

**圆信永丰基金管理有限公司**

**圆信永丰汇利混合型证券投资基金（LOF）**

**招募说明书（更新）**

基金管理人：圆信永丰基金管理有限公司

基金托管人：兴业证券股份有限公司

二〇二二年十二月

## 重要提示

本基金的募集申请经中国证监会 2017 年 10 月 18 日证监许可[2017]1847 号文准予募集注册。**基金合同已于 2017 年 11 月 30 日正式生效。**

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整、及时、简明和易得。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投资价值、市场前景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。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资有风险，投资者在投资本基金时应认真阅读本招募说明书、基金合同、基金产品资料概要等信息披露文件，全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，自主判断基金的投资价值，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对投资本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，自行承担投资风险。投资者根据所持有份额享受基金的收益，但同时也需承担相应的投资风险。投资本基金可能遇到的风险包括：因政治、经济、社会等因素对证券价格波动产生影响而引发的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金份额持有人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特定风险等。

基金资产投资于科创板股票，会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有投资风险，包括但不限于退市风险、市场风险、流动性风险、集中度风险、系统性风险、政策风险等。

本基金可投资中小企业私募债券。中小企业私募债券属于高风险的债券投资品种，其流动性风险和信用风险均高于一般债券品种，会影响组合的风险特征。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%。中小企业私募债券的流动性风险在于该类债券采取非公开方式发行和交易，由于不公开资料，外部评级机构一般不对这类债券进行外部评级，可能会降低市场对该类债券的认可度，从而影响该类债券的市场流动性。中小企业私募债券的信用风险在于该类债券发行主体的资产规模较小、经营的波动性较大，同时，各类材料（包括募集说明书、审计报告）不公开发布，也大大提高了分析并跟踪发债主体

信用基本面的难度。

本基金为混合型基金，属于证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的品种，其预期风险收益水平高于债券型基金、货币市场基金，低于股票型基金。

本基金基金合同、招募说明书等法律文件中涉及基金风险收益特征或风险状况的表述仅为主要基于基金投资方向与策略特点的概括性表述；而本基金各销售机构依据中国证券投资基金业协会发布的《基金募集机构投资者适当性管理实施指引（试行）》及内部评级标准、将基金产品按照风险由低到高顺序进行风险级别评定划分，其风险评级结果所依据的评价要素可能更多、范围更广，与本基金法律文件中的风险收益特征或风险状况表述并不必然一致或存在对应关系。同时，不同销售机构因其采取的具体评价标准和方法的差异，对同一产品风险级别的评定也可能各有不同；销售机构还可能根据监管要求、市场变化及基金实际运作情况等适时调整对本基金的风险评级。敬请投资人知悉，在购买本基金时按照销售机构的要求完成风险承受能力与产品风险之间的匹配检验，并须及时关注销售机构对于本基金风险评级的调整情况，谨慎作出投资决策。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，但不保证投资本基金一定盈利，也不保证基金份额持有人的最低收益；因基金价格可升可跌，亦不保证基金份额持有人能全数取回其原本投资。

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并不构成对本基金业绩表现的保证。

基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化导致的投资风险，由投资者自行承担。

投资人应当认真阅读基金合同、基金招募说明书等信息披露文件，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。

**本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容更新截止日为 2022 年 11 月 30 日，其中，基金管理人的人员信息的更新截止日为 2022 年 12 月 21 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2022 年 9 月 30 日（未经审计）。**

## 目录

|                             |     |
|-----------------------------|-----|
| 第一节绪言.....                  | 1   |
| 第二节释义.....                  | 2   |
| 第三节基金管理人.....               | 8   |
| 第四节基金托管人.....               | 19  |
| 第五节相关服务机构.....              | 22  |
| 第六节基金的募集.....               | 35  |
| 第七节基金合同的生效.....             | 36  |
| 第八节基金的上市交易.....             | 37  |
| 第九节基金份额的申购与赎回.....          | 38  |
| 第十节基金的投资.....               | 50  |
| 第十一节基金的财产.....              | 66  |
| 第十二节基金资产的估值.....            | 67  |
| 第十三节基金的收益与分配.....           | 73  |
| 第十四节基金的费用与税收.....           | 75  |
| 第十五节基金的会计与审计.....           | 77  |
| 第十六节基金的信息披露.....            | 78  |
| 第十七节侧袋机制.....               | 85  |
| 第十八节风险揭示.....               | 88  |
| 第十九节基金合同的变更、终止与基金财产的清算..... | 96  |
| 第二十节基金合同的内容摘要.....          | 98  |
| 第二十一节基金托管协议的内容摘要.....       | 115 |
| 第二十二节对基金份额持有人的服务.....       | 129 |
| 第二十四节招募说明书的存放及查阅方式.....     | 132 |
| 第二十五节备查文件.....              | 133 |

## 第一节 绪言

《圆信永丰汇利混合型证券投资基金（LOF）招募说明书》（以下简称“本招募说明书”）由圆信永丰基金管理有限公司依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）和其他有关法律法规的规定以及《圆信永丰汇利混合型证券投资基金（LOF）基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

本招募说明书阐述了圆信永丰汇利混合型证券投资基金（LOF）的投资目标、投资策略、风险、费率等与投资者投资决策有关的全部必要事项，投资人在作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。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写，并经中国证监会注册。基金合同是约定基金合同当事人之间权利、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。

## 第二节释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

- 1、基金或本基金：指圆信永丰汇利混合型证券投资基金（LOF）
- 2、基金管理人：指圆信永丰基金管理有限公司
- 3、基金托管人：指兴业证券股份有限公司
- 4、基金合同：指《圆信永丰汇利混合型证券投资基金（LOF）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《圆信永丰汇利混合型证券投资基金（LOF）托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
- 6、招募说明书或本招募说明书：指《圆信永丰汇利混合型证券投资基金（LOF）招募说明书》及其更新
- 7、基金份额发售公告：指《圆信永丰汇利混合型证券投资基金（LOF）基金份额发售公告》
- 8、基金产品资料概要：指《圆信永丰汇利混合型证券投资基金基金产品资料概要》及其更新
- 9、上市交易公告书：指《圆信永丰汇利混合型证券投资基金（LOF）基金份额上市交易公告书》
- 10、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
- 11、《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，经 2012 年 12 月 28 日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自 2013 年 6 月 1 日起实施，并经 2015 年 4 月 24 日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修改的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 12、《销售办法》：指中国证监会 2013 年 3 月 15 日颁布、同年 6 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 13、《信息披露办法》：指中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1

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

14、《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

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

16、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

17、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

18、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

19、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

20、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

21、合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》、《人民币合格境外机构投资者境内证券投资试点办法》及相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者

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

23、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

24、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、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务

25、销售机构：指圆信永丰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，办理基金销售业务的机构，以及可通过上海证券交易所交易系统办理基金销售业务的会员单位。其中可通过上海证券交易所交易系统办理本基金销售

业务的机构必须是具有基金销售业务资格、并经上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的会员单位

26、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开放式基金账户和/或上海证券账户的建立和管理、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

27、登记机构：指办理登记业务的机构。本基金的登记机构为中国证券登记结算有限责任公司

28、基金账户：指投资者通过场外销售机构在中国证券登记结算有限责任公司注册的开放式基金账户，用于记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况

29、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买卖本基金的基金份额和办理认购、申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户

30、上海证券账户：指在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司开设的上海证券交易所人民币普通股票账户（即 A 股账户）或证券投资基金账户，基金投资者通过上海证券交易所办理基金交易、场内认购、场内申购和场内赎回等业务时需持有上海证券账户

31、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

32、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

33、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

34、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

35、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

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

37、T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日（不包含 T 日）

38、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

39、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

40、《业务规则》：上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司、圆信永丰基金管理有限公司、基金销售机构的相关业务规则

41、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

42、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

43、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

44、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

45、上市交易：投资人通过场内会员单位以集中竞价的方式买卖基金份额的行为

46、转托管：指基金份额持有人将持有的基金份额在登记结算系统内不同销售机构（网点）或证券登记系统内不同会员单位（席位或交易单元）之间进行转登记的行为，包括系统内转托管和跨系统转托管

47、系统内转托管：指基金份额持有人将其持有的基金份额在登记结算系统内不同销售机构（网点）之间进行转托管的行为或者证券登记系统内不同会员单位（席位或交易单元）之间进行指定关系变更的行为

48、跨系统转托管：指基金份额持有人将其持有的基金份额在登记结算系统和证券登记系统之间进行转登记托管的行为

49、会员单位：指具有基金销售业务资格并经上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的上海证券交易所会员单位

50、登记结算系统：指中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统，通过场外销售机构认购、申购的基金份额登记在本系统

51、证券登记系统：指中国证券登记结算有限责任公司上海分公司证券登记

系统，通过场内会员单位认购、申购或买入的基金份额登记在本系统

52、场外：指上海证券交易所交易系统外的销售机构利用其自身柜台或者其他交易系统办理基金份额认购、申购和赎回业务的基金销售机构和场所，通过该等场所办理基金份额的认购、申购和赎回也称为场外认购、场外申购和场外赎回

53、场内：通过具有相应业务资格的上海证券交易所会员单位利用上海证券交易所交易系统办理基金份额的认购、申购、赎回和上市交易等业务的场所，通过该等场所办理基金份额的认购、申购、赎回也称为场内认购、场内申购、场内赎回

54、场外基金份额：指登记在登记结算系统下的基金份额

55、场内基金份额：指登记在证券登记系统下的基金份额

56、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

57、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%

58、元：指人民币元

59、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

60、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

61、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

62、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

63、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

64、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

65、7 个工作日可变现资产：指包括可在交易所、银行间市场正常交易的股票、债券、非金融企业债务融资工具及同业存单，7 个工作日内到期或可支取的逆回购、银行存款，7 个工作日内能够确认收到的各类应收款项等

66、摆动定价机制：指当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，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待

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

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

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

70、不可抗力：指本合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

### 第三节基金管理人

#### 一、基金管理人概况

名称：圆信永丰基金管理有限公司

住所：中国（福建）自由贸易试验区厦门片区（保税港区）海景南二路 45 号 4 楼 02 单元之 175

设立时间：2014 年 1 月 2 日

法定代表人：胡荣炜

办公地址：中国上海市浦东新区世纪大道 1528 号陆家嘴基金大厦 19 楼

电话：021-60366000；传真：021-60366009

客服电话：400-607-0088

联系人：严晓波

注册资本：人民币贰亿元整

股权结构：厦门国际信托有限公司（以下简称“厦门国际信托”）持有 51% 的股权；永丰证券投资信托股份有限公司（以下简称“永丰投信”）持有 49% 的股权。

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监许可[2013]1514 号

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

#### 二、主要人员情况

##### （一）董事会成员

董事长：

胡荣炜先生，公司董事长，厦门大学经济学硕士、工商管理硕士，CFA 持证人，经济师职称。历任福建省中国银行厦门市分行营业部储蓄科、风险管理处审查科科长、风险管理处业务审查副科长、科长，柯达亚太影像材料制造财务经理，柯达（厦门）数码影像有限公司财务经理，柯达中国区制造财务内控总监，厦门磐基大酒店有限公司集团副总经理，厦门金圆投资集团有限公司投资管理部投资经理，厦门市创业投资有限公司总经理助理、副总经理，厦门国际信托有限公司副总经理。现任厦门国际信托有限公司总经理、中共厦门国际信托有限公司党委副书记。

**独立董事：**

柳经纬先生，公司独立董事，厦门大学法学硕士。历任厦门大学法律系（法学院）助教、讲师、副教授、教授、法律系主任、法学院副院长、中国政法大学科研处处长。现任中国政法大学教授、博士生导师、司法文明协同创新中心副主任。曾兼任香港冯元钺律师事务所、施文律师事务所担任中国法律顾问。现兼任中欧法学院兼职教授，北京鑫诺律师事务所兼职律师，北京仲裁委员会仲裁员，厦门仲裁委员会仲裁员，兰州仲裁委员会仲裁员，中国标准化专家委员会委员。

刘志云先生，公司独立董事，厦门大学国际法学博士。历任厦门大学法学院讲师、副教授，兼任元翔（厦门）国际航空港股份有限公司等上市公司独立董事。现任厦门大学法学院教授。

吴超鹏先生，公司独立董事，厦门大学企业管理博士。历任厦门大学管理学院财务学副教授、副院长。现任厦门大学管理学院财务学教授、博导、常务副院长，兼任中国管理现代化研究会常务理事、财务与会计专业委员会副主任委员。

**股东董事：**

蔡炎坤先生，公司董事，厦门大学货币银行学硕士。历任厦门国际信托投资公司证券交易营业部副经理、证券总部副总经理、信托部经理、市场开发部经理、资金运作部经理、厦门国际信托有限公司股权投资总部总经理、公司总经理助理、公司副总经理兼工会主席、党委委员。现任圆信永丰基金管理有限公司总经理。

郑华女士，公司董事，厦门大学行政管理本科学历，经济师职称。历任厦门建发信托投资公司业务员、办公室主任等职；厦门国际信托有限公司办公室主任、人力资源部总经理、财富管理中心总经理、公司总经理助理等职。现任厦门国际信托有限公司副总经理。

许如玫女士，公司董事，美国德州州立大学企业管理硕士。历任建弘国际投资顾问研究员，建弘证券经理，建弘投信基金经理、营销企划部门主管，永丰金资产管理（亚洲）董事总经理，永丰证券投资信托股份有限公司董事长、总经理；现任永丰金融控股股份有限公司财务长、永丰创业投资股份有限公司董事长。兼任永丰银行董事。

濮乐伟先生，公司董事，休斯顿大学工商管理硕士。历任摩根投信董事总经理，摩根证券总经理，摩根富林明投顾总经理；现任永丰证券投资信托股份有限

公司总经理。

白中琪先生，公司董事，台湾中央大学硕士。历任上海高德机械有限公司总经理、上海成美投资顾问有限公司总经理、上海东立国际旅行社有限公司总经理，现任永丰金证券(亚洲)有限公司上海代表处首席代表、台北市市政顾问。

## （二）监事会成员

林家进先生，公司监事会主席，铭传大学管理学院硕士。历任中信期货经理（股）公司董事长兼总经理、元富期货（股）公司总经理、国泰期货（股）公司总经理、国泰证券（股）公司副总经理，现任永丰期货（股）公司总经理。

