

---

**东兴量化多策略灵活配置混合型  
证券投资基金招募说明书(更新)  
(2019年第1号)**

**基金管理人：东兴证券股份有限公司**

**基金托管人：中国工商银行股份有限公司**

**二零一九年四月**

## 重要提示

东兴量化多策略灵活配置混合型证券投资基金（简称“本基金”）于2016年8月2日经中国证券监督管理委员会证监许可【2016】1744号文注册募集。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。投资者认购（或申购）本基金时应认真阅读本招募说明书。

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，本基金在投资运作过程中可能面临各种风险，包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资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等。

本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中高风险水平的投资品种。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板和其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、地方政府债、企业债券、公司债券、短期融资券、超短期融资券、中期票据、次级债、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换公司债等）、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、权证、资产支持证券、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）。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。

投资有风险，投资者在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同，全面认识本基金产品的风险收益特征，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资者的风险承受能力相适应。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。

基金管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。

本招募说明书已经本基金托管人复核，基金管理人股权结构数据截止日为 2018 年 12 月 31 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2019 年 3 月 31 日，本招募说明书其他所载内容截止日为 2019 年 4 月 27 日。

## 目录

一、绪言 .....	1
二、释义 .....	2
三、基金管理人 .....	7
四、基金托管人 .....	18
五、相关服务机构 .....	25
六、基金的募集 .....	31
七、基金份额的申购、赎回与转换 .....	32
八、基金的投资 .....	42
九、基金的业绩 .....	53
十、基金的财产 .....	54
十一、基金资产的估值 .....	55
十二、基金的收益与分配 .....	60
十三、基金的费用与税收 .....	62
十四、基金的会计和审计 .....	64
十五、基金的信息披露 .....	65
十六、风险揭示 .....	71
十七、基金合同的变更、终止与基金财产的清算 .....	75
十八、基金合同的内容摘要 .....	77
十九、基金托管协议的内容摘要 .....	105
二十、对基金份额持有人的服务 .....	124
二十一、其他应披露事项 .....	125
二十二、招募说明书存放及查阅方式 .....	126
二十三、备查文件 .....	127

## 一、绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性管理规定》”）、《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》”）和其他有关法律法规的规定，以及《东兴量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

本招募说明书阐述了东兴量化多策略灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“基金”或“本基金”）的投资目标、策略、风险、费率等与投资者投资决策有关的全部必要事项，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

本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，并经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）注册。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资者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。基金投资者欲了解本基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

## 二、释义

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：

基金或本基金：	指东兴量化多策略灵活配置混合型证券投资基金；
基金管理人：	指东兴证券股份有限公司；
基金托管人：	指中国工商银行股份有限公司；
基金合同或本基金合同：	指《东兴量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充；
托管协议：	指基金管理人与基金托管人就本基金签订的《东兴量化多策略灵活配置混合型证券投资基金托管协议》及其任何有效修订和补充；
招募说明书：	指《东兴量化多策略灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》及其定期更新；
基金份额发售公告：	指《东兴量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金份额发售公告》
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
《基金法》：	指 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，并自 2013 年 6 月 1 日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
《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
《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
《流动性管理规定》：	指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10 月 1

	日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订
《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
中国证监会：	指中国证券监督管理委员会
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
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
个人投资者：	指依据有关法律法规规定可以投资于证券投资基金的自然人
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；
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》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；
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；
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
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
基金份额持有人大会：	指按照本基金合同第十一部分之规定召集、召开并由基金份额持有人或其合法的代理人进行表决的会议；

基金销售业务：	指基金管理人或销售机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务
销售机构：	指东兴证券股份有限公司以及符合《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
登记业务：	指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资者基金账户的建立和管理、基金份额登记、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
登记机构：	指办理登记业务的机构。基金的登记机构为东兴证券股份有限公司或接受东兴证券股份有限公司委托代为办理登记业务的机构
基金账户：	指登记机构为投资者开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户
基金交易账户：	指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构办理认购、申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务导致的基金份额变动及结余情况的账户
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
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
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
存续期：	指基金合同生效至终止之间的不定期期限



工作日：	指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日
T 日：	指销售机构在规定时间受理投资者申购、赎回或其他业务申请的开放日
T+n 日	指自 T 日起第 n 个工作日(不包含 T 日)
开放日：	指为投资者办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日；
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
《业务细则》	指《东兴证券股份有限公司开放式证券投资基金业务规则》，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
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
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
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
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
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
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受理基金申购申请的一种投资方式；
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%
元:	指人民币元
基金收益:	指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、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
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;
基金资产净值:	指基金资产总值减去基金负债后的价值;
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;
基金资产估值:	指计算评估基金资产和负债的价值,以确定基金资产净值和基金份额净值的过程;
流动性受限资产:	指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产,包括但不限于到期日在10个交易日以上的逆回购与银行定期存款(含协议约定有条件提前支取的银行存款)、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等
摆动定价机制:	指当开放式基金遭遇大额申购赎回时,通过调整基金份额净值的方式,将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者,从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响,确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待
指定媒介:	指中国证监会指定的用以进行信息披露的媒介、互联网网站及其他媒介;
不可抗力:	指本基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件;

### 三、基金管理人

#### （一）基金管理人概况

名称：东兴证券股份有限公司

成立日期：2008 年 5 月 28 日

注册地址：北京市西城区金融大街 5 号（新盛大厦）12、15 层

办公地址：北京市西城区金融大街 5 号（新盛大厦）6、10、12、15、16 层

法定代表人：魏庆华

组织形式：股份有限公司

联系人：陈智勇

联系电话：010-57307309

传真：010-57307388

注册资本：275796.0657 万元人民币

股权结构：（截止 2018 年 12 月末）

序号	股东名称	持股数量（股）	持股比例（%）
1	中国东方资产管理股份有限公司	1,454,600,484	52.74
2	山东高速股份有限公司	119,989,367	4.35
3	中国证券金融股份有限公司	82,463,160	2.99
4	福建天宝矿业集团股份有限公司	61,530,568	2.23
5	上海工业投资（集团）有限公司	55,159,200	2.00

