点所提供的服务进行投诉。

客服热线电话投诉、电子邮件投诉、信函投诉是主要投诉受理渠道，基金管理人客户服务部负责管理投诉电话、投诉邮箱。现场投诉和意见簿投诉

是补充投诉渠道，由各代销机构和基金管理人分别管理。

对于工作日期间受理的投诉，原则上是及时回复；对于不能及时回复的投诉，基金管理人承诺在投诉送达基金管理人的24小时之内做出回复。对于非工作日提出的投诉，顺延至下一工作日完成回复。

客户服务部邮箱：[service@boscam.com.cn](mailto:service@boscam.com.cn)

## 二十二、其他披露事项

本基金及基金管理人的有关更新公告如下：

| 序号 | 公告事项                                                 | 披露方式           | 披露日期       |
|----|------------------------------------------------------|----------------|------------|
| 1  | 上银基金管理有限公司关于旗下部分基金新增联泰基金为销售机构及参加费率优惠活动的公告            | 中国证监会规定报刊和规定网站 | 2020-05-20 |
| 2  | 上银基金管理有限公司关于旗下基金根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修改基金合同及托管协议的公告 | 中国证监会规定报刊和规定网站 | 2020-05-23 |
| 3  | 上银鑫达灵活配置混合型证券投资基金基金合同                                | 中国证监会规定网站      | 2020-05-23 |
| 4  | 上银鑫达灵活配置混合型证券投资基金托管协议                                | 中国证监会规定网站      | 2020-05-23 |
| 5  | 上银鑫达灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书（2020年第2号）                   | 中国证监会规定网站      | 2020-05-23 |
| 6  | 上银鑫达灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书摘要（2020年第2号）                 | 中国证监会规定网站      | 2020-05-23 |
| 7  | 上银基金管理有限公司关于旗下部分基金新增盈米基金为销售机构及参加费率优惠活动的公告            | 中国证监会规定报刊和规定网站 | 2020-05-27 |
| 8  | 上银基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告                    | 中国证监会规定报刊和规定网站 | 2020-06-17 |
| 9  | 上银基金管理有限公司旗下部分基金更新招募说明书及摘要提示性公告                      | 中国证监会规定报刊和规定网站 | 2020-06-24 |
| 10 | 上银鑫达灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书（2020年第3号）                   | 中国证监会规定网站      | 2020-06-24 |
| 11 | 上银鑫达灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书摘要（2020年第3号）                 | 中国证监会规定网站      | 2020-06-24 |
| 12 | 上银基金管理有限公司关于旗下部分基金新增肯特瑞为销售机构及参加费率优惠活动的公告             | 中国证监会规定报刊和规定网站 | 2020-06-24 |

|    |                                           |                |            |
|----|-------------------------------------------|----------------|------------|
| 13 | 上银基金管理有限公司关于旗下部分基金新增植信基金为销售机构及参加费率优惠活动的公告 | 中国证监会规定报刊和规定网站 | 2020-07-08 |
| 14 | 上银基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告                   | 中国证监会规定报刊和规定网站 | 2020-07-11 |
| 15 | 上银基金管理有限公司旗下部分基金 2020 年第 2 季度报告提示性公告      | 中国证监会规定报刊和规定网站 | 2020-07-21 |
| 16 | 上银鑫达灵活配置混合型证券投资基金 2020 年第 2 季度报告          | 中国证监会规定网站      | 2020-07-21 |
| 17 | 上银基金管理有限公司关于旗下部分基金新增度小满为销售机构及参加费率优惠活动的公告  | 中国证监会规定报刊和规定网站 | 2020-07-31 |
| 18 | 上银基金管理有限公司关于旗下部分基金新增交通银行为销售机构及参加费率优惠活动的公告 | 中国证监会规定报刊和规定网站 | 2020-07-31 |
| 19 | 上银基金管理有限公司关于业务系统维护的公告                     | 中国证监会规定网站      | 2020-08-27 |
| 20 | 上银基金管理有限公司关于旗下部分基金新增诺亚正行为销售机构及参加费率优惠活动的公告 | 中国证监会规定报刊和规定网站 | 2020-08-28 |
| 21 | 上银基金管理有限公司旗下部分基金 2020 年中期报告提示性公告          | 中国证监会规定报刊和规定网站 | 2020-08-31 |
| 22 | 上银鑫达灵活配置混合型证券投资基金 2020 年中期报告              | 中国证监会规定网站      | 2020-08-31 |
| 23 | 上银基金管理有限公司关于旗下基金披露基金产品资料概要的提示性公告          | 中国证监会规定报刊和规定网站 | 2020-08-31 |
| 24 | 上银鑫达灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新               | 中国证监会规定网站      | 2020-08-31 |
| 25 | 上银基金管理有限公司关于不法分子冒用本公司名义开展非法证券活动的严正声明      | 中国证监会规定网站      | 2020-09-29 |
| 26 | 上银基金管理有限公司旗下部分基金 2020 年第 3 季度报告提示性公告      | 中国证监会规定报刊和规定网站 | 2020-10-28 |