赵耀煌先生，公司监事，厦门大学管理学院本科学历，会计师职称。历任厦门通士达有限公司、厦门松霖科技有限公司、百威英博（厦门）服务外包有限公司会计及项目主管等职；厦门国际信托有限公司财务部信托会计、投资发展部项目经理、资产运营部总经理助理、投资发展部总经理助理等职。现任厦门国际信托有限公司投资发展部副总经理。

吴烨女士，公司职工监事、综合管理部总监，华东师范大学本科学历。历任江苏联合信托投资有限公司人事行政主管、德邦证券有限责任公司人力资源部薪酬福利经理，湘财证券股份有限公司人力资源与发展总部人事经理。

谢雁南女士，公司职工监事、监察稽核部总监，上海交通大学工商管理硕士。历任上海蝶翠诗商业有限公司法务部法务岗、汇丰银行(中国)有限公司零售银行及财富管理业务部合规专员、东吴基金管理有限公司合规风控部高级法务经理。

## （三）公司总经理及其他高级管理人员

蔡炎坤先生，公司总经理，简历见上。

兰文伟先生，公司督察长，中南民族大学本科学历。历任厦门国际信托有限公司证券部业务主办、法务专员、合规管理部副总经理、法务合规部总经理、党委办公室主任、风险总监、纪委书记，曾任福建厦门理海律师事务所律师。

范妍女士，公司副总经理兼首席投资官，复旦大学管理学硕士。历任兴业证券股份有限公司研究所行业与公司研究员，安信证券股份有限公司研究部策略分析师，工银瑞信基金管理有限公司研究部高级策略研究员，圆信永丰基金管理有限公司权益投资部基金经理助理、副总监、总监。

姚德明先生，公司首席信息官，上海财经大学工商管理硕士，历任上海康时

信息有限公司技术部数据库 dba、上海东方龙马软件有限公司技术部数据库 dba、华安基金管理有限公司信息技术部 OP 主管；自 2013 年 2 月加入圆信永丰基金管理有限公司，担任信息技术部总监一职。

吴莉芳女士，公司副总经理、财务负责人，本科学历，会计师职称。历任厦门国际信托有限公司海沧办事处会计、子公司会计、财务经理，厦门国际信托有限公司财务部、计划财务部会计、市场开发部信托经理、研究发展部研究员、办公室副主任、人力资源部总经理。

#### （四）本基金基金经理

##### 1、本基金现任基金经理

邹维先生，上海交通大学国际经济与贸易本科学历，现任圆信永丰基金管理有限公司权益投资部基金经理。历任永丰金证券业务助理，圆信永丰基金管理有限公司研究部研究员、权益投资部基金经理助理。邹维先生于 2019 年 1 月 25 日至 2020 年 3 月 5 日管理圆信永丰多策略精选混合型证券投资基金、于 2019 年 1 月 25 日起管理圆信永丰汇利混合型证券投资基金（LOF）、于 2019 年 7 月 17 日起管理圆信永丰精选回报混合型证券投资基金，于 2020 年 9 月 23 日起管理圆信永丰兴研灵活配置混合型证券投资基金。

##### 2、本基金的历任基金经理

洪流先生，2017 年 11 月 30 日至 2019 年 1 月 31 日任本基金基金经理。

李明阳先生，2017 年 12 月 5 日至 2021 年 11 月 19 日任本基金基金经理。

#### （五）投资决策委员会成员

主席：

蔡炎坤先生，简历见上。

成员：

王琳女士，复旦大学世界经济研究所硕士，现任圆信永丰基金管理有限公司交易部总监。历任国泰君安证券交易员，国联安基金管理有限公司交易员，金元惠理基金管理有限公司交易部总监。

范妍女士，简历见上。

胡春霞女士，武汉大学金融学硕士，现任圆信永丰基金管理有限公司权益投资部总监。历任港澳证券投资咨询部分析师，中原证券研究所研究员，海通证券

研究所研究员，国泰君安证券研究所研究员，圆信永丰基金管理有限公司权益投资部副总监。

林铮先生，厦门大学经济学硕士，现任圆信永丰基金管理有限公司固收投资部总监。历任厦门国贸集团投资研究员，国贸期货宏观金融期货研究员，海通期货股指期货分析师，圆信永丰基金管理有限公司专户投资部副总监、固收投资部副总监。

崔长峰先生，上海交通大学金融学博士，现任圆信永丰基金管理有限公司权益投资部基金经理。历任平安资产管理公司量化投资部投资经理，圆信永丰基金管理有限公司专户量化投资部总监、专户一部总监。

陈臣先生，上海交通大学工商管理硕士，现任圆信永丰基金管理有限公司研究部副总监（主持工作）。历任易唯思商务咨询有限公司研究部研究助理，永丰金证券（亚洲）有限公司研究部研究员，中国国际金融股份有限公司研究部研究员，圆信永丰基金管理有限公司研究部研究员、总监助理、权益投资部基金经理兼研究部总监助理。

督察长有权列席公募基金投资决策委员会会议，经总经理批准的其他人员可列席参会。

（六）上述人员之间均不存在近亲属关系。

### 三、基金管理人的职责

（一）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；

（二）办理基金备案手续；

（三）对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；

（四）按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

（五）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

（六）编制季度报告、中期报告和年度报告；

（七）计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；

（八）办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；

（九）按照规定召集基金份额持有人大会；

（十）保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

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

（十二）有关法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他职责。

#### 四、基金管理人关于遵守法律法规的相关承诺

（一）本基金管理人承诺严格遵守现行有效的相关法律、法规、规章、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、规章、基金合同和中国证监会有关规定的行为发生。

（二）本基金管理人承诺严格遵守《中华人民共和国证券法》、《基金法》及有关法律法规，建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止下列行为发生：

1、将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；

2、不公平地对待管理人管理的不同基金财产；

3、利用基金财产或者职务之便为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；

4、向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；

5、侵占、挪用基金财产；

6、泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

7、玩忽职守，不按照规定履行职责；

8、法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。

（三）本基金管理人承诺加强员工管理和培训，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，不按照规定履行职责；

7、违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

8、除按基金管理人制度进行基金、特定客户资产管理计划运作投资外，直接或间接进行其他股票投资；

9、协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易；

10、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；

11、贬损同行，以抬高自己；

12、以不正当手段谋求业务发展；

13、有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；

14、在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；

15、其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

#### 五、基金管理人关于禁止性行为的相关承诺

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

(1) 承销证券；

(2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；

(3) 从事承担无限责任的投资；

(4) 买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；

(5) 向其基金管理人、基金托管人出资；

(6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

(7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合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的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以

上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

法律、行政法规或监管部门取消或变更上述禁止性或限制性规定，如适用于本基金，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。

## 六、基金经理承诺

1、依照有关法律、法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；

2、不利用职务之便为自己及其代理人、受雇人或任何第三人谋取不当利益；

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，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

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。

## 七、基金管理人的内部控制制度

基金管理人始终将“持有人利益优先”原则放在首位，扎实推进全面风险管理与全员风险管理，坚持“积极参与、事前防范、合规经营、稳健发展”的风控理念，以内控制度建设作为风险管理的基石，以风控组织架构作为风险管理的载体，以制度流程的切实执行作为风险管理的核心，以内部独立部门的有效监督作为风险管理的关键，以充分使用先进的风险管理技术和方式方法作为风险管理的保障，强调对于内部控制与风险管理的持续关注和资源投入。

### （一）内部控制概述

内部控制是指基金管理人为防范和化解风险，保证经营运作符合基金管理人发展规划，在充分考虑内外部环境的基础上，通过建立组织机制、运用管理方法、实施操作程序与控制措施而形成的有机系统。

内部控制是由为保障业务正常运作、实现既定的经营目标、防范经营风险而设立的各种内部控制机制和一系列规范内部运作程序、描述控制措施和方法等制度构成的统一整体。

内部控制是由基金管理人的董事会、管理层和员工共同实施的合理保证。

### （二）内部控制目标

1、保证基金管理人的经营运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念；

2、防范和化解经营风险，提高经营管理效益，确保经营业务的稳健运行和受托资产的安全完整，实现基金管理人的持续、稳定、健康发展；

3、确保基金、基金管理人财务和其他信息真实、准确、完整、及时。

### （三）内部控制原则

1、健全性原则：内部控制机制覆盖基金管理人的各项业务、各个部门和各级人员，并贯穿于决策、执行、监督、反馈等各个环节；

2、有效性原则：通过科学的内部控制手段和方法，建立合理的内部控制程序，维护内部控制制度的有效执行；

3、独立性原则：基金管理人各机构、部门和岗位职责应当保持相对独立，基金资产、固有资产、其他资产的运作应当分离；

4、相互制约原则：基金管理人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：基金管理人运用科学化的经营管理方法降低运营成本，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。

### （四）内部控制组织体系

基金管理人依据自身经营特点设立顺序递进、权责统一、严密有效的内控防线：

1、建立以各岗位目标责任制为基础的第一道内控防线。员工积极发挥主观能动性，在严于律己的前提下，相互监督制衡。各岗位职责明确，有详细的岗位说明书和业务流程，各岗位人员在上岗前均应知悉并以书面方式承诺遵守，在授权范围内承担责任。

2、建立相关部门、相关岗位之间相互监督制衡的第二道内控防线。基金管理人在相关部门和相关岗位之间建立重要业务处理凭据传递和信息沟通制度，后续部门及岗位对前部门及岗位负有监督责任。

3、建立以公司督察长、监察稽核部门对各岗位、各部门、各机构、各项业务全面实施监督反馈的第三道防线。督察长、监察稽核部门独立于其他部门，对内部控制制度的执行情况实行严格的检查和反馈。

4、建立以董事会下属风险与合规管理委员会对公司经营管理和基金运作中

的合法合规性实行全面监督的第四道防线。风险与合规管理委员会对公司经营和基金运作中的风险进行严格的合规检查和风险控制评估并审议公司风险管理工作报告。

董事会对基金管理人的风险管理负有最终责任。

#### （五）内部控制制度

内部控制制度指规范内部控制的一系列规章制度和义务规则，是内部控制的重要组成部分。内部控制制度制订的基本依据为法律法规、中国证监会及其他主管部门有关文件的规定。

基金管理人依据合法合规性、全面性、审慎性、适时性等内部控制制度制订原则，已构建较为合理完备并易于执行的内部控制与风险管理制度体系，具体包括四个层面：

1、一级制度：包括公司章程、股东会议事规则、董事会议事规则、监事会议事规则、董事会专门委员会议事规则等公司治理层面的经营管理纲领性制度。

2、二级制度：包括内部控制大纲、内部机构设置及职能划分、风险控制制度、投资管理制度、基金会计制度、信息披露制度、监察稽核制度、信息技术管理制度、财务管理制度、档案管理制度、紧急情况处理制度等公司基本管理制度。

3、三级制度：包括公司范围内适用的全局性专项管理制度与各业务职能部门管理制度。

4、四级制度：包括各业务条线单个部门内部或跨部门层面的业务规章、业务规则、业务流程、操作规程等具体细致的规范化管理制度。

#### （六）内部控制内容

（1）控制环境。控制环境构成基金管理人内部控制的基础，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。

（2）风险评估。基金管理人建立科学严密的风险评估体系，对内外部风险进行识别、评估和分析，及时防范和化解风险；建立完整的风险控制程序，包括风险识别、风险评估、风险控制和风险监督；对各部门和各业务循环存在的风险点进行识别评估，并建立相应的控制措施；使用科学的风险量化技术和严格的风险限额控制对投资风险实行定量分析和管理。

（3）控制措施。基金管理人设立顺序递进、权责统一、严密有效的多道内

部控制防线，制定并执行包括授权控制、资产分离、岗位分离、业务流程和操作规程、业务记录、绩效考核等在内的多样化的具体控制措施。

（4）信息沟通。基金管理人维护内部控制信息沟通渠道的畅通，建立清晰的报告系统。

（5）内部监控。基金管理人建立有效的内部监控制度，设置督察长和独立的监察稽核部门，对内部控制制度的执行情况进行持续的监督与反馈，保证内部控制制度的有效落实，并评价内部控制的有效性，根据市场环境、新的金融工具、新的技术应用和新的法律法规等情况适时改进。

（6）流动性风险控制。基金管理人建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，包括但不限于：严密完备的管理制度、科学规范的业务控制流程、清晰明确的组织架构与职责分工、独立严格的监督制衡与评估机制、灵活有效的应急处置计划等。

（7）流动性风险监测与预警制度。基金管理人全覆盖、多维度建立以压力测试为核心的开放式基金流动性风险监测与预警制度，并区分不同类型开放式基金制定健全有效的流动性风险指标预警监测体系、建立常态化的压力测试工作机制。

#### （七）基金管理人关于内部控制制度的声明

本基金管理人确知建立、维持、完善、实施和有效执行风险管理和内部控制制度是本基金管理人董事会及管理层的责任，董事会承担最终责任。本基金管理人特别声明以上关于内部控制制度的披露真实、准确、完备，并承诺将根据市场环境的变化和业务的发展不断完善内部控制制度。

## 第四节基金托管人

### 一、基金托管人情况

名称：兴业证券股份有限公司

住所：福州市湖东路 268 号

设立日期：2000 年 05 月 19 日

注册资本：669667.167400 万人民币

法定代表人：杨华辉

办公地址：上海市浦东新区长柳路 36 号丁香国际商业中心东塔 11 楼

电话：021-20370763

联系人：江咏絮

### 二、主要人员情况

基金托管人针对本基金配备了经验丰富的估值核算、资金清算及交收等人员，主要成员均为硕士研究生学历，具备多年银行、券商相关工作经验，具备基金从业资格。团队人员从事过股票型、债券型或混合型公募基金、证券公司集合资产管理计划、期货资产管理计划、私募投资基金、基金公司及子公司专户产品等多类型产品的估值核算工作，能够及时处理资金清算和交收工作，在日常工作中具备足够丰富的托管业务处理经验。

### 三、基金托管业务经营情况

兴业证券股份有限公司于 2014 年 11 月经中国证监会批准获取证券投资基金托管业务资格，批准文号：中国证券监督管理委员会证监许可【2014】1170 号。

兴业证券股份有限公司始终坚持“专业化、规范化、市场化”的经营思想，坚持“稳健规范、长远发展”的经营原则，严格履行托管人的各项职责，切实维护基金份额持有人合法权益。经过几年的发展积累，兴业证券股份有限公司托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括公募基金、证券期货经营机构私募资产管理计划、私募投资基金等产品在内的较为全面的托管产品类型体系。