#### （二）主要人员情况

##### 1、董事会成员

魏庆华先生，1964 年 10 月出生，博士研究生学历，高级经济师，中国国籍，无境外永久居留权。曾就职于福建清流县外贸局；曾任清流县人民银行股长、副行长；三明市人民银行办公室副主任（主持工作）；闽发证券三明支公司总经理、闽发证券副总裁、总裁，东兴证券副总经理，总经理、财务负责人，东兴期货董事长，东兴资本董事长，东兴投资董事长。现任东兴证券董事长。

张涛先生，1972年8月出生，博士研究生学历，正高级经济师，中国国籍，无境外永久居留权。曾任华泰证券总裁办公室总裁秘书、投资银行一部业务经理、福州办事处副主任、上海总部投资银行业务部副总经理（主持）、深圳总部副总经理（主持）兼深圳彩田路营业部总经理、董事会秘书兼总裁助理、董事会办公室主任、副总裁，华泰期货有限公司董事长，钟山有限公司董事、副总裁，钟山金融控股有限公司董事长。现任东兴证券董事、总经理、财务负责人，东兴投资董事长。

谭世豪先生，1964年1月出生，硕士研究生，高级经济师，中国国籍，无境外永久居留权。曾任中国银行国际业务部科员、主任科员、副处长、处长；中国东方股权及投行部经理、助理总经理，资产经营部助理总经理、副总经理；深圳外贸集团董事长，监事长；邦信资产管理有限公司副总经理兼深圳分公司副总经理；中国东方人力资源部副总经理；东兴证券副董事长。现任东兴证券董事、副总经理，东兴香港董事会主席。

江月明先生，1971年8月出生，硕士研究生学历，持有中国律师执业资格证书，中国国籍，无境外永久居留权。2001年7月至2016年8月历任中国东方经营处置审查办公室职员、高级主任，总裁办公室经理、高级经理、助理总经理，风险管理部助理总经理、副总经理，董事会办公室（引战上市办公室）副总经理（主持工作）；现任中国东方董事会办公室（上市办公室）总经理，兼任东富（天津）股权投资基金管理有限公司董事、东方邦信创业投资有限公司董事。2017年3月至今任东兴证券董事。

曾涛先生，1972年12月出生。大学本科学历。曾就职于中国银行股份有限公司海南省分行，中国东方资产管理股份有限公司海口办事处。曾任中国东方资产管理股份有限公司人力资源部高级经理、总经理助理、副总经理，机构管理部副总经理主持工作，中华联合保险集团股份有限公司副总经理、合规负责人、纪委书记。2017年6月至今任中国东方办公室总经理，兼任大连银行股份有限公司董事。2019年3月起任东兴证券董事。

董裕平先生，1969年10月出生，博士研究生学历，研究员（中国社科院）、博士生导师、博士后合作导师，哈佛大学经济系访问学者。曾任国家开发银行行政策研究室科级行员、经济师，稽核评价局稽核一处副处长、综合处副处长、正处

级行员、高级经济师；中国社会科学院金融研究所副研究员、研究员、公司金融研究室主任、法与金融研究室主任、所纪委委员、所长助理，兼任中国社会科学院投融资研究中心主任；中国东方战略发展规划部副总经理。2018年11月至今任中国东方战略发展规划部（研究院）副总经理（主持工作），2018年12月至今兼任东方邦信融通控股股份有限公司董事。2019年3月起任东兴证券董事。

屠旋旋先生，1973年8月出生，大学本科，经济师，中国国籍，无境外永久居留权。曾就职于中国银行上海市分行、东方资产上海办事处，上海大盛资产管理有限公司；曾任上海国盛（集团）有限公司资产管理中心副主任、上海国盛集团资产管理有限公司经营部总经理、总裁助理；现任上海国盛集团资产管理有限公司副总裁，上海正浩资产管理有限公司董事长，上海经济年鉴社总经理。2007年8月至今任东兴证券董事。

王云泉先生，1969年3月出生，硕士研究生，高级经济师、会计师，中国国籍，无境外永久居留权。曾就职于山东省交通厅人事处、山东省交通开发投资公司办公室、山东基建股份有限公司。历任山东高速股份有限公司总经理助理、副总经理、董事会秘书、总法律顾问、董事。2013年9月至今，兼任山东高速投资发展有限公司董事长；2017年12月至今，兼任山东高速（深圳）投资有限公司董事长（法定代表人）。现任山东高速投资控股有限公司总经理，2018年6月至今任东兴证券董事。

郑振龙先生，1966年3月出生，博士研究生，厦门大学管理学院教授，中国国籍，无境外永久居留权。曾任厦门大学研究生院副院长、经济学院副院长、金融系副主任（主持工作）。现任厦门大学闽江学者特聘教授、国务院学位委员会学科评议组成员，享受国务院政府特殊津贴，兼任华福证券独立董事，厦门国际银行股份有限公司独立董事、福建华通银行独立董事。2017年3月至今任东兴证券独立董事。

张伟先生，1977年4月出生，博士研究生，具有FRM（金融风险管理师）资格，中国国籍，无境外永久居留权。2001年8月至2012年2月，历任中国人民银行研究生部教研部研究实习员、副主任兼助理研究员；中国人民银行研究生部行政部副主任兼副研究员。2012年3月至今任清华大学五道口金融学院校友办主任兼副研究员。主要从事宏观经济、货币政策、汇率体制、股票投资、外汇

投资、金融稳定机制、金融危机预警机制等方面研究。2017年3月起任东兴证券独立董事。

宫肃康先生，1965年3月出生，硕士研究生学历，注册会计师，中国国籍，无境外永久居留权。曾任中央财政金融学院税务系教师、北京市新技术产业开发试验区财政审计所专管员、宁波创源文化发展股份有限公司独立董事。现任北京天平会计师事务所有限责任公司执行董事总经理、北京天平健税务师事务所执行董事总经理。2017年12月至今任东兴证券独立董事。