|    |                                                      |                |            |
|----|------------------------------------------------------|----------------|------------|
| 27 | 上银鑫达灵活配置混合型证券投资基金 2020 年第 3 季度报告                     | 中国证监会规定网站      | 2020-10-28 |
| 28 | 上银基金管理有限公司关于更新旗下公募基金风险等级的公告                          | 中国证监会规定网站      | 2020-10-29 |
| 29 | 上银基金管理有限公司关于提醒电子直销平台个人投资者及时上传身份证件影印件并完善、更新身份信息的公告    | 中国证监会规定报刊和规定网站 | 2020-10-31 |
| 30 | 上银基金管理有限公司关于旗下部分基金新增长量基金为销售机构及参加费率优惠活动的公告            | 中国证监会规定报刊和规定网站 | 2020-11-11 |
| 31 | 上银基金管理有限公司关于提醒电子直销平台个人投资者及时上传身份证件影印件并完善、更新身份信息的提示性公告 | 中国证监会规定报刊和规定网站 | 2020-11-13 |
| 32 | 上银基金管理有限公司关于旗下部分基金新增蛋卷基金为销售机构及参加费率优惠活动的公告            | 中国证监会规定报刊和规定网站 | 2020-11-19 |
| 33 | 上银基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告                              | 中国证监会规定报刊和规定网站 | 2020-11-20 |
| 34 | 上银基金管理有限公司关于业务系统维护的公告                                | 中国证监会规定网站      | 2020-12-17 |
| 35 | 上银基金管理有限公司关于旗下部分基金改聘会计师事务所的公告                        | 中国证监会规定报刊和规定网站 | 2020-12-29 |
| 36 | 上银基金管理有限公司关于终止与大泰金石基金销售有限公司合作关系的公告                   | 中国证监会规定报刊和规定网站 | 2021-01-19 |
| 37 | 上银基金管理有限公司旗下部分基金 2020 年第 4 季度报告提示性公告                 | 中国证监会规定报刊和规定网站 | 2021-01-22 |
| 38 | 上银鑫达灵活配置混合型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告                     | 中国证监会规定网站      | 2021-01-22 |
| 39 | 上银基金管理有限公司关于网上直销平台银联通支付通道部分交易业务暂停的公告                 | 中国证监会规定报刊和规定网站 | 2021-01-26 |
| 40 | 上银基金管理有限公司关于                                         | 中国证监会规定网       | 2021-02-05 |

|    |                                                                         |                |            |
|----|-------------------------------------------------------------------------|----------------|------------|
|    | 信息技术突发事件发生时投资者可替代交易方式的公示                                                | 站              |            |
| 41 | 上银基金管理有限公司关于旗下部分基金新增大连网金为销售机构及参加费率优惠活动的公告                               | 中国证监会规定报刊和规定网站 | 2021-02-26 |
| 42 | 上银基金管理有限公司关于旗下部分基金新增宁波银行为销售机构及参加费率优惠活动的公告                               | 中国证监会规定报刊和规定网站 | 2021-03-17 |
| 43 | 上银基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告                                                 | 中国证监会规定报刊和规定网站 | 2021-03-31 |
| 44 | 上银基金管理有限公司旗下部分基金 2020 年年度报告提示性公告                                        | 中国证监会规定报刊和规定网站 | 2021-03-31 |
| 45 | 上银鑫达灵活配置混合型证券投资基金 2020 年年度报告                                            | 中国证监会规定网站      | 2021-03-31 |
| 46 | 上银基金管理有限公司关于调整旗下部分基金最低认申购金额、最低追加金额、最低定期定额投资金额、最低赎回份额、最低转换份额及账户最低保留份额的公告 | 中国证监会规定报刊和规定网站 | 2021-04-06 |
| 47 | 上银基金管理有限公司旗下部分基金 2021 年第 1 季度报告提示性公告                                    | 中国证监会规定报刊和规定网站 | 2021-04-22 |
| 48 | 上银鑫达灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告                                        | 中国证监会规定网站      | 2021-04-22 |
| 49 | 上银基金管理有限公司高级管理人员变更公告                                                    | 中国证监会规定报刊和规定网站 | 2021-04-23 |

### 二十三、招募说明书存放及查阅方式

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

对投资者按上述方式所获得的文件及其复印件，基金管理人和基金托管人保证与所公告文本的内容完全一致。

投资者还可以直接登录基金管理人的网站（[www.boscam.com.cn](http://www.boscam.com.cn)）查阅和下载招募说明书。

## 二十四、备查文件

### （一）备查文件目录

- 1、中国证监会注册上银鑫达灵活配置混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《上银鑫达灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《上银鑫达灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《关于上银基金管理有限公司申请募集上银鑫达灵活配置混合型证券投资基金之法律意见书》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、中国证监会要求的其他文件。

### （二）存放地点

备查文件存放于基金管理人和基金托管人的办公场所和营业场所。

### （三）查阅方式

投资者可到基金管理人和基金托管人的住所免费查阅备查文件。

上银基金管理有限公司

二〇二二年五月二十日

## 附件 1：基金合同的内容摘要

### 一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

#### （一）基金管理人的权利与义务

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

- （1）依法募集资金；
- （2）自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
- （3）依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- （4）销售基金份额；
- （5）按照规定召集基金份额持有人大会；
- （6）依据《基金合同》及有关法律法规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律法规规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资人的利益；
- （7）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- （8）选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；
- （9）担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；
- （10）依据《基金合同》及有关法律法规规定决定基金收益的分配方案；
- （11）在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购、赎回或转换申请；
- （12）依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- （13）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；
- （14）以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- （15）选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券/期货经纪商或其他为

