

南方香港成长灵活配置混合型证券投资基金 招募说明书

基金管理人：南方基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

重要提示

本基金经中国证监会 2015 年 7 月 7 日证监许可[2015]1524 号文核准募集。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

本基金投资于境外证券市场，基金净值会因为境外证券市场波动等因素产生波动。在投资本基金前，投资者应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对申购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，获得基金投资收益，亦承担基金投资中出现的各类风险。本基金的主要风险一是境外投资产品风险，包括香港市场风险、汇率风险、政治风险、小市值股票风险、初级产品风险、大宗交易风险和证券借贷/正回购/逆回购风险等。二是开放式基金风险，包括利率风险、信用风险、流动性风险、管理风险、会计核算风险、税务风险、交易结算风险、法律风险和衍生品风险等。三是本基金合同风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险。本基金主要投资香港市场，整体表现受到经济运行情况、香港本地货币/财政政策、产业政策、税法、汇率、交易规则、结算、托管以及其他运作风险等多种因素的影响，上述因素的波动和变化可能会使基金资产面临潜在风险。

投资有风险，投资人认购（或申购）基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》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，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。本基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现；基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行承担。

目录

第一部分	绪言.....	3
第二部分	释义.....	4
第三部分	风险揭示.....	8
第四部分	基金的投资.....	11
第五部分	基金管理人.....	21
第六部分	基金的募集.....	29
第七部分	基金合同的生效.....	32
第八部分	基金份额的申购和赎回.....	33
第九部分	基金的费用与税收.....	42
第十部分	基金的财产.....	44
第十一部分	基金资产估值.....	45
第十二部分	基金的收益与分配.....	50
第十三部分	基金的会计与审计.....	52
第十四部分	基金的信息披露.....	53
第十五部分	基金合同的变更、终止和基金财产的清算.....	58
第十六部分	基金托管人.....	60
第十七部分	境外托管人.....	62
第十八部分	相关服务机构.....	64
第十九部分	基金合同的内容摘要.....	66
第二十部分	基金托管协议的内容摘要.....	87
第二十一部分	基金份额持有人服务.....	99
第二十二部分	其他应披露事项.....	102
第二十三部分	招募说明书存放及其查阅方式.....	103
第二十四部分	备查文件.....	104

第一部分 绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第6号<基金合同的内容与格式>》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》（以下简称“《试行办法》”）、《关于实施〈合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法〉有关问题的通知》（以下简称“《通知》”）以及《南方香港成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》编写。

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，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

第二部分 释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

- 1、基金或本基金：指南方香港成长灵活配置混合型证券投资基金
- 2、基金管理人：指南方基金管理有限公司
- 3、基金托管人：指中国银行股份有限公司
- 4、境外托管人：指符合法律法规规定的条件，根据基金托管人与其签订的合同，为本基金提供境外资产托管服务的境外金融机构
- 5、基金合同：指《南方香港成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》及其任何有效修订和补充
- 6、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《南方香港成长灵活配置混合型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
- 7、招募说明书或本招募说明书：指《南方香港成长灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》及其定期的更新
- 8、基金份额发售公告：指《南方香港成长灵活配置混合型证券投资基金基金份额发售公告》
- 9、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等
- 10、《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，自 2004 年 6 月 1 日起实施并在 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
- 11、《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
- 12、《信息披露办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 8 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 13、《运作办法》：指中国证监会 2014 年 7 月 7 日颁布、同年 8 月 8 日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 14、《试行办法》：指中国证监会 2007 年 6 月 18 日颁布、同年 7 月 5 日实施的《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》及颁布机关对其不时做出的修订

- 15、中国证监会：指中国证券监督管理委员会
- 16、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会
- 17、外管局：指国家外汇管理局或其分支机构
- 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》（包括其不时修订）及相关法律法规规定可以投资于中国境内证券市场的中国境外的机构投资者
- 22、人民币合格境外机构投资者：指按照《人民币合格境外机构投资者境内证券投资试点办法》（包括其不时修订）及相关法律法规规定，运用来自境外的人民币资金进行境内证券投资的境外法人
- 23、投资人：指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和人民币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
- 24、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
- 25、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定投等业务
- 26、销售机构：指南方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
- 27、登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等
- 28、登记机构：指办理登记业务的机构。基金的登记机构为南方基金管理有限公司或接受南方基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构，本基金的登记机构为南方基金管理有限公司
- 29、基金账户：指登记机构为投资人开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户
- 30、基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构办理基金业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户
- 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、深圳证券交易所及境外主要投资场所的正常交易日

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)，n 为自然数

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

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份额的行为

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

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

47、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%

48、元：指人民币元

49、汇率：如无特指，指中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价

50、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

51、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

- 52、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值
- 53、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
- 54、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
- 55、指定媒介：指中国证监会指定的用以进行信息披露的媒介
- 56、香港：指香港特别行政区
- 57、不可抗力：指本基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件
- 58、中国：指中华人民共和国（仅为基金合同目的,不包括香港特别行政区、澳门特别行政区及台湾地区）

第三部分 风险揭示

本基金投资于香港证券市场，基金净值会因为香港证券市场波动等因素产生波动。基金投资中出现的风险分为如下三类，一是境外投资产品风险，包括香港市场风险、汇率风险和政治风险等；二是开放式基金风险，包括利率风险、信用风险、流动性风险、管理风险、会计核算风险、税务风险、交易结算风险、法律风险和衍生品风险等。三是本基金合同风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险。

一、境外投资产品风险

1、香港市场风险

香港证券市场整体表现受到经济运行情况、香港本地货币/财政政策、产业政策、税法、汇率、交易规则、结算、托管以及其他运作风险等多种因素的影响，上述因素的波动和变化可能会使基金资产面临潜在风险。此外，投资香港市场的成本、波动性也可能高于国内市场，存在一定的市场风险。

2、汇率风险

一方面，本基金每日的净资产价值以人民币计价，而基金资产主要投资于以港币计价的标的，因此当人民币汇率发生变动时，将会影响到人民币计价的净资产价值。

3、政治风险

国家或地区的财政政策、货币政策、产业政策、地区发展政策等宏观政策发生变化，导致市场波动而影响基金收益，也会产生风险，称之为政治风险。例如，境外市场的政府可能会鉴于政治上的优先考虑，改变支付政策。本基金以境外市场为主要投资地区，因此境外市场的政治、社会或经济情势的变动(包括自然灾害、战争、暴动或罢工等)，都可能对本基金造成直接或者是间接的负面冲击。

4、小市值股票风险

对于小市值股票而言，由于上市公司发展模式、管理能力尚未成熟，相对于大型蓝筹股而言，其二级市场价格波动性更大，并可能给投资者带来较大损失。

5、初级产品风险

本基金将不直接投资于钢材、煤炭、有色金属等初级产品，但上述初级产品价格的不利变化可能对本基金部分投资标的带来负面影响，从而影响本基金的投资收益。

6、大宗交易风险

大宗交易的成交价格并非完全由市场供需关系形成，可能与市场价格存在一定差异，从而导致大宗交易参与者的非正常损益。

7、证券借贷/正回购/逆回购风险

证券借贷/正回购/逆回购风险的主要风险在于交易对手风险，具体讲，对于证券借贷，交易期满时借方未如约偿还所借证券，或在交易期间未如约支付已借出证券产生的所有股息、利息和分红；对于正回购，交易期满时买方未如约卖回已买入证券，或在交易期间未如约支付售出证券产生的所有股息、利息和分红；对于逆回购，交易期满时卖方未如约买回已售出证券。

二、开放式基金风险

1、利率风险

利率风险是指由于利率变动而导致的证券价格和证券利息的损失。利率风险是债券投资所面临的主要风险，息票利率、期限和到期收益率水平都将影响债券的利率风险水平。国家或地区的利率变动还将影响该地区的经济与汇率等。

2、信用风险

信用风险是指债券发行人是否能够实现发行时的承诺，按时足额还本付息的风险。一般认为：国债的信用风险可以视为零，而其它债券的信用风险可按专业机构的信用评级确定，信用等级变化或市场对某一信用等级水平下债券率的变化都会迅速地改变债券的价格，从而影响到基金资产。投资标的可能因财务结构恶化或整体产业衰退，致使专业评等机构调降该投资标的的债信，进而使得该投资标的产生潜在资本损失的风险。但本基金主要采取股票组合管理，信用风险相对较低。衍生品有一定的交易对手信用风险，可通过严格筛选交易对手来控制。

3、流动性风险

流动性风险是指金融资产不能迅速变现，而可能遭受折价损失的风险。流动性风险将主要表现在以下几个方面：基金资产不能迅速转变成现金，或变现成本很高；不能应付可能出现的投资人大额赎回的风险；证券投资中个券和个股的流动性风险等。这些风险的主要形成原因是市场整体流动性相对不足或者证券市场中流动性不均匀，存在个股流动性风险。

4、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以及对经济形势、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手段和管理技术等因素的变化也会影响基金收益水平。

5、会计核算风险

会计核算风险主要是指由于会计核算及会计管理上违规操作形成的风险，如经常性的串户，帐务记重，透支、过失付款，资金汇划系统款项错划，日终轧帐假平，会计备份数据丢失，利息计算错误等。通过双会计制以及基金会计核算、托管方会计复核的方法可以有效控制会计核算风险。

6、税务风险

在境外投资时，因境外税务法律法规的不同，可能会就股息、利息、资本利得等收益向当地税务机关缴纳税金，包括预扣税，该行为可能会使得资产回报受到一定影响。境外市场的税收法律法规的规定可能变化，或者加以具有追溯力的修订，所以可能须向投资所在国家或地区缴纳本基金销售、估值或者出售投资当日并未预计的额外税项。本基金在投资境外市场时会事先了解当地的税务法律法规，同时，在境外托管人的协助下，完成投资所在国家或地区的税务扣缴工作。

7、交易结算风险

结算风险是一种特殊形式的信用风险。当双方在同一天进行交换时，就会产生结算风险。在一方已经进行了支付后，如果另一方发生违约，就会产生结算风险。本基金将通过国际性的专业清算公司统一进行交易结算，规避结算风险。

8、法律风险

由于交易合约在法律上无效、合约内容不符合法律的规定，或者由于税制、破产制度的改变等法律上的原因，给交易者带来损失的可能性。法律风险主要发生在 OTC（也称为柜台市场）的交易中。法律风险主要来自两个方面：一是合约的不可实施性，包括合约潜在的非法性，对手缺乏进行该项交易的合法资格，以及现行的法律法规发生变更而使该合约失去法律效力等；二是交易对手因经营不善等原因失去清偿能力或不能依照法律规定对其为清偿合约进行平仓交易。对于法律风险，本基金将本着审慎的原则按照中国证监会的要求选择交易对手，并借助于本基金聘请的海外律师严格合约的各项条款与内容，同时，关注相应国家或地区法律环境的变化，有效规避法律风险。

9、衍生品风险

本基金投资衍生品的目的是为了基金的有效管理和避险，而不是投机，基金管理人将通过控制规模、计算合约理论价值、风险敞口、及时移仓等手段来有效控制风险。

三、本基金合同风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险

本基金合同投资章节有关风险收益特征的表述是基于投资范围、投资比例、证券市场普遍规律等做出的概述性描述，代表了一般市场情况下本基金的长期风险收益特征。销售机构（包括基金管理人直销机构和代销机构）根据相关法律法规对本基金进行风险评价，不同的销售机构采用的评价方法也不同，因此销售机构的风险等级评价与基金合同中风险收益特征的表述可能存在不同，投资人在购买本基金时需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。

第四部分 基金的投资

一、投资目标

在适度控制风险并保持良好流动性的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。

二、投资范围

本基金主要投资于全球证券市场中具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会批准上市的股票），股指期货、权证，债券（国债、金融债、企业（公司）债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产以及现金；已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证；银行存款、可转让存单、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；法律法规允许的、已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金（包括ETF）；中国证监会认可的境外交易所上市交易的金融衍生产品及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

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

基金的投资组合比例为：本基金投资组合中股票投资占基金资产的比例为0-95%，其中投资于本基金定义的香港成长股票的投资比例不低于非现金基金资产的80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金以后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

三、投资策略

本基金主要采用稳健的资产配置和积极的股票投资策略。在资产配置中，通过定量与定性相结合的方法分析对宏观经济中结构性、政策性、周期性以及突发性事件进行研判，挖掘未来经济的发展趋势及背后的驱动因素，预测可能对资本市场产生的重大影响，确定投资组合的投资范围和比例。在股票投资中，采用“自上而下”的行业配置策略和“自下而上”的个股选择策略，精选出具有持续竞争优势，且估值有吸引力的股票，精心科学构建股票投资组合，并辅以严格的投资组合风险控制，以获取超额收益。

1、资产配置策略

本基金通过定量与定性相结合的方法分析宏观经济和证券市场发展趋势，评估市场的系

统性风险和各类资产的预期收益与风险，据此合理制定和调整各类资产的比例，在保持总体风险水平相对稳定的基础上，力争投资组合的稳定增值。此外，本基金将持续地进行定期与不定期的资产配置风险监控，适时地做出相应的调整。

2、股票投资策略

(1) 香港成长股票投资策略

本基金主要投资于香港成长股票。本基金定义的香港成长股票为：投资于香港地区发行、上市的，市净率、中期预期盈利增长率、最近5年收入增长率等指标均较高的股票。在上述基础上采用“自上而下”的行业配置策略和“自下而上”的个股选择策略，精选出具有持续竞争优势，且估值有吸引力的股票。具体如下：

1) “自上而下”的行业配置策略：本基金根据宏观经济运行、上下游行业运行态势与利益分配的观察来确定优势或景气行业，以发现能够改变个股未来价值释放能力的系统性条件，从而以最低的组合风险优选并确定优质的股票组合。本基金将根据以下指标筛选优质行业：

A、宏观经济景气状况及所处阶段，主要分析目前经济增长的构成、来源、景气状况，寻找在当前增长模式下增长空间和弹性最大的行业，寻找经济转型中受益程度最高的行业。

B、金融货币政策变化情况，主要根据不同阶段的利率、汇率、财政、货币政策，寻找阶段最优行业。

C、产业政策及发展环境的变化，主要根据国家不同阶段对不同产业的政策和环境，寻找受扶持、受鼓励、发展环境得到持续改善的行业，获取这一行业高速发展的机会。

D、行业所处的生命周期及其在产业链中的地位变化，主要是动态分析行业发展周期、与上下游关系与谈判地位，寻找产业链中由弱转强或优势扩大的行业。

2) “自下而上”的个股选择：本基金将重点比较上市公司的现有账面资产价值与股票投资价值（调整后P/B，同时考虑ROE指标），在此基础上优选未来价值能够释放的上市公司作为主要投资对象。本基金将根据以下指标筛选优质个股：