孙广亮先生，1963年7月出生，硕士研究生学历，律师，中国国籍，无境外永久居留权。曾任中国法律事务中心律师、众鑫律师事务所律师，现任北京市华堂律师事务所合伙人律师、主任，大商股份有限公司独立董事、大恒新纪元科技股份有限公司独立董事。2017年12月至今任东兴证券独立董事。

## 2、监事会成员

秦斌先生，1968年4月出生，博士研究生学历，中国国籍，无境外永久居留权。曾任江苏广播电视大学团总支副书记；中国银行总行海外行管理部科员、主任科员；中国东方股权部业务三部助理经理、股权及投行业务部副总经理、市场开发部业务发展部副总经理、总裁办公室综合信息处副经理（主持工作）、总裁办公室助理总经理、党委办公室和总裁办公室副主任、副总经理、党委办公室和研发中心副主任、副总经理（主持工作）、研发中心总经理、战略发展规划部总经理。2016年1月至2019年1月任东兴证券董事。现任东兴证券监事、监事会主席。

叶淑玉女士，1957年5月出生，物理学学士、中欧EMBA，高级工程师、会计师，中国国籍，无境外永久居留权。曾任福州无线电七厂质检科副科长兼厂团总支书记；福州电子工业局团委委员；福州智达电脑品管部副经理；福建新世纪电脑集团有限公司副总裁；实达电脑集团人力资源处处长、监事；实达电脑与美国Compaq合资公司副总经理；上海外高桥房地产有限公司副总经理。现任福建东煌投资集团股份有限公司董事、董事长助理兼董事会秘书，福建天宝矿业集团股份有限公司董事、副总裁兼董事会秘书。2017年3月至今任东兴证券监事。

罗小平先生，1960年5月出生，硕士研究生，高级经济师，中国国籍，无境外永久居留权。曾任华夏证券股份有限公司投行部副总经理、并购部和证券营业部总经理、中华企业咨询有限公司执行总裁；中国诚通控股集团有限公司战略发展中心总监。现任中国诚通控股集团有限公司专职派出董事、中国物流有限公司董事、中国诚通香港有限公司董事。2011年11月至今任东兴证券监事。

郝洁女士，1971年4月出生，硕士研究生，中国国籍，无境外永久居留权。曾任信达资产管理公司财务部会计，宏源证券财务部总经理助理、副总经理，现任东兴证券财务部总经理，兼任东兴投资董事、东兴期货董事。2017年3月至今任东兴证券职工监事。

杜彬先生，1973年2月出生，本科学历，中国国籍，无境外永久居留权。曾任中国人民银行条法司综合处科员；中国民族国际信托投资公司国际业务部副经理、资产管理部总经理，民族证券法律及合规政策部经理，合规部副总经理、总经理，合规部兼风险管理部总经理，合规风控部总经理；现任东兴证券合规法律部总经理、东兴投资董事、东兴期货监事、东兴资本监事、上海东策盛资产管理有限公司监事。2014年8月至今任东兴证券职工监事。

### 3、总经理及其他高级管理人员

魏庆华、张涛先生和谭世豪先生，简历请参见上述关于董事的介绍

许学礼先生，1963年12月出生，博士研究生学历，高级经济师，中国国籍，无境外永久居留权。曾任财政部财政科学研究所助理研究员；中国南山开发公司上市小组成员；深圳证券交易所高级研究员；广州尊荣集团副总经理；深圳汉君雄投资公司副总经理；亚洲控股有限公司总裁助理；大通证券股份有限公司副总经理；东兴证券首席风险官，东兴资本董事。现任东兴证券副总经理、合规总监、首席风险官，东兴香港董事。

银国宏先生，1974年3月出生，博士研究生学历，中国国籍，无境外永久居留权。曾任中国教育科技信托投资公司证券营业部研究咨询部经理；中信建投证券研究所所长助理；东兴证券研究所总经理，公司助理总经理兼研究所总经理、机构业务部总经理、资产管理业务总部总经理、基金业务部总经理。现任东兴证券副总经理、衍生品部总经理，东兴期货董事长，上海伴兴实业发展有限公司董事长。

张军先生，1975年5月出生，硕士研究生学历，中国国籍，无境外永久居留权。曾任北京市园林局香山公园科员；中诚信托投资有限责任公司信托经理；证监会发行监管部审核一处科员、副调研员、副处长；东兴证券首席风险官。现任东兴证券副总经理，东兴香港董事。

刘亮先生，1974年10月出生，本科学历，中国国籍，无境外永久居留权。曾就职于福建省政府办公厅证券办、中国证监会福建特派员办事处。曾任福建省证券监督管理委员会科员，中国证监会福建监管局科员、副主任科员、主任科员、党办副主任、稽查处副处长、纪委委员、党办副主任（主持）、党办主任；东兴证券助理总经理、总经理办公室总经理、场外市场业务总部总经理、新疆分公司总经理、深圳分公司总经理、东兴证券董事会秘书，董事会办公室总经理。现任东兴证券副总经理，福建分公司总经理。

陈海先生，1970年12月出生，本科学历，中国国籍，无境外永久居留权。曾任闽发证券深圳营业部会计主管、福州五一中路营业部分析师、信息研究中心股评部经理、福州北环东路营业部助理总经理；东兴证券福州北环东路营业部助理总经理、副总经理、营销总监，福州五一中路营业部江厝服务部负责人、福州江厝营业部总经理、福建分公司副总经理，公司助理总经理兼任资产管理业务总部业务一部总经理、公司助理总经理兼任资产管理业务总部总经理。现任东兴证券副总经理，东兴香港董事，东兴证券（香港）有限公司董事会主席。

张锋先生，1973年12月出生，硕士研究生学历，中国国籍，无境外永久居留权。曾任中国银行总行营业部出口处职员；中国东方股权部、实业部、评估部助理经理、副经理；东兴证券北京北四环中路证券营业部总经理、企业融资部总经理、财富管理部总经理。现任东兴证券董事会秘书，公司助理总经理，机构客户部总经理。