### 四、基金托管人的内部控制制度

#### （一）内部控制目标

兴业证券股份有限公司作为基金托管人，严格遵守国家有关托管业务的法律

法规、行业监管规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

## （二）内部控制组织结构

兴业证券股份有限公司设有审计监察部、合规法务部、风险管理部，组织和实施公司合规及风险管理、内部控制等相关工作。定期对托管业务内部控制机制全面性、有效性进行检查、指导。资产托管部内设稽查监督部二级部门，配备专职内控合规人员负责托管业务的内控合规工作，独立行使稽查监督职权。

## （三）内部控制制度及措施

资产托管部已建立完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，确保托管业务的规范操作，内控机制得到有效实施；相关业务人员均具备从业资格；业务管理严格实行复核、审核、检查制度；授权工作实行集中控制；业务印章按规程保管、存放、使用；账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区域专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现系统化操作，技术系统完整、独立，最大限度防范操作风险。

## 五、托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《基金法》、《基金合同》、托管协议和有关基金法规的规定，基金托管人对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金费用的支付、基金申购资金的到账和赎回资金的划付、基金收益分配、基金的融资条件等行为的合法性、合规性进行监督和核查，其中对基金的投资监督和检查自基金合同生效之日开始。基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、《基金合同》、托管协议或有关基金法规规定的行为，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，并以书面形式或相关方式对基金托管人发出回函确认。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。基金托管人有义务要求基金管理人赔偿因其过失致使投资者遭受的损失。

基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时

通知基金管理人限期纠正。

## 第五节相关服务机构

### 一、基金份额发售机构

#### （一）场外销售机构

##### 1、直销机构

###### （1）圆信永丰基金管理有限公司直销中心

上海直销中心办公地址：上海市浦东新区世纪大道 1528 号陆家嘴基金大厦  
19 楼

电话：021-60366073；传真：021-60366001

###### （2）电子直销

###### 1) 名称：圆信永丰基金管理有限公司电子直销

交易网站：[www.gtsfund.com.cn](http://www.gtsfund.com.cn)

客服电话：4006070088；021-60366818

###### 2) 名称：圆信永丰基金管理有限公司电子直销系统之微信交易端口

圆信永丰基金微信公众号：[gtsfund4006070088](#)

客服电话：4006070088；021-60366818

##### 2、其他销售机构

###### （1）兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 268 号

办公地址：上海市浦东新区长柳路 36 号兴业证券大厦

法定代表人：杨华辉

联系人：乔琳雪

客服电话：95562

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

###### （2）中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：陈四清

联系人：王迪睿

客服电话：95588

公司网址：www.icbc.com.cn

(3) 兴业银行股份有限公司

注册地址：福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦

办公地址：上海市浦东新区银城路 167 号 9 层

法定代表人：吕家进

联系人：孙琪虹

客服电话：95561

公司网址：www.cib.com.cn

(4) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路 969 号 3 幢 5 层 599 室

办公地址：浙江省杭州市西湖区西溪路 556 号阿里 Z 空间小邮局

法人代表：王珺

联系人：韩爱彬

客服电话：400-0766-123

网站：www.fund123.cn

(5) 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 号金座东方财富大厦 26 楼

法定代表人：其实

联系人：廖小满

客服电话：400-1818-188

公司网址：www.1234567.com.cn

(6) 华福证券有限责任公司

注册地址：福建省福州市鼓楼区鼓屏路 27 号 1#楼 3 层、4 层、5 层

办公地址：中国上海市浦东新区滨江大道 5129 号陆家嘴滨江中心 N1 幢

法定代表人：黄金琳

联系人：王虹

客服电话：400-88-96326

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

(7) 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

联系人: 李娟

客服电话: 4008215399

公司网址: [www.noah-fund.com](http://www.noah-fund.com)

(8) 上海陆金所基金销售有限公司

注册地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

办公住址: 上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

法定代表人: 陈祎彬

联系人: 缪刘颖

客服电话: 4008219031

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

(9) 中国银河证券股份有限公司

注册地址: 北京市丰台区西营街 8 号院 1 号楼 7 至 18 层 101

办公地址: 北京市丰台区西营街 8 号院 1 号楼青海金融大厦

法定代表人: 陈亮

联系人: 辛国政

客服电话: 4008-888-888

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

(10) 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: 上海市浦东新区浦明路 1500 号万得大厦 11 楼

法定代表人: 宋晓言

联系人: 徐亚丹

客服电话: 400-799-1888

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

(11) 浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：杭州市文二西路元茂大厦 1 号 903 室

办公地址：杭州市余杭区五常街道同顺街 18 号同花顺大楼

法定代表人：吴强

联系人：费超超

客服电话：952555

公司网址：[www.5ifund.com](http://www.5ifund.com)

(12) 中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001

办公地址：青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座 5 层

法定代表人：冯恩新

联系人：孙秋月

客服电话：95548

公司网址：[sd.citics.com](http://sd.citics.com)

(13) 中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场(二期)北座

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人：张佑君

联系人：马静懿

客服电话：95548

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

(14) 中信期货有限公司

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

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

法定代表人：张皓

联系人：李琪

客服电话：4009908826

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

(15) 海通证券股份有限公司

注册地址: 上海市广东路 689 号

办公地址: 上海市广东路 689 号

法定代表人: 周杰

联系人: 鲍清

客服电话: 95553

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

(16) 浙商证券股份有限公司

注册地址: 杭州市江干区五星路 201 号

办公地址: 杭州市江干区五星路 201 号

法定代表人: 吴承根

联系人: 高扬

电话: 95345

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

(17) 交通银行股份有限公司

注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区银城中路 188 号

办公地址: 中国(上海)自由贸易试验区银城中路 188 号

法定代表人: 任德奇

联系人: 胡佳敏

客服电话: 95559

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

(18) 平安证券股份有限公司

注册地址: 广东省深圳市福田区益田路 5033 号平安金融中心 61-64 层

办公地址: 上海市浦东新区张杨路 2389 弄 LCM 置汇旭辉广场 D 座 11 层

法定代表人: 何之江

联系人: 王阳

客服电话: 4000-188-288

公司网址: [stock.pingan.com](http://stock.pingan.com)

(19) 上海挖财基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 层

办公地址：上海浦东新区杨高南路 759 号陆家嘴世纪金融广场 2 号楼 18 层

法定代表人：吕柳霞

联系人：毛善波

客服电话：021-50810673

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

(20) 上海凯石财富基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区西藏南路 765 号 602-115 室

办公地址：上海市黄浦区延安东路 1 号凯石大厦

法定代表人：陈继武

客服电话：400-643-3389

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

(21) 德邦证券股份有限公司

注册地址：上海市普陀区曹杨路 510 号南半幢 9 楼

联系人：上海市黄浦区中山东二路 600 号外滩金融中心 N1 幢 9 层

法定代表人：武晓春

客服电话：400-8888-128

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

(22) 上海有鱼基金销售有限公司

注册地址：上海自由贸易试验区浦东大道 2123 号 3 层 3E-2655 室

办公地址：上海市徐汇区桂平路 391 号 B 座 20 层

法定代表人：林琼

联系人：周峰

客服电话：400-767-6298

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

(23) 中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市东城区朝内大街 188 号

法定代表人：王常青

联系人：许梦园

客服电话：95587 4008-888-108

公司网址：www.csc108.com

(24) 国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址：深圳市福田区福华一路 125 号国信金融大厦

法定代表人：张纳沙

联系人：李颖

客服电话：95536

公司网址：www.guosen.com.cn

(25) 华泰证券股份有限公司

注册地址：南京市江东中路 228 号

办公地址：南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场

法定代表人：周易

联系人：胡子豪

电话：95597

公司网址：www.htsc.com.cn

(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 11 层

法定代表人：张跃伟

联系人：宋晨

客服电话：400-820-2899

公司网址：www.erichfund.com

(27) 财咨道信息技术有限公司

注册地址：辽宁省沈阳市浑南区白塔二南街 18-2 号 B 座 601

办公地址：上海市虹口区青云路 266 号 4 楼

法定代表人：朱荣晖

联系人：董丹萍

客服电话：400-003-5811

公司网址：www.jinjiwo.com

（28）上海基煜基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区广东路 500 号 30 层 3001 单元

办公地址：上海浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦

法定代表人：王翔

联系人：居晓菲

电话：400-820-5369

公司网址：www.jiyufund.com.cn

（29）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

联系人：高源

客服电话：4007009665

公司网址：www.ehowbuy.com

（30）北京汇成基金销售有限公司

注册地址：北京市西城区西直门外大街 1 号院 2 号楼 17 层 19C13

办公地址：北京市西城区西直门外大街 1 号院 2 号楼 17 层 19C13

法定代表人：王伟刚

联系人：宋子琪

客服电话：400-619-9059

网址：www.hcfunds.com

（31）天津国美基金销售有限公司

注册地址：天津经济技术开发区第一大街 79 号 MSDC1-28 层 2801

办公地址：北京市朝阳区霄云路 26 号鹏润大厦 B 座 9 层

法定代表人：丁东华

联系人：段江啸

客服电话：400-111-0889

公司网址：www.gomefund.com

(32) 珠海盈米基金销售有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 1201-1203 室

法定代表人：肖雯

联系人：王宇昕

客服电话：020-89629066

公司网址：www.yingmi.cn

(33) 京东肯特瑞基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区知春路 76 号(写字楼)1 号楼 4 层 1-7-2

办公地址：北京市通州区亦庄经济技术开发区科创十一街 18 号院京东集团  
总部 A 座 17 层

法定代表人：邹保威

联系人：李丹

客服电话：95118

公司网站：kenterui.jd.com

(34) 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

联系人：李鑫

客服电话：4000-899-100

公司网址：www.yibaijin.com

(35) 中信证券华南股份有限公司

注册地址：广州市天河区临江大道 395 号 901 室(部位:自编 01), 1001 室

办公地址：广州市天河区临江大道 395 号合利天德广场 T1 楼 10 层

法定代表人：胡伏云

联系人：郭杏燕

客服电话：95548

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

（36）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：南京市鼓楼区中山北路 2 号绿地紫峰大厦 2005 室

法定代表人：吴言林

联系人：张竞妍

联系电话：025-66046166

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

（37）恒泰证券股份有限公司

注册地址：内蒙古自治区呼和浩特市新城区海拉尔东街满世尚都办公商业综合楼

办公地址：北京市西城区金融大街 17 号中国人寿中心 11 楼

法定代表人：庞介民

联系人：熊丽

客服电话：956088

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

（38）东方财富证券股份有限公司

公司简称：东方财富证券

法定代表人：戴彦

注册地址：西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城 10 栋楼

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号东方财富大厦

联系人：付佳

联系电话：021-23586603

传真：021-23586860

客服电话：95357

公司网站： <http://www.18.cn>

（39）阳光人寿保险股份有限公司

注册地址：海南省三亚市迎宾路 360-1 号三亚阳光金融广场 16 层

办公地址：北京市朝阳区朝外大街乙 12 号昆泰国际大厦 18 层

法定代表人：李科

联系人：杨超

联系方式：18701527808

公司网址：www.sinosig.com

（40）北京创金启富基金销售有限公司

注册地址：北京市西城区民丰胡同 31 号 5 号楼 215A

办公地址：北京市西城区白纸坊东街 2 号经济日报社综合楼 A 座 712 室

法定代表人：梁蓉

电话：400-6262-1818

公司网址：www.5irich.com

（41）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 路 1033 室

办公地址：上海市虹口区东大名路 1098 弄浦江国际金融广场 53 楼

法定代表人：李兴春

联系人：夏南

客服电话：95733

公司网址：www.leadfund.com.cn

（42）腾安基金销售（深圳）有限公司

办公地址：深圳市南山区海天二路 33 号腾讯滨海大厦 15 楼

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

法定代表人：林海峰

联系人：马骏

客服电话：4000-890-555

公司网址：www.tenganxinxi.com

（43）万联证券股份有限公司

注册地址：广州市天河区珠江东路 11 号 18、19 楼全层

办公地址：广州市天河区珠江东路 11 号 18、19 楼全层

法定代表人：袁笑一

联系人：吕祥崑

客服电话：95322

公司网址：www.wlzq.cn

（44）平安银行股份有限公司

注册地址：中华人民共和国广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号

办公地址：中国广东省深圳市福田区益田路 5023 号平安金融中心 B 座

法定代表人：谢永林

联系人：张广森

客服电话：95511

公司网址：www.bank.pingan.com

（45）泰信财富基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国路甲 92 号-4 至 24 层内 10 层 1012

办公地址：北京市朝阳区建国路乙 118 号京汇大厦 1206

法定代表人：彭浩

联系人：孔安琪

客服电话：400-004-8821

公司网址：www.taixincf.com

基金管理人可根据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》和基金合同等的规定，调整销售机构或选择其他符合要求的机构销售本基金，并及时履行信息披露义务。

（二）场内销售机构：本基金办理场内认购、申购和赎回业务的销售机构为具有基金销售业务资格并经上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的上海证券交易所会员单位。具体会员单位名单可在上海证券交易所网站查询。

## 二、登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街 17 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：周明

联系人：朱立元

电话：010-58598839；传真：010-58598907

三、出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市锦天城律师事务所

办公地址：上海市浦东新区银城中路 501 号上海中心大厦 11、12 楼

负责人：顾功耘

电话：021-20511000；传真：021-20511999

联系人：李鹏飞

经办律师：李鹏飞、詹磊

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：中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼

执行事务合伙人：李丹

联系人：张晓阳

联系电话：021-23238888

传真：021-23238800

经办注册会计师：魏佳亮、张晓阳

## 第六节基金的募集

本基金由管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定募集。

本基金经 2017 年 10 月 18 日中国证监会证监许可[2017]1847 号文准予注册募集。募集期自 2017 年 11 月 6 日至 2017 年 11 月 24 日,共募集 1,771,692,924.41 份基金份额,募集户数为 18751 户。

本基金为上市契约型开放式基金,存续期限为不定期

## 第七节基金合同的生效

### 一、基金合同的生效

本基金合同于 2017 年 11 月 30 日正式生效。自基金合同生效日起，基金管理人正式开始管理本基金。

### 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说明原因并报送解决方案，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。

## 第八节基金的上市交易

### 一、上市交易的证券交易所

上海证券交易所

### 二、上市交易的时间

本基金自 2018 年 1 月 31 日起上市交易,已于 2018 年 1 月 25 日在指定媒体上发布了《圆信永丰汇利混合型证券投资基金(LOF)上市交易公告书》。

### 三、上市交易的规则

本基金基金份额在上海证券交易所的上市交易需遵守《上海证券交易所交易规则》、《上海证券交易所证券投资基金上市规则》等有关规定。

### 四、上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市

本基金的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市按照相关法律法规、中国证监会及上海证券交易所的相关规定执行。