A、对于上市公司的现有资产价值分析，侧重于分析公司的净资产的构成、调整后净资产、资产的重置价值。

B、对于未来价值释放能力分析，侧重于分析公司的行业增长空间、行业结构、上下游地位、竞争优势、管理能力。优选具备未来价值释放能力的公司：首先是具备持续稳定盈利增长的公司，即具有良好的行业增长空间，所处行业结构相对稳定，在产业链中处于优势地位，具有一定的竞争优势，公司治理结构透明完善，管理水平领先的上市公司。其次是具备经营反转的公司，即所处行业出现新需求，拓展新产品或新技术成功，上下游运行态势好转，公司治理结构与管理水平出现改变的上市公司。。

C、上市公司以下六个方面的指标：资产质量指标，如调整后净资产等。资产结构指标，如资产负债率等。盈利能力指标，如净资产收益率等。盈利质量指标，如各项现金流指标等。

成长能力指标，如长期主营业务收入增长率等。运营能力指标，如总资产周转率等。

（2）境内股票投资策略

本基金也可投资于境内股票市场，具体将采用定性和定量分析相结合的方法，充分挖掘香港与境内股票市场间的价值洼地，力争实现基金资产的长期稳健增值。

1) 定性分析

在定性分析方面，本基金关于具备以下特征的上市公司：

- A、公司所处的行业符合国家的战略发展方向，同时公司在行业中具有明显的竞争优势；
- B、公司具有良好的创新能力，这种创新包括产品的创新、盈利模式的创新、兼并收购的创新等；
- C、公司具有良好的治理结构，从大股东、管理层到中层业务骨干有不错的激励机制，同时企业的信息披露公开透明；
- D、公司的产品、人才、机制、资源有明显优势，且具有一定的资金实力，有一定的进入壁垒，有利于企业在行业快速成长的过程中不断提高企业的市场份额；

2) 定量分析

本基金将对反映上市公司质量和增长潜力的成长性指标、财务指标和估值指标等进行定量分析，以挑选具有成长优势、财务优势和估值优势的个股。

- A、成长性指标：收入增长率、营业利润增长率和净利润增长率等；
- B、财务指标：毛利率、营业利润率、净利率、净资产收益率、经营活动净收益/利润总额等；
- C、估值指标：市盈率相对盈利增长比率（PEG）、市盈率（PE）、市销率（PS）和总市值。

3、基金投资策略

本基金投资于 ETF 和权益类基金，根据对不同因素的研究与判断，对基金投资组合进行调整，以降低投资组合的投资风险。

（1）投资于 ETF 可以享受市场发展的平均收益。本基金在投资 ETF 时，将重点分析标的指数的代表性、跟踪误差以及流动性等指标。

（2）主动型基金将采取定量和定性相结合的分析方式进行筛选，通过构建主动投资组合，创造出超额回报。

a) 定性选择：

对基金的选择主要考虑该基金的投资策略是否符合本基金精选配置的投资思路，包括股票和衍生品等的选择方法，以及本基金对投资的稳定性、风险和收益的要求；该基金的管理和研究团队应该有较长期良好的历史记录，并且能够即时了解公司人员的变动；该基金的管理人应该有稳健良好的财务状况，有良好的风险控制制度和记录，其经营理念和本基金产品的目标一致或者接近。

b) 定量选择:

- i. 该基金的过往历史业绩在一定的时间段内好于其业绩基准,或者管理该基金的基金经理有长期优良的表现。
- ii. 中立机构(如晨星等基金评级公司)对公司的评级在同类基金中处于中等(50%)以上水平。
- iii. 基金的超额收益和标准差的比率(夏普比率)好于同类基金的中值。
- iv. 基金买卖证券的交易成本处于同类基金中的合理水平。

4、固定收益产品投资策略

本基金的固定收益产品投资将综合考虑收益、风险和流动性等指标,在深入分析宏观经济发展、货币政策以及市场结构的基础上,灵活运用积极和消极的固定收益投资策略。

消极固定收益投资策略的目标是在满足现金管理需要的基础上为基金资产提供稳定的收益。本基金主要通过利率免疫策略来进行消极债券投资。积极固定收益投资策略的目标是利用市场定价的短暂无效率来获得低风险甚至是无风险的超额收益;本基金的积极债券投资主要基于对利率期限结构的研究。本基金也将从债券市场的结构变化中寻求积极投资的机会。

5、资产支持证券投资策略

资产支持证券投资关键在于对基础资产质量及未来现金流的分析,本基金将采用基本面分析和数量化模型相结合,对个券进行风险分析和价值评估后进行投资。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资,以降低流动性风险。

6、金融衍生品投资策略

本基金在金融衍生品的投资中主要遵循避险和有效管理两项策略和原则:

(1) 避险。主要用于市场风险大幅累计时的避险操作,减小基金投资组合因市场下跌而遭受的市场风险;

(2) 有效管理。利用金融衍生品流动性好,交易成本低等特点,通过金融衍生品对投资组合的仓位进行及时调整,提高投资组合的运作效率。

此外,在符合有关法律法规规定并且有效控制风险的前提下,本基金还将进行证券借贷交易、回购交易等投资,以增加收益,保障投资者的利益。

未来,随着投资工具的丰富,本基金可相应调整和更新相关投资策略,并及时进行公告。

四、投资决策依据和流程**1、决策依据**

(1) 国家有关法律、法规和本基金合同的有关规定。依法决策是本基金进行投资的前提。

(2) 宏观经济发展态势、微观经济运行环境和证券市场走势。这是本基金投资决策的基础。

(3)投资对象收益和风险的配比关系。在充分权衡投资对象的收益和风险的前提下作出投资决策，是本基金维护投资者利益的重要保障。

2、决策程序

(1)决定主要投资原则：投资决策委员会是公司投资的最高决策机构，决定基金的主要投资原则，确立基金的投资方针及投资方向，审定基金的资产及行业配置方案。

(2)提出投资建议：投资研究团队依据对宏观经济、股票市场运行趋势的判断，结合基金合同、投资制度向基金经理提出股票资产的投资建议。

(3)制定投资决策：基金经理在遵守投资决策委员会制定的投资原则前提下，根据研究员提供的投资建议以及自己的分析判断，做出具体的投资决策。

(4)进行风险评估：风险管理部门对公司旗下基金投资组合的风险进行监测和评估，并出具风险监控报告。

(5)评估和调整决策程序：基金管理人有权根据环境的变化和实际的需要调整决策的程序。

五、投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

(1) 本基金投资组合中股票投资占基金资产的比例为 0-95%，其中投资于本基金定义的香港成长股票的投资比例不低于非现金基金资产的 80%。

(2) 本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金以后，保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。

(3) 本基金投资境内权证应当符合以下规定：

1) 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%；

2) 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%；

3) 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%。

(4) 本基金境内投资资产支持证券应当符合以下规定：

1) 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%；

2) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

3) 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%；

4) 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%；

5) 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。

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

(6) 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%, 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。

(7) 本基金在境内投资中, 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%; 在任何交易日日终, 持有的买入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; 在任何交易日日终, 持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%; 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%; 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。

(8) 本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%;

(9) 本基金的境内存款银行为具有证券投资基金托管人资格、证券投资基金销售业务资格或合格境外机构投资者托管人资格的境内商业银行, 本基金的境外存款银行为中资商业银行在境外设立的分行或在最近一个会计年度达到中国证监会认可的信用评级机构评级的境外银行。本基金存放在具有基金托管资格的同一境内商业银行, 中资商业银行在境外设立的分行或在最近一个会计年度达到中国证监会认可的信用评级机构评级的境外银行的存款, 不得超过基金资产净值的 20%; 存放在境内不具有基金托管资格的同一商业银行的存款, 不得超过基金资产净值的 5%; 若同时具境内与境外资格, 以境内资格为准。存放于基金托管账户的存款可以不受上述限制。

(10) 本基金持有同一机构(政府、国际金融组织除外)发行的证券市值不得超过基金净值的 10%。

(11) 本基金持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不得超过基金资产净值的 10%, 其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的 3%。本基金投资于国内依法发行上市的股票、债券等金融工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具不受上述限制。

(12) 本基金不得购买证券用于控制或影响发行该证券的机构或其管理层。本基金管理人管理的全部基金不得持有同一机构 10% 以上具有投票权的证券发行总量; 同一机构境内外上市的总股本应当合并计算, 同时应当一并计算全球存托凭证和美国存托凭证所代表的基础证券, 并假设对持有的股本权证行使转换。

(13) 本基金持有非流动性资产市值不得超本过基金净值的 10%。前项非流动性资产是指法律或基金合同规定的流通受限证券以及中国证监会认定的其他资产。

(14) 本基金持有境外基金的市值合计不得超过本基金净值的 10%，但持有货币市场基金不受此限制。

(15) 本基金管理人所管理的全部基金持有任何一只境外基金，不超过该境外基金总份额的 20%。

(16) 本基金境外投资中，投资衍生品应当仅限于投资组合避险或有效管理，不得用于投机或放大交易，同时应当严格遵守下列规定：

1) 本基金的金融衍生品全部敞口不得高于基金资产净值的 100%。

2) 本基金投资期货支付的初始保证金、投资期权支付或收取的期权费、投资柜台交易衍生品支付的初始费用的总额不得高于基金资产净值的 10%。

3) 本基金投资于远期合约、互换等柜台交易金融衍生品，应当符合以下要求：

① 所有参与交易对手方（中资商业银行除外）应当具有不低于中国证监会认可的信用评级机构评级；

② 交易对手方应当至少每个工作日对交易进行估值，并且本基金可在任何时候以公允价值终止交易；

③ 任一交易对手方的市值计价敞口不得超过基金资产净值的 20%。

4) 本基金不得直接投资与实物商品相关的衍生品。

(17) 本基金境外投资中，可以参与证券借贷交易，并且应当遵守下列规定：

1) 所有参与交易对手方（中资商业银行除外）应当具有中国证监会认可的信用评级机构评级。

2) 应当采取市值计价制度进行调整以确保担保物市值不低于已借出证券市值的 102%。

3) 借方应当在交易期内及时向本基金支付已借出证券产生的所有股息、利息和分红。一旦借方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留和处置担保物以满足索赔需要。

4) 除中国证监会另有规定外，担保物可以是以下金融工具或品种：

A、 现金；

B、 存款证明；

C、 商业票据；

D、 政府债券；

E、 中资商业银行或由不低于中国证监会认可的信用评级机构评级的境外金融机构（作为交易对手方或其关联方的除外）出具的不可撤销信用证。

5) 本基金有权在任何时候终止证券借贷交易并在正常市场惯例的合理期限内要求归还任一或所有已借出的证券。

6) 基金管理人应当对基金参与证券借贷交易中发生的任何损失负相应责任。

(18) 本基金境外投资中,可以根据正常市场惯例参与正回购交易、逆回购交易,并且应当遵守下列规定:

1) 所有参与正回购交易对手方(中资商业银行除外)应当具有中国证监会认可的信用评级机构信用评级。

2) 参与正回购交易,应当采取市值计价制度对卖出收益进行调整以确保现金不低于已售出证券市值的 102%。一旦买方违约,本基金根据协议和有关法律有权保留或处置卖出收益以满足索赔需要。

3) 买方应当在正回购交易期内及时向本基金支付售出证券产生的所有股息、利息和分红。

4) 参与逆回购交易,应当对购入证券采取市值计价制度进行调整以确保已购入证券市值不低于支付现金的 102%。一旦卖方违约,本基金根据协议和有关法律有权保留或处置已购入证券以满足索赔需要。

5) 基金管理人应当对基金参与证券正回购交易、逆回购交易中发生的任何损失负相应责任。

(19) 基金参与境外证券借贷交易、正回购交易,所有已借出而未归还证券总市值或所有已售出而未回购证券总市值均不得超过基金总资产的 50%。前项比例限制计算,基金因参与证券借贷交易、正回购交易而持有的担保物、现金不得计入基金总资产。

(20) 法律法规和基金合同规定的其他限制。

如果法律法规或监管机构变更或取消上述限制,本基金将相应变更或取消上述规定,不需经基金份额持有人大会审议。

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。若本基金投资超过基金合同约定的投资比例规定的,基金管理人应当在超过比例后 30 个工作日内采用合理的商业措施进行调整以符合基金合同规定的投资比例要求,法律法规或中国证监会另有规定的依其规定执行。

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) 购买不动产;
- (2) 购买房地产抵押按揭;
- (3) 购买贵金属或代表贵金属的凭证;
- (4) 购买实物商品;
- (5) 除应付赎回、交易清算等临时用途以外,借入现金。该临时用途借入现金的比例不得超过本基金资产净值的 10%;
- (6) 利用融资购买证券,但投资金融衍生品除外;

- (7) 参与未持有基础资产的卖空交易；
- (8) 从事证券承销业务；
- (9) 向基金管理人、基金托管人出资；
- (10) 违反规定向他人贷款或提供担保；
- (11) 从事承担无限责任的投资；
- (12) 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；
- (13) 直接投资与实物商品相关的衍生品；
- (14) 中国证监会禁止的其他行为。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先的原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须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。

除非法律法规和监管部门禁止，本基金可以投资境外资产托管人发行的金融产品。

如法律法规或监管部门取消上述限制，在可适用于本基金的情况下，则本基金投资不再受相关限制。

六、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为： $\text{经人民币汇率调整的恒生指数收益率} \times 95\% + \text{人民币同期活期存款利率} \times 5\%$

恒生指数是香港市场存在历史最长久的指数，是反映香港股票市场表现最具有代表性的综合指标，自推出至今一直获广泛使用，能够更好的反映香港证券市场的平均收益水平，是适合作为本基金业绩比较基准的指数。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时，本基金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。如果本基金业绩比较基准所参照的指数在未来不再发布时，基金管理人可以按相关监管部门要求履行相关手续后，依据维护基金份额持有人合法权益的原则，选取相似的或可替代的指数作为业绩比较基准的参照指数，而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，其长期平均风险和预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基

金、货币市场基金。

八、基金管理人代表基金行使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、债权人权利，保护基金份额持有人的利益。

第五部分 基金管理人

一、基金管理人概况

名称：南方基金管理有限公司

住所及办公地址：深圳市福田区福华一路六号免税商务大厦塔楼 31、32、33 层整层

成立时间：1998 年 3 月 6 日

法定代表人：吴万善

注册资本：3 亿元人民币

电话：(0755) 82763888

传真：(0755) 82763889

联系人：鲍文革

南方基金管理有限公司是经中国证监会证监基字[1998]4 号文批准，由南方证券有限公司、厦门国际信托投资公司、广西信托投资公司共同发起设立。2000 年，经中国证监会证监基金字[2000]78 号文批准进行了增资扩股，注册资本达到 1 亿元人民币。2005 年，经中国证监会证监基金字[2005]201 号文批准进行增资扩股，注册资本达 1.5 亿元人民币。2010 年，经证监许可[2010]1073 号文核准深圳市机场（集团）有限公司将其持有的 30%股权转让给深圳市投资控股有限公司。2014 年公司进行增资扩股，注册资本金达 3 亿元人民币。目前股权结构：华泰证券股份有限公司 45%、深圳市投资控股有限公司 30%、厦门国际信托有限公司 15%及兴业证券股份有限公司 10%。