#### 4、合规总监

许学礼先生，简历请参见上述关于总经理及其他高级管理人员的介绍。

#### 5、本基金基金经理

李兵伟先生，中央财经大学金融学硕士，9年证券行业经验，具有基金从业资格。2010年开始从事证券行业工作，2010年7月至2015年8月，任信达证券



金融工程研究员、投资经理；2015年9月加入东兴证券基金业务部。具有多年量化投研经验，对量化选股和量化择时有深刻的体会和执行经验。

程远，北京大学硕士，具有11年证券行业经验。现任东兴证券基金业务部投资总监、研究总监、基金经理，曾任华泰证券研究所纺织服装行业首席研究员兼任社会服务行业首席研究员和轻工造纸行业首席研究员。中央电视台财经频道特约嘉宾，中国证券报特约撰稿人。

#### 6、基金业务投资决策委员会成员

银国宏先生，简历请参见上述关于经营管理层人员的介绍

王青女士，现任基金业务部总经理。

程远先生，现任基金业务部投资总监，兼任研究总监、基金经理。

孙继青先生，现任基金业务部基金经理。

张琳娜女士，现任基金业务部基金经理。

7、上述人员之间均不存在近亲属关系。

### （三）基金管理人的职责

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

2、办理本基金备案手续；

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、办理与基金资产管理业务活动有关的信息披露事项；

9、召集基金份额持有人大会；

10、保存基金资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，代表本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、执行生效的基金份额持有人大会决定；

13、有关法律法规和中国证监会规定的其他职责。

（四）基金管理人承诺

1、基金管理人承诺不从事违反《中华人民共和国证券法》的行为，并承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反《中华人民共和国证券法》行为的发生；

2、基金管理人承诺不从事违反《基金法》的行为，并承诺建立健全内部风险控制制度，采取有效措施，防止下列行为的发生：

- （1）将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金资产从事证券投资；
- （2）不公平地对待其管理的不同基金资产；
- （3）利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；
- （4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- （5）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）法律法规以及中国证监会规定禁止的其他行为。

3、基金管理人承诺不从事证券法规规定禁止从事的其他行为。

4、基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律、法规、规章及行业规范，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权益；
- （4）在包括向中国证监会报送的资料中进行虚假信息披露；
- （5）拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
- （6）玩忽职守、滥用职权；

（7）违反现行有效的有关法律、法规、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；

- （8）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；

(9) 违反证券交易场所业务规则，利用对敲、对倒、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；

(10) 贬损同行，以提高自己；

(11) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；

(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) 其他法律、行政法规禁止的行为。

## 5、基金经理承诺

(1) 依照有关法律、法规、规章和基金合同的规定，本着勤勉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、代理人、代表人、受雇人或任何其他第三人谋取不当利益；

(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；

(4) 不协助、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。

## (五) 基金管理人的内部控制制度

### 1、内部控制的原则

#### (1) 全面性原则

内部控制应当贯穿决策、执行和监督全过程，覆盖企业及其所属单位的各种业务和事项。

#### (2) 重要性原则

内部控制应当在全面控制的基础上，关注重要业务事项和高风险领域。

#### (3) 制衡性原则

内部控制应当在治理结构、机构设置及权责分配、业务流程等方面形成相互制约、相互监督，同时兼顾运营效率。

#### (4) 适应性原则

内部控制应当与企业经营规模、业务范围、竞争状况和风险水平等相适应，并随着情况的变化及时加以调整。

#### (5) 成本效益原则

内部控制应当权衡实施成本与预期效益，以适当的成本实现有效控制。

## 2、内部控制的体系结构

公司的内部控制体系结构是一个分工明确、相互牵制的组织结构，由董事会对合规管理、风险管理和内部控制有效性承担最终责任，各个业务部门负责本部门的风险评估和监控，稽核审计部负责监察公司的风险管理措施的执行。具体而言，包括如下组成部分：

（1）董事会：负责制定公司的内部控制政策，对内部控制负完全的和最终的责任。

（2）合规总监：独立行使合规管理权利；直接对董事会负责；及时向董事会及/或董事会下设的相关专门委员会提交有关公司规范运作和风险控制方面的工作报告；

（3）投资决策委员会：负责制定、完善投资决策制度和流程；确定各基金的投资理念、投资原则以及投资限制；核准基金投资证券池的构成；审定各基金的资产配置方案，根据市场形势调整在类别资产、市场、行业间的分配比例及投资规模范围；制定投资授权方案，对超出授权的投资作出决定；评估各基金的业绩表现和风险状况；评估交易单元和交易对手，作出新增或者剔除的决定；研究风险控制委员会对投资有关问题的意见和建议。

（4）风险控制委员会：负责建立基金管理业务风险控制体系；制定基金管理业务风险控制相关制度；根据自身管理能力及风险控制水平，合理确定不同时期基金管理业务的计划规模；制订基金管理业务自有资金年度使用计划、风险限额，并提交公司总经理办公会审议；对新业务、新产品进行风险审查；听取、评议基金管理部上一季度业务运作及风险管理情况的报告及下一季度风险管理工作计划。审议公司基金管理业务的其他重大风险事项；

（5）稽核审计部：负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理系统的发展提供协助，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标；

（6）业务部门：风险管理是每一个业务部门最首要的责任。部门经理对本部门的风险负全部责任，负责履行公司的风险管理程序，负责本部门的风险管理系统的开发、执行和维护，用于识别、监控和降低风险。

### 3、内部控制的措施

（1）建立、健全内控体系，完善内控制度：公司建立、健全了内控结构，高管人员关于内控有明确的分工，确保各项业务活动有恰当的组织授权，确保稽核审计、合规管理、风险控制等工作是独立的，并得到高管人员的支持，同时置备操作手册，并定期更新；

（2）建立相互分离、相互制衡的内控机制：建立、健全了各项制度，做到基金经理分开，投资决策分开，基金交易集中，形成不同部门，不同岗位之间的制衡机制，从制度上减少和防范风险；