### 五、上市交易的费用

本基金上市交易的费用按照上海证券交易所的有关规定办理。

六、相关法律法规、中国证监会及上海证券交易所对基金上市交易的规则等相关规定内容进行调整的,本基金基金合同相应予以修改,且此项修改无须召开基金份额持有人大会。若上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司增加基金上市交易方面的新功能,本基金管理人可以在履行适当的程序后增加相应功能。

## 第九节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。其中，场外申购和赎回场所为基金管理人的直销网点及基金场外非直销销售机构的销售网点；场内申购和赎回场所为具有基金销售业务资格，且经上海证券交易所及登记机构认可的会员单位。具体的销售机构将由基金管理人在招募说明书或其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并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、申购和赎回的开放日及时间

#### 1、申购与赎回的开放日及时间

投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。场内申购赎回的办理时间为9:30-11:30和13:00-15:00。场外申购赎回的办理时间以场外销售机构规定为准。

基金合同生效后，若出现新的证券/期货交易市场、证券/期货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、申购与赎回的开始时间

基金管理人已于2018年1月31日开始办理本基金的日常申购、赎回业务。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购或者赎回或者转换。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基金份额申购、赎回的价格。

### 三、申购、赎回限制

#### 1、申购金额的限制

投资者在基金管理人网上直销平台和其他销售机构网点申购本基金基金份

额每次申购最低金额为人民币 100.00 元（含申购费）。通过基金管理人的直销柜台申购本基金基金份额每次申购最低金额为人民币 1,000.00 元（含申购费）。

## 2、赎回份额的限制

投资者赎回基金份额，单笔赎回不得少于 100.00 份；账户最低余额为 100.00 份基金份额，若某笔赎回业务将导致投资者在销售机构托管的本基金份额余额不足 100.00 份时，基金管理人有权将投资者该交易账户的剩余基金份额一次性全部赎回。

3、场外销售机构对上述最低申购限额、交易级差、最低赎回份额有其他规定的，以场外销售机构的业务规定为准，但不得低于上述下限。

4、本基金对单个基金份额持有人累计持有的基金份额不设置最高份额限制。

5、对于场内申购、赎回及持有场内基金份额的数量限制，上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则另有规定的，从其最新规定办理。

6、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告并报中国证监会备案。

## 四、申购和赎回的程序

### 1、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、申购与赎回的确认与通知

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。

基金销售机构对申购、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、赎回申请的确认以登记机构的确认结果为准。对于申购、赎回申请的确认情况，投资者应及时查询并妥善行使合法

权利。因投资者怠于履行前述查询等各项义务，致使其相关权益受损的，基金管理人、基金托管人、基金销售机构不承担由此造成的损失或不利后果。

基金管理人可以在不违反法律法规的前提下，对上述业务办理时间进行调整，并在调整实施日前按照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

3、申购与赎回款项支付的方式与时间

投资人申购基金份额时，必须全额交付申购款项，投资人在规定时间前全额交付款项，申购申请成立；登记机构确认基金份额时，申购生效。若申购不成立或无效，申购款项将退回投资人账户，由此产生的利息等损失由投资人自行承担。

基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；登记机构确认赎回时，赎回生效。投资人赎回申请成功后，基金管理人将在 T+7 日（包括该日）内支付赎回款项。遇证券/期货交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其它非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程时，赎回款项顺延至下一个工作日划出。在发生巨额赎回或基金合同载明的其他暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。

五、申购和赎回的费用

1、申购费用

本基金的申购费用由投资人承担，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。

（1）本基金场外申购费率如下：

| 申购金额（M）        | 申购费率     |
|----------------|----------|
| M<100 万        | 1.50%    |
| 100 万元≤M<200 万 | 1.20%    |
| 200 万元≤M<500 万 | 0.80%    |
| M≥500 万        | 1000 元/笔 |

注：M 为申购金额，单位为人民币元。

投资人重复申购，须按每次申购所对应的费率档次分别计费。

（2）本基金的场内申购费率参照场外申购费率执行。

2、赎回费用

(1) 本基金场外赎回费率如下：

| 持有期限（Y）                              | 赎回费率  |
|--------------------------------------|-------|
| $Y < 7$ 日                            | 1.50% |
| $7 \text{ 日} \leq Y < 30 \text{ 日}$  | 0.75% |
| $30 \text{ 日} \leq Y < 6 \text{ 个月}$ | 0.50% |
| $Y \geq 6 \text{ 个月}$                | 0%    |

注：Y 为基金份额持有期限；1 个月为 30 日

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担。对持续持有期少于 7 日的投资人收取不低于 1.5% 的赎回费，对持续持有期少于 30 日的投资人收取不低于 0.75% 的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产；对持续持有期少于 3 个月的投资人收取不低于 0.5% 的赎回费，并将不低于赎回费总额的 75% 计入基金财产；对持续持有期长于 3 个月但少于 6 个月的投资人收取不低于 0.5% 的赎回费，并将不低于赎回费总额的 50% 计入基金财产；对持续持有期长于 6 个月的投资人，应当将不低于赎回费总额的 25% 计入基金财产。

(2) 本基金的场内赎回费率参照场外赎回费率执行。

3、基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

4、办理基金份额的场内申购、赎回业务应遵守上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关业务规则。若相关法律法规、中国证监会、上海证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对场内申购、赎回业务规则有新的规定，基金合同相应予以修改，并按照新规定执行，且此项修改无须召开基金份额持有人大会。

5、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率并另行公告。

## 六、申购和赎回的数额和价格

### （一）申购份额的计算公式

本基金申购采用“金额申购”的方式。基金的申购金额包括申购费用和净申购金额。申购基金份额的计算公式为：

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

（对于使用固定金额申购费的申购， $\text{申购费用} = \text{固定申购费金额}$ ）

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

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{申购当日基金份额净值}$$

场外申购份额的计算结果保留到小数点后两位，小数点两位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。场内申购份额计算结果先按四舍五入的原则保留到小数点后两位，再采用截位方式保留到整数位，整数位后小数部分的份额对应的资金返还投资者。

例 1：某投资者投资 10 万元通过场外申购本基金基金份额，对应申购费率为 1.50%，假设申购当日基金份额的基金份额净值为 1.0320 元，则其可得到的申购份额为：

$$\text{申购费用} = 100,000.00 \times 1.50\% / (1 + 1.50\%) = 1,477.83 \text{ 元}$$

$$\text{净申购金额} = 100,000.00 - 1,477.83 = 98,522.17 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 98,522.17 / 1.0320 = 95,467.22 \text{ 份}$$

即投资者投资 10 万元通过场外申购本基金基金份额，对应申购费率为 1.50%，假设申购当日基金份额的基金份额净值为 1.0320 元，则其得到 95,467.22 份基金份额。

例 2：某投资者投资 10 万元通过场内申购本基金基金份额，对应申购费率为 1.50%，假设申购当日基金份额的基金份额净值为 1.0320 元，则其可得到的申购份额为：

$$\text{申购费用} = 100,000.00 \times 1.50\% / (1 + 1.50\%) = 1,477.83 \text{ 元}$$

$$\text{净申购金额} = 100,000.00 - 1,477.83 = 98,522.17 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 98,522.17 / 1.0320 = 95,467.22 \text{ 份（四舍五入保留到小数点后两位）} \\ = 95,467 \text{ 份（截位方式保留至整数位）}$$

$$\text{退款金额} = 0.22 \times 1.0320 = 0.23 \text{ 元}$$

$$\text{实际净申购金额} = 98,522.17 - 0.23 = 98,521.94 \text{ 元}$$

即投资者投资 10 万元通过场内申购本基金基金份额,对应申购费率为 1.50%,假设申购当日基金份额的基金份额净值为 1.0320 元,则其得到 95,467 份基金份额,退款金额为 0.23 元。

## （二）赎回金额的计算公式

本基金采用“份额赎回”方式,赎回价格以 T 日基金份额净值为基准进行计算。本基金采用相同场内外赎回费率结构,具体计算公式为:

赎回总额=赎回份额×T 日基金份额净值

赎回费用=赎回总额×赎回费率

赎回金额=赎回总额—赎回费用

上述计算结果均按四舍五入方法,保留到小数点后 2 位,由此产生的收益或损失由基金财产承担。

例:某投资者赎回本基金 1 万份基金份额,持有时间为 5 个月,对应的赎回费率为 0.50%,假设赎回当日 T 日基金份额的基金份额净值是 1.1200 元,则其可得到的赎回金额为:

赎回总额=10,000.00×1.1200=11,200.00 元

赎回费用=11,200.00×0.50%=56.00 元

净赎回金额=11,200.00—56.00=11,144.00 元

即:投资者 T 日赎回本基金 1 万份基金份额,持有时间为 5 个月,假设 T 日基金份额净值是 1.1200 元,则其可得到的净赎回金额为 11,144.00 元。

## （三）本基金份额净值的计算

基金份额净值=基金资产净值总额/当日发行在外的基金份额总数

本基金份额净值的计算,保留到小数点后 4 位,小数点后第 5 位四舍五入,由此产生的收益或损失由基金财产承担。T 日的基金份额净值在当天收市后计算,并在 T+1 日内公告。遇特殊情况,经中国证监会同意,可以适当延迟计算或公告。

## 七、拒绝或暂停接受申购

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转。
- 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。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基金估值，并采取暂停接受基金申购申请的措施。

3、证券/期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值或无法办理申购业务。

4、接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。

5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人利益的情形。

6、基金管理人接受某笔或者某些申购申请（含转入及定投）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。

7、申购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、单一投资者单日或单笔申购金额上限的情形。

8、基金管理人、基金托管人、基金销售机构、上海证券交易所或注册登记机构的技术故障等异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。

9、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、8、9 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全部或部分拒绝的，被拒绝的申购款项将退还给投资人。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。

#### 八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资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收投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。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基金估值，并采取

延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施。

3、证券/期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值或者无法办理赎回业务。

4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

5、出现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。

6、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停接受基金份额持有人的赎回申请或者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，对于场外赎回申请，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4项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。对于场内赎回申请，按照上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关规定办理。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。

## 九、巨额赎回的情形及处理方式

### 1、巨额赎回的认定

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

### 2、巨额赎回的处理方式

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

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

（2）部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的10%的

前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。当出现巨额赎回时，场内赎回申请按照上海证券交易所及登记机构的有关业务规则办理。

若基金发生巨额赎回，在单个基金份额持有人超过基金总份额 10%以上的赎回申请的情况下，基金管理人应当延期办理赎回申请。对于该基金份额持有人未超过上述比例的部分，基金管理人有权根据前段“（1）全部赎回”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。但是，如该持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。

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

### 3、巨额赎回的公告

当发生上述巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，并在 2 日内在规定媒介上刊登公告。

### 十、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

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

2、如发生暂停的时间为 1 日，基金管理人应于重新开放日，在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 1 个开放日的基金份额净值。

3、如发生暂停的时间超过 1 日，基金管理人可以根据暂停申购或赎回的时间，依照《信息披露办法》的有关规定，最迟于重新开放日在规定媒介上刊登重

新开放申购或赎回的公告；也可以根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间，届时不再另行发布重新开放的公告。

## 十一、基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及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基金合同的规定制定并公告，并提前告知基金托管人与相关机构。

## 十二、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。

## 十三、基金的转托管

### 1、基金份额的登记

本基金的份额采用分系统登记的原则。场外认购、申购或通过跨系统转托管从场内转入的基金份额登记在登记结算系统基金份额持有人开放式基金账户下，场内认购、申购、上市交易买入或通过跨系统转托管从场外转入的基金份额登记在证券登记系统基金份额持有人的上海证券账户下。

### 2、系统内转托管

（1）基金份额持有人可将其持有的基金份额在登记结算系统内不同销售机构（网点）之间进行转托管或在证券登记系统内不同会员单位之间进行指定关系变更。

（2）基金份额登记在登记结算系统的基金份额持有人在变更办理基金份额

赎回业务的销售机构时，须办理已持有基金份额的系统内转托管。

（3）募集期内不得办理系统内转托管。

（4）基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。

（5）系统内转托管的具体办理方法参照中国证券登记结算有限责任公司以及基金销售机构的有关规定。

## 2、跨系统转托管

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

（2）基金份额跨系统转托管的具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司及上海证券交易所的相关规定办理。

（3）本基金上市前、权益分派期间、上海证券交易所规定相应停牌日期、基金份额处于质押、冻结状态或出现上海证券交易所、登记机构规定的其他情形时，不得办理跨系统转托管。

3、基金销售机构或登记机构可以按照相关规定向基金份额持有人收取转托管费。

## 十四、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。

## 十五、基金的冻结和解冻

基金登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻，以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。基金份额的冻结手续、冻结方式按照登记机构的相关规定办理。

基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益按照我国法律法规、监管规章及国家有权机关的要求以及登记机构业务规定处理。

## 十六、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。

#### 十七、其他业务

在不违反法律法规及中国证监会规定的前提下，基金注册登记机构可依据其业务规则，受理基金份额质押等其他业务，并收取一定的手续费用。

#### 十八、基金申赎安排的补充和调整

基金管理人可在不违反相关法律法规、对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，根据具体情况对上述申购和赎回的安排进行补充和调整并提前公告。

#### 十九、实施侧袋机制期间本基金的申购与赎回

本基金实施侧袋机制的，本基金的申购和赎回安排详见本招募说明书“侧袋机制”部分的规定或相关公告。

## 第十节基金的投资

### 一、投资目标

在严格控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争实现基金资产持续稳定增值。

### 二、投资范围

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

基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 60%-95%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持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）。权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或对投资比例要求发生变更，基金管理人在履行适当程序后，可以相应调整本基金的投资范围和投资比例规定。

### 三、投资策略

#### （一）资产配置策略

本基金通过对国家宏观经济政策的深入分析，在动态跟踪财政政策、货币政策的基础上，判断宏观经济运行所处的经济周期及趋势，分析不同政策对各类资产的市场影响和预期收益风险，评估股票、债券等大类资产的估值水平和投资价值，确定投资组合的资产配置比例，并适时进行调整。

#### （二）股票投资策略

##### 1、行业配置策略

本基金结合定量和定性的方法分析行业的基本面。定量分析包括盈利分析、估值分析和景气度分析等，定性分析分为行业生命周期识别和行业竞争结构分析。

A、行业收益率是行业配置的主要参考指标。影响各个行业收益率的要素可以分解为三类：一类是质量因子，如 ROE，毛利率、周转率、现金流质量等；第二类是估值因子，如 P/E、P/B、EV/EBITDA 等；第三类是经济周期的景气指标，如行业 PMI 指数、终端消费数据、产能利用率、库存、通货膨胀等。不同行业的盈利对不同因子的敏感度差异较大。