二、主要人员情况

1、董事会成员

吴万善先生，董事，中共党员，工商管理硕士，高级经济师。历任中国人民银行江苏省分行金融管理处科员、中国人民银行南京市分行江宁支行科员；华泰证券证券发行部副经理、总经理助理；江苏省证券登记处总经理；华泰证券副总经理、总裁。现任华泰证券股份有限公司董事长兼党委副书记、南方基金管理有限公司董事长、华泰金融控股（香港）有限公司董事。

张涛先生，董事，中共党员，毕业于河海大学技术经济及管理专业，获博士学位。1994 年 8 月加入华泰证券，历任总裁秘书、投资银行一部业务经理、上海总部投资银行业务部副总经理、公司董事会秘书、总裁助理兼董事会办公室主任、副总裁、党委委员。现任华泰证券股份有限公司副总裁、党委委员；华泰长城期货有限公司董事长、华泰金融控股（香港）有限公司董事。

姜健先生，董事，中共党员，毕业于南京林业大学经济及管理专业，获硕士学位。1994年12月加入华泰证券并一直在华泰证券工作，历任人事处职员、人事处培训教育科科长、投资银行总部股票事务部副总经理、投资银行一部副总经理、投资银行一部高级经理、投资银行总部副总经理兼发行部经理、资产管理总部总经理、投资银行总部业务总监、总裁助理、副总裁、董事会秘书等职务。现任华泰证券股份有限公司的副总裁、党委委员、董事会秘书；华泰联合证券有限责任公司董事、华泰紫金投资有限责任公司董事、江苏股权交易中心有限责任公司董事长、华泰瑞通投资管理有限公司董事、江苏银行股份有限公司董事、证通股份有限公司董事。

夏桂英女士，董事，中共党员，高级经济师，26年法律公司管理经济工作从业经历。毕业于中国政法大学法律专业，获法学硕士学位。曾先后担任中国政法大学中国法制研究所教师、深圳市人大法工委办公室主任科员、深圳市光通发展有限公司办公室主任、深圳市投资管理公司总法律顾问、深圳市对外劳动服务有限公司党总支书记、董事长等职。2004年10月加入深圳市投资控股有限公司，历任法律事务部部长、企业一部部长职务。现任深圳市投资控股有限公司副总经理、深圳市通产集团有限公司董事、深圳市高新投集团有限公司董事、深圳市城市建设开发（集团）公司董事、深圳市中小企业信用融资担保集团有限公司董事。

项建国先生，董事，中共党员，高级会计师，大学本科毕业于中南财经大学财务会计专业。曾在江西财经大学任教并担任审计教研室副主任，其后在深圳蛇口信德会计师事务所、深圳市商贸投资控股公司、深圳市投资控股有限公司任职，历任深圳市投资控股有限公司投资部部长、投资发展部部长、企业一部部长、战略发展部部长，长期从事投融资、股权管理、股东事务等工作。现任深圳市投控产业园区开发运营公司副总经理、中国深圳对外贸易（集团）有限公司董事、深圳市高新投集团有限公司监事、华润五丰肉类食品（深圳）有限公司董事、深圳市建筑设计研究总院有限公司董事。

李自成先生，董事，中共党员，硕士研究生学历。历任厦门大学哲学系团总支副书记、厦门国际信托投资公司办公室主任、营业部经理、计财部经理、公司总经理助理、厦门国际信托投资有限公司副总经理、厦门国际信托有限公司副总经理、工会主席、党总支副书记。现任厦门国际信托有限公司总经理。

庄园芳女士，董事，工商管理硕士，经济师。历任兴业证券交易业务部总经理助理、负责人，证券投资部副总经理、总经理，投资总监；现任兴业证券股份有限公司副总裁、兴业创新资本管理有限公司董事、兴证（香港）金融控股有限公司董事。

杨小松先生，总裁，中共党员，经济学硕士，注册会计师。历任德勤国际会计师行会计专业翻译，光大银行证券部职员，美国NASDAQ实习职员，证监会处长、副主任。2012年加入南方基金，担任督察长，现任南方基金管理有限公司董事、总裁、党委副书记。

姚景源先生，独立董事，经济学硕士。历任国家经委副处长、商业部政策研究室副处长、

国际合作司处长、副司长、中国国际贸易促进会商业行业分会副会长、常务副会长、国内贸易部商业发展中心主任、中国商业联合会副会长、秘书长、安徽省政府副秘书长、安徽省阜阳市政府市长、安徽省统计局局长、党组书记、国家统计局总经济师兼新闻发言人。现任国务院参事室特约研究员，中国经济 50 人论坛成员，中国统计学会副会长。

李心丹先生，独立董事，金融学博士，国务院特殊津贴专家，国务院学位委员会、教育部全国金融硕士专业学位教学指导委员会委员。历任东南大学经济管理学院助教、讲师、副教授、教授，现任南京大学工程管理学院院长、金融工程研究中心主任、南京大学创业投资研究与发展中心执行主任、教授、博士生导师、江苏省省委决策咨询专家、上海证券交易所上市委员会委员及公司治理委员会委员、上海证券交易所、深圳证券交易所、国信证券等单位的博士后指导导师，中国金融学年会常务理事、国家留学基金会评审专家、江苏省资本市场研究会会长、江苏省科技创新协会副会长。

周锦涛先生，独立董事，工商管理博士，香港证券及投资学会高级资深会员。曾任职香港警务处(商业罪案调查科)，香港证券及期货专员办事处，及香港证券及期货事务监察委员会，退休前为该会的法规执行部总监。其后曾任该会法规执行部顾问及香港汇业集团控股有限公司独立非执行董事。现任香港金融管理局顾问。

郑建彪先生，独立董事，中共党员，经济学硕士，20 年以上证券从业经历。毕业于财政部科研所，曾任职于北京市财政局、深圳蛇口中华会计师事务所、京都会计师事务所等机构，先后担任干部、经理、副主任等工作。现担任致同会计师事务所（特殊普通合伙）董事合伙人，中国证监会上市公司并购重组专家咨询委员会委员职务。

周蕊女士，独立董事，硕士研究生学历，曾工作于北京市万商天勤（深圳）律师事务所、北京市中伦（深圳）律师事务所、北京市信利（深圳）律师事务所，现任北京市金杜（深圳）律师事务所华南区管理合伙人，全联并购公会广东分会副会长、广东省律师协会女律师委员会副主任、深圳市中小企业改制专家服务团专家、深圳市中小企业公共服务联盟副主席、深圳市易尚展示股份有限公司独立董事。

2、监事会成员

骆新都女士，监事，经济学硕士，经济师。历任民政部外事处处长、南方证券有限公司副总裁、南方基金管理有限公司董事长、顾问；现任南方基金管理有限公司监事会主席。

舒本娥女士，监事，15 年的证券行业从业经历。毕业于杭州电子工业学院会计专业，获学士学位。曾任职于熊猫电子集团公司，担任财务处处长工作。1998 年 10 月加入华泰证券，历任计划资金部副总经理、稽查监察部副总经理、总经理、计划财务部总经理。现任华泰证券股份有限公司财务负责人、计划财务部总经理；华泰联合证券有限责任公司监事会主席、华泰长城期货有限公司副董事长、华泰紫金投资有限责任公司董事、华泰瑞通投资管理有限公司董事。

姜丽花女士，监事，中共党员，高级会计师，大学本科毕业于深圳广播电视大学会计学

专业。曾在浙江兰溪马涧米厂、浙江兰溪纺织机械厂、深圳市建筑机械动力公司、深圳市建设集团、深圳市建设投资控股公司工作，2004年深圳市投资控股有限公司成立至今，历任公司计划财务部副经理、经理，财务预算部副部长，长期从事财务管理、投融资、股权管理、股东事务等工作，现任深圳市投资控股有限公司考核分配部部长，深圳经济特区房地产（集团）股份有限公司董事、深圳市建安（集团）股份有限公司董事、深圳市国际招标有限公司董事、深圳市深投物业发展有限公司董事。

苏荣坚先生，监事，中共党员，学士学位，高级经济师。历任三明市财政局、财委，厦门信达股份有限公司财务部、厦门国际信托投资公司财务部业务主办、副经理，自营业务部经理；现任厦门国际信托有限公司财务总监兼财务部总经理。

林红珍女士，监事，投资经济管理专业学士学位，后参加中国人民大学金融学院研究生进修班。曾任厦门对外供应总公司会计、厦门中友贸易联合公司财务部副经理、厦门外供房地产开发公司财务部经理，1994年进入兴业证券，先后担任计财部财务综合组负责人、直属营业部财务部经理、财务会计部计划财务部经理、风险控制部总经理助理兼审计部经理、风险管理部副总监、稽核审计部副总监、风险管理部副总经理（主持工作）、兴业证券风险管理部总经理，现任兴业证券股份有限公司财务部总经理、兴业创新资本管理有限公司监事。

苏民先生，职工监事，博士研究生，工程师。历任安徽国投深圳证券营业部电脑工程师，华夏证券深圳分公司电脑部经理助理，南方基金管理有限公司运作保障部副总监、市场服务部总监、电子商务部总监；现任南方基金管理有限公司风险管理部总监。

张德伦先生，职工监事，中共党员，硕士学历。历任北京邮电大学副教授、华为技术有限公司处长、汉唐证券人力资源部总经理、海王生物人力资源总监、华信惠悦咨询公司副总经理、首席顾问，2010年1月加入南方基金管理有限公司，现任人力资源部总监。

林斯彬先生，职工监事，民商法专业硕士，先后担任金杜律师事务所证券业务部实习律师、浦东发展银行深圳分行资产保全部职员、银华基金管理有限公司监察稽核部法务主管、民生加银基金管理有限公司监察稽核部职员，2008年12月加入南方基金管理有限公司，历任监察稽核部经理、高级经理、总监助理，现任监察稽核部副总监。

3、公司高管人员

吴万善先生，董事长，简历同上。

杨小松先生，总裁，简历同上。

俞文宏先生，副总裁，中共党员，工商管理硕士，经济师，历任江苏省投资公司业务经理、江苏国际招商公司部门经理、江苏省国际信托投资公司投资银行部总经理、江苏国信高科技创业投资有限公司董事长兼总经理。2003年加入南方基金，现任南方基金管理有限公司副总裁、党委委员、南方资本管理有限公司董事长兼总经理。

郑文祥先生，副总裁，工商管理硕士。曾任职于湖北省荆州市农业银行、南方证券公司、国泰君安证券公司。2000年加入南方基金，历任国债投资经理、专户理财部副总监、南方

避险增值基金基金经理、总经理助理兼养老金业务部总监，现任南方基金管理有限公司副总裁。

朱运东先生，副总裁，中共党员，经济学学士。曾任职于财政部地方预算司及办公厅、中国经济开发信托投资公司，2002 年加入南方基金，历任北京分公司总经理、产品开发部总监、总裁助理、首席市场执行官，现任南方基金管理有限公司副总裁、党委委员。

秦长奎先生，副总裁，中共党员，工商管理硕士。历任南京汽车制造厂经营计划处科员，华泰证券有限责任公司营业部总经理、总裁助理兼基金部总经理、投资银行总部副总经理兼债券部总经理。2005 年加入南方基金，曾任督察长兼监察稽核部总监，现任南方基金管理有限公司副总裁、纪委委员。

鲍文革先生，督察长，中国民主同盟盟员，经济学硕士。历任财政部中华会计师事务所审计师，南方证券有限公司投行部及计划财务部总经理助理，1998 年加入南方基金，历任运作保障部总监、公司监事、财务负责人、总经理助理，现任南方基金管理有限公司督察长、南方资本管理有限公司董事。

常克川先生，副总裁，中共党员，EMBA 工商管理硕士。历任中国农业银行副处级秘书，南方证券有限责任公司投资业务部总经理、沈阳分公司总经理、总裁助理，联合证券（现为华泰联合证券）董事会秘书、合规总监等职务；2011 年加入南方基金，任职董事会秘书、纪委书记，现任南方基金管理有限公司副总裁、董事会秘书、纪委书记、南方资本管理有限公司董事。

李海鹏先生，副总裁，工商管理硕士。曾任美国 AXA Financial 公司投资部高级分析师，2002 年加入南方基金管理有限公司，历任高级研究员、基金经理助理、基金经理、全国社保及国际业务部执行总监、全国社保业务部总监、固定收益部总监、总经理助理兼固定收益投资总监，现任南方基金管理有限公司副总裁、固定收益投资总监、南方东英资产管理有限公司（香港）董事。

4、基金经理

蔡青女士，英国朴茨茅斯大学金融决策分析专业硕士，具有基金从业资格。2006 年 7 月加入南方基金，历任国际业务部研究员、高级研究员。2011 年 6 月至 2015 年 5 月，担任南方全球的基金经理助理。2015 年 5 月至今，任南方全球基金经理。

5、投资决策委员会成员

总裁杨小松先生，副总裁兼固定收益投资总监、南方东英资产管理有限公司（香港）董事李海鹏先生，总裁助理兼权益投资总监史博先生。

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

三、基金管理人的职责

(1) 依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的

发售、申购、赎回和登记事宜；

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

四、基金管理人关于遵守法律法规的承诺

1、基金管理人承诺遵守《基金法》及其他相关法律法规的规定，建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止违反《基金法》及其他相关法律法规行为的发生。

2、基金管理人承诺不从事下列行为：

- (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。

五、基金管理人关于禁止性行为的承诺

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

- 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。

法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

六、基金经理承诺

- 1、依照有关法律、法规和基金合同的规定，本着勤勉尽责的原则为基金份额持有人谋取最大利益；
- 2、不能利用职务之便为自己、受雇人或基金份额持有人以外的人谋取利益；
- 3、不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、不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

七、基金管理人的内部控制制度

1、内部控制制度概述

为了保证公司规范运作，有效地防范和化解管理风险、经营风险以及操作风险，确保基金财务和公司财务以及其他信息真实、准确、完整，从而最大程度地保护基金份额持有人的利益，本基金管理人建立了科学合理、控制严密、运行高效的内部控制制度。