（3）建立、健全岗位责任制：建立、健全了岗位责任制，使每个员工都明确自己的任务、职责，并及时将各自工作领域中的风险隐患上报，以防范和减少风险；

（4）建立风险分类、识别、评估、报告、提示程序：使用适合的程序，确认和评估与公司运作和投资有关的风险；公司建立了自下而上的风险报告程序，对风险隐患进行层层汇报，使各个层次的人员及时掌握风险状况，从而以最快速度作出决策；

（5）建立内部监控系统：建立了有效的内部监控系统，如电脑预警系统、投资监控系统，能对可能出现的各种风险进行全面和实时的监控；

（6）使用数量化的风险管理手段：采取数量化、技术化的风险控制手段，建立数量化的风险管理模型，用以提示指数趋势、行业及个股的风险，以便公司及时采取有效的措施，对风险进行分散、控制和规避，尽可能地减少损失；

（7）提供足够的培训：制定了完整的培训计划，为所有员工提供足够和适当的培训，使员工明确其职责所在，控制风险。

### 4、基金管理人关于内部合规控制声明书

（1）本公司承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确；

（2）本公司承诺根据市场变化和公司发展不断完善内部合规控制。

## 四、基金托管人

### （一）基金托管人情况

名称：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

成立时间：1984年1月1日

法定代表人：陈四清

注册资本：人民币34,932,123.46万元

联系电话：010-66105799

联系人：郭明

### （二）主要人员情况

截至2018年12月，中国工商银行资产托管部共有员工202人，平均年龄33岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

### （三）基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本养老保险、企业年金基金、QFII资产、QDII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII专户资产、ESCROW等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2018年12月，中国工商银行共托管证券投资基金923只。自2003年以来，本行连续十五年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的64项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托

管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

#### （四）基金托管人的内部控制制度

中国工商银行资产托管部自成立以来，各项业务飞速发展，始终保持在资产托管行业的优势地位。这些成绩的取得，是与资产托管部“一手抓业务拓展，一手抓内控建设”的做法是分不开的。资产托管部非常重视改进和加强内部风险管理工作，在积极拓展各项托管业务的同时，把加强风险防范和控制的力度，精心培育内控文化，完善风险控制机制，强化业务项目全过程风险管理作为重要工作来做。2005、2007、2009、2010、2011、2012、2013、2014、2015、2016、2017共十一次顺利通过评估组织内部控制和安全措施最权威的 ISAE3402 审阅，获得无保留意见的控制及有效性报告。充分表明独立第三方对我行托管服务在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可，也证明中国工商银行托管服务的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨，达到国际先进水平。目前，ISAE3402 审阅已经成为年度化、常规化的内控工作手段。

##### 1、内部风险控制目标

保证业务运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，强化和建立守法经营、规范运作的经营思想和经营风格，形成一个运作规范化、管理科学化、监控制度化的内控体系；防范和化解经营风险，保证托管资产的安全完整；维护持有人的权益；保障资产托管业务安全、有效、稳健运行。

##### 2、内部风险控制组织结构

中国工商银行资产托管业务内部风险控制组织结构由中国工商银行稽核监察部门（内控合规部、内部审计局）、资产托管部内设风险控制处及资产托管部各业务处室共同组成。总行稽核监察部门负责制定全行风险管理政策，对各业务部门风险控制工作进行指导、监督。资产托管部内部设置专门负责稽核监察工作的内部风险控制处，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，对业务的运行独立行使稽核监察职权。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

##### 3、内部风险控制原则

（1）合法性原则。内控制度应当符合国家法律法规及监管机构的监管要求，并贯穿于托管业务经营管理活动的始终。

（2）完整性原则。托管业务的各项经营管理活动都必须有相应的规范程序和监督制约；监督制约应渗透到托管业务的全过程和各个操作环节，覆盖所有的部门、岗位和人员。

（3）及时性原则。托管业务经营活动必须在发生时能准确及时地记录；按照“内控优先”的原则，新设机构或新增业务品种时，必须做到已建立相关的规章制度。

（4）审慎性原则。各项业务经营活动必须防范风险，审慎经营，保证基金资产和其他委托资产的安全与完整。

（5）有效性原则。内控制度应根据国家政策、法律及经营管理的需要适时修改完善，并保证得到全面落实执行，不得有任何空间、时限及人员的例外。

（6）独立性原则。设立专门履行托管人职责的管理部门；直接操作人员和控制人员必须相对独立，适当分离；内控制度的检查、评价部门必须独立于内控制度的制定和执行部门。

#### 4、内部风险控制措施实施

（1）严格的隔离制度。资产托管业务与传统业务实行严格分离，建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度，并采取了良好的防火墙隔离制度，能够确保资产独立、环境独立、人员独立、业务制度和管理独立、网络独立。

（2）高层检查。主管行领导与部门高级管理层作为工行托管业务政策和策略的制定者和管理者，要求下级部门及时报告经营管理情况和特别情况，以检查资产托管部在实现内部控制目标方面的进展，并根据检查情况提出内部控制措施，督促职能管理部门改进。

（3）人事控制。资产托管部严格落实岗位责任制，建立“自控防线”、“互控防线”、“监控防线”三道控制防线，健全绩效考核和激励机制，树立“以人为本”的内控文化，增强员工的责任心和荣誉感，培育团队精神和核心竞争力。并通过进行定期、定向的业务与职业道德培训、签订承诺书，使员工树立风险防范与控制理念。



（4）经营控制。资产托管部通过制定计划、编制预算等方法开展各种业务营销活动、处理各项事务，从而有效地控制和配置组织资源，达到资源利用和效益最大化目的。

（5）内部风险管理。资产托管部通过稽核监察、风险评估等方式加强内部风险管理，定期或不定期地对业务运作状况进行检查、监控，指导业务部门进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施，排查风险隐患。