基金提供服务的外部机构；

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

(17) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

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

(2) 办理基金备案手续；

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

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

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

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

(7) 依法接受基金托管人的监督；

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

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(10) 编制季度报告、中期报告和年度报告；

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

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

(13) 按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有

人分配基金收益；

（14）按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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

（16）按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料不少于法律法规规定的最低年限；

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

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

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

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

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

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

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

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

（25）执行生效的基金份额持有人大会的决议；

（26）建立并保存基金份额持有人名册；

（27）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

（二）基金托管人的权利与义务

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

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

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

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

（4）根据相关市场规则，为基金开设证券账户及投资所需其他账户、为基金办理证券交易资金清算。

（5）提议召开或召集基金份额持有人大会；

（6）在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

（7）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

（1）以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

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

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

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

（5）保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

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

（7）保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另

有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；

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

（9）办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

（10）对基金财务会计报告、季度报告、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；

（11）保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料不少于法律法规规定的最低年限；

（12）建立并保存基金份额持有人名册；

（13）按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

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

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

（16）按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；

（17）参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

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

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

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

（21）执行生效的基金份额持有人大会的决议；

（22）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

### 三、基金份额持有人的权利和义务

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

同一类别每份基金份额具有同等的合法权益。

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

- (1) 分享基金财产收益；
- (2) 参与分配清算后的剩余基金财产；
- (3) 依法申请赎回或转让其持有的基金份额；
- (4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会；
- (5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- (6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- (7) 监督基金管理人的投资运作；
- (8) 对基金管理人、基金托管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

- (1) 认真阅读并遵守《基金合同》、招募说明书等信息披露文件；
- (2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；
- (3) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；
- (4) 缴纳基金认购、申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；
- (5) 在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；
- (6) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；
- (7) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

- (8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## 二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。基金份额持有人大会未设立日常机构。

### (一) 召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会，法律法规、中国证监会或《基金合同》另有规定的除外：

- (1) 终止《基金合同》（法律法规、中国证监会另有规定或《基金合同》另有约定的除外）；
- (2) 更换基金管理人；
- (3) 更换基金托管人；
- (4) 转换基金运作方式（法律法规、中国证监会另有规定或《基金合同》另有约定的除外）；
- (5) 调整基金管理人、基金托管人的报酬标准或调高销售服务费率（法律法规、中国证监会另有规定或《基金合同》另有约定的除外）；
- (6) 变更基金类别；
- (7) 本基金与其他基金的合并；
- (8) 变更基金投资目标、范围或策略（法律法规、中国证监会另有规定或《基金合同》另有约定的除外）；
- (9) 变更基金份额持有人大会程序（法律法规、中国证监会另有规定或《基金合同》另有约定的除外）；
- (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%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；
- (12) 对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；
- (13) 法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

2、以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

（1）法律法规要求增加的基金费用的收取；

（2）在法律法规和《基金合同》规定的范围内，且在不对份额持有人权益产生实质性不利影响的情况下，调整本基金的申购费率、调低赎回费率、调低销售服务费率或调整收费方式，或者增加、减少或调整基金份额类别设置或分类规则；

（3）因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；

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

（5）基金管理人、登记机构、基金销售机构，在法律法规规定或中国证监会许可的范围内，在不对份额持有人权益产生实质性不利影响的情况下，调整有关认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务规则；

（6）当法律法规或中国证监会的相关规定变更时，本基金在履行适当程序后可对资产配置比例进行适当调整；

（7）在法律法规规定或中国证监会许可的范围内，在不对份额持有人权益产生实质性不利影响的情况下，基金推出新业务或服务；

（8）按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

## （二）会议召集人及召集方式

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

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集；

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

4、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开。

5、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

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

### （三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 30 日，依据有关规定进行公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

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

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联

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

#### （四）基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会等方式或法律法规、中国证监会允许的其他方式，会议的召开方式由会议召集人确定。

1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托证明委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

（1）亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；

（2）经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的  $1/2$ （含  $1/2$ ）。

参加基金份额持有人大会的基金份额持有人的基金份额低于上述规定比例的，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会，应当有代表  $1/3$  以上（含  $1/3$ ）基金份额的基金份额持有人或其代理人参加，方可召开。

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

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

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

(3) 本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的, 基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的  $1/2$  (含  $1/2$ );

参加基金份额持有人大会的基金份额持有人的基金份额低于上述规定比例的, 召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内, 就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会, 应当有代表  $1/3$  以上(含  $1/3$ ) 基金份额的基金份额持有人或其代理人参加, 方可召开。

(4) 上述第(3)项中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, 同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定, 并与基金登记注册机构记录相符;

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

4、基金份额持有人授权他人代为出席会议并表决的, 授权方式可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式, 具体方式在会议通知中列明。