内部控制制度是指公司为实现内部控制目标而建立的一系列组织机制、管理方法、操作程序与控制措施的总称。内部控制制度由内部控制大纲、基本管理制度、部门业务规章等组成。

公司内部控制大纲是对公司章程规定的内控原则的细化和展开，是对各项基本管理制度的总揽和指导，内部控制大纲明确了内控目标、内控原则、控制环境、内控措施等内容。

基本管理制度包括内部会计控制制度、风险控制制度、投资管理制度、监察稽核制度、基金会计制度、信息披露制度、信息技术管理制度、资料档案管理制度、业绩评估考核制度和紧急应变制度等。

部门业务规章是在基本管理制度的基础上，对各部门的主要职责、岗位设置、岗位职责、操作守则等的具体说明。

2、内部控制原则

健全性原则。内部控制机制必须覆盖公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员，并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个运作环节。

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

独立性原则。公司各机构、部门和岗位在职能上应当保持相对独立，公司基金资产、自

有资产、其他资产的运作应当分离。

相互制约原则。公司内部部门和岗位的设置必须权责分明、相互制衡，并通过切实可行的措施来实行。

成本效益原则。公司应充分发挥各机构、各部门及各级员工的工作积极性，运用科学化的方法尽量降低经营运作成本，提高经济效益，以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

3、主要内部控制制度

(1) 内部会计控制制度

公司依据《中华人民共和国会计法》等国家有关法律、法规制订了基金会计制度、公司财务会计制度、会计工作操作流程和会计岗位职责，并针对各个风险控制点建立严密的会计系统控制。

内部会计控制制度包括凭证制度、复核制度、账务处理程序、基金估值制度和程序、基金财务清算制度和程序、成本控制制度、财务收支审批制度和费用报销管理办法、财产登记保管和实物资产盘点制度、会计档案保管和财务交接制度等。

(2) 风险管理控制制度

风险控制制度由风险控制委员会组织各部门制定，风险控制制度由风险控制的机构设置、风险控制的程序、风险控制的具体制度、风险控制制度执行情况的监督等部分组成。

风险控制的具体制度主要包括投资风险管理制度、交易风险管理制度、财务风险控制制度、信息技术系统风险控制制度以及岗位分离制度、防火墙制度、反馈制度、保密制度等程序性风险管理制度。

(3) 监察稽核制度

公司设立督察长，负责监督检查基金和公司运作的合法合规情况及公司内部风险控制情况。督察长由总经理提名，董事会聘任，并经全体独立董事同意。

督察长负责组织指导公司监察稽核工作。除应当回避的情况外，督察长享有充分的知情权和独立的调查权。督察长根据履行职责的需要，有权参加或者列席公司董事会以及公司业务、投资决策、风险管理等相关会议，有权调阅公司相关文件、档案。督察长应当定期或者不定期向全体董事报送工作报告，并在董事会及董事会下设的相关专门委员会定期会议上报告基金及公司运作的合法合规情况及公司内部风险控制情况。

公司设立监察稽核部门，具体执行监察稽核工作。公司配备了充足合格的监察稽核人员，明确规定了监察稽核部门及内部各岗位的职责和 workflow。

监察稽核制度包括内部稽核管理办法、内部稽核工作准则等。通过这些制度的建立，检查公司各业务部门和人员遵守有关法律、法规和规章的情况；检查公司各业务部门和人员执行公司内部控制制度、各项管理制度和业务规章的情况。

第六部分 基金的募集

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定，并经中国证监会 2015 年 7 月 7 日证监许可[2015]1524 号文核准募集。

本基金为契约型开放式基金。基金存续期限为不定期。

一、募集期

自基金份额发售之日起不超过 3 个月，具体发售时间见基金份额发售公告。

二、发售对象

符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和人民币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。

三、发售方式和销售渠道

本基金将通过各销售机构的基金销售网点或按基金管理人、销售机构提供的其他方式办理公开发售，各销售机构的具体名单见基金份额发售公告或相关业务公告。

本基金认购采取全额缴款认购的方式。若资金未全额到账则认购无效，基金管理人将认购无效的款项退回。基金投资人在募集期内可多次认购，认购一经确认不得撤销。

基金销售机构对认购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认购申请。认购的确认以登记机构或基金管理人的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利，否则，由此产生的投资人任何损失由投资人自行承担。

本基金认购的申请方式为书面申请或各销售机构规定的其他方式。

本基金基金份额发售面值为人民币 1.00 元，按面值发售。

当日（T 日）在规定时间内提交的申请，投资人通常可在 T+2 日到网点查询交易情况，在募集截止日后 3 个工作日内可以到网点打印交易确认书。

四、首次募集规模上限

本基金可设置首次募集规模上限，具体募集上限及规模控制的方案详见基金份额发售公告或其他公告。若本基金设置首次募集规模上限，基金合同生效后不受此募集规模的限制。

五、认购费用

本基金认购费率最高不高于 1.5%，且随认购金额的增加而递减，如下表所示：

认购金额 (M)	认购费率
M < 100 万	1.5
100 万 ≤ M < 500 万	0.9
500 万 ≤ M < 1000 万	0.3
1000 万 ≤ M	每笔 1000 元

投资人重复认购，须按每次认购所对应的费率档次分别计费。

基金认购费用不列入基金财产，主要用于基金的市场推广、销售、登记等募集期间发生的各项费用。

基金管理人及其他基金销售机构可以在不违背法律法规规定及《基金合同》约定的情形下，对基金认购费用实行一定的优惠，费率优惠的相关规则和流程详见基金管理人或其他基金销售机构届时发布的相关公告或通知。

六、认购期利息的处理方式

《基金合同》生效前，投资人的认购款项只能存入专门账户，不得动用。认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有，其中利息转份额以基金登记机构的记录为准。

七、基金认购份额的计算

1、基金认购采用“金额认购、份额确认”的方式。基金的认购金额包括认购费用和净认购金额。认购份额的计算公式为：

$$\text{净认购金额} = \text{认购金额} / (1 + \text{认购费率})$$

$$\text{认购费用} = \text{认购金额} - \text{净认购金额}$$

$$\text{认购份额} = (\text{净认购金额} + \text{认购利息}) / \text{基金份额面值}$$

例：某投资人投资 10 万元认购本基金份额，该笔认购产生利息 50 元，对应认购费率为 1.5%，则其可得到的认购份额为：

$$\text{净认购金额} = 100,000 / (1 + 1.5\%) = 98,522.17 \text{ 元}$$

$$\text{认购费用} = 100,000 - 98,522.17 = 1,477.83 \text{ 元}$$

$$\text{认购份额} = (98,522.17 + 50) / 1.00 = 98,572.17 \text{ 份}$$

2、认购份额的计算中，涉及基金份额的计算结果均保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分舍弃，舍弃部分归入基金财产；涉及金额的计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

3、认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有，其中利息转份额的数量以基金登记机构的记录为准。

八、基金认购金额的限制

本基金销售机构首次认购和追加认购最低金额均为人民币 1,000 元，具体认购金额以各基金销售机构的公告为准。

九、基金份额的认购和持有限额

基金管理人不对募集期间的单个投资人的累计认购金额进行限制。

第七部分 基金合同的生效

一、基金备案的条件

本基金自基金份额发售之日起 3 个月内，在基金募集份额总额不少于 2 亿份，基金募集金额不少于 2 亿元人民币且基金认购人数不少于 200 人的条件下，基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售，并在 10 日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告之日起 10 日内，向中国证监会办理基金备案手续。

基金募集达到基金备案条件的，自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起，《基金合同》生效；否则《基金合同》不生效。基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对《基金合同》生效事宜予以公告。基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。

二、基金合同不能生效时募集资金的处理方式

如果募集期限届满，未满足基金备案条件，基金管理人应当承担下列责任：

- 1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；
- 2、在基金募集期限届满后 30 日内退还投资人已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息。
- 3、如基金募集失败，基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和销售机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。

三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

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

法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

第八部分 基金份额的申购和赎回

一、申购与赎回场所

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。具体的销售机构将由基金管理人在招募说明书或其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并予以公告。基金投资人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。若基金管理人或其指定的销售机构开通电话、传真或网上等交易方式，投资人可以通过上述方式进行申购与赎回。

二、申购与赎回的开放日及时间

1、开放日及开放时间

本基金申购和赎回的开放日为深圳证券交易所、上海证券交易所及本基金投资的主要市场同时交易的交易日，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的规定或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。本基金目前投资的主要市场为香港证券市场。若本基金投资的主要市场发生变更，将在招募说明书（更新）中进行列示。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。基金管理人可与销售机构约定，在开放日的其他时间或非开放日受理或者拒绝投资者的申购、赎回申请，届时以基金管理人或者销售机构的公告为准。如果本基金接受投资者在非开放时间或非开放日提出的申购、赎回申请的，其基金份额申购、赎回价格为下次办理基金份额申购、赎回时间所在开放日的价格。

基金合同生效后，若出现新的证券、期货市场，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》的有关规定在指定媒介上公告。

2、申购、赎回开始日及业务办理时间

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

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

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

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

1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算；

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；

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

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

四、申购与赎回的程序

1、申购和赎回的申请方式

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

2、申购和赎回的款项支付

投资人申购基金份额时，必须在规定的时间内全额交付申购款项，否则所提交的申购申
请不成立。投资人在提交赎回申请时须持有足够的基金份额余额，否则所提交的赎回申请不
成立。投资人交付申购款项，申购成立；登记机构确认基金份额时，申购生效。基金份额持
有人递交赎回申请，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+10 日(包括该日)内支付赎回款项。在发生
巨额赎回或本基金合同载明的其他暂停赎回或延缓支付赎回款的情形时，款项的支付办法参
照本基金合同有关条款处理。如遇基金投资所处的主要市场或外汇市场正常或非正常停市、
外管局相关规定或本基金所投资市场的交易清算规则变更，或证券/期货交易所或交易市场
数据传输延迟、通讯系统故障、银行交换系统故障或其他非基金管理人及基金托管人所能控
制的因素影响了业务流程，则赎回款项划付时间相应顺延。

3、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请
日(T 日)，在正常情况下，本基金登记机构在 T+2 日内对该交易的有效性进行确认。T 日提
交的有效申请，投资人应在 T+3 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申请一定成功，而仅代表销售机构确实
接收到申请。申购、赎回申请的确认以登记机构或基金管理人的确认结果为准。对于申请的
确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利。

五、申购与赎回的数额限制

1、本基金首次申购和追加申购的最低金额均为 1,000 元，基金销售机构另有规定的，以基金销售机构的规定为准。本基金单笔赎回申请不低于 1 份，投资人全额赎回时不受上述限制。各销售机构在符合上述规定的前提下，可根据情况调高单笔最低赎回份额要求，具体以销售机构公布的为准，投资人需遵循销售机构的相关规定；

2、本基金不对投资人每个交易账户的最低基金份额余额进行限制；

3、本基金不对单个投资人累计持有的基金份额上限进行限制；

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

六、申购费用和赎回费用

1、本基金的申购费率最高不高于 1.6%，且随申购金额的增加而递减，如下表所示：

购买金额 (M)	申购费率%
M < 100 万	1.6
100 万 ≤ M < 500 万	1.0
500 万 ≤ M < 1000 万	0.5
1000 万 ≤ M	每笔 1000 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。

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。

2、本基金赎回费率最高不超过 1.5%，随申请份额持有时间增加而递减。具体如下表所示（其中 1 年指 365 天）：

申请份额持有时间 (N)	赎回费率
N < 7 日	1.5%
7 日 ≤ N < 30 日	0.75%
30 日 ≤ N < 1 年	0.5%
1 年 ≤ N < 2 年	0.3%
N ≥ 2 年	0

投资人可将其持有的全部或部分基金份额赎回。赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。对于持有期少于 30 日的基金份额所收取的赎回费，赎回费用全额归入基金财产；对于持有期长于 30 日但少于 3 个月的基金份额

所收取的赎回费，赎回费用 75% 归入基金财产；对于持有期长于 3 个月但小于 6 个月的基金份额所收取的赎回费，赎回费用 50% 归入基金财产；对于持有期长于 6 个月的基金份额所收取的赎回费，赎回费用 25% 归入基金财产。

3、本基金的申购费率、赎回费率和收费方式由基金管理人根据《基金合同》的规定确定。基金管理人可以根据《基金合同》的相关约定调整费率或收费方式，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体公告。

4、基金管理人及其他基金销售机构可以在不违背法律法规规定及《基金合同》约定的情形下，对基金销售费用实行一定的优惠，费率优惠的相关规则和流程详见基金管理人或其他基金销售机构届时发布的相关公告或通知。

七、申购份额与赎回金额的计算

1、基金申购份额的计算

本基金的申购金额包括申购费用和净申购金额。申购份额的计算公式为：

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

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

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

例：某投资人投资 10 万元申购本基金份额，假设申购当日基金份额净值为 1.017 元，对应申购费率为 1.6%，则其可得到的申购份额为：

$$\text{净申购金额} = 100,000 / (1 + 1.6\%) = 98,425.20 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 100,000 - 98,425.20 = 1,574.80 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 98,425.20 / 1.017 = 96,779.94 \text{ 份}$$

2、基金赎回金额的计算

本基金的赎回金额计算公式为：

$$\text{赎回费用} = \text{赎回份额} \times \text{赎回当日基金份额净值} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{赎回金额} = \text{赎回份额} \times \text{赎回当日基金份额净值} - \text{赎回费用}$$

例：某投资人申购本基金份额，持有 3 个月赎回 10 万份，赎回费率为 0.5%，假设赎回当日基金份额净值是 1.017 元，则其可得到的赎回金额为：

$$\text{赎回费用} = 100,000 \times 1.017 \times 0.5\% = 508.5 \text{ 元}$$

$$\text{赎回金额} = 100,000 \times 1.017 - 508.5 = 101,191.5 \text{ 元}$$

3、基金份额净值的计算

T 日的基金份额净值在 T+1 日收市后计算，并在 T+2 日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。本基金份额净值的计算，保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

4、申购份额、余额的处理方式

申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后,以当日基金份额净值为基准计算,上述涉及基金份额的计算结果均保留到小数点后 2 位,小数点后 2 位以后的部分舍弃,舍弃部分归入基金财产;上述涉及金额的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。

5、赎回金额的处理方式

赎回金额为按实际确认的有效赎回份额以当日基金份额净值为基准并扣除相应的费用,计算结果保留到小数点后 2 位,小数点后 2 位以后的部分四舍五入,由此产生的误差计入基金财产。

八、申购和赎回的登记

投资人申购基金成功后,基金登记机构在 T+2 日为投资人登记权益并办理登记手续,投资人自 T+3 日(含该日)后有权赎回该部分基金份额。

投资人赎回基金成功后,基金登记机构在 T+2 日为投资人办理扣除权益的登记手续。

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

九、拒绝或暂停申购的情形及处理方式

发生下列情况时,基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请:

- 1、因不可抗力导致基金无法正常运作。
- 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时,基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。
- 3、本基金投资所处的证券、期货交易所或外汇市场正常或非正常停市,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申购业务。
- 4、因基金收益分配、基金投资组合内某个或某些证券即将上市等原因,使短期内继续接受申购可能会影响或发生损害现有基金份额持有人利益的。
- 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,或其他损害现有基金份额持有人利益的情形。
- 6、基金管理人、基金托管人、基金销售机构或登记机构因技术故障或异常情况导致基金销售系统、基金登记系统、基金会计系统或证券登记结算系统无法正常运行。
- 7、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。
- 8、基金投资的主要市场的证券市场或外汇市场休市时或本基金的资产组合中的重要部分发生暂停交易或其他重大事件,继续接受申购可能会影响或损害其他基金份额持有人利益时。
- 9、基金资产规模达到基金管理人规定的上限(基金管理人可根据中国证监会、外管局

的核准的境外投资额度及市场情况进行调整)；

10、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第 1、2、3、4、5、6、8、9、10 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

十、暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。

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

3、本基金投资所处的证券、期货交易所或外汇市场正常或非正常停市，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、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、遵循基金份额持有人利益优先原则，发生损害持有人利益的情形时，可暂停接受投资人的赎回申请。

7、基金投资的主要市场的证券市场或外汇市场休市时或本基金的资产组合中的重要部分发生暂停交易或其他重大事件，继续接受赎回可能会影响或损害其他基金份额持有人利益时。

8、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述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，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。若出现上述第 4 项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

十一、巨额赎回的情形及处理方式

1、巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过前一

开放日的基金总份额的 10%，即认为是发生了巨额赎回。

2、巨额赎回的处理方式

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

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

(2) 部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的 10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

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

3、巨额赎回的公告

当发生上述延期赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式（包括但不限于短信、电子邮件或由基金销售机构通知等方式）在 3 个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在指定媒介上刊登公告。

十二、其他暂停申购和赎回的情形及处理方式

发生《基金合同》或《招募说明书》中未予载明的事项，但基金管理人认为有正当理由认为需要暂停基金申购、赎回的，可以经届时有效的合法程序宣布暂停接受投资人的申购、赎回申请。

十三、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，基金管理人应及时向中国证监会备案，并在规定期限内指定媒介上刊登暂停公告。

2、基金管理人可以根据暂停申购或赎回的时间，依照《信息披露办法》的有关规定，最迟于重新开放日在指定媒介上刊登重新开放申购或赎回的公告；也可以根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间，届时不再另行发布重新开放的公告。

十四、基金的转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及本基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的其他基金份额之间的转换业务,基金转换可以收取一定的转换费,相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及本基金合同的规定制定并公告,并提前告知基金托管人与相关机构。

十五、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、符合法律法规的其他非交易过户。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。

十六、基金的转托管

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

十七、定投计划

基金管理人可以为投资人办理定投计划,具体规则由基金管理人另行规定。投资人在办理定投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投计划最低申购金额。

十八、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来处理。

十九、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。

二十、其他业务

在相关法律法规允许的条件下，基金登记机构可依据其业务规则，受理基金份额质押等业务，并收取一定的手续费用。

第九部分 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、审计费、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、所投资基金的交易费用和管理费用及在境外市场的开户、交易、清算、登记等各项费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、基金进行外汇兑换交易的相关费用；
- 9、基金依照有关法律法规应当缴纳的，购买或处置证券有关的任何税收、征费、关税、印花税、交易及其他税收及预扣提税；
- 10、与基金缴纳税收有关的手续费、汇款费、顾问费等；
- 11、更换基金管理人，更换基金托管人及基金资产由原基金托管人转移新基金托管人所引起的费用，但因基金管理人或基金托管人自身原因导致被更换的情形除外；
- 12、基金相关账户的开户及维护费用；
- 13、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 1.8% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.8\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.3% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.3\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

本基金的托管费的具体使用由基金托管人支配；如果委托境外资产托管人，其中可以部分作境外资产托管人的费用，具体支付由基金托管人与境外资产托管人在有关协议中进行约定。

上述“一、基金费用的种类”中第 3—13 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

四、费用调整

基金管理人可以根据与基金份额持有人利益一致的原则，结合产品特点和投资人的需求设置基金管理费率的结构和水平。

基金管理人和基金托管人可根据基金规模等因素协商一致，酌情调低基金管理费率、托管费率，无需召开基金份额持有人大会。除根据法律法规要求提高该等报酬标准以外，提高上述费率需经基金份额持有人大会决议通过。基金管理人必须于新的费率实施日前根据《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

五、基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家或投资市场所在国家或地区的税收法律、法规执行。

第十部分 基金的财产

一、基金资产总值

基金资产总值是指购买的各类证券及票据价值、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和。

二、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

三、基金财产的账户

基金托管人根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立资金账户、证券账户、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、境外托管人、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、境外托管人和基金销售机构的财产，并由基金托管人和境外托管人保管。基金管理人、基金托管人、境外托管人、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、境外托管人因依法解散、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。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。现金存入现金账户时构成境外资产托管人的等额债务，除非法律法规及撤销或清盘程序明文规定该等现金不归于清算财产外。

对境外托管人的破产而产生的损失，基金托管人应采取措施进行追偿，基金管理人配合基金托管人进行追偿。基金托管人在已根据《试行办法》的要求谨慎、尽职的原则选择、委任和监督境外托管人，基金托管人对境外托管人破产产生的损失不承担责任。

第十一部分 基金资产估值

一、估值日

本基金的估值日为本基金的开放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、债券、基金、衍生工具和其它投资等持续以公允价值计量的金融资产及负债。

三、估值方法

1、证券交易所上市的有价证券的估值

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

(2) 交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（本合同另有约定的除外），采用估值技术确定公允价值；

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

(4) 交易所上市的资产支持证券，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、配股和公开增发的股票，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或未挂牌转让的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

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

定确定公允价值。

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

4、衍生工具估值方法

(1) 本基金投资境内股指期货合约，按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；

(2) 境外上市流通衍生工具按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。

(3) 未上市衍生工具按成本价估值，如成本价不能反映公允价值，则采用估值技术确定公允价值。

5、存托凭证估值方法

公开挂牌的存托凭证按其所在证券交易所的最近交易日的收盘价估值。

6、基金估值方法

(1) 上市流通的基金份额按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。

(2) 其他基金份额按最近交易日的基金份额净值估值。

7、非流动性资产或暂停交易的证券估值方法

对于未上市流通或流通受限或暂停交易的证券，应参照上述估值原则进行估值。如果上述估值方法不能客观反映公允价值的，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

8、汇率

人民币对主要外汇的汇率应当以估值日中国人民银行或其认可机构公布的人民币汇率中间价为准。涉及其他货币对人民币的汇率，采用估值日国际市场主要信息披露机构提供的其它币种对美元的汇率套算。

9、税收

对于按照中国法律法规和基金投资所在地的法律法规规定应交纳的各项税金，本基金将按权责发生制原则进行估值；对于因税收规定调整或其他原因导致基金实际交纳税金与估算的应交税金有差异的，基金将在相关税金实际支付日进行相应的估值调整。

10、为股票、固定收益证券、外汇等基金资产估值需要，经过基金管理人和基金托管人协商一致，并履行适当程序后，可以利用及依据基金管理人届时确定的一种或多种来源的数据信息。

11、在任何情况下，基金管理人如采用本款第1—10项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本款第1—10项规定的方法对基金资产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，并与基金

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、自律规则另有规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

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

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

四、估值程序

1、基金份额净值是按照每个估值日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到0.001元，小数点后第4位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人应每个估值日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

2、基金管理人应每个估值日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或本基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个估值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3位以内(含第3位)发生估值错误时，视为基金份额净值错误。

本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。

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) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

六、暂停估值的情形

- 1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场或相关交易所、外汇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、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前一日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、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，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

2、由于不可抗力原因，或由于证券交易所、期货交易所、登记结算公司或独立价格服务商等其他中介机构发送的数据错误等，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

第十二部分 基金的收益与分配

一、基金利润的构成

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

二、基金可供分配利润

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

三、基金收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每份基金份额每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人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；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后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；

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

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不利影响的前提下，基金管理人可在按照监管部门要求履行适当程序后对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

四、收益分配方案

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

五、收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，在 2 个工作日内在指定媒介公告并报中国证监会备案。

基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过

15 个工作日。

六、基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额。红利再投资的计算方法，依照登记机构相关业务规则执行。

第十三部分 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，并在法律法规允许的范围内参考国际会计准则；
- 5、本基金独立建账、独立核算；
- 6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；
- 7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

二、基金的年度审计

- 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的具有证券从业资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意。
- 3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所需在2个工作日内在指定媒介公告并报中国证监会备案。

第十四部分 基金的信息披露

一、本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《基金合同》及其他有关规定。相关法律法规关于信息披露的披露方式、披露内容、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法规和中国证监会规定的自然人、法人和其他组织。

本基金信息披露义务人按照法律法规和中国证监会的规定披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的媒介披露，并保证基金投资人能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

三、本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

- 1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；
- 2、对证券投资业绩进行预测；
- 3、违规承诺收益或者承担损失；
- 4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构；
- 5、登载任何自然人、法人或者其他组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；
- 6、中国证监会禁止的其他行为。

四、本基金公开披露的信息应采用中文文本。如同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证两种文本的内容一致。两种文本发生歧义的，以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

五、公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

（一）基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议

1、《基金合同》是界定《基金合同》当事人的各项权利、义务关系，明确基金份额持有人大会召开的规则及具体程序，说明基金产品的特性等涉及基金投资人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人决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。《基金合同》生效后，基金管理人在每6个月结束之日起45日内，更新招募说明书并登载在网站上，将更新后的招募说明书摘要登载在指定媒介上；基金管理人在公告的15日前向主要办公场所所在地的中国证监会派出机构报送更新的招募说明书，并就有关更新内容提供说明。

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

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

（二）基金份额发售公告

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

（三）《基金合同》生效公告

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

（四）基金资产净值、基金份额净值

《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在每个估值日后2个工作日内通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定媒介上。

（五）基金份额申购、赎回价格

基金管理人应当在《基金合同》、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资人能够在基金份额发售网点查阅或者复制前述信息资料。

（六）基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告

基金管理人应当在每年结束之日起90日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定媒介上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。

基金管理人应当在上半年结束之日起60日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度

报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定媒介上。

基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定媒介上。

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

基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。

本基金若投资境内股指期货，应在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告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。

本基金若投资境内资产支持证券，应在基金年报及半年报中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细；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。

（七）临时报告

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 个工作日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地的中国证监会派出机构备案。

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

- 1、基金份额持有人大会的召开；
- 2、终止《基金合同》；
- 3、转换基金运作方式；
- 4、更换基金管理人、基金托管人、境外托管人；
- 5、基金管理人、基金托管人、境外托管人的法定名称、住所发生变更；
- 6、基金管理人股东及其出资比例发生变更；
- 7、基金募集期延长；
- 8、基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动；
- 9、基金管理人的董事在一年内变更超过百分之五十；
- 10、基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过百分之三十；
- 11、涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼或仲裁；
- 12、基金管理人、基金托管人、境外托管人受到监管部门的调查；

13、基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚，基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚；

14、重大关联交易事项；

15、基金收益分配事项；

16、管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；

17、基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；

18、基金改聘会计师事务所；

19、变更基金销售机构；

20、更换基金登记机构；

21、本基金开始办理申购、赎回；

22、本基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；

23、本基金发生巨额赎回并延期办理；

24、本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；

25、本基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；

26、中国证监会规定和基金合同约定的其他事项。

（八）澄清公告

在《基金合同》存续期限内，任何公共媒介中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会。

（九）基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

（十）中国证监会规定的其他信息。

六、信息披露事务管理

基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度，指定专人负责管理信息披露事务。

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

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告和定期更新的招募说明书等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人出具书面文件或者盖章确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定媒介中选择披露信息的媒介。

基金管理人、基金托管人除依法在指定媒介上披露信息外，还可以根据需要在其他公共

媒介披露信息，但是其他公共媒介不得早于指定媒介披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

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

七、信息披露文件的存放与查阅

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

基金定期报告公布后，应当分别置备于基金管理人和基金托管人的住所，以供公众查阅、复制。

第十五部分 基金合同的变更、终止和基金财产的清算

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

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

二、《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，《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。

6、基金管理人与基金托管人协商一致或基金资产清算小组认为有对基金份额持有人更为有利的清算方法，本基金财产的清算可按该方法进行，并及时公告，不需召开基金份额持有人大会。相关法律法规或监管部门另有规定的，按相关法律法规或监管部门的要求办理。

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。

第十六部分 基金托管人

一、基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期：1983年10月31日

注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

法定代表人：田国立

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

托管业务部总经理：李爱华

托管部门信息披露联系人：王永民

客服电话：95566

传真：(010) 66594942

二、基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于1998年，现有员工110余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内，中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。

三、证券投资基金托管情况

截至2014年12月31日，中国银行已托管307只证券投资基金，其中境内基金282只，QDII基金25只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

四、托管业务的内部控制制度

中国银行托管业务部风险管理与控制工作是中国银行全面风险控制工作的组成部分，秉承中国银行风险控制理念，坚持“规范运作、稳健经营”的原则。中国银行托管业务部风险

控制工作贯穿业务各环节，包括风险识别，风险评估，工作程序设计与制度建设，风险检视，工作程序与制度的执行，工作程序与制度执行情况的内部监督、稽核以及风险控制工作的后评价。

2007年起，中国银行连续聘请外部会计师事务所开展托管业务内部控制审阅工作。先后获得基于“SAS70”、“AAF01/06”“ISAE3402”和“SSAE16”等国际主流内控审阅准则的无保留意见的审阅报告。2013年，中国银行同时获得了基于“ISAE3402”和“SSAE16”双准则的内部控制审计报告。中国银行托管业务内控制度完善，内控措施严密，能够有效保证托管资产的安全。

五、托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当立即通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。

第十七部分 境外托管人

名称：[中国银行(香港)有限公司]
 住所：[香港花园道 1 号中银大厦]
 办公地址：[香港花园道 1 号中银大厦]
 法定代表人：[岳毅总裁]
 成立时间：[1964 年 10 月 16 日]
 组织形式：[股份有限公司]
 存续期间：[持续经营]
 联系人：[黄晚仪 副总经理 托管业务主管]
 联系电话：[852-3982-3753]

中国银行(香港)有限公司(“中银香港”)已于 1964 年成立,并在 2001 年 10 月 1 日正式重组为中国银行(香港)有限公司,是一家在香港注册的持牌银行。其控股公司-中银香港(控股)有限公司(“中银香港(控股)”)则于 2001 年 2 日在香港注册成立,并于 2002 年 7 月 25 日开始在香港联合交易所主板上市,2002 年 12 月 2 日被纳入为恒生指数成分股。中银香港目前主要受香港金管局、证监会以及联交所等机构的监管。