（6）数据安全控制。我们通过业务操作区相对独立、数据和传真加密、数据传输线路的冗余备份、监控设施的运用和保障等措施来保障数据安全。

（7）应急准备与响应。资产托管业务建立专门的灾难恢复中心，制定了基于数据、应用、操作、环境四个层面的完备的灾难恢复方案，并组织员工定期演练。为使演练更加接近实战，资产托管部不断提高演练标准，从最初的按照预订时间演练发展到现在的“随机演练”。从演练结果看，资产托管部完全有能力在发生灾难的情况下两个小时内恢复业务。

#### 5、资产托管部内部风险控制情况

（1）资产托管部内部设置专职稽核监察部门，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，全面贯彻落实全程监控思想，确保资产托管业务健康、稳定地发展。

（2）完善组织结构，实施全员风险管理。完善的风险管理体系需要从上至下每个员工的共同参与，只有这样，风险控制制度和措施才会全面、有效。资产托管部实施全员风险管理，将风险控制责任落实到具体业务部门和业务岗位，每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责，通过建立纵向双人制、横向多部门制的内部组织结构，形成不同部门、不同岗位相互制衡的组织结构。

（3）建立健全规章制度。资产托管部十分重视内控制度的建设，一贯坚持把风险防范和控制的理念和方法融入岗位职责、制度建设和工作流程中。经过多年努力，资产托管部已经建立了一整套内部风险控制制度，包括：岗位职责、业务操作流程、稽核监察制度、信息披露制度等，覆盖所有部门和岗位，渗透各项业务过程，形成各个业务环节之间的相互制约机制。

（4）内部风险控制始终是托管部工作重点之一，保持与业务发展同等地位。资产托管业务是商业银行新兴的中间业务，资产托管部从成立之日起就特别强调

规范运作，一直将建立一个系统、高效的风险防范和控制体系作为工作重点。随着市场环境的变化和托管业务的快速发展，新问题、新情况不断出现，资产托管部始终将风险管理放在与业务发展同等重要的位置，视风险防范和控制为托管业务生存和发展的生命线。

#### （五）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《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范围和投资对象、基金投融资比例、基金投资禁止行为、基金参与银行间债券市场、基金资产净值的计算、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，其中对基金的投资比例的监督和核查自基金合同生效之后六个月开始。

基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、基金合同、基金托管协议或有关基金法律法规规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对，并以书面形式对基金托管人发出回函确认。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。基金管理人未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

#### （六）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、证券账户及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》、《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、证券账户及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；

(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》及《托管协议》的规

定进行；如果基金管理人未执行《基金合同》及《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）从基金管理人或其委托的登记机构处接受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》及《托管协议》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定；

（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。

## 五、相关服务机构

### （一）基金份额发售机构

#### 1、直销机构

##### （1）东兴证券股份有限公司直销中心

###### a、东兴证券股份有限公司网上直销系统

交易系统网址：<https://tradefund.dxzq.net/etrading/>

###### b、东兴证券股份有限公司直销柜台

办公地址：北京市西城区平安里西大街28号中海国际中心6层

联系人：陈智勇

直销中心电话：010-57307309

传真：010-57307388

公司网站：<http://www.dxzq.net>

##### （2）东兴证券股份有限公司分支机构

住所：北京西城区金融大街5号新盛大厦B 座6层

办公地址：北京西城区金融大街5号新盛大厦B 座6层

法人代表：魏庆华

联系人：田丰舞

传真：010-57307388

#### 2、代销机构

##### （1）中国工商银行股份有限公司

注册地址：中国北京市西城区复兴门内大街55号

客服电话：95588

公司网站：<http://www.icbc.com.cn/ICBC/default.htm>

##### （2）大连银行股份有限公司

注册地址：辽宁省大连市中山区中山路 88 号

客服电话：400-664-0099

公司网站：<http://www.bankofdl.com>

##### （3）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

客服电话： 4009918918 / 4001818188

公司网址： [www.1234657.com.cn](http://www.1234657.com.cn)

（4）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

客服电话： 400-700-9665

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

（5）上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

客服电话： 400-820-2899

公司网站： <http://www.erichfund.com/>

（6）北京展恒基金销售股份有限公司

注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号

客服电话： 400-818-8000

公司网站： [www.myfund.com](http://www.myfund.com)

（7）上海利得基金销售有限公司

注册地址：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室

客服电话： 400-921-7755

公司网站： [www.leadbank.com.cn](http://www.leadbank.com.cn)

（8）乾道金融信息服务（北京）有限公司

注册地址：北京市海淀区东北旺村南 1 号楼 7 层 7117 室

客服电话： 400-088-8080

公司网站： [www.qiandaojr.com](http://www.qiandaojr.com)

（9）北京恒天明泽基金销售有限公司

注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室

客服电话： 4007-868-868

公司网站： [www.chtfund.com](http://www.chtfund.com)

（10）北京汇成基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108 号

客服电话： 400-068-1176

公司网站：[www.fundzone.cn](http://www.fundzone.cn)

(11) 北京钱景基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012

客服电话：400-893-6885

公司网站：[www.qianjing.com](http://www.qianjing.com)

(12) 北京新浪仓石基金销售有限公司

地址：北京市海淀区西北旺东路10号院西区8号楼新浪总部大厦

客服电话：86-10-62675369

公司网站：<https://trade.xincai.com/web/promote>

(13) 上海万得基金销售有限公司

地址：上海市浦东新区浦明路1500号万得大厦

客服电话：400-820-9463

公司网址：<http://www.wind.com.cn/Default.aspx>

(14) 上海基煜基金销售有限公司

地址：上海市昆明路518号北美广场A1002-A1003室

客服电话：400-820-5369

公司网址：<https://www.jiyufund.com.cn/login>

(15) 大泰金石基金销售有限公司

注册地址：南京市建邺区江东中路222号南京奥体中心现代五项馆2105室

客服电话：400-928-2266

公司网站：<http://www.dtfunds.com>

(16) 北京肯特瑞基金销售有限公司

地址：北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-06

客服电话：400 088 8816

公司网站：<http://kenterui.jd.com/kenTeRui.html>

(17) 联讯证券股份有限公司

注册地址：广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、  
四楼

客服电话：95564

公司网站：[www.lxzq.com.cn](http://www.lxzq.com.cn)