#### (五) 议事内容与程序

##### 1、议事内容及提案权

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

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

## 2、议事程序

### (1) 现场开会

在现场开会的方式下,首先由大会主持人按照下列第(七)条规定程序确定和公布监票人,然后由大会主持人宣读提案,经讨论后进行表决,并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表,在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下,由基金托管人授权其出席会议的代表主持;如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会,则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的 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。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会,不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

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

### (2) 通讯开会

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

### (六) 表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议:

1、一般决议,一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的 50%以上(含 50%)通过方为有效;除下列第 2 项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

2、特别决议,特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的 2/3 以上(含 2/3)通过方可做出。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》、与其他基金合并应当以特别决议通过方

为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资人身份文件的表决视为有效出席的投资人，表面符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

#### （七）计票

##### 1、现场开会

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

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

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

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

##### 2、通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进

行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

#### （八）生效与公告

基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

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

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

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

### 三、《基金合同》解除和终止的事由、程序

#### （一）《基金合同》的变更

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

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议应当报中国证监会备案，自决议通过之日起生效，且自决议生效后两日内在规定媒介公告。

#### （二）《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：

1、基金份额持有人大会决定终止的；

2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；

3、《基金合同》约定的其他情形；

4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### （三）基金财产的清算

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

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、符合《中华人民共和国证券法》规定的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

4、基金财产清算程序：

（1）《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；

（2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；

（3）对基金财产进行估值和变现；

（4）制作清算报告；

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

（6）将清算报告报中国证监会备案并公告；

（7）对基金剩余财产进行分配。

5、基金财产清算的期限为 6 个月。

### （四）清算费用

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

### （五）基金财产清算剩余资产的分配

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

份额比例进行分配。

#### （六）基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告，基金财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

#### （七）基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存不少于法律法规规定的最低年限。

### 四、争议解决方式

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，任何一方均有权将争议提交上海国际经济贸易仲裁委员会（上海国际仲裁中心），按照上海国际经济贸易仲裁委员会（上海国际仲裁中心）届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为上海市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力，仲裁费用和律师费用由败诉方承担。

争议处理期间，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。

《基金合同》受中国法律管辖。

### 五、基金合同存放地和投资人取得基金合同的方式

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

**附件 2：基金托管协议的内容摘要****一、基金托管协议当事人****（一）基金管理人**

名称：上银基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区秀浦路 2388 号 3 幢 528 室

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 1528 号陆家嘴基金大厦 9 楼

邮政编码：200122

法定代表人：汪明

成立时间：2013 年 8 月 30 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监基金字[2013]1114 号文

组织形式：有限责任公司

注册资本：3 亿元人民币

存续期间：持续经营

联系电话：（021）60232799

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、特定客户资产管理和中国证监会许可的其他业务。【企业经营涉及行政许可的，凭许可证件经营】

**（二）基金托管人**

名称：兴业银行股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 154 号

办公地址：上海市银城路 167 号

法定代表人：吕家进

成立日期：1988 年 8 月 22 日

批准设立机关和批准设立文号：中国人民银行总行，银复（1988）347 号

基金托管业务批准文号：证监基金字[2005]74 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：207.74 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、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；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；代理发行股票以外的有价证券；买卖、代理买卖股票以外的有价证券；资产托管业务；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；结汇、售汇业务；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；财务顾问、资信调查、咨询、见证业务；经中国银行业监督管理委员会批准的其他业务（以上范围凡涉及国家专项专营规定的从其规定）。

## 二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

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

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转债（含可分离交易可转换债券）、次级债、短期融资券、中期票据、中小企业私募债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货、国债期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为 0%–95% 权证投资占基金资产净值的比例为 0%–3%；每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款。本基金将根据基金管理人的净资本规模，以及本基金的投资风格和流动性特点，兼顾基金投资的安全性、流动性和收益性，合理控制基金投资流通受限证券的比例。

如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。

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

- 1、本基金股票投资占基金资产的比例为 0% - 95%;
- 2、本基金每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的保证金以后, 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;
- 3、本基金持有一家公司发行的证券, 其市值不超过基金资产净值的 10%;
- 4、本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券, 不超过该证券的 10%;
- 5、本基金持有的全部权证, 其市值不得超过基金资产净值的 3%;
- 6、本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证, 不得超过该权证的 10%;
- 7、本基金在任何交易日买入权证的总金额, 不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%;
- 8、本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例, 不得超过基金资产净值的 10%;
- 9、本基金持有的全部资产支持证券, 其市值不得超过基金资产净值的 20%;
- 10、本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例, 不得超过该资产支持证券规模的 10%;
- 11、本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券, 不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%;
- 12、本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间, 如果其信用等级下降、不再符合投资标准, 应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出;
- 13、基金财产参与股票发行申购, 本基金所申报的金额不超过本基金的总资产, 本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;
- 14、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%; 本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年, 债券回购到期后不得展期;
- 15、本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%;
- 16、本基金持有单只中小企业私募债券, 其市值不得超过本基金资产净值的 10%;
- 17、本基金投资中小企业私募债的合计市值比例不超过基金资产净值的

10%;

18、本基金参与股指期货交易依据下列标准建构组合:

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

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

C. 本基金在任何交易日日终,持有的卖出期货合约价值不得超过本基金持有的股票总市值的 20%;

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

E. 本基金在任何交易日内交易(不包括平仓)的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%;

19、本基金在任何交易日日终,持有的买入国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的 15%;持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%;本基金所持有的债券(不含到期日在一年以内的政府债券)市值和买入、卖出国债期货合约价值,合计(轧差计算)应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定。本基金在任何交易日内交易(不包括平仓)的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 30%;

20、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%;

21、本基金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被动超过前款所规定比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;

22、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;

23、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述第(12)、(21)、(22)项以外,因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的,基金管理人应当在10个交易日内进行调整,但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定时,从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内,本基金的投资范围、投资策略应符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券,或者从事其他重大关联交易的,应当符合本基金的投资目标和投资策略,遵循基金份额持有人利益优先原则,防范利益冲突,建立健全内部审批机制和评估机制,按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人同意,并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议,并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。法律法规或监管部门取消或变更上述限制,如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准,无需召开基金份额持有人大会审议。

(三)基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对本托管协议第十五章第(九)条规定的基金投资禁止行为进行监督。基金托管人通过事后监督方式对基金管理人基金投资禁止行为进行监督。

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

1. 基金托管人依据有关法律法规的规定和基金合同的约定对于基金管理人参与银行间债券市场交易时面临的交易对手资信风险进行监督。

基金管理人向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的、本基金适用的银

行间债券市场交易对手的名单,并按照审慎的风险控制原则在该名单中约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金托管人在收到名单后2个工作日内回函确认收到该名单。基金管理人应定期或不定期对银行间债券市场现券及回购交易对手的名单进行更新,名单中增加或减少银行间债券市场交易对手时须向基金托管人提出书面申请,基金托管人于2个工作日内回函确认收到后,对名单进行更新。基金管理人收到基金托管人书面确认后,被确认调整的名单开始生效,新名单生效前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易,仍应按照协议进行结算。

如果基金托管人发现基金管理人与不在名单内的银行间债券市场交易对手进行交易,应及时提醒基金管理人撤销交易,经提醒后基金管理人仍执行交易并造成基金财产损失的,由基金管理人承担相应责任,基金托管人不承担责任,发生此种情形时,基金托管人有权报告中国证监会。

## 2. 基金托管人对于基金管理人参与银行间债券市场交易的交易方式的控制。

基金管理人在银行间债券市场进行现券买卖和回购交易时,需按交易对手名单中约定的该交易对手所适用的交易结算方式进行交易。如果基金托管人发现基金管理人没有按照事先约定的有利于信用风险控制的方式进行交易时,基金托管人应及时提醒基金管理人与交易对手重新确定交易方式,经提醒后仍未改正时造成基金财产损失的,由基金管理人承担相应责任,基金托管人不承担责任,法律法规另有规定的除外。

## 3. 基金管理人向基金托管人提供银行间债券市场交易对手名单。

基金管理人有责任控制交易对手的资信风险,在与银行间债券市场交易对手名单以外的交易对手进行交易时,由于交易对手资信风险引起的损失先由基金管理人承担,其后有权要求相关责任人进行赔偿,如果基金托管人在运作中严格遵循了上述监督流程,则对于由于交易对手资信风险引起的损失,不承担赔偿责任。在基金管理人与银行间债券市场交易对手名单中的交易对手,以约定适用的交易方式进行交易的情况下,由于交易对手资信风险引起的损失,基金管理人不承担责任,但基金管理人有权要求相关责任人进行赔偿。

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

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

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

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

基金管理人应至少于首次执行投资指令之前两个工作日将上述资料书面发至基金托管人，保证基金托管人有足够的时间进行审核。基金托管人应在收到上述资料后两个工作日内，以书面或其他双方认可的方式确认收到上述资料。

4. 在投资流通受限证券之前，基金管理人应至少提前一个交易日向基金托管人提供有关流通受限证券的相关信息，具体应当包括但不限于如下文件(如有)：

拟发行数量、定价依据、监管机构的批准证明文件复印件、基金管理人与承销商签订的销售协议复印件、缴款通知书、基金拟认购的数量、价格、总成本、划款账号、划款金额、划款时间文件等。基金管理人应保证上述信息的真实、完整。

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

6. 基金托管人应对基金管理人是否遵守法律法规进行监督，并审核基金管理人提供的有关书面信息。基金托管人认为上述资料可能导致基金出现风险的，有权要求基金管理人在投资流通受限证券前就该风险的消除或防范措施进行补充书面说明，并保留查看基金管理人风险管理部门就基金投资流通受限证券出具

的风险评估报告等备查资料的权利。否则，基金托管人有权拒绝执行有关指令。因拒绝执行该指令造成基金财产损失的，基金托管人不承担任何责任，并有权报告中国证监会。

如基金管理人和基金托管人无法达成一致，应及时上报中国证监会请求解决。如果基金托管人切实履行监督职责，则不承担任何责任。如果基金托管人没有切实履行监督职责，导致基金出现风险，基金托管人应承担连带责任。