截至 2014 年 12 月月底,中银香港(控股)有限公司的总资产超过 21,893 亿港元,资本总额超过 1,815.7 亿港元,总资本比率为 17.51%。中银香港的财务实力及双 A 级信用评级,可以媲美不少大型全球托管银行。中银香港(控股)最新信评如下(截至 2014 年 12 月 31 日):

	穆迪投资 服务	标准普 尔	惠誉国际 评级
评级展望	稳定	稳定	稳定
长期	Aa3	A+	A
短期	P-1	A-1	F1
展望	稳定	稳定	稳定

中银香港作为香港第二大银行集团,亦为三家本地发钞银行之一,拥有最庞大分行网络与广阔的客户基础。

托管服务是中银香港企业银行业务的核心产品之一,目前为超过六十万企业及工商客户提供一站式的证券托管服务。对于服务国内企业及机构性客户(包括各类 QDII 及其各类产品等),亦素有经验,于行业处于领先地位,包括于 2006 年被委任为国内首只银行类 QDII 产

品之境外托管行，于 2007 年被委任为国内首只券商类 QDII 集成计划之境外托管行，另于 2010 年服务市场首宗的跨境 QDII-ETF 等；至于服务境外机构客户方面亦成就显著：

- | | |
|---------------------------|---------------------------|
| 在人民币合格境外机构投资者 (RQFII) 的领域 | =>成为此类人民币产品的最大服务商 |
| 在离岸人民币 CNH 公募基金的领域 | =>成为市场上首家服务商 (2010 年 8 月) |
| | =>目前亦为最大的服务商 |
| 在港上市的交易所买卖基金 (ETF) | =>中资发行商的最大服务商之一 |
| 在离岸私募基金的领域 | =>新募长仓基金的最大服务商之一 |
| 在非上市的股权/债权投资领域 | =>香港少有的服务商之一 |

其业务专长及全方位的配备，令中银香港成为目前本地唯一的中资全面性专业全球托管银行，亦是唯一荣获「亚洲投资人杂志」颁发奖项的中资托管行（2012 年服务提供者奖项「最佳跨境托管亚洲银行奖」）。



在 2013 年 5 月份，中银香港更进一步，荣获「财资杂志」颁发「最佳 QFII 托管行奖」，实在是对中银香港服务能力的最佳说明。



截至 2014 年 12 月 31 日止，中银香港(控股)的托管资产规模超过 7,353.28 亿港元。

第十八部分 相关服务机构

一、销售机构

1、直销机构：

南方基金管理有限公司

住所及办公地址：深圳市福田区福华一路六号免税商务大厦塔楼 31、32、33 层整层

法定代表人：吴万善

电话：（0755）82763905 （0755）82763906

传真：（0755）82763900

联系人：张锐珊

2、代销机构：

（1）销售机构：中国银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：田国立

客服电话：95566

公司网站：www.boc.cn

（2）本基金其他基金销售机构情况详见基金管理人发布的相关公告。

二、登记机构

名称：南方基金管理有限公司

住所及办公地址：深圳市福田区福华一路 6 号免税商务大厦塔楼 31、32、33 层整层

法定代表人：吴万善

电话：（0755）82763849

传真：（0755）82763889

联系人：古和鹏

三、出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

注册地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：俞卫锋

联系人：黎明

电话: (86 21) 3135 8666

传真: (86 21) 3135 8600

经办律师: 黎明、孙睿

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: 上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址: 上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

法定代表人: 杨绍信

联系人: 陈熹

联系电话: 021-23238888

传真: 021-23238800

经办注册会计师: 薛竞、陈熹

第十九部分 基金合同的内容摘要

一、基金管理人、基金托管人和基金份额持有人的权利、义务

(一) 基金管理人的权利与义务

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

- (1) 依法募集资金；
- (2) 自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
- (3) 依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- (4) 销售基金份额；
- (5) 按照规定召集基金份额持有人大会；
- (6) 依据《基金合同》及有关法律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人的利益；
- (7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- (8) 选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；
- (9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务；
- (10) 依据《基金合同》及有关法律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与赎回申请；
- (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及债权人权利，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) 在遵守届时有效的法律法规和监管规定，且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，为支付本基金应付的赎回、交易清算等款项，基金管理人有权代表基金份额持有人在必要限度内以基金资产作为质押进行融资；
- (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、非交易过户和定投等业务规则，在法律法规和本基金合同规定的范围内决定和调整基金的除调高管理费率、托管费率之外的基金相关费率结构和收费方式；
- (17) 委托第三方机构办理本基金的交易、清算、估值、结算等业务并对其委托的第三

方机构承担责任；

(18) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

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

(2) 办理基金备案手续；

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

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

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

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

(7) 依法接受基金托管人的监督；

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

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(10) 编制季度、半年度和年度基金报告；

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

(12) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露，但向监管机构、司法机关、审计、法律等外部专业顾问提供的除外；

(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人提供的各项文件或资料在规定时间内发出，并且保证投资人能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合

理成本的前提下得到有关资料的复印件；

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

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

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

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

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

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

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

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(26) 建立并保存基金份额持有人名册；

(27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(二) 基金托管人的权利与义务

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

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

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

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

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

(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) 选择、更换或撤销境外托管人；

(8) 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》、《托管协议》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；
- (5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
- (6) 按规定开设基金财产的资金账户、证券账户、期货账户等投资所需账户，按照《基金合同》及《托管协议》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》、《托管协议》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露，但向监管机构、司法机关、审计、法律等外部专业顾问提供的除外；
- (8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、赎回价格；
- (9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
- (10) 对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》、《托管协议》的规定进行；如果基金管理人未执行《基金合同》、《托管协议》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、《基金合同》和《托管协议》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业监督管理机构，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) 对基金的境外财产，基金托管人可授权境外托管人代为履行其承担的受托人职责。境外托管人在履行职责过程中，因本身过错、疏忽等原因而导致基金财产受损的，基金托管人应当承担相应责任；

(23) 保护基金份额持有人利益，按照规定对基金日常投资行为和资金汇出入情况实施监督，如发现投资指令或资金汇出入违法、违规，应当及时向中国证监会、外管局报告；

(24) 安全保护基金财产，准时将公司行为信息通知基金管理人，确保基金及时收取应得收入；

(25) 每月结束后 7 个工作日内，向中国证监会和外管局报告基金管理人境外投资情况，并按相关规定进行国际收支申报；

(26) 基金托管人应办理基金管理人就管理本基金的有关结汇、售汇、收汇、付汇和人民币资金结算业务；

(27) 基金托管人应保存基金管理人就管理本基金的资金汇出、汇入、兑换、收汇、付汇、资金往来、委托及成交记录等相关资料，其保存的时间应当不少于 20 年；

(28) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(三) 基金份额持有人的权利与义务

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

同一类别的每份基金份额具有同等的合法权益。

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

(1) 分享基金财产收益；

(2) 参与分配清算后的剩余基金财产；

(3) 依法申请赎回或转让其持有的基金份额；

(4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会；

(5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；

(6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；

(7) 监督基金管理人的投资运作；

(8) 对基金管理人、基金托管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；

(9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

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

二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

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

基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。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，但法律法规、中国证监会另有规定或基金合同另有约定的除外：

- (1) 终止《基金合同》；
- (2) 更换基金管理人；
- (3) 更换基金托管人；
- (4) 转换基金运作方式；
- (5) 提高基金管理人、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；
- (8) 变更基金投资目标、范围或策略；
- (9) 变更基金份额持有人大会程序；
- (10) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- (11) 单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人

大会；

(12) 对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

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

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

(1) 调低基金管理费、基金托管费；

(2) 法律法规要求增加的基金费用的收取和其他应由基金承担的费用；

(3) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内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调整本基金的申购费率、调低赎回费率、变更收费方式，增加、减少或调整基金份额类别设置及对基金份额分类办法、规则进行调整；

(4) 在不违反法律法规、《基金合同》的规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，调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则；

(5) 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，增加、减少或调整基金份额类别设置及对基金份额分类办法、规则进行调整；

(6) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；

(7) 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；

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

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

(二) 会议召集人及召集方式

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

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集；

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

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

出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开，并告知基金管理人，基金管理人应当配合；

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

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

（三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

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

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

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

（四）基金份额持有人出席会议的方式

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

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

基金份额持有人大会议程：

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

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

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以召集人通知的非现场方式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址或系统。通讯开会应以召集人通知的非现场方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

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

(3) 本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）；若本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）基金份额的持有人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见；

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

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

4、在法律法规和监管机关允许的前提下，基金份额持有人授权他人代为出席会议并表决的，授权方式可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式，具体方式在会议通知中列明。

（五）议事内容与程序

1、议事内容及提案权

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

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

2、议事程序

（1）现场开会

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

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

（2）通讯开会

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

（六）表决

基金份额持有人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。转换基金运作方式、与其他基金合并、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

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

在上述规则的前提下，具体规则以召集人发布的基金份额持有人大会通知为准。

（七）计票

1、现场开会

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

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

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

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

2、通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

（八）生效与公告

基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

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

基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决

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

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

三、基金收益分配原则、执行方式

(一) 基金利润的构成

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

(二) 基金可供分配利润

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

(三) 基金收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为 12 次,每份基金份额每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10%,若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配;

2、本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资人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;若投资人不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;

3、基金收益分配后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;

4、每一基金份额享有同等分配权;

5、法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

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不利影响的前提下,基金管理人可在按照监管部门要求履行适当程序后对基金收益分配原则进行调整,不需召开基金份额持有人大会。

(四) 收益分配方案

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

(五) 收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定,并由基金托管人复核,在 2 个工作日内在指定媒介公告并报中国证监会备案。

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

（六）基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额。红利再投资的计算方法，依照登记机构相关业务规则执行。

四、与基金财产管理、运作有关费用的提取、支付方式与比例

（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、审计费、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、所投资基金的交易费用和管理费用及在境外市场的开户、交易、清算、登记等各项费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、基金进行外汇兑换交易的相关费用；
- 9、基金依照有关法律法规应当缴纳的，购买或处置证券有关的任何税收、征费、关税、印花税、交易及其他税收及预扣提税；
- 10、与基金缴纳税收有关的手续费、汇款费、顾问费等；
- 11、更换基金管理人，更换基金托管人及基金资产由原基金托管人转移新基金托管人所引起的费用，但因基金管理人或基金托管人自身原因导致被更换的情形除外；
- 12、基金相关账户的开户及维护费用；
- 13、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1.8%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.8\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付

给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.3% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.3\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

本基金的托管费的具体使用由基金托管人支配；如果委托境外资产托管人，其中可以部分作境外资产托管人的费用，具体支付由基金托管人与境外资产托管人在有关协议中进行约定。

上述“一、基金费用的种类”中第 3—13 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。

五、基金财产的投资方向和投资限制

（一）投资范围

本基金主要投资于全球证券市场中具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会批准上市的股票），股指期货、权证，债券（国债、金融债、企业（公司）债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产以及现金；已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证；银行存款、可转让存单、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；法律法规允许的、已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金（包括ETF）；中国证监会认可的境外交易所上市交易的金融衍生产品及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

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

基金的投资组合比例为：本基金投资组合中股票投资占基金资产的比例为 0-95%，其中投资于本基金定义的香港成长股票的投资比例不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金以后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

（二）投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金投资组合中股票投资占基金资产的比例为 0-95%，其中投资于本基金定义的香港成长股票的投资比例不低于非现金基金资产的 80%。

（2）本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金以后，保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。

（3）本基金投资境内权证应当符合以下规定：

1）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%；

2）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%；

3）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%。

（4）本基金境内投资资产支持证券应当符合以下规定：

1）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%；

2）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

3）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%；

4）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%；

5）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。

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

（6）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%，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。

（7）本基金在境内投资中，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%；在任何交易日日终，持有的买入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；在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；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%；

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。

(8) 本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

(9) 本基金的境内存款银行为具有证券投资基金托管人资格、证券投资基金销售业务资格或合格境外机构投资者托管人资格的境内商业银行，本基金的境外存款银行为中资商业银行在境外设立的分行或在最近一个会计年度达到中国证监会认可的信用评级机构评级的境外银行。本基金存放在具有基金托管资格的同一境内商业银行，中资商业银行在境外设立的分行或在最近一个会计年度达到中国证监会认可的信用评级机构评级的境外银行的存款，不得超过基金资产净值的 20%；存放在境内不具有基金托管资格的同一商业银行的存款，不得超过基金资产净值的 5%；若同时具境内与境外资格，以境内资格为准。存放于基金托管账户的存款可以不受上述限制。

(10) 本基金持有同一机构（政府、国际金融组织除外）发行的证券市值不得超过基金净值的 10%。

(11) 本基金持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不得超过基金资产净值的 10%，其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的 3%。本基金投资于国内依法发行上市的股票、债券等金融工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具不受上述限制。

(12) 本基金不得购买证券用于控制或影响发行该证券的机构或其管理层。本基金管理人管理的全部基金不得持有同一机构 10%以上具有投票权的证券发行总量；同一机构境内外上市的总股本应当合并计算，同时应当一并计算全球存托凭证和美国存托凭证所代表的基础证券，并假设对持有的股本权证行使转换。

(13) 本基金持有非流动性资产市值不得超过基金净值的 10%。前项非流动性资产是指法律或基金合同规定的流通受限证券以及中国证监会认定的其他资产。

(14) 本基金持有境外基金的市值合计不得超过本基金净值的 10%，但持有货币市场基金不受此限制。

(15) 本基金管理人管理的全部基金持有任何一只境外基金，不超过该境外基金总份额的 20%。

(16) 本基金境外投资中，投资衍生品应当仅限于投资组合避险或有效管理，不得用于投机或放大交易，同时应当严格遵守下列规定：

1) 本基金的金融衍生品全部敞口不得高于基金资产净值的 100%。

2) 本基金投资期货支付的初始保证金、投资期权支付或收取的期权费、投资柜台交易衍生品支付的初始费用的总额不得高于基金资产净值的 10%。

3) 本基金投资于远期合约、互换等柜台交易金融衍生品，应当符合以下要求：

① 所有参与交易对手方（中资商业银行除外）应当具有不低于中国证监会认可的信

用评级机构评级；

②交易对手方应当至少每个工作日对交易进行估值，并且本基金可在任何时候以公允价值终止交易；

③任一交易对手方的市值计价敞口不得超过基金资产净值的 20%。

4)本基金不得直接投资与实物商品相关的衍生品。

(17) 本基金境外投资中，可以参与证券借贷交易，并且应当遵守下列规定：

1) 所有参与交易对手方（中资商业银行除外）应当具有中国证监会认可的信用评级机构评级。

2) 应当采取市值计价制度进行调整以确保担保物市值不低于已借出证券市值的 102%。

3) 借方应当在交易期内及时向本基金支付已借出证券产生的所有股息、利息和分红。

一旦借方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留和处置担保物以满足索赔需要。

4) 除中国证监会另有规定外，担保物可以是以下金融工具或品种：

A、 现金；

B、 存款证明；

C、 商业票据；

D、 政府债券；

E、 中资商业银行或由不低于中国证监会认可的信用评级机构评级的境外金融机构（作为交易对手方或其关联方的除外）出具的不可撤销信用证。

5) 本基金有权在任何时候终止证券借贷交易并在正常市场惯例的合理期限内要求归还任一或所有已借出的证券。

6) 基金管理人应当对基金参与证券借贷交易中发生的任何损失负相应责任。

(18) 本基金境外投资中，可以根据正常市场惯例参与正回购交易、逆回购交易，并且应当遵守下列规定：

1) 所有参与正回购交易对手方（中资商业银行除外）应当具有中国证监会认可的信用评级机构信用评级。

2) 参与正回购交易，应当采取市值计价制度对卖出收益进行调整以确保现金不低于已售出证券市值的 102%。一旦买方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留或处置卖出收益以满足索赔需要。