(18) 方德保险代理有限公司

公司网站：[www.jhjhome.net](http://www.jhjhome.net)

客服热线：400-8557-333

(19) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

公司网站：<https://www.antfortune.com/>

客服热线：95188

(20) 南京苏宁基金销售有限公司

公司网站：<https://www.snjijin.com/>

客服热线：95177

(21) 深圳众禄基金销售股份有限公司

公司网站：<http://www.jjmmw.com/>

客服热线：4006-788-887

(22) 济安财富（北京）基金销售有限公司

公司网站：<http://www.jianfortune.com/>

客服热线：400-673-7010

(23) 北京植信基金销售有限公司

公司网站：<https://www.zhixin-iv.com/>

客服热线：4006-802-123

(24) 上海联泰基金销售有限公司

公司网站：<http://www.66liantai.com/>

客服热线：400-166-6788

(25) 珠海盈米基金销售有限公司

公司网站：<https://www.yingmi.cn/>

(26) 嘉实财富管理有限公司

公司网站：<https://www.harvestwm.cn/>

客服热线：400-021-8850

(27) 北京加和基金销售有限公司

公司网站：[www.bzfunds.com](http://www.bzfunds.com)

电话：010-50866175



（28）上海陆金所基金销售有限公司

公司网站：<http://www.lufunds.com/>

客服热线：400-8219-031

（29）大连网金基金销售有限公司

公司网站：<http://www.yibaijin.com/>

客服热线：4000-899-100

（30）北京蛋卷基金销售有限公司

公司网站：<https://danjuanapp.com/>

客服热线：4000-618-518

（31）万家财富基金销售（天津）有限公司

公司网站：<http://www.wanjiawealth.com/>

客服热线：010-59013895

## （二）登记机构

名称：东兴证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 5 号（新盛大厦）B 座 12、15 层

法定代表人：魏庆华

办公地址：北京市西城区平安里西大街28号中海国际中心6层

联系人：王广辉

电话：010-57307359

传真：010-57307366

## （三）律师事务所

名称：北京市天元律师事务所

住所：北京市西城区丰盛胡同 28 号太平洋保险大厦 10 层

办公地址：北京市西城区丰盛胡同 28 号太平洋保险大厦 10 层

负责人：朱小辉

电话：010-57763888

传真：010-57763777

经办律师：吴冠雄、李晗

（四）会计师事务所

名称：德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城西二办公楼 8  
层 10 室

办公地址：北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城西二办公楼 8  
层 10 室

执行事务合伙人：崔劲

联系电话：010-85207108

传真：010-85181218

经办注册会计师：李燕、王亚坤

## 六、基金的募集

（一）本基金根据 2016 年 8 月 2 日中国证券监督管理委员会《关于准予东兴量化多策略灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可【2016】1744 号）注册，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。

（二）基金类型、运作方式及存续期

本基金类型：混合型证券投资基金

本基金运作方式：契约型开放式

本基金存续期：不定期

（三）本基金根据《关于东兴量化多策略灵活配置混合型证券投资基金备案确认的函》（机构部函【2016】2616 号）的批准，于 2016 年 10 月 27 日基金合同生效。

《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，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。

法律法规另有规定时，从其规定。

## 七、基金份额的申购、赎回与转换

### （一）申购与赎回的场所

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。具体的销售网点名单详见本招募说明书“五、相关服务机构”或其他相关公告。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。

### （二）申购与赎回的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

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

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

#### 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三个月开始办理申购，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三个月开始办理赎回，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、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、赎回或转换申请且基金份额登记机构确认接受的，其基金份额申购、赎回或转换价格为下一开放日基金份额申购、赎回或转换的价格。

### （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。

5、遵循“基金份额持有人利益优先”原则，基金管理人在办理基金份额申购、赎回业务时，如果发生申购、赎回损害持有人利益的情形时，应当及时暂停申购、赎回业务。

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，必须全额交付申购款项，投资人交付款项，申购成立，基金份额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，基金份额登记机构确认赎回时，赎回生效。基金份额持有人赎回申请成功后，基金管理人将在T+7日(包括该日)内支付赎回款项。在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照本基金合同有关条款处理。

##### 3、申购和赎回申请的确认

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

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

#### （五）申购金额和赎回份额的限制

1、投资人通过代销机构申购本基金，每个基金账户单笔申购最低金额为 1,000 元人民币，代销机构另有规定的，从其规定；本公司直销柜台每个基金账户首次单笔申购最低金额为 10,000 元人民币；通过本公司网上交易平台申购本基金时，每个基金账户单笔申购最低金额为 1,000 元人民币，定投每次最低金额为 100 元人民币；

2、基金份额持有人在销售机构赎回时，每次赎回申请不得低于 100 份基金份额。基金份额持有人赎回时或赎回后在销售机构（网点）单个交易账户保留的基金份额余额不足 100 份的，余额部分基金份额在赎回时需同时全部赎回。

3、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益，具体请参见相关公告。

4、基金管理人可以在法律法规允许的情况下根据实际情况对以上限制进行调整，最迟在调整生效前 2 个工作日至少在一家指定媒介及基金管理人网站公告并报中国证监会备案。

#### （六）申购费用与赎回费用

##### 1、申购费用

本基金申购费率如下表所示：

申购金额（M）	费率
M<50 万元	1.5%
50 万元≤M<100 万元	1.2%
100 万元≤M<500 万元	0.8%
M≥500 万元	1000 元/笔

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。投资人可以多次申购本基金，申购费用按单笔申购金额确定申购费率，以每笔申购申请单独计算费用。

## 2、赎回费用

本基金赎回费率如下表所示：

基金份额持有期限（N）	赎回费率
N<7 日	1.50%
7 日≤N<30 日	0.75%
30 日≤N<1 年	0.50%
1 年≤N<2 年	0.25%
N≥2 年	0.00%