7. 相关法律法规对基金投资流通受限证券有新规定的，从其规定。

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

本基金投资银行存款的信用风险主要包括存款银行的信用等级、存款银行的支付能力等涉及到存款银行选择方面的风险。基金管理人向基金托管人提供存款银行名单，本基金投资除存款银行名单以外的银行存款出现由于存款银行信用风险而造成的损失时，先由基金管理人负责赔偿，之后有权要求相关责任人进行赔偿，如果基金托管人在运作过程中遵循上述监督流程，则对于由于存款银行信用风险引起的损失，不承担赔偿责任。基金管理人与基金托管人协商一致后，可以根据当时的市场情况对存款银行名单进行调整。

（七）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资中期票据和中小企业私募债进行监督

1. 基金管理人管理的基金在投资中期票据和中小企业私募债前，基金管理人应根据审慎原则，制定严格的关于投资中期票据和中小企业私募债的风险控制制度、流动性风险和信用风险处置预案，并书面提供给基金托管人，基金托管人依据上述文件对基金管理人投资中期票据和中小企业私募债的额度和比例进行监督。

2. 如未来有关监管部门发布的法律法规对证券投资基金投资中期票据和中小企业私募债另有规定的，从其规定。

3. 基金托管人有权监督基金管理人在相关基金投资中期票据和中小企业私募债时的法律法规遵守情况，有关制度、信用风险、流动性风险处置预案的完善情况，有关额度、比例限制的执行情况。基金托管人发现基金管理人的上述事项违反法律法规和基金合同以及本托管协议的规定，应及时以书面形式通知基金管

理人纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人应按相关托管协议要求向基金托管人及时发出回函，并及时改正。基金托管人有权随时对所通知事项进行复查，督促基金管理人改正。如果基金管理人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。

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

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

基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到书面通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函，就基金托管人的疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对于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。

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

对基金托管人发出的书面提示，基金管理人应在规定时间内答复并改正，或就基金托管人的疑义进行解释或举证；对基金托管人按照法律法规、基金合同和本托管协议的要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

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

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

基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本托管协议规定行使监督权，

或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的，基金托管人应报告中国证监会。

（十三）基金托管人依据有关法律法规的规定、基金合同和本托管协议的约定对于基金关联交易进行监督。

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其他重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先的原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

为履行上述信息披露义务，基金管理人和基金托管人应事先相互提供与本机构有控股关系的股东或与本机构有其他重大利害关系的关联方名单及其更新，加盖公章并书面提交，并确保所提供的关联方名单的真实性、完整性、全面性。名单变更后基金管理人或基金托管人应及时发送对方，基金管理人或基金托管人于2个工作日内电话或回函确认已知名单的变更。

### 三、基金管理人对基金托管人的业务核查

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

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

基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式给基金管理人发出回函，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基

金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复基金管理人并改正。

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

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

#### 四、基金财产的保管

##### （一）基金财产保管的原则

1. 基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产；
2. 基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户、证券账户等投资所需账户；
3. 基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，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，确保基金财产的完整与独立；
4. 基金托管人按照基金合同和本托管协议的约定保管基金财产，如有特殊情况双方可另行协商解决；
5. 对于因为基金投资产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金账户的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金财产造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金财产的损失，基金托管人应予以必要的协助与配合，但对此不承担任何责任；
6. 基金托管人应安全、完整地保管基金资产；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。不属于基金托管人实际有效控制下的实物证券的损坏、灭失，基金托管人不承担责任；
7. 基金托管人对因为基金管理人投资产生的存放或存管在基金托管人以外机构的基金财产，由于该等机构或该等机构会员单位等本托管协议当事人外第三

方的欺诈、疏忽、过失或破产等原因给基金财产造成的损失等不承担责任；

8. 除依据法律法规和基金合同的规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

## （二）基金募集期间及募集资金的验资

1. 基金募集期间募集的资金应存于基金管理人在具有托管资格的商业银行开立的“基金募集专户”。该账户由基金管理人开立并管理。

2. 基金募集期满或基金停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》、基金合同等有关规定后，基金管理人应将属于基金财产的全部资金划入基金托管人开立的基金银行账户，同时在规定时间内，聘请符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所进行验资，出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的 2 名或 2 名以上中国注册会计师签字方为有效。

3. 若基金募集期限届满，未能达到基金合同生效的条件，由基金管理人按规定办理退款等事宜，基金托管人应给予充分的协助与配合。

## （三）基金银行账户的开立和管理

1. 基金托管人以基金托管人的名义开设资产托管专户，保管基金财产的银行存款。该资产托管专户同时也是基金托管人在法人集中清算模式下，代表所托管的包括本基金财产在内的所有托管资产与中国证券登记结算有限责任公司进行一级结算的专用账户。该账户的开设和管理由基金托管人承担。本基金的一切货币收支活动，均需通过基金托管人的资产托管专户进行。基金管理人、基金托管人可根据实际情况需要，为本基金开立资金清算辅助账户，以办理相关的资金汇划业务。

2. 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任何其他银行账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