3) 买方应当在正回购交易期内及时向本基金支付售出证券产生的所有股息、利息和分红。

4) 参与逆回购交易，应当对购入证券采取市值计价制度进行调整以确保已购入证券市值不低于支付现金的 102%。一旦卖方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留或处置已购入证券以满足索赔需要。

5) 基金管理人应当对基金参与证券正回购交易、逆回购交易中发生的任何损失负相应

责任。

(19) 基金参与境外证券借贷交易、正回购交易，所有已借出而未归还证券总市值或所有已售出而未回购证券总市值均不得超过基金总资产的 50%。前项比例限制计算，基金因参与证券借贷交易、正回购交易而持有的担保物、现金不得计入基金总资产。

(20) 法律法规和基金合同规定的其他限制。

如果法律法规或监管机构变更或取消上述限制，本基金将相应变更或取消上述规定，不需经基金份额持有人大会审议。

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。若本基金投资超过基金合同约定的投资比例规定的，基金管理人应当在超过比例后 30 个工作日内采用合理的商业措施进行调整以符合基金合同规定的投资比例要求，法律法规或中国证监会另有规定的依其规定执行。

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) 购买不动产；
- (2) 购买房地产抵押按揭；
- (3) 购买贵金属或代表贵金属的凭证；
- (4) 购买实物商品；
- (5) 除应付赎回、交易清算等临时用途以外，借入现金。该临时用途借入现金的比例不得超过本基金资产净值的 10%；
- (6) 利用融资购买证券，但投资金融衍生品除外；
- (7) 参与未持有基础资产的卖空交易；
- (8) 从事证券承销业务；
- (9) 向基金管理人、基金托管人出资；
- (10) 违反规定向他人贷款或提供担保；
- (11) 从事承担无限责任的投资；
- (12) 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；
- (13) 直接投资与实物商品相关的衍生品；
- (14) 中国证监会禁止的其他行为。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先的原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审

议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

除非法律法规和监管部门禁止，本基金可以投资境外资产托管人发行的金融产品。

如法律法规或监管部门取消上述限制，在可适用于本基金的情况下，则本基金投资不再受相关限制。

六、基金资产净值的计算方法和公告方式

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

1、基金份额净值是按照每个估值日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到 0.001 元，小数点后第 4 位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人应每个估值日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

2、基金管理人应每个估值日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或本基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个估值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。

七、基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产的清算方式

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

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

（二）《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，《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。

6、基金管理人应与基金托管人协商一致或基金资产清算小组认为有对基金份额持有人更为有利的清算方法，本基金财产的清算可按该方法进行，并及时公告，不需召开基金份额持有人大会。相关法律法规或监管部门另有规定的，按相关法律法规或监管部门的要求办理。

(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。

八、争议解决方式

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局

的，对当事人均有约束力。除非仲裁裁决另有规定，仲裁费由败诉方承担。

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。

九、基金合同存放地和投资人取得合同的方式

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

第二十部分 基金托管协议的内容摘要

一、基金托管协议当事人

(一) 基金管理人（或简称“管理人”）

名称：南方基金管理有限公司

住所：深圳市福田区中心区福华一路六号免税商务大厦塔楼 31、32、33 层整层

法定代表人：吴万善

成立时间：1998 年 3 月 6 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监基金字[1998]4 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：人民币 3 亿元

经营范围：基金募集；基金销售；资产管理以及中国证监会许可的其他业务

存续期间：持续经营

(二) 基金托管人（或简称“托管人”）

名称：中国银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：田国立

成立时间：1983 年 10 月 31 日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

经营范围：吸收人民币存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；从事同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱服务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代客外汇买卖；外汇信用卡的发行和代理国外信用卡的发行及付款；资信调查、咨询、见证业务；组织或参加银团贷款；国际贵金属买卖；海外分支机构经营与当地法律许可的一切银行业务；在港澳地区的分行依据当地法令可发行或参与代理发行当地货币；经中国人民银行批准的其他业务。

存续期间：持续经营

二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督。主要包括以下方面：

1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。

基金管理人应将拟投资的股票风格库等各投资品种的具体范围提供给基金托管人。基金管理人可以根据实际情况的变化，对各投资品种的具体范围予以更新和调整，并应及时通知基金托管人。基金托管人根据上述投资范围对基金的投资进行监督：

本基金主要投资于全球证券市场中具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会批准依法上市的股票），股指期货、权证，债券（国债、金融债、企业（公司）债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产以及现金；已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证；银行存款、可转让存单、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；法律法规允许的、已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金（包括 ETF）；中国证监会认可的境外交易所上市交易的金融衍生产品及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

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

基金的投资组合比例为：本基金投资组合中股票投资占基金资产的比例为 0-95%，其中投资于本基金定义的香港成长股票的投资比例不低于非现金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金以后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

2、对基金投融资比例进行监督：

(1) 本基金投资组合中股票投资占基金资产的比例为 0-95%，其中投资于本基金定义的香港成长股票的投资比例不低于非现金基金资产的 80%。

(2) 本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金以后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券。

(3) 本基金投资境内权证应当符合以下规定：

1) 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%；

2) 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%;

3) 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%。

(4) 本基金境内投资资产支持证券应当符合以下规定:

1) 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%;

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

3) 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%;

4) 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%;

5) 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。

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

(6) 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%, 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。

(7) 本基金在境内投资中, 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%; 在任何交易日日终, 持有的买入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; 在任何交易日日终, 持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%; 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%; 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。

(8) 本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%;

(9) 本基金的境内存款银行为具有证券投资基金托管人资格、证券投资基金销售业务资格或合格境外机构投资者托管人资格的境内商业银行, 本基金的境外存款银行为中资商业银行在境外设立的分行或在最近一个会计年度达到中国证监会认可的信用评级机构评级的境外银行。本基金存放在具有基金托管资格的同一境内商业银行, 中资商业银行在境外设立的分行或在最近一个会计年度达到中国证监会认可的信用评级机构评级的境外银行的存款, 不得超过基金资产净值的 20%; 存放在境内不具有基金托管资格的同一商业银行的存款, 不得超过基金资产净值的 5%; 若同时具境内与境外资格, 以境内资格为准。存放于基金托管

账户的存款可以不受上述限制。

(10) 本基金持有同一机构（政府、国际金融组织除外）发行的证券市值不得超过基金净值的 10%。

(11) 本基金持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不得超过基金资产净值的 10%，其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的 3%。本基金投资于国内依法发行上市的股票、债券等金融工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具不受上述限制。

(12) 本基金不得购买证券用于控制或影响发行该证券的机构或其管理层。本基金管理人管理的全部基金不得持有同一机构 10%以上具有投票权的证券发行总量；同一机构境内外上市的总股本应当合并计算，同时应当一并计算全球存托凭证和美国存托凭证所代表的基础证券，并假设对持有的股本权证行使转换。

(13) 本基金持有非流动性资产市值不得超过基金净值的 10%。前项非流动性资产是指法律或基金合同规定的流通受限证券以及中国证监会认定的其他资产。

(14) 本基金持有境外基金的市值合计不得超过本基金净值的 10%，但持有货币市场基金不受此限制。

(15) 本基金管理人所管理的全部基金持有任何一只境外基金，不超过该境外基金总份额的 20%。

(16) 本基金境外投资中，投资衍生品应当仅限于投资组合避险或有效管理，不得用于投机或放大交易，同时应当严格遵守下列规定：

1) 本基金的金融衍生品全部敞口不得高于基金资产净值的 100%。

2) 本基金投资期货支付的初始保证金、投资期权支付或收取的期权费、投资柜台交易衍生品支付的初始费用的总额不得高于基金资产净值的 10%。

3) 本基金投资于远期合约、互换等柜台交易金融衍生品，应当符合以下要求：

① 所有参与交易对手方（中资商业银行除外）应当具有不低于中国证监会认可的信用评级机构评级；

② 交易对手方应当至少每个工作日对交易进行估值，并且本基金可在任何时候以公允价值终止交易；

③ 任一交易对手方的市值计价敞口不得超过基金资产净值的 20%。

4) 本基金不得直接投资与实物商品相关的衍生品。

(17) 本基金境外投资中，可以参与证券借贷交易，并且应当遵守下列规定：

1) 所有参与交易对手方（中资商业银行除外）应当具有中国证监会认可的信用评级机构评级。

2) 应当采取市值计价制度进行调整以确保担保物市值不低于已借出证券市值的 102%。

3) 借方应当在交易期内及时向本基金支付已借出证券产生的所有股息、利息和分红。

一旦借方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留和处置担保物以满足索赔需要。

4) 除中国证监会另有规定外，担保物可以是以下金融工具或品种：

A、 现金；

B、 存款证明；

C、 商业票据；

D、 政府债券；

E、 中资商业银行或由不低于中国证监会认可的信用评级机构评级的境外金融机构（作为交易对手方或其关联方的除外）出具的不可撤销信用证。

5) 本基金有权在任何时候终止证券借贷交易并在正常市场惯例的合理期限内要求归还任一或所有已借出的证券。

6) 基金管理人应当对基金参与证券借贷交易中发生的任何损失负相应责任。

(18) 本基金境外投资中，可以根据正常市场惯例参与正回购交易、逆回购交易，并且应当遵守下列规定：

1) 所有参与正回购交易对手方（中资商业银行除外）应当具有中国证监会认可的信用评级机构信用评级。

2) 参与正回购交易，应当采取市值计价制度对卖出收益进行调整以确保现金不低于已售出证券市值的 102%。一旦买方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留或处置卖出收益以满足索赔需要。

3) 买方应当在正回购交易期内及时向本基金支付售出证券产生的所有股息、利息和分红。

4) 参与逆回购交易，应当对购入证券采取市值计价制度进行调整以确保已购入证券市值不低于支付现金的 102%。一旦卖方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留或处置已购入证券以满足索赔需要。

5) 基金管理人应当对基金参与证券正回购交易、逆回购交易中发生的任何损失负相应责任。

(19) 基金参与境外证券借贷交易、正回购交易，所有已借出而未归还证券总市值或所有已售出而未回购证券总市值均不得超过基金总资产的 50%。前项比例限制计算，基金因参与证券借贷交易、正回购交易而持有的担保物、现金不得计入基金总资产。

(20) 法律法规和基金合同规定的其他限制。

如果法律法规或监管机构变更或取消上述限制，本基金将相应变更或取消上述规定，不需经基金份额持有人大会审议。

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。若本基金投资超过基金合同约定的投资比例规定的，基金管理人应当在超过比例后 30 个工作日内采

用合理的商业措施进行调整以符合基金合同规定的投资比例要求，法律法规或中国证监会另有规定的依其规定执行。

（二）基金托管人应根据有关法律法规的规定、基金合同的约定及本协议的约定，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、相关信息披露等进行复核。

（三）基金托管人在上述第（一）、（二）款的监督和核查中发现基金管理人违反法律法规的规定及本协议的约定，应及时提示基金管理人限期纠正，基金管理人收到提示后应及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函并改正。在限期内，基金托管人有权随时对提示事项进行复查。基金管理人对基金托管人提示的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应及时向中国证监会报告。

（四）基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律法规或本协议的规定，应当拒绝执行，及时提示基金管理人，并依照法律法规的规定及时向中国证监会报告。基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律法规或本协议规定的，应当及时提示基金管理人，并依照法律法规的规定及时向中国证监会报告。

（五）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。

三、基金管理人 对基金托管人的业务核查

（一）在本协议的有效期内，在不违反公平、合理原则以及不妨碍基金托管人遵守相关法律法规及其行业监管要求的基础上，基金管理人有权对基金托管人履行本协议的情况进行必要的核查，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、复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

（二）基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、无正当理由未执行或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法律法规及本协议有关规定时，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正，基金托管人收到通知后应及时核对并及时回复基金管理人。在限期内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应依照法律法规的规定报告中国证监会。

（三）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。

四、基金财产的保管

（一）基金财产保管的原则

- 1、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人、境外托管人的固有财产。
- 2、基金托管人应安全保管基金财产，未经基金管理人的合法合规指令或法律法规、《基金合同》及本协议另有规定，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和证券账户等投资所需账户。
- 4、基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，独立核算，分账管理，确保基金财产的完整与独立。
- 5、基金托管人可将基金财产安全保管和办理与基金财产过户有关的手续等职责委托给境外托管人履行。
- 6、除依据有关法律法规规定和基金合同、本协议约定外，基金托管人、及其境外托管人不得利用基金财产为自己或第三方谋取利益。
- 7、基金托管人应当确保境外托管人不得自行运用、处分、分配托管证券；
- 8、现金账户中的现金由基金托管人或其境外托管人以银行身份持有。
- 9、托管人或其境外托管人按照有关市场的适用法律、法规和市场惯例，支付现金、办理证券登记等托管业务。

（二）基金合同生效前募集资金的验资和入账

- 1、基金募集期满或基金管理人宣布停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定的，由基金管理人在法定期限内聘请具有从事相关业务资格的会计师事务所对基金进行验资，并出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的 2 名以上（含 2 名）中国注册会计师签字方为有效。
- 2、基金管理人应将属于本基金财产的全部资金划入在基金托管人处为本基金开立的基金银行账户中，并确保划入的资金与验资确认金额相一致。