B、根据周期性行业和弱周期性行业的不同属性分类研究。行业景气度和供需关系是周期性行业配置的重要依据，基金管理人主要通过跟踪各个行业的资本开支、库存、原材料和产成品价格、产能利用率等指标来把握周期性行业的轮动规律。

在上述分析的基础上，本基金将选择直接受益、长期受益或间接受益且行业基本面良好的行业进行重点配置。

## 2、个股精选策略

本基金选股策略将采用“自下而上”的分析方法，通过定量和定性相结合的方式紧密跟踪中国经济结构调整和转型过程中具备长期价值增长潜力的上市公司。

本基金的定量分析主要关注上市公司的基本面情况，包括财务分析和资产估值分析。重点关注上市公司的资产质量、盈利能力、偿债能力、成本控制能力、成长性和相对价值等。定性分析主要关注企业的公司治理结构、团队管理能力、核心竞争力、创新能力和经营策略等。

## （三）债券投资策略

在债券投资方面，基金管理人将通过自上而下和自下而上相结合、定性分析和定量分析相补充的方法，确定资产在非信用类债券（国债、中央银行票据等）和信用类债券（如企业债、公司债等）之间的配置比例，灵活应用期限结构策略、类属策略、信用策略、息差策略、互换策略等，在合理管理并控制组合风险的前提下，最大化组合收益。

### 1、债券资产配置策略

在宏观经济趋势研究、货币及财政政策趋势研究的基础上，以中长期利率趋

势分析和债券市场供求关系研究为核心，自上而下地决定债券组合久期、动态调整各类金融资产比例，结合收益率水平曲线形态分析和类属资产相对估值分析，优化债券组合的期限结构和类属配置。

### （1）久期配置

基金管理人将通过积极主动地预测市场利率的变动趋势，相应调整债券组合的久期配置，以达到提高债券组合收益、降低债券组合利率风险的目的。在确定债券组合久期的过程中，基金管理人将在判断市场利率波动趋势的基础上，根据债券市场收益率曲线的当前形态，通过合理假设下的情景分析和压力测试，最后确定最优的债券组合久期。

根据对市场利率变化趋势的预期，可适当调整组合久期，预期市场利率水平将上升时，适当降低组合久期；预期市场利率将下降时，适当提高组合久期。

### （2）期限结构配置

对同一类属收益率曲线形态和期限结构变动进行分析，在给定组合久期以及其它组合约束条件的情形下，通过建立债券组合优化数量模型，确定最优的期限结构。

### （3）类属配置

对不同类型固定收益品种的利率风险、信用风险、流动性等因素进行分析，研究各类型投资品种的利差和变化趋势，制定债券类属配置策略，以获取不同债券类属之间利差变化所带来的投资收益。

## 2、信用类债券的投资策略

对企业债、公司债和短期融资券等信用类债券采取自上而下和自下而上相结合的投资策略。影响信用债信用风险的因素分为行业风险、公司风险、现金流风险、资产负债风险和其他风险等五个方面。

为控制信用风险，基金管理人将根据国家有权机构批准或认可的信用评级机构提供的信用评级，并结合内部评级系统分析信用债的相对信用水平、违约风险及理论信用利差。

## 3、息差策略

利用回购等方式融入低成本资金，购买较高收益的债券，以期获取超额收益的操作方式。

#### 4、互换策略

不同券种在利息、违约风险、久期、流动性、税收和衍生条款等方面存在差别，基金管理人可以同时买入和卖出具有相近特性的两个或两个以上券种，赚取收益级差。

#### 5、可转换债券投资策略

可转换债券兼具权益类证券与债券的特性，具有抵御下行风险、分享股票价格上涨收益的特点。可转换债券的选择结合其债性和股性特征，在对公司基本面和转债条款深入研究的基础上进行估值分析，投资于公司基本面优良、具有较高安全边际和良好流动性的可转换债券，获取稳健的投资回报。

#### 6、资产支持证券投资策略

本基金通过分析资产支持证券对应资产池的资产特征，来估计资产违约风险和提前偿付风险，根据资产证券化的收益结构安排，模拟资产支持证券的本金偿还和利息收益的现金流支付，并利用合理的收益率曲线对资产支持证券进行估值。同时还将充分考虑该投资品种的风险补偿收益和市场流动性，控制资产支持证券投资的风险，以获取较高的投资收益。

#### 7、中小企业私募债券投资策略

中小企业私募债券由于该券种的发行主体资质相对较弱，且存在信息透明度较低等问题，因而面临更大的信用风险，属于高风险高收益品种，未来有可能出现债券到期后企业不能按时清偿债务的情况，从而导致基金资产的损失。

本基金将从发行主体所处行业的稳定性、未来成长性，以及企业经营、现金流状况、抵质押及担保增信措施等方面优选信用资质相对较强的高收益债进行投资。严格执行分散化投资策略，分散行业、发行人和区域集中度，以避免行业或区域性事件对组合造成的集体冲击。

#### （四）股指期货投资策略

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整

体风险。

#### （五）权证投资策略

权证为本基金辅助性投资工具。在进行权证投资时，基金管理人将通过对权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型寻求其合理估值水平，根据权证的高杠杆性、有限损失性、灵活性等特性，通过限量投资、趋势投资、优化组合、获利等投资策略进行权证投资。基金管理人将充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征，通过资产配置、品种与类属选择，谨慎进行投资，追求较稳定的当期收益。

#### 四、投资限制

##### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）股票资产占基金资产的 60%-95%；

（2）每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持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）；

（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%；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%；

（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

15%；

(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) 本基金参与股指期货交易，应当遵守下列要求：

1) 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%；

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

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

4) 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；

5) 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%；

(16) 本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

(17) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外

的因素致使基金不符合前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；

（18）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；

（19）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）、（17）、（18）项外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外，法律法规另有规定的从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受上述限制或相应变更上述限制，无需召开基金份额持有人大会审议。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

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

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合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的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

法律、行政法规或监管部门取消或变更上述禁止性或限制性规定，如适用于本基金，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。

## 五、投资决策依据和决策程序

### （一）投资决策与交易机制

本基金实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。

投资决策委员会是本基金的最高决策机构，定期或遇重大事件时就投资管理业务的重大问题进行讨论，并对本基金投资做方向性指导。

基金经理在投资决策委员会确定的投资范围内制定并实施具体的投资策略，向交易部下达投资指令。

交易部负责执行投资指令，就指令执行过程中的问题及市场面的变化对指令执行的影响等问题及时向基金经理反馈，并可提出基于市场面的具体建议。交易部同时负责各项投资限制的监控以及本基金资产与公司旗下其他基金之间的公平交易控制。

风险管理部行使风险管理职能，监控投资风险，并出具风险分析和业绩评估报告。

### （二）投资程序

投资决策委员会负责决定基金投资的重大决策。基金经理在授权范围内，制定具体的投资组合方案并执行。交易部负责执行投资指令。

1、基金经理根据市场的趋势、运行的格局和特点，并结合基金合同、投资风格拟定投资策略报告。

2、投资策略报告提交给投资决策委员会。投资决策委员会审批决定基金投资相关重要事项。

3、基金经理根据批准后的投资策略确定最终的资产分布比例、个券投资分布方式等。

4、对已投资品种进行跟踪，对投资组合进行动态调整。

## 六、业绩比较基准

沪深 300 指数收益率 $\times 60\%$  + 上证国债指数收益率 $\times 40\%$

沪深 300 指数是中证指数公司依据国际指数编制标准并结合中国市场的实际情况编制的沪深两市统一指数，科学地反映了我国证券市场的整体业绩表现，具有一定的权威性和市场代表性，适合作为本基金股票投资部分的基准。

上证国债指数由中证指数公司编制，以上海证券交易所上市的所有固定利率国债为样本，按照发行量加权而成。具有良好的债券市场代表性，适合作为本基金债券投资部分的基准。

如果今后法律法规发生变化，或者上述指数停止计算编制或更改名称，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩比较基准的指数时，本基金可以在与基金托管人协商一致的情况下，报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告，无需召开基金份额持有人大会。

## 七、风险收益特征

本基金为混合型基金，属于证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的品种，其预期风险收益水平高于债券型基金、货币市场基金，低于股票型基金。

## 八、基金管理人代表基金行使股东权利和债权人权利的处理原则及方法

- 1、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；
- 2、有利于基金资产的安全与增值；
- 3、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金份额持有人的利益；
- 4、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利，保护基金份额持有人的利益。

## 九、侧袋机制的实施和投资运作安排

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

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

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

#### 十、基金投资组合报告（未经审计）

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。

基金托管人兴业证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 10 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至 2022 年 9 月 30 日。

##### 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              | 204,045,673.67 | 92.46         |
|    | 其中：股票             | 204,045,673.67 | 92.46         |
| 2  | 基金投资              | —              | —             |
| 3  | 固定收益投资            | 14,079,366.12  | 6.38          |
|    | 其中：债券             | 14,079,366.12  | 6.38          |
|    | 资产支持证券            | —              | —             |
| 4  | 贵金属投资             | —              | —             |
| 5  | 金融衍生品投资           | —              | —             |
| 6  | 买入返售金融资产          | —              | —             |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | —              | —             |
| 7  | 银行存款和结算备付金合计      | 2,225,044.43   | 1.01          |
| 8  | 其他资产              | 344,192.73     | 0.16          |
| 9  | 合计                | 220,694,276.95 | 100.00        |

## 2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代<br>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                  | 1,389,497.47   | 0.63         |
| C      | 制造业                  | 173,197,602.99 | 78.71        |
| D      | 电力、热力、燃气及水生<br>产和供应业 | -              | -            |
| E      | 建筑业                  | -              | -            |
| F      | 批发和零售业               | -              | -            |
| G      | 交通运输、仓储和邮政业          | -              | -            |
| H      | 住宿和餐饮业               | -              | -            |
| I      | 信息传输、软件和信息技术<br>服务业  | 85,583.54      | 0.04         |
| J      | 金融业                  | 17,530,631.00  | 7.97         |
| K      | 房地产业                 | 11,702,649.00  | 5.32         |
| L      | 租赁和商务服务业             | -              | -            |
| M      | 科学研究和技术服务业           | 111,518.89     | 0.05         |
| N      | 水利、环境和公共设施管<br>理业    | 10,621.17      | 0.00         |
| O      | 居民服务、修理和其他服<br>务业    | -              | -            |
| P      | 教育                   | -              | -            |
| Q      | 卫生和社会工作              | 17,569.61      | 0.01         |
| R      | 文化、体育和娱乐业            | -              | -            |
| S      | 综合                   | -              | -            |
|        | 合计                   | 204,045,673.67 | 92.73        |

2.2 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港股通股票。

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  | 002179 | 中航光电 | 285,243 | 16,544,094.00 | 7.52         |
| 2  | 600519 | 贵州茅台 | 7,515   | 14,071,837.50 | 6.39         |
| 3  | 300054 | 鼎龙股份 | 495,900 | 11,653,650.00 | 5.30         |
| 4  | 300750 | 宁德时代 | 27,700  | 11,104,653.00 | 5.05         |
| 5  | 600036 | 招商银行 | 325,900 | 10,966,535.00 | 4.98         |
| 6  | 600048 | 保利发展 | 528,800 | 9,518,400.00  | 4.33         |
| 7  | 601677 | 明泰铝业 | 510,640 | 9,283,435.20  | 4.22         |
| 8  | 600309 | 万华化学 | 97,832  | 9,010,327.20  | 4.09         |
| 9  | 601012 | 隆基绿能 | 162,782 | 7,798,885.62  | 3.54         |
| 10 | 601689 | 拓普集团 | 104,100 | 7,682,580.00  | 3.49         |

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      | 14,079,366.12 | 6.40         |
| 2  | 央行票据      | —             | —            |
| 3  | 金融债券      | —             | —            |
|    | 其中：政策性金融债 | —             | —            |
| 4  | 企业债券      | —             | —            |
| 5  | 企业短期融资券   | —             | —            |
| 6  | 中期票据      | —             | —            |

|    |           |               |      |
|----|-----------|---------------|------|
| 7  | 可转债（可交换债） | -             | -    |
| 8  | 同业存单      | -             | -    |
| 9  | 其他        | -             | -    |
| 10 | 合计        | 14,079,366.12 | 6.40 |

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  | 019664 | 21 国债 16 | 137,890 | 14,079,366.12 | 6.40         |

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

根据基金合同约定，本基金不参与贵金属投资。

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持有股指期货合约。

10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据基金合同约定，本基金不参与国债期货投资。

11 投资组合报告附注

11.1 基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的投资决策程序说明

通过查阅中国证监会、中国银保监会网站公开目录“行政处罚决定”及查阅相关发行主体的公司公告，在基金管理人知悉的范围内，报告期内基金投资的前十名证券的发行主体除招商银行（600036.SH）的发行主体招商银行股份有限公司外没有被监管部门立案调查的情形，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2022年3月21日，招商银行股份有限公司因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在多项违法违规行为，被中国银行保险监督管理委员会出具行政处罚（银保监罚决字[2022]21号），罚款300万元。

对上述证券的投资决策程序的说明：本基金投资上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

11.2 本基金前十名股票未超出基金合同规定备选股票库。

11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额(元)      |
|----|---------|------------|
| 1  | 存出保证金   | 75,855.11  |
| 2  | 应收证券清算款 | 260,949.60 |
| 3  | 应收股利    | —          |
| 4  | 应收利息    | —          |
| 5  | 应收申购款   | 7,388.02   |
| 6  | 其他应收款   | —          |
| 7  | 其他      | —          |
| 8  | 合计      | 344,192.73 |

11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

## 11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## 十一、基金的业绩

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

历史时间段基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇利 LOF 基金

| 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 11 月 30 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日 | 1.27%   | 0.28%     | -0.30%     | 0.52%         | 1.57%  | -0.24% |
| 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日            | -22.13% | 1.43%     | -13.74%    | 0.80%         | -8.39% | 0.63%  |
| 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日            | 50.11%  | 1.23%     | 22.93%     | 0.75%         | 27.18% | 0.48%  |
| 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日            | 50.27%  | 1.47%     | 17.94%     | 0.86%         | 32.33% | 0.61%  |
| 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日            | 21.79%  | 1.34%     | -1.14%     | 0.70%         | 22.93% | 0.64%  |
| 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 9 月 30 日             | -22.09% | 1.39%     | -13.08%    | 0.77%         | -9.01% | 0.62%  |
| 2017 年 11 月 30 日(基金合同生效日)至 2022 年 9 月 30 日  | 68.81%  | 1.37%     | 7.14%      | 0.77%         | 61.67% | 0.60%  |