3. 基金银行账户的开立和管理应符合银行业监督管理机构的有关规定。

## （四）定期存款账户

基金财产投资定期存款在存款机构开立的银行账户，包括实体或虚拟账户，其预留印鉴经各方商议后预留。对于任何的定期存款投资，基金管理人都必须和

存款机构签订定期存款协议,约定双方的权利和义务,该协议作为划款指令附件。该协议中必须有如下明确条款:“存款证实书不得被质押或以任何方式被抵押,并不得用于转让和背书;本息到期归还或提前支取的所有款项必须划至托管专户(明确户名、开户行、账号等),不得划入其他任何账户”。如定期存款协议中未体现前述条款,基金托管人有权拒绝定期存款投资的划款指令。在取得存款证实书后,基金托管人保管证实书正本或者复印件。基金管理人应该在合理的时间内进行定期存款的投资和支取事宜,若基金管理人提前支取或部分提前支取定期存款,若产生息差(即本基金已计提的资金利息和提前支取时收到的资金利息差额),该息差的处理方法由基金管理人和基金托管人双方协商解决

#### (五) 基金证券账户和结算备付金账户的开立和管理

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

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

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

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

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

#### (六) 债券托管专户的开设和管理

基金合同生效后,基金托管人根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司的有关规定,以本基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司与银行间市场清算所股份有限公司开立债券托管账户,并代表基金进行银行间市场债券的结算。

### （七）股指期货、国债期货的相关账户的开立和管理

基金管理人、基金托管人应当按照相关规定开立期货结算账户、期货资金账户，在中国金融期货交易所获取交易编码。期货结算账户名称、期货资金账户名称及交易编码对应名称应按照有关规定设立。

### （八）其他账户的开立和管理

1. 因业务发展需要而开立的其他账户，可以根据法律法规和基金合同的规定，由基金托管人负责开立。新账户按有关规定使用并管理。

2. 法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定。

### （九）基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的有关实物证券等有价凭证由基金托管人存放于基金托管人的保管库，也可存入中央国债登记结算有限责任公司、中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司或票据营业中心的代保管库，保管凭证由基金托管人持有。实物证券等有价凭证的购买和转让，由基金管理人和基金托管人共同办理。属于基金托管人实际有效控制下的实物证券在基金托管人保管期间的损坏、灭失，由此产生的责任应由基金托管人承担。基金托管人对由基金托管人以外机构实际有效控制的证券不承担保管责任。

### （十）与基金财产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的、与基金财产有关的重大合同的原件分别由基金管理人、基金托管人保管。除本托管协议另有规定外，基金管理人代表基金签署与基金财产有关的重大合同时应保证基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人应在重大合同签署后及时将重大合同传真给基金托管人，并及时将正本送达基金托管人处。因基金管理人发送的合同传真件与事后送达的合同原件不一致所造成的后果，由基金管理人负责。重大合同的保管期限不少于法律法规规定的最低年限。

对于无法取得二份以上的正本的，基金管理人应向基金托管人提供加盖授权业务章的合同传真件，未经双方协商或未在合同约定范围内，合同原件不得转移。

## 五、基金资产净值计算和复核

### （一）基金资产净值的计算、复核与完成的时间及程序

### 1. 基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

各类基金份额净值是指按照每个交易日闭市后，该类基金资产净值除以当日该类基金份额的余额数量计算，精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人每个交易日计算基金资产净值及各类基金份额净值，经基金托管人复核无误后，按规定公告。但基金管理人根据法律法规或基金合同的规定暂停估值时除外。

### 2. 复核程序

基金管理人每个交易日对基金资产进行估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

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

## （二）基金资产估值方法和特殊情形的处理

### 1. 估值对象

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

### 2. 估值方法

#### （1）证券交易所上市的有价证券的估值

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

2) 交易所上市实行净价交易的债券按估值日第三方估值机构提供的相应品

种的净价进行估值；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，确定公允价值；

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，确定公允价值；经与托管人协商一致，基金管理人可采用第三方估值机构提供的相关数据作为估值依据；

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

(2) 处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

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

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

(3) 金融衍生品的估值

1) 评估金融衍生品价值时，应当采用市场公认或者合理的估值方法确定公允价值；

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

(4) 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) 对只在上海证券交易所固定收益平台或只在深圳证券交易所综合协议

平台进行交易的债券，采用估值技术确定公允价值或按成本法进行估值。

（6）中小企业私募债采用估值技术确定公允价值或按成本法进行估值。

（7）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。

（8）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。

（9）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。

（10）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。

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

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

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

### 3. 特殊情形的处理

（1）基金管理人、基金托管人按估值方法的第（10）项进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值估值错误处理。

（2）由于证券、期货交易所及注册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免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

#### （三）基金份额净值错误的处理方式

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当任一类基金份额净值小数点后4位以内(含第4位)发生估值错误时,视为该类基金份额净值错误。

### 1、估值错误类型

本基金运作过程中,如果由于基金管理人或基金托管人、或登记机构、或销售机构、或投资人自身的过错造成估值错误,导致其他当事人遭受损失的,过错的责任人应当对由于该估值错误遭受损失当事人(“受损方”)的直接损失按下述“估值错误处理原则”给予赔偿,承担赔偿责任。