（三）基金的银行账户的开设和管理

- 1、基金托管人应负责本基金的银行账户的开设和管理。
- 2、基金托管人以本基金的名义开设本基金的银行账户。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。本基金的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益、收取申购款，均需通过本基金的银行账户进行。
- 3、本基金银行账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立其他任何银行账户；亦不得使用本基金的银行账户进行本基金业务以外的活动。
- 4、基金银行账户的管理应符合账户所在国家或地区有关法律法规的有关规定。

（四）基金进行境内定期存款投资的账户开设和管理

基金管理人以基金名义在基金托管人认可的存款银行的指定营业网点开立存款账户，基

金托管人负责该账户的日常管理以及银行预留印鉴的保管和使用。在上述账户开立和账户相关信息变更过程中，基金管理人应提前向基金托管人提供开户或账户变更所需的相关资料。

（五）基金证券账户、结算备付金账户及其他投资账户的开设和管理

1、基金托管人或境外托管人在基金所投资市场的交易所或登记结算机构处按照该交易所或登记结算机构的业务规则开立证券账户，基金管理人应提供必要的协助。

2、本基金证券账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人以及各自委托代理人不得出借或转让本基金的证券账户，亦不得使用本基金的证券账户进行本基金业务以外的活动。

3、基金托管人以自身法人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，用于办理基金托管人所托管的包括本基金在内的全部基金在境内证券交易所进行证券投资所涉及的资金结算业务。结算备付金的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

4、在本托管协议生效日之后，本基金被允许从事其他投资品种的投资业务的，涉及相关账户的开设、使用的，若无相关规定，则基金托管人应当比照并遵守上述关于账户开设、使用的规定。

5、因业务发展需要而开立的其他账户，可以根据投资市场所在国家或地区法律法规和基金合同的规定，由基金托管人或境外托管人负责开立，基金管理人应提供必要的协助。新账户按有关规则使用并管理。

6、相关账户的开立和管理应符合账户所在国家或地区有关法律法规的规定。

（六）债券托管专户的开设和管理

基金合同生效后，基金管理人负责以基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表基金进行交易；基金托管人负责以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司与银行间市场清算所股份有限公司开设银行间债券市场债券托管账户，并代表基金进行银行间债券市场债券和资金的清算。在上述手续办理完毕之后，由基金托管人负责向中国人民银行报备。

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。

（七）基金财产投资的有关有价凭证的保管

基金财产投资的有关实物证券由基金托管人存放于基金托管人及其境外托管人的保管库。实物证券的购买和转让，由基金托管人及其境外托管人根据基金管理人的指令办理。属于基金托管人及其境外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。基金托管人对基金托管人及其境外托管人以外机构实际有效控制的证券不承担保管责任。

（八）与基金财产有关的重大合同及有关凭证的保管

基金托管人按照法律法规保管由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同及

有关凭证。基金管理人代表基金签署有关重大合同后应在收到合同正本后 30 日内将一份正本的原件提交给基金托管人。除本协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时应当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。重大合同由基金管理人与基金托管人按规定各自保管至少 15 年。

五、基金资产净值计算和会计核算

（一）基金资产净值的计算和复核

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

2、基金管理人应于每个估值日对基金财产估值，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。估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算业务指引》及其他法律法规的规定。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，基金托管人复核。基金管理人应于每个估值日结束后计算得出前一日的该基金份额净值，并在盖章后以双方约定的方式发送给基金托管人。基金托管人应对净值计算结果进行复核，并以双方约定的方式将复核结果传送给基金管理人，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

3、当相关法律法规或《基金合同》规定的估值方法不能客观反映基金财产公允价值时，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

4、基金管理人、基金托管人发现基金估值违反《基金合同》订明的估值方法、程序以及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，双方应及时进行协商和纠正。

5、当基金资产的估值导致基金份额净值小数点后三位内发生差错时，视为基金份额净值估值错误。当基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当估值错误达到基金份额净值的 0.25% 时，基金管理人应当报中国证监会备案；当估值错误达到基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应当在报中国证监会备案的同时并及时进行公告。如法律法规或监管机关对前述内容另有规定的，按其规定处理。

6、由于基金管理人对外公布的任何基金净值数据错误，导致该基金财产或基金份额持有人的实际损失，基金管理人应对此承担责任。若基金托管人计算的净值数据正确，则基金托管人对该损失不承担责任；若基金托管人计算的净值数据也不正确，则基金托管人也应承担部分未正确履行复核义务的责任。如果上述错误造成了基金财产或基金份额持有人的不当得利，且基金管理人及基金托管人已各自承担了赔偿责任，则基金管理人应负责向不当得利之主体主张返还不当得利。如果返还金额不足以弥补基金管理人和基金托管人已承担的赔偿金额，则双方按照各自赔偿金额的比例对返还金额进行分配。

7、由于证券交易所及其登记结算公司发送的数据错误，或由于其他不可抗力原因，基

金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

8、如果基金托管人的复核结果与基金管理人的计算结果存在差异，且双方经协商未能达成一致，基金管理人可以按照其对基金份额净值的计算结果对外予以公布，基金托管人可以将相关情况报中国证监会备案。

（二）基金会计核算

1、基金账册的建立

基金管理人和基金托管人在《基金合同》生效后，应按照双方约定的同一记账方法和会计处理原则，分别独立地设置、登记和保管基金的全套账册，对双方各自的账册定期进行核对，互相监督，以保证基金财产的安全。若双方对会计处理方法存在分歧，应以基金管理人的处理方法为准。

2、会计数据和财务指标的核对

基金管理人和基金托管人应定期就会计数据和财务指标进行核对。如发现存在不符，双方应及时查明原因并纠正。

3、基金财务报表和定期报告的编制和复核

基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。月度报表的编制，应于每月终了后 5 个工作日内完成；招募说明书在《基金合同》生效后每六个月更新并公告一次，于该等期间届满后 45 日内公告。季度报告应在每个季度结束之日起 10 个工作日内编制完毕并于每个季度结束之日起 15 个工作日内予以公告；半年度报告在会计年度半年终了后 40 日内编制完毕并于会计年度半年终了后 60 日内予以公告；年度报告在会计年度结束后 60 日内编制完毕并于会计年度终了后 90 日内予以公告。基金合同生效不足两个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。

基金管理人在月度报表完成当日，将报表盖章后提供给基金托管人复核；基金托管人在收到后应 3 个工作日内进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在季度报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后 5 个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在半年度报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后 10 个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在年度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人应在收到后 15 个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人和基金托管人之间的上述文件往来均以加密传真的方式或双方商定的其他方式进行。

基金托管人在复核过程中，发现双方的报表存在不符时，基金管理人和基金托管人应共同查明原因，进行调整，调整以双方认可的账务处理方式为准；若双方无法达成一致以基金管理人的账务处理为准。核对无误后，基金托管人在基金管理人提供的报告上加盖托管业务

部门公章或者出具加盖托管业务部门公章的复核意见书，双方各自留存一份。如果基金管理人与基金托管人不能于应当发布公告之日之前就相关报表达成一致，基金管理人有权按照其编制的报表对外发布公告，基金托管人有权就相关情况报证监会备案。

六、基金份额持有人名册的保管

（一）基金份额持有人名册的内容

基金份额持有人名册的内容包括但不限于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包括以下几类：

- 1、基金募集期结束时的基金份额持有人名册；
- 2、基金权益登记日的基金份额持有人名册；
- 3、基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册；
- 4、每半年度最后一个交易日的基金份额持有人名册。

（二）基金份额持有人名册的提供

对于每半年度最后一个交易日的基金份额持有人名册，基金管理人应在每半年度结束后5个工作日内定期向基金托管人提供。对于基金募集期结束时的基金份额持有人名册、基金权益登记日的基金份额持有人名册以及基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册，基金管理人应在相关的名册生成后5个工作日内向基金托管人提供。

（三）基金份额持有人名册的保管

基金托管人应妥善保管基金份额持有人名册。如基金托管人无法妥善保存持有人名册，基金管理人应及时向中国证监会报告，并代为履行保管基金份额持有人名册的职责。基金托管人应对基金管理人由此产生的保管费给予补偿。

七、适用法律与争议解决方式

（一）本协议适用中华人民共和国法律并从其解释。

（二）基金管理人与基金托管人之间因本协议产生的或与本协议有关的争议可通过友好协商解决。任何一方有权将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会，并按其时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。

（三）除争议所涉的内容之外，本协议的当事人仍应履行本协议的其他规定。

八、托管协议的变更、终止与基金财产的清算

（一）托管协议的变更

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行变更。变更后的新协议，其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突。变更后的新协议应当报中国证监会备案。

（二）托管协议的终止

发生以下情况，本托管协议应当终止：

- 1、《基金合同》终止；
- 2、本基金更换基金托管人；
- 3、本基金更换基金管理人；
- 4、发生《基金法》、《运作办法》或其他法律法规规定的终止事项。

（三）基金财产的清算

基金管理人和基金托管人应按照《基金合同》及有关法律法规的规定对本基金的财产进行清算。

第二十一部分 基金份额持有人服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务，以下是主要的服务内容，基金管理人根据基金份额持有人的需要和市场的变化，有权增加和修改相关服务项目。如因系统、第三方或不可抗力等原因，导致下述服务无法提供，基金管理人不承担相关责任。

一、基金份额持有人交易资料的寄送及发送服务

1、交易确认单

每次交易结束后，投资人可在 T+3 个工作日后通过销售机构的网点查询或打印交易确认单。

2、纸质对账单

每季度结束后 15 个工作日内，基金管理人向本季度有交易且有定制的投资人寄送对账单，资料（含姓名及地址等）不详的除外。投资人可通过基金管理人网站（www.nffund.com）、客服热线（400-889-8899 转人工）、客服邮箱（service@nffund.com 或 service@southernfund.com）及在线客服等途径申请/取消对账单服务。

3、电子对账单

基金管理人提供月度、季度、年度电子邮件对账单及月度、季度手机短信对账单服务，基金管理人将以电子邮件或手机短信形式向定制的投资人定期发送。投资人可通过基金管理人网站（www.nffund.com）、客服热线（400-889-8899 转人工）、客服邮箱（service@nffund.com 或 service@southernfund.com）及在线客服等途径申请/取消对账单服务。

二、网上在线服务

（一）通过基金管理人网站（www.nffund.com），投资人可获得如下服务：

1、查询服务

投资人通过基金账户号、身份证号等开户证件号码和查询密码登录基金管理人网站“账户查询”栏目，可享有基金交易查询、账户查询和基金信息查询服务。

2、信息资讯服务

投资人可以利用基金管理人网站获取本基金和基金管理人的各类信息，包括基金的法律文件、基金公告、业绩报告和基金管理人最新动态等各类最新资料。

3、网上交易服务

投资人可通过基金管理人网站“网上交易”系统办理本基金的开户、认购/申购、定投、赎回及信息查询等业务。有关基金管理人电子直销具体业务规则请参见基金管理人网站相关公告和业务规则。

4、自助答疑服务

投资人可通过基金管理人网站“在线客服”，根据提示操作输入要咨询问题的关键词，便可自助进行相关问题的搜索及解答。

5、网上人工服务

投资人可登录基金管理人网站通过“在线客服”获得投资顾问、服务定制/取消、账户查询等专项服务。

6、专用客户端下载

投资人可通过基金管理人网站下载专用客户端，如PC版、iPhone版、iPad版和Android版等，通过专用客户端获得基金净值查询、账户查询、理财资讯及相关客户服务。基金管理人电子直销投资人还可通过专用客户端进行基金交易。

(二) 投资人通过手机上网，访问<https://wap.southernfund.com>可获得基金管理人最新的理财资讯，办理各项基金查询和基金交易业务。手机WAP交易具体规则请参见基金管理人网站相关公告和业务规则。

(三) 投资人通过微信添加基金管理人（可搜索公众号“南方基金”或微信号“NF4008898899”）为朋友，可查阅基金净值、基金动态及活动、服务资讯等。如绑定个人账户，还可享有基金交易（仅限基金管理人电子直销投资人）、账户查询、基金交易查询、持有理财基金到期日查询等服务。

三、信息定制服务

投资人可以通过基金管理人网站（www.nffund.com）、客户服务中心提交信息定制申请，基金管理人通过电子邮件或手机短信定期发送所定制的信息。

- 1、电子邮件：基金份额净值、电子邮件对账单、各类电邮资讯等。
- 2、手机短信：基金份额净值、手机短信对账单、各类短/彩信资讯等。

四、账户资料变更服务

为便于投资人及时得到基金管理人提供的各项服务，请投资人及时更新服务联系信息。投资人可通过以下4种方式进行服务联系信息（包括联系地址、手机号码、固定电话、电子邮箱等）的变更。基金管理人电子直销投资人交易联系信息的变更，请遵照基金管理人电子直销相关规定办理：

- 1、登录基金管理人网站“账户查询”或“网上交易”（仅限基金管理人电子直销投资人）系统自助修改联系信息。
- 2、致电基金管理人客户服务中心400-889-8899转人工修改。
- 3、发送邮件至基金管理人客服邮箱service@nffund.com或service@southernfund.com提交修改申请。

4、通过基金管理人网站“在线客服”在线提交修改申请。

五、客户服务中心电话服务

投资人拨打基金管理人客服热线400-889-8899（国内免长途话费）可享有如下服务：

1、自助语音服务：提供7×24小时基金净值信息、账户交易情况、基金产品等自助查询服务。

2、人工服务：提供每周七天，每日不少于8小时的人工服务（法定节假日除外）。投资人可以通过该热线获得投资顾问、业务咨询、信息查询、服务投诉及建议、信息定制、资料修改等专项服务。

3、电话交易服务：基金管理人电子直销投资人可通过基金管理人的电话交易系统办理开放式基金的认购、申购、交易撤单、交易密码修改、信息查询和投资人该直销账户下开放式基金的赎回、转换及分红方式变更等业务。有关基金电话交易的具体业务规则请参见基金管理人网站相关公告和业务规则。

六、客户投诉及建议受理服务

投资人可以通过基金管理人客户服务中心人工热线、在线客服、书信、电子邮件、短信、传真及各销售机构网点柜台等不同的渠道对基金管理人和销售网点所提供的服务进行投诉或提出建议。

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

第二十二部分 其他应披露事项

本基金暂无其他应披露事项。基金合同如有未尽事宜，由基金合同当事人各方按有关法律法规和规定协商解决。

第二十三部分 招募说明书存放及其查阅方式

本招募说明书存放在本基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所，投资人可在办公时间免费查阅；也可按工本费购买本招募说明书复制件或复印件，但应以招募说明书正本为准。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

第二十四部分 备查文件

- 1、中国证监会准予本基金募集注册的文件
- 2、《南方香港成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《南方香港成长灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 4、《南方基金管理有限公司开放式基金业务规则》
- 5、法律意见书
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照
- 8、中国证监会要求的其他文件

（本页仅供《南方香港成长灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》使用）

签订地： 市

签订日： 年 月 日