## 第十一节 基金的财产

### 一、基金资产总值

基金资产总值是指基金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、期货账户以及投资所需的其他专用账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

### 四、基金财产的保管和处分

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

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

## 第十二节基金资产的估值

### 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、股指期货合约、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

本基金所持有的投资品种，按如下原则进行估值：

#### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

（1）交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化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）交易所上市的固定收益类有价证券，区分如下情况处理：对在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（另有规定的除外），选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对在交易所市场上市交易的可转换债券，使用最近交易日的市价（收盘价）作为估值全价；

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

#### 2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

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

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

(4) 交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，以活跃市场上未经调整的报价作为计量日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表计量日公允价值的情况下，对市场报价进行调整以确认计量日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，则采用估值技术确定其公允价值。

3、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，以第三方估值机构提供的价格数据估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

4、中小企业私募债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。

5、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

6、本基金投资股指期货合约，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。

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

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、当本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，具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。

11、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。

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，按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。

#### 四、估值程序

1、基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日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，由此产生的误差计入基金财产。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人于每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将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。当基金份额净值小数点后 4 位以内（含第 4 位）发生估值错误时，视为基金份额净值错误。

基金合同的当事人应按照以下约定处理：

##### 1、估值错误类型

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

上述估值错误的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等。对于因技术原因引起的差错，若

系同行业现有技术水平不能预见、不能避免、不能克服，则属不可抗力，按照下述规定执行：由于不可抗力原因造成投资人的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

## 2、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。

（5）按法律法规规定的其他原则处理差错。

## 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；错误偏差达到基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告。

(3) 基金管理人和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差，以基金管理人计算结果为准。

(4) 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。如果法律法规或监管机关没有规定的，基金管理人和基金托管人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则协商一致后参照行业惯例处理。

### 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、当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上的，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停估值；

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、实施侧袋机制期间的基金资产估值

本基金实施侧袋机制的，应根据本部分的约定对主袋账户资产进行估值并披

露主袋账户的基金净值信息，暂停披露侧袋账户份额净值。

#### 九、特殊情况的处理

1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 11 项进行估值时，所造成的误差不得作为基金资产估值错误处理。

2、由于不可抗力原因，或由于证券/期货交易所或登记结算公司发送的数据错误等原因，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消除或减轻由此造成的影响。

## 第十三节基金的收益与分配

### 一、基金利润的构成

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

### 二、基金可供分配利润

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

### 三、基金收益分配原则

1、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。登记在基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为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；登记在证券登记系统基金份额持有人上海证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式，具体权益分配程序等有关事项遵循上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；

2、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

3、每一基金份额享有同等分配权；

4、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，在 2 日内在规定媒介公告。

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。现金

分红的计算方法等有关事项遵循上海证券交易所以及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定。

#### 七、实施侧袋机制期间的收益分配

本基金实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配。

## 第十四节基金的费用与税收

### 一、基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券/期货交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、基金的账户开户费用、账户维护费用；
- 9、基金的上市费及年费；
- 10、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

### 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 3 个工作日内，按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

#### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.15\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 3 个工作日内，按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

上述“一、基金费用的种类中第 3—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、实施侧袋机制期间的基金费用

本基金实施侧袋机制的，与侧袋账户有关的费用可以从侧袋账户中列支，但应待侧袋账户资产变现后方可列支，有关费用可酌情收取或减免，但不得收取管理费，详见招募说明书“侧袋机制”部分的规定。

### 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。

## 第十五节基金的会计与审计

### 一、基金会计政策

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披露；

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等双方约定的方式确认。

### 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《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。

## 第十六节基金的信息披露

一、本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《基金合同》及其他有关规定。相关法律法规关于信息披露的披露内容、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，按照法律法规和中国证监会的规定披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性和完整性、及时性、简明性和易得性。

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

（一）基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议、基金产品资料概要

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。同时，基金管理人应当在招募说明书中加强风险揭示，对设计复杂、风险较高的基金应以显著、清晰的方式揭示基金投资运作及交易等环节的相关风险。《基金合同》生效后，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。

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、基金产品资料概要应提供基金产品的重要信息，包括但不限于产品概况、投资目标与投资策略、投资组合资产配置图表、基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图、投资本基金涉及的费用、风险揭示、重要提示等，是基金产品销售文件的一部分。

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各自网站上。

（二）基金份额发售公告

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

（三）《基金合同》生效公告

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

（四）上市交易公告书

基金份额获准在证券交易所上市交易的，基金管理人应当在基金份额上市交

易的 3 个工作日内，将基金份额上市交易公告书登载在规定网站上，并将上市交易公告书提示性公告登载在规定报刊上。

#### （五）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基金份额净值和基金份额累计净值。

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

基金管理人应当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基金份额净值和基金份额累计净值。

#### （六）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。

#### （七）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，并将年度报告登载于规定网站上，将年度报告提示性公告登载在规定报刊上。基金年度报告的财务会计报告应当经过符合《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，并将中期报告正文登载在规定网站上，将中期报告提示性公告登载在规定报刊上。

基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在规定网站上，并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。

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。

基金运作期间，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，基金管理人应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告

“影响投资者决策的其他重要信息”项下文件中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。

#### （八）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，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、转换基金运作方式、基金合并；
- 4、更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；
- 5、基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；
- 6、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- 7、基金管理公司变更持有百分之五以上股权的股东、变更公司实际控制人；
- 8、基金募集期延长或提前结束募集；
- 9、基金管理人的高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；
- 10、基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十，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；
- 11、涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼或仲裁；
- 12、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，基金托管人或其基金托管部门负责人因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；
- 13、基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证

券，或者从事其他重大关联交易事项，中国证监会另有规定的情形除外；

14、基金收益分配事项；

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

16、基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；

17、本基金开始办理申购、赎回；

18、本基金发生巨额赎回并延期办理；

19、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；

20、本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；

21、基金份额停复牌或终止上市；

22、本基金发生涉及申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回的重大事项；

23、基金管理人采用摆动定价机制进行估值时；

24、基金信息披露义务人认为可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的其他事项或法律法规、中国证监会及上海证券交易所规定的其他事项。

#### （九）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、基金上市交易的证券交易所。

#### （十）基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

#### （十一）投资股指期货的信息披露

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

#### （十二）投资中小企业私募债券的信息披露

基金管理人应当在基金投资中小企业私募债券后 2 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。基金管理人应当在基金年度报告、基金中期报告和基金季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。

#### （十三）投资资产支持证券的信息披露

本基金投资资产支持证券，基金管理人应在基金年度报告及基金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。基金管理人应在基金季度报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期末按市值占基金净资产比例大小排序的前 10 名资产支持证券明细。

#### （十四）投资非公开发行股票的相关公告

在本基金投资非公开发行股票后两个交易日内，基金管理人应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。

#### （十五）清算报告

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

#### （十六）实施侧袋机制期间的信息披露

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

#### （十七）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等法规的规定。

基金托管人应当按照相关法律、行政法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告、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者电子确认。

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的信息。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，还可以根据需要在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。

为基金信息披露义务人公开披露的基金信息出具审计报告、法律意见书的专业机构，应当制作工作底稿，并将相关档案至少保存到《基金合同》终止后 10 年。

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

#### 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、暂停或延迟信息披露的情形

当出现下述情况时，基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金相关信息：

- 1、不可抗力；
- 2、发生暂停估值的情形；
- 3、法律法规规定、中国证监会或基金合同认定的其他情形。

九、本基金信息披露事项以法律法规规定及本章节约定的内容为准。

## 第十七节侧袋机制

### 一、侧袋机制的实施条件和实施程序

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

基金管理人应当在启用侧袋机制后及时发布临时公告，并及时聘请符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所进行审计并披露专项审计意见。

### 二、实施侧袋机制期间基金份额的申购与赎回

1、启用侧袋机制当日，基金登记机构以基金份额持有人的原有账户份额为基础，确认相应侧袋账户基金份额持有人名册和份额；当日收到的申购申请，按照启用侧袋机制后的主袋账户份额办理；当日收到的赎回申请，仅办理主袋账户的赎回申请并支付赎回款项。

2、实施侧袋机制期间，基金管理人不得办理侧袋账户份额的申购、赎回和转换；同时，基金管理人按照基金合同和招募说明书的约定办理主袋账户份额的赎回，并根据主袋账户运作情况确定是否暂停申购。

3、除基金管理人应按照主袋账户的份额净值办理主袋账户份额的申购和赎回外，本招募说明书“基金份额的申购与赎回”部分的申购、赎回规定适用于主袋账户份额。巨额赎回按照单个开放日内主袋账户基金份额净赎回申请超过前一开放日主袋账户基金总份额的 10% 认定。

### 三、实施侧袋机制期间的基金投资

侧袋机制实施期间，本招募说明书“基金的投资”部分约定的投资组合比例、投资策略、组合限制、业绩比较基准、风险收益特征等约定仅适用于主袋账户。基金管理人计算各项投资运作指标和基金业绩指标时仅需考虑主袋账户资产。

基金管理人原则上应当在侧袋机制启用后 20 个交易日内完成对主袋账户投资组合的调整，因资产流动性受限等中国证监会规定的情形除外。

基金管理人不得在侧袋账户中进行除特定资产处置变现以外的其他投资操作。

### 四、实施侧袋机制期间的基金估值

本基金实施侧袋机制的，基金管理人和基金托管人应对主袋账户资产进行估值并披露主袋账户的基金净值信息，暂停披露侧袋账户份额净值。侧袋账户的会计核算应符合《企业会计准则》的相关要求。

#### 五、实施侧袋账户期间的基金费用

1、本基金实施侧袋机制的，主袋账户的基金管理费、基金托管费按主袋账户基金资产净值作为基数计提。

2、与侧袋账户有关的费用可从侧袋账户中列支，但应待侧袋账户资产变现后方可列支，有关费用可酌情收取或减免，但不得收取管理费。

#### 六、侧袋账户中特定资产的处置变现和支付

特定资产以可出售、可转让、恢复交易等方式恢复流动性后，基金管理人应当按照基金份额持有人利益最大化原则，采取将特定资产予以处置变现等方式，及时向侧袋账户份额持有人支付对应变现款项。

侧袋机制实施期间，无论侧袋账户资产是否全部完成变现，基金管理人都应当及时向侧袋账户全部份额持有人支付已变现部分对应的款项。若侧袋账户资产无法一次性完成处置变现，基金管理人在每次处置变现后均应按照相关法律法规要求及时发布临时公告。

侧袋账户资产全部完成变现并终止侧袋机制后，基金管理人应及时聘请符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所进行审计并披露专项审计意见。

#### 七、侧袋机制的信息披露

##### 1、临时公告

在启用侧袋机制、处置特定资产、终止侧袋机制以及发生其他可能对投资者利益产生重大影响的事项后基金管理人应及时发布临时公告。

##### 2、基金净值信息

基金管理人应按照招募说明书“基金的信息披露”部分规定的基金净值信息披露方式和频率披露主袋账户份额的基金份额净值和基金份额累计净值。实施侧袋机制期间本基金暂停披露侧袋账户份额净值和累计净值。

##### 3、定期报告

侧袋机制实施期间，基金管理人应当在基金定期报告中披露报告期内侧袋账户相关信息，基金定期报告中的基金会计报表仅需针对主袋账户进行编制。会计

师事务所对基金年度报告进行审计时，应对报告期内基金侧袋机制运行相关的会计核算和年度报告披露等发表审计意见。

## 第十八节 风险揭示

本基金为混合型基金，属于证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的品种，其预期风险收益水平高于债券型基金、货币市场基金，低于股票型基金。

### 一、投资于本基金的风险

#### 1、市场风险

证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响，导致基金收益水平变化而产生风险，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。证券市场是国民经济的晴雨表，而经济运行具有周期性的特点。宏观经济运行状况将对证券市场的收益水平产生影响，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。因此基金投资收益水平会受到利率变化的影响。

（4）购买力风险。基金投资的收益可能因为通货膨胀的影响而导致购买力下降，从而使基金的实际收益下降。如果发生通货膨胀，基金投资于证券所获得的收益可能会被通货膨胀抵消，从而影响基金资产的保值增值。

#### 2、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。

#### 3、债券收益率曲线变动风险

债券收益率曲线变动风险是指与收益率曲线非平行移动有关的风险，单一的久期指标并不能充分反映这一风险的存在。

#### 4、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。

## 5、流动性风险

流动性风险可视为一种综合性风险，它是其他风险在基金管理和公司整体经营方面的综合体现。中国的证券市场还处在初期发展阶段，在某些情况下某些投资品种的流动性不佳，由此可能影响到基金投资收益的实现。开放式基金要随时应对投资者的赎回，如果基金资产未能以合理价格及时变现以支付投资者赎回款项，或者变现时使基金净值产生不利的影响，都会影响基金运作和收益水平。尤其是在发生巨额赎回时，如果基金资产变现能力差，可能会产生基金仓位调整的困难，导致流动性风险，可能影响基金份额净值或者导致基金管理人无法接受投资人的全部赎回申请。基金管理人并不保证完全避免此类风险的发生但本基金将通过一系列风险控制指标加强对流动性风险的跟踪、防范和控制，努力去克服流动性风险。

### （1）基金申购、赎回安排

#### 1）申购与赎回的开放日及时间

投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。场内申购赎回的办理时间为9:30-11:30和13:00-15:00。场外申购赎回的办理时间以场外销售机构规定为准。

#### 2）基金合同生效后，开始接受申购/赎回的时间

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

### （2）拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

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

基金管理人加强本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易风险对手的集中度，按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的交易对手实时交易额度管理并进行动态调

整。基金管理人已建立健全逆回购交易质押品管理制度，根据质押品资质审慎确定质押率水平，持续监测质押品的风险状况与价值变动，质押品按照公允价值计算足额。

### （3）巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

基金管理人根据相关内部管理制度与法律法规的要求执行对于本基金巨额赎回的事前监测、事中管控与事后评估机制。当本基金发生基金合同约定的巨额赎回且现金类资产不足以支付赎回款项时，基金管理人在当日接受赎回申请比例不低于上一开放日基金总份额的 10%的前提下，通过压力测试等手段充分评估基金组合资产变现能力、投资比例变动与基金单位份额净值波动，对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，审慎接受、确认赎回申请，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。