上述估值错误的主要类型包括但不限于:资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等。

### 2、估值错误处理原则

(1) 估值错误已发生,但尚未给当事人造成损失时,估值错误责任方应及时协调各方,及时进行更正,因更正估值错误发生的费用由估值错误责任方承担;由于估值错误责任方未及时更正已产生的估值错误,给当事人造成损失的,由估值错误责任方对直接损失承担赔偿责任;若估值错误责任方已经积极协调,并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正,则其应当承担相应赔偿责任。估值错误责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认,确保估值错误已得到更正。

(2) 估值错误的责任方对有关当事人的直接损失负责,不对间接损失负责,并且仅对估值错误的有关直接当事人负责,不对第三方负责。

(3) 因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但估值错误责任方仍应对估值错误负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失(“受损方”),则估值错误责任方应赔偿受损方的损失,并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利;如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方,则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给估值错误责任方。

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

### 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

（1）查明估值错误发生的原因，列明所有的当事人，并根据估值错误发生的原因确定估值错误的责任方；

（2）根据估值错误处理原则或当事人协商的方法对因估值错误造成的损失进行评估；

（3）根据估值错误处理原则或当事人协商的方法由估值错误的责任方进行更正和赔偿损失；

（4）根据估值错误处理的方法，需要修改基金登记机构交易数据的，由基金登记机构进行更正，并就估值错误的更正向有关当事人进行确认。

4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

（1）基金份额净值计算出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

（2）错误偏差达到该类基金份额净值的 0.25% 时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到该类基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应当公告。

（3）前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

（四）暂停估值与公告基金份额净值的情形

1. 基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2. 因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

3、当前一估值日基金资产净值 50% 以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，且经与基金托管人协商确认后应当暂停基金估值；

4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

发生前述第 3 项情形时，基金管理人应采取延缓支付赎回款项的措施。

（五）基金会计制度

按国家有关部门规定的会计制度执行。

（六）基金账册的建立

基金管理人进行基金会计核算并编制基金财务会计报告。基金管理人、基金

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

### （七）基金财务报表与报告的编制和复核

#### 1. 财务报表的编制

基金财务报表由基金管理人编制，基金托管人复核。

#### 2. 报表复核

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

#### 3. 财务报表的编制与复核时间安排

##### （1）报表的编制

基金管理人应当在每月结束后 5 个工作日内完成月度报表的编制；在每个季度结束之日起 15 个工作日内完成基金季度报告的编制；在上半年结束之日起两个月内完成基金中期报告的编制；在每年结束之日起三个月内完成基金年度报告的编制。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。基金合同生效不足两个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。

##### （2）报表的复核

基金管理人应当在月度报表完成当日，将报表盖章后提供给基金托管人复核；基金托管人在收到后应在 3 日内进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人应当在季度报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后 5 个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人应当在中期报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后 15 日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人应当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 20 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传真或双方商定的其他方式进行。

基金托管人在复核过程中，发现双方的报表存在不符时，基金管理人和基金

托管人应共同查明原因，进行调整，调整以国家有关规定为准。核对无误后，基金托管人在基金管理人提供的报告上加盖业务印鉴或者出具加盖托管业务部门公章的复核意见书，或进行电子确认，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中国证监会备案。基金管理人应留足充分的时间，便于基金托管人复核相关报表及报告。

基金托管人在对财务会计报告、中期报告或年度报告复核完毕后，需盖章确认或出具相应的复核确认书，以备有权机关对相关文件审核时提示。

## 六、基金份额持有人名册的保管

基金份额持有人名册的内容必须包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。基金份额持有人名册由基金的注册登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，基金管理人和基金托管人应按照目前相关规则分别保管基金份额持有人名册，保存期不少于法律法规规定的最低年限。如不能妥善保管，则按相关法规承担责任。

在基金托管人要求或编制中期报告和年度报告前，基金管理人应将有关资料送交基金管理人，不得无故拒绝或延误提供，并保证其真实性、准确性和完整性。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。

## 七、争议解决方式

因本托管协议而产生的或与本托管协议有关的一切争议，双方当事人应通过协商、调解解决，协商、调解不能解决的，任何一方均有权将争议提交上海国际经济贸易仲裁委员会（上海国际仲裁中心），按照上海国际经济贸易仲裁委员会（上海国际仲裁中心）届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为上海市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力，仲裁费用和律师费用由败诉方承担。

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

本托管协议受中华人民共和国法律管辖。

## 八、托管协议的变更、终止与基金财产的清算

### （一）托管协议的变更程序

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

### （二）基金托管协议终止出现的情形

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

### （三）基金财产的清算

#### 1. 基金财产清算小组

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

（2）基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、符合《中华人民共和国证券法》规定的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

#### 2. 基金财产清算程序

- （1）基金合同终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；
- （2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- （3）对基金财产进行估值和变现；
- （4）制作清算报告；
- （5）聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算

报告出具法律意见书；

（6）将清算报告报中国证监会备案并公告；

（7）对基金剩余财产进行分配。

3. 基金财产清算的期限为 6 个月。

4. 清算费用

清算费用是指基金财产清算小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小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

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；基金财产清算结果经符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计，并由律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组公告。

7. 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存不少于法律法规规定的最低年限。