单个基金份额持有人在单个开放日申请赎回基金份额超过基金总份额一定比例情形下的流动性风险管理措施：如本基金发生单个基金份额持有人在单个开放日申请赎回基金份额超过上一开放日基金总份额 10%的情形，基金管理人可以通过压力测试等手段充分评估基金组合资产变现能力、投资比例变动与基金单位份额净值波动，审慎办理并部分确认该单个基金份额持有人的赎回申请，并可对于其余未办理赎回申请部分延期至下一个开放日办理。如下一开放日基金管理人经评估认为其余未办理赎回申请部分如全部办理支付相应赎回款项仍有困难或认为因支付相应赎回款项而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动或存在将对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响的其他情形的，基金管理人可决定将部分赎回申请继续延期至下一个开放日办理，直到该单个基金份额持有人的赎回申请全部赎回为止。

### （4）实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响

基金管理人经与基金托管人协商，在确保投资者得到公平对待的前提下，可依照法律法规及基金合同的约定，可以综合运用各类流动性风险管理工具，对赎回申请等进行适度调整，作为特定情形下基金管理人流动性风险管理的辅助措施，包括但不限于延期办理巨额赎回申请、暂停接受赎回申请、延缓支付赎回款项、收取短期赎回费、暂停基金估值、摆动定价以及中国证监会认定的其他措施。基

金管理人应当围绕前述工具的实施条件、发起部门、决策程序、业务流程等事项，制定清晰的内部制度并定期更新，确保相关工具实施的及时、有序、透明及公平。

#### 1) 延期办理巨额赎回申请、暂停接受赎回申请、延缓支付赎回款项

如依照法律法规及基金合同的约定本基金发生需延期办理巨额赎回申请、暂停接受赎回申请、延缓支付赎回款项的情形，经本基金基金经理发起，经基金管理人管理层决定，并经与基金托管人协商一致后，基金管理人可以实施相关流动性管理工具，并依据法律法规及基金合同的约定进行信息披露。在前述情况下，投资者的赎回申请将不被基金管理人接受或全部办理，或投资者赎回申请对应的赎回款项金额发生变动或赎回款项到达投资者银行账户时间发生延迟，将对投资者的预期资金安排产生一定影响。

#### 2) 收取短期赎回费

依照法律法规及基金合同的约定，本基金对于持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5% 的赎回费并全额计入基金财产，将对投资者赎回申请对应的赎回款项金额产生一定影响。

#### 3) 暂停基金估值

如依照法律法规及基金合同的约定本基金发生需暂停基金估值的情形，经本基金基金经理发起，经基金管理人管理层决定，并经与基金托管人协商一致后，基金管理人可以暂停基金估值，并依据法律法规及基金合同的约定进行信息披露。在前述情况下，基金管理人可暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项，投资者的赎回申请将不被基金管理人接受，或赎回申请对应的赎回款项到达投资者银行账户时间发生延迟，将对投资者的预期资金安排产生一定影响。

#### 4) 摆动定价

如依照法律法规及基金合同的约定本基金发生需摆动定价的情形，经本基金基金经理发起，经基金管理人管理层决定，并经与基金托管人协商一致后，基金管理人可以对基金资产净值实施摆动定价，并依据法律法规及基金合同的约定进行信息披露。在前述情况下，基金资产净值将相应发生变动，将对投资者申购金额对应的基金份额数量或者赎回份额对应的赎回款项金额产生一定影响。

#### (5) 实施侧袋机制对投资者的影响

侧袋机制是一种流动性风险管理工具，是将特定资产分离至专门的侧袋账户

进行处置清算，并以处置变现后的款项向基金份额持有人进行支付，目的在于有效隔离并化解风险。但基金启用侧袋机制后，侧袋账户份额将停止披露基金份额净值，并不得办理申购、赎回和转换，仅主袋账户份额正常开放赎回，因此启用侧袋机制时持有基金份额的持有人将在启用侧袋机制后同时持有主袋账户份额和侧袋账户份额，侧袋账户份额不能赎回，其对应特定资产的变现时间具有不确定性，最终变现价格也具有不确定性并且有可能大幅低于启用侧袋机制时的特定资产的估值，基金份额持有人可能因此面临损失。

实施侧袋机制期间，因本基金不披露侧袋账户份额的净值，即便基金管理人在基金定期报告中披露报告期末特定资产可变现净值或净值区间的，也不作为特定资产最终变现价格的承诺，因此对于特定资产的公允价值和最终变现价格，基金管理人不承担任何保证和承诺的责任。

基金管理人将根据主袋账户运作情况合理确定申购政策，因此实施侧袋机制后主袋账户份额存在暂停申购的可能。

启用侧袋机制后，基金管理人计算各项投资运作指标和基金业绩指标时仅需考虑主袋账户资产，基金业绩指标应当以主袋账户资产为基准，因此本基金披露的业绩指标不能反映特定资产的真实价值及变化情况。

## 6、管理风险

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

## 7、操作或技术风险

基金的相关当事人在各业务环节的操作过程中，可能因内部控制存在缺陷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、交易错误和 IT 系统故障等。

此外，在本基金的各种交易行为或后台运作中，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、登记机构、销售机构、证券交易所和证券登记结算机构等。

## 8、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。

## 9、本基金特有风险

### （1）基金运作的特有风险

本基金在上海证券交易所挂牌上市，由于上市期间可能因信息披露导致基金停牌，投资者在停牌期间不能买卖本基金上市交易份额，产生风险；同时，可能因上市后交易对手不足而产生流动性风险；另外，当基金份额持有人将份额转向场外交易后导致场内的基金份额或持有人数不满足上市条件时，本基金存在终止上市的可能。

### （2）投资中小企业私募债的风险

本基金可投资中小企业私募债券。中小企业私募债券属于高风险的债券投资品种，其流动性风险和信用风险均高于一般债券品种，会影响组合的风险特征。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%。中小企业私募债券的流动性风险在于该类债券采取非公开方式发行和交易，由于不公开资料，外部评级机构一般不对这类债券进行外部评级，可能会降低市场对该类债券的认可度，从而影响该类债券的市场流动性。中小企业私募债券的信用风险在于该类债券发行主体的资产规模较小、经营的波动性较大，同时，各类材料（包括募集说明书、审计报告）不公开发布，也大大提高了分析并跟踪发债主体信用基本面的难度。

### （3）投资资产支持证券的风险

本基金的投资范围包括资产支持证券，资产支持证券是一种债券性质的金融工具，风险主要包括资产风险及证券化风险。资产风险来源于资产本身，包括价格波动风险、流动性风险等；证券化风险主要包括信用评级风险、法律风险等。

### （4）投资股指期货的风险

①股指期货交易采用保证金交易方式，潜在损失可能成倍放大，具有杠杆性风险；

②股指期货合约到期时，本基金的账户如仍持有未平仓合约，交易所将按照交割结算价将账户持有的合约进行现金交割，因此无法继续持有到期合约，具有

到期日风险；

③持仓组合品种变现时，由于市场流动性严重不足或头寸持有集中度过大导致未在合理价位成交，存在变现损失风险；

④股指期货设置了涨跌停板限制，本基金的账户中股指期货持仓可能无法平仓，存在流动性风险；

⑤交易所设置了持仓限制，本基金的账户中股指期货持仓超过限制比例，会被交易所或期货公司强行平仓，存在强行平仓风险；

⑥交易所设置了强制减仓限制，本基金的账户中股指期货持仓符合交易所强制减仓范围的，存在强制减仓的风险。

（5）投资科创板股票存在的风险包括但不限于如下风险：

（a）退市风险

科创板退市制度较主板更为严格，退市时间更短，退市速度更快；退市情形更多，新增市值低于规定标准、上市公司信息披露或者规范运作存在重大缺陷导致退市的情形；执行标准更严，明显丧失持续经营能力，仅依赖与主业无关的贸易或者不具备商业实质的关联交易维持收入的上市公司可能会被退市；且不再设置暂停上市、恢复上市和重新上市环节，上市公司退市风险更大。

（b）市场风险

科创板个股集中来自新一代信息技术、高端装备、新材料、新能源、节能环保及生物医药等高新技术和战略新兴产业领域。大多数企业为初创型公司，企业未来盈利、现金流、估值均存在不确定性，与传统二级市场投资存在差异，整体投资难度加大，个股市场风险加大。科创板个股上市前五日无涨跌停限制，第六日开始涨跌幅限制在正负 20%以内，个股波动幅度较其他股票加大，市场风险随之上升。

（c）流动性风险

由于科创板投资门槛高于 A 股其他板块，整体板块流动性可能弱于 A 股，基金组合存在无法及时变现及其他相关流动性风险。

（d）集中度风险

科创板为新设板块，初期可投标的较少，投资者容易集中投资于少量个股，市场可能存在高集中度状况，整体存在集中度风险。

(e) 系统性风险

科创板企业均为市场认可度较高的科技创新企业，在企业经营及盈利模式上存在趋同，所以科创板个股相关性较高，市场表现不佳时，系统性风险将更为显著。

(f) 政策风险

国家对高新技术产业扶持力度及重视程度的变化会对科创板企业带来较大影响，国际经济形势变化对战略新兴产业及科创板个股也会带来政策影响。

10、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有遭受损失的风险，以及证券市场、基金管理人及基金销售机构可能因不可抗力无法正常工作，从而产生影响基金的申购和赎回按正常时限完成的风险；

(7) 金融市场危机、行业竞争、代理商违约、基金托管人违约等超出基金管理人自身直接控制能力之外的风险，也可能导致基金或者基金份额持有人利益受损；

(8) 其他意外导致的风险。

## 第十九节基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### 一、《基金合同》的变更

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

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议生效后方可执行，并于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、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

3、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登载在规定网站上，将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

(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，但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的，清算期限相应顺延。

#### 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会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

#### 七、基金财产清算账册及文件的保存

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

## 第二十章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）基金份额持有人的权利与义务

基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受，基金投资者自依据《基金合同》取得的基金份额，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。

每份基金份额具有同等的合法权益。

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

- （1）分享基金财产收益；
- （2）参与分配清算后的剩余基金财产；
- （3）依法转让或申请赎回其持有的基金份额；
- （4）按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会；
- （5）出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- （6）查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- （7）监督基金管理人的投资运作；
- （8）对基金管理人、基金托管人、基金销售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各种原因获得的不当得利；

(9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## (二) 基金管理人的权利与义务

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) 召集基金份额持有人大会；

(6) 依据《基金合同》及有关法律、法规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

(7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

(8) 选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；

(9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；

(10) 依据《基金合同》及有关法律、法规规定决定基金收益的分配方案；

(11) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购、赎回、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 15 年以上；

(17) 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的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同期活期存款利息(税

后)在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人;

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议;

(26) 建立并保存基金份额持有人名册;

(27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

### (三) 基金托管人的权利与义务

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

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

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

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

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

(5) 提议召开或召集基金份额持有人大会;

(6) 在基金管理人更换时,提名新的基金管理人;

(7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产;

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

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

(4) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外,不得利用基金财

产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；

(5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

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

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

(8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值、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 15 年以上；

(12) 建立并保存基金份额持有人名册；

(13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

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

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

(16) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；

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

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

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

(20) 按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义

务，基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿；

（21）执行生效的基金份额持有人大会的决议；

（22）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## 二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

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

本基金份额持有人大会不设日常机构。

### （一）召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

（1）终止《基金合同》，本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的除外）；

（5）调整基金管理人、基金托管人的报酬标准；

（6）变更基金类别；

（7）本基金与其他基金的合并（法律法规、中国证监会另有规定的除外）；

（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的除外）；

（9）变更基金份额持有人大会程序；

（10）基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；

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

（12）对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

（13）终止基金上市，但因本基金不再具备上市条件而被上海证券交易所终止上市的除外；

（14）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、以下情况在法律法规允许的情况下，且在对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，可由基金管理人和基金托管人协商一致后修改，不需召开基金份额持有人大会：

（1）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》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式，调整基金份额类别的设置；

（3）因相应的法律法规、上海证券交易所或登记机构的相关规则发生变动而应当对《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重大变化；

（5）基金管理人、销售机构、相关证券交易所和基金登记机构在法律法规规定、中国证监会许可或基金合同规定的范围内调整或修改《业务规则》，在不违反法律法规、《基金合同》的约定以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，调整包括但不限于有关基金认购、申购、赎回、转换、基金交易、非交易过户、转托管等业务规则；

（6）在法律法规允许的情况下，且在对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金推出新业务或服务；

（7）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以外的其他情形。

## （二）会议召集人及召集方式

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

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集；

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

人，基金管理人应当配合。

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

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

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

### （三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

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

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知

中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、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、通讯开会方式或法律法规、监管机构允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

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

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

（2）经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）；若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效的基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之一（含三分之一）。

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式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）本人直接出具书面表决意见或授权他人代表出具书面表决意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）；若本人直接出具书面表决意见或授权他人代表出具书面表决意见基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一（含三分之一）以上基金份额的持有人直接出具书面表决意见或授权他人代表出具书面表决意见；

（4）上述第（3）项中直接出具书面表决意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面表决意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面表决意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《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、在法律法规和监管机关允许的情况下，本基金的基金份额持有人亦可采用网络、电话或其他非书面方式进行表决，或者采用网络、电话或其他非书面方式授权他人代为出席基金份额持有人大会并表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

4、在会议召开方式上，本基金亦可采用其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开基金份额持有人大会，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。

（五）议事内容与程序

## 1、议事内容及提案权

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

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

## 2、议事程序

### （1）现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

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

### （2）通讯开会

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

## （六）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1、一般决议，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表

决权的二分之一以上（含二分之一）通过方为有效；除下列第 2 项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。除基金合同另有约定外，转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》、本基金与其他基金合并以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的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表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

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

#### （七）计票

##### 1、现场开会

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

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

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

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

## 2、通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对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) 实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定

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

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

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

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

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

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

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

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

同一主侧袋账户内的每份基金份额具有平等的表决权。

（十）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的部分，如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

### 三、基金合同解除和终止的事由、程序

#### （一）《基金合同》的变更

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

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议生效后方可执行，并于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、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

3、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，但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的，清算期限相应顺延。

### （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会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

#### （七）基金财产清算账册及文件的保存

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

### 四、争议解决方式

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，任何一方均有权提交上海国际经济贸易仲裁委员会，根据该会届时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点在上海市，仲裁裁决是终局性的并对相关各方均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

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

《基金合同》受中国法律管辖。

### 五、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

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

## 第二十一节基金托管协议的内容摘要

### 一、托管协议当事人

#### （一）基金管理人

名称：圆信永丰基金管理有限公司

住所：中国（福建）自由贸易试验区厦门片区（保税港区）海景南二路 45 号 4 楼 02 单元之 175

办公地址：中国上海市浦东新区世纪大道 1528 号陆家嘴基金大厦 19 楼

法定代表人：洪文瑾

成立日期：2014 年 1 月 2 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证券监督管理委员会证监许可（2013）1514 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：人民币贰亿元整

存续期间：永续经营

经营范围：基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务

#### （二）基金托管人

名称：兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 268 号

办公地址：上海市浦东新区长柳路 36 号丁香国际商业中心东塔 11 楼

法定代表人：杨华辉

成立日期：2000 年 05 月 19 日

基金托管业务批准文号：证监许可（2014）1170 号《关于核准兴业证券股份有限公司证券投资基金托管资格的批复》

组织形式：股份有限公司

注册资本：669667.167400 万人民币

存续期间：2000 年 05 月 19 日至 2050 年 05 月 19 日

经营范围：证券经纪；证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财

务顾问；证券承销与保荐；证券自营；融资融券；证券投资基金代销；为期货公司提供中间介绍业务；代销金融产品。（有效期至 2017 年 6 月 26 日）；互联网信息服务不含新闻、出版、教育、医疗保健、药品和医疗器械等内容及电子公告服务（有效期至 2017 年 8 月 16 日）；证券投资基金托管业务。（依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动）

## 二、基金托管人与基金管理人之间的业务监督、核查

### （一）基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权

基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种池，以便基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。

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

基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 60%-95%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持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）。权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或对投资比例要求发生变更，基金管理人在履行适当程序后，可以相应调整本基金的投资范围和投资比例规定。

（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，对基金投融资比例进行监督

- 1、股票资产占基金资产的 60%-95%;
- 2、每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,保持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);
- 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%;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%;
- 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 15%;
- 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、本基金参与股指期货交易，应当遵守下列要求：

（1）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%；

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

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

（4）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；

（5）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%；

16、本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

17、本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前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；

18、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；

19、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、17、18 项外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外，法律法规另有规定的从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日

起开始。

法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受上述限制或相应变更上述限制，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，对基金投资禁止行为进行监督

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

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

（四）托管协议当事人为控制基金参与银行间债券市场的信用风险，由基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。

基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的、本基金适用的银行间债券市场交易对手名单，并按照审慎的风险控制原则约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金管理人应严格按照交易对手名单的范围在银行间债券市场选择交易对手。基金托管人监督基金管理人是否按事前提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易。基金管理人可以定期或不定期对银行间债券市场交易对手名单及结算方式进行更新，新名单确定前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。如基金管理人根据市场情况需要临时调整银行间债券市场交易对手名单及结算方式的，应向基金托管人说明理由。

基金管理人负责对交易对手的资信控制，按银行间债券市场的交易规则进行交易，并承担交易对手不履行合同造成的损失，若未履约的交易对手未能承担违约责任及其他相关法律责任的，基金管理人有权向相关交易对手追偿，基金托管人应予以必要的协助与配合。

基金托管人根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督。如基金托管人事后发现基金管理人没有按照事先约定的交易对手或交易方式进行交易时，基金托管人应及时以书面或双方认可的其他方式提醒基金管理人，经提醒后基金管理人仍未改正时造成基金资产损失的，基金托管人不承担由此造成的相应损失和责任。如果基金托管人未能切实履行监督职责，导致基金出现风险或造成基金资产损失的，基金托管人应承担相应责任。

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

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

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

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

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

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

上述规章制度须经基金管理人董事会批准。

4、在投资流通受限证券之前，基金管理人应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。

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，基金托管人应承担相应责任。

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。

（七）基金托管人应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、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查。

（八）基金托管人发现基金管理人的投资指令或实际投资运作违反法律法规、基金合同、基金托管协议及其他有关规定时的处理方式和程序

基金托管人应及时以电话提醒或书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到书面通知后应在下一个工作日及时核对，并以书面形式向基金托管人发出回函，就基金托管人的合理疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限。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。基金托管人有义务要求基金管理人赔偿因其违反基金合同而致使投资者遭受的损失，如果基金托管人未能切实履行监督职责，导致基金出现风险或

造成基金资产损失的，基金托管人应承担相应责任。对于依据交易程序尚未成交的且基金托管人在交易前能够监控的投资指令，基金托管人发现该投资指令违反法律法规规定或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，立即以书面或以双方认可的其他方式通知基金管理人，并向中国证监会报告。对于必须于估值完成后方可获知的监控指标或依据交易程序已经成交的投资指令，基金托管人发现该投资指令违反法律法规或者违反基金合同约定的，应当立即以书面或以双方认可的其他方式通知基金管理人，并报告中国证监会。

基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查，包括但不限于在规定时间内答复基金托管人并改正，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规要求需向中国证监会报送基金监督报告的，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

（九）基金托管人应当依照法律法规和基金合同约定，加强对侧袋机制启用、特定资产处置和信息披露方面的复核和监督。

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

（十）基金管理人应对基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括但不限于基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、期货账户以及其他投资所需账户，复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、根据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。

（十一）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、基金托管协议及其他有关规定时的处理方式和程序。

基金管理人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。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应报告中国证监会。基金管理人有权要求基金托管人赔偿基金管理人及基金财产因此所遭受的损失。

（十二）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。

### 三、基金财产的保管

#### （一）基金财产保管的原则

1、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。

2、基金托管人应安全、完整地保管基金财产，未经基金管理人的正当指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。

3、基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户、证券账户、期货账户以及其他投资所需要的账户。

4、基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户、独立核算，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。

5、基金托管人根据基金管理人的指令，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。基金托管人未经基金管理人的合法合规指令，不得自行运用、处分、分配本基金的任何资产（不包含基金托管人依据中国证券登记结算有限责任公司结算数据完成场内交易交收、托管资产开户银行扣收结算费和账户维护费等费用）。

6、对于因为基金认/申购、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，但对此不承担相应责任。

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

## （二）基金募集期间及募集资金的验资

1、基金募集期间募集的资金应存于基金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、基金募集期限届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》及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为本基金开立的基金银行账户，同时在规定时间内，聘请具有符合《证券法》规定的会计师事务所验资，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或基金停止募集时，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，基金托管人应提供充分协助。

## （三）基金的银行存款账户的开立和管理

1、基金托管人以基金托管人的名义开设基金托管专户，保管基金财产的银行存款。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，均需通过基金托管专户进行。

2、基金银行存款账户的开立和管理，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、基金的银行存款账户的开立和管理，限于满足开展本基金业务的需要，应符合银行业监督管理机构的有关规定。

4、对于基金因进行定期存款投资等活动而开立账户的，基金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，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。该协议中可以约定如下类似条款：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的类似内容，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，托管人保管证实书正本。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管理人和托管人双方协商解决。

（四）基金托管人因办理基金的清算交收而在中国证券登记结算机构开立证券交收账户和资金交收账户

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、结算保证金、交收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。

（五）债券托管账户的开立和管理

基金合同生效后，基金管理人负责以本基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表基金进行交易；基金托管人根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司和银行间市场清算所股份有限公司的有关规定，在中央国债登记结算有限责任公司和银行间市场清算所股份有限公司开立债券托管账户、持有人账户和资金结算账户，并代表基金进行银行间市场债券的结算。基金管理人和基金托管人共同代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议。

（六）证券账户的开立和管理

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。

证券账户开户费由本基金财产承担。此项开户费由基金管理人先行垫付，待

托管产品起始运营后，基金管理人可向基金托管人发送划款指令，将代垫开户费从本产品托管资金账户中扣还基金管理人。账户开立后，基金托管人应及时将证券账户开通信息通知基金管理人。

#### （七）股指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

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。

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，从其规定办理。

#### （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、银行定期存款的存款证实书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/北京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、银行定期存款的存款证实书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。除协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金财产有关的重大合同时应保证基金一方持有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。重大合同的保管期限为基金合同终止后 15 年。

对于无法取得二份以上的正本的，基金管理人应向基金托管人提供加盖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。

### 四、基金资产净值计算与复核

### （一）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。

基金份额净值是指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数，基金份额净值的计算，精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。国家另有规定的，从其规定。

### （二）复核程序

基金管理人应每个工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产进行估值后，将当日的基金资产净值和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，由基金管理人按照规定对外公布。

（三）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，基金托管人承担复核责任。因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致意见的，按照基金管理人对于基金净值信息的计算结果对外予以公布。

## 五、基金份额持有人名册的登记与保管

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。保管方式可以采用电子或文档的形式。保管期限为 15 年，法律法规另有规定或有权机关另有要求的除外。

在基金托管人要求或编制半年报和年报前，基金管理人应将有关资料送交基金托管人，不得无故拒绝或延误提供，并保证其真实性、准确性和完整性。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。若基金管理人或基金托管人由于自身原因无法妥善保管基金份额持有人名册，应按有关法规规定各自承担相应的责任，法律法规另有规定或有权机关另有要求的除外。

## 六、争议解决方式

因本托管协议产生或与之相关的争议，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，仲裁地点为上海市，按照上海国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担，仲裁裁决另有规定除外。

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。

## 七、托管协议的修改与终止

（一）基金托管协议变更和终止的有关事宜，包括但不限于：

### 1、基金托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议的内容进行变更。变更后的托管协议，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应当报中国证监会备案。

### 2、基金托管协议终止出现的情形

（1）基金合同终止；

（2）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；

（3）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；

（4）发生法律法规或基金合同规定的终止事项。

## 第二十二节对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务,并将根据基金份额持有人的需要和市场的变化增加、修改这些服务项目。目前基金管理人基金份额持有人主要的服务项目如下:

### 一、呼叫中心

#### 1、自动语音服务

提供每周 7 天、每天 24 小时的自动语音服务,客户可通过电话查询基金净值、最新公告等信息。

#### 2、人工电话服务

周一至周五的人工电话服务时间为上午 9:00-11:30,下午 13:00-17:00 法定节假日除外。

客户服务电话:400-607-0088(免长途话费)或 021-60366818

客户服务传真:021-60366001

### 二、电子服务

#### 1、网站服务

通过基金管理人网站,投资者可获得如下服务:

##### (1) 查询服务

基金份额持有人可通过基金管理人网站查询账户相关信息。

##### (2) 资讯服务

投资者可通过基金管理人网站获取基金和基金管理人相关信息,包括基金法律文件、基金管理人最新动态、投研视点等。

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

#### 2、邮件服务

基金管理人为基金份额持有人提供邮件形式的个性化盖章对账单。个性化盖章对账单需要基金份额持有人主动定制且需提供有效的电子邮箱地址。定制方法如下:基金份额持有人可拨打基金管理人客服热线 4006070088 或 021-60366818 转人工服务进行定制。

### 三、基金份额持有人的对账单服务

1、基金份额持有人可登录本公司网站 (<http://www.gtsfund.com.cn>) 查阅对账单。

2、本公司至少每年度以短信或其他形式向通过圆信永丰直销渠道购买并持有本公司基金份额的基金份额持有人提供基金保有情况信息，包括基金名称、基金代码、持有份额等，但由于基金份额持有人在本公司未更新联系方式导致基金管理人无法送出的除外。

#### 四、客户投诉处理

基金份额持有人可以通过基金管理人提供的客服热线自动语音留言、客服热线人工坐席、网站留言、书信、电子邮件、传真等渠道对基金管理人和销售机构所提供的服务进行投诉。基金份额持有人还可以通过销售机构的服务电话对该销售机构提供的服务进行投诉。

#### 五、服务渠道

1、客服电话：400-607-0088（免长途话费）或（021）60366818

2、客服传真：（021）60366001

3、网站：[www.gtsfund.com.cn](http://www.gtsfund.com.cn)

4、客服邮箱：[service@gtsfund.com.cn](mailto:service@gtsfund.com.cn)

5、其他，如信件邮寄等。

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

## 第二十三节其他应披露事项

| 公告事项                                                  | 法定披露日期     |
|-------------------------------------------------------|------------|
| 圆信永丰汇利混合型证券投资基金 (LOF) 2021年第四季度报告                     | 2022-01-24 |
| 关于圆信永丰基金管理有限公司旗下部分基金参加浙江同花顺基金销售有限公司开展的申购、定投费率优惠活动的公告  | 2022-02-17 |
| 圆信永丰基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告            | 2022-03-02 |
| 圆信永丰汇利混合型证券投资基金 (LOF) 2021年年度报告                       | 2022-03-31 |
| 圆信永丰汇利混合型证券投资基金 (LOF) 2022年第一季度报告                     | 2022-04-22 |
| 圆信永丰汇利混合型证券投资基金 (LOF) 基金产品资料概要更新                      | 2022-06-30 |
| 圆信永丰汇利混合型证券投资基金 (LOF) 2022 年第二季度报告                    | 2022-07-21 |
| 圆信永丰汇利混合型证券投资基金 (LOF) 2022 年中期报告                      | 2022-08-31 |
| 圆信永丰基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告                            | 2022-10-19 |
| 圆信永丰汇利混合型证券投资基金 (LOF) 2022 年第三季度报告                    | 2022-10-26 |
| 关于圆信永丰基金管理有限公司旗下部分基金参加上海凯石财富基金销售有限公司开展的申购、定投费率优惠活动的公告 | 2022-10-31 |
| 圆信永丰基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告                            | 2022-11-04 |

## 第二十四节招募说明书的存放及查阅方式

本基金招募说明书存放于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的住所，投资者可在营业时间免费查阅。投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得招募说明书的复印件。投资者还可以直接登录基金管理人网站上进行查阅和下载。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。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。

## 第二十五节备查文件

一、本基金备查文件包括以下文件：

- 1、中国证监会准予圆信永丰汇利混合型证券投资基金（LOF）募集注册的文件
- 2、圆信永丰汇利混合型证券投资基金（LOF）基金合同
- 3、圆信永丰汇利混合型证券投资基金（LOF）托管协议
- 4、关于募集注册圆信永丰汇利混合型证券投资基金（LOF）之法律意见书
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 7、注册登记协议
- 8、中国证监会要求的其他文件

二、备查文件的存放地点和投资者查阅方式：

以上备查文件存放在基金管理人和基金托管人的办公场所，在营业时间可供免费查阅。

圆信永丰基金管理有限公司

二〇二二年十二月三十日