注：N 为基金份额持有期限；1 年指 365 天。

投资者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。

基金管理人可以按照《基金合同》的相关规定调整申购、赎回费率或调整收费方式，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前 2 个工作日在至少一家中国证监会指定媒介及基金管理人网站公告。

### （七）申购份额与赎回金额的计算

#### 1、基金申购份额的计算

净申购金额 = 申购金额 / (1 + 申购费率)

申购费用 = 申购金额 - 净申购金额

申购份额 = 净申购金额 / 申购当日基金单位净值

基金份额份数保留到小数点后两位，小数点后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。

例如：某投资者投资 5 万元申购基金，对应费率为 1.5%，假设申购当日基金份额净值为 1.016 元，则其可得到的申购份额为：

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} / (1 + \text{申购费率}) = 50,000 / (1 + 1.5\%) = 49,261.08$$

$$\text{申购费用} = \text{申购金额} - \text{净申购金额} = 50,000 - 49,261.08 = 738.92$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{申购当日基金份额净值} = 49,261.08 / 1.016 = 48,485.31 \text{ 份}$$

即：投资者投资 5 万元申购基金，假设申购当日基金份额净值为 1.016 元，则可得到 48,485.31 份基金份额。

## 2、基金赎回金额的计算

$$\text{赎回金额} = \text{赎回份数} \times \text{T 日基金份额净值}$$

$$\text{赎回费用} = \text{赎回金额} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{净赎回金额} = \text{赎回金额} - \text{赎回费用}$$

计算结果均按照四舍五入方法，保留小数点后两位，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

例如：某投资者赎回基金 1 万份基金份额，持有期大于 30 日但小于 1 年，对应的赎回费率为 0.5%，假设赎回当日基金份额净值是 1.016 元，则可得到的净赎回金额为：

$$\text{赎回金额} = 10000 \times 1.016 = 10,160 \text{ 元}$$

$$\text{赎回费} = 10,160 \times 0.5\% = 50.80 \text{ 元}$$

$$\text{净赎回金额} = 10160 - 50.80 = 10,109.20 \text{ 元}$$

即：投资者赎回基金 1 万份基金份额，假设赎回当日基金份额净值是 1.016 元，则其可得到的净赎回金额为 10,109.20 元。

## 3、基金份额净值的计算

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。



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

#### （八）申购和赎回的注册登记

1. 基金投资人在 T 日申购基金成功后，正常情况下，登记机构在 T+1 日为基金投资者增加权益并办理登记手续，基金投资者自 T+2 日起有权赎回该部分基金份额。

2. 基金投资人在 T 日赎回基金成功后，正常情况下，登记机构在 T+1 日为基金投资者扣除权益并办理相应的登记手续。

3. 基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述登记办理时间进行调整，并最迟于开始实施前 3 个工作日在指定媒介及基金管理人网站上公告。

#### （九）拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理

##### 1、拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

（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收投资人的申购申请。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接受基金申购申请。

（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。

（4）基金管理人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有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过 50%，或者变相规避 50% 集中度的情形时。

（7）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）、（7）项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资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。

## 2、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。

（4）连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

（5）继续接受赎回申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。

（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赎回申请或延缓支付赎回款项时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付，并以后续开放日的基金份额净值为依据计算赎回金额。若出现上述第 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。

## 3、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

（1）发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人当日应立即向中国证监会备案，并在规定期限内指定媒介上刊登暂停公告。

(2) 如发生暂停的时间为1日，基金管理人应于重新开放日，在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近1个开放日的基金份额净值。

(3) 如发生暂停的时间超过1日但少于2周（含2周），暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前2日在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近1个开放日的基金份额净值。

(4) 如发生暂停的时间超过2周，暂停期间，基金管理人应每2周至少刊登暂停公告1次；当连续暂停时间超过两个月时，可对重复刊登暂停公告的频率进行调整。暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前2日在指定媒介上连续刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近1个开放日的基金份额净值。

#### (十) 巨额赎回的认定及处理方式

##### 1、巨额赎回的认定

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

##### 2、巨额赎回的处理方式

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

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

(2) 部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。若发生巨额赎回，对于单个基金份额持有人当日赎回申请超过上一开放日基金总份额40%以上的部分，将自动进行延期办理。对于其余当日非自动延期办理的赎回申请，应当按单个账户非自动延期办理的赎回申请量占非自动延期办理的赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额。对于未能赎回部分，投资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某一类别的基金份额净值为基准计算赎回金额，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。部分延期赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

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

### 3、巨额赎回的公告

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

#### （十一）基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及本基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换业务。基金转换可以收取一定的转换费，相关基金转换的规则由基金管理人届时另行规定并公告，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份额登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及基金份额登记机构认可、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份额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

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

#### （十四）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。

## 八、基金的投资

### （一）投资目标

本基金通过数量化的方法进行积极的组合管理与风险控制，力争实现超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。

### （二）投资理念

本基金通过数量化投资分析手段，从多个角度对股票进行系统化分析研究，识别市场价值低估的机会，在既定风险水平下最大限度提高投资收益，尽可能提高基金夏普比率。

### （三）投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板和其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、地方政府债、企业债券、公司债券、短期融资券、超短期融资券、中期票据、次级债、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换公司债券等）、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、权证、资产支持证券、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）。

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。

本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%；在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，每个交易日日终现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。

### （四）投资策略

本基金采用量化方法进行投资，通过量化分析手段甄选多种有效的投资策略，在投资过程中最大限度消除人为情绪波动对投资造成的扰动。通过多种量化策略的组合搭配以达到获取稳定 Alpha 组合并进行择时判断的效果，降低系统性及非系统性风险。

#### 1、资产配置策略

本基金通过提取宏观经济、市场趋势、微观主体的关键量化指标并运用数量化模型进行客观分析，结合美林投资时钟理论，综合考虑本基金投资目标、风控要求等因素，合理确定在股票市场、债券市场、货币市场的配置比例，并不断进行动态管理。

## 2、股票投资策略

本基金采用多种量化策略进行股票投资，主要策略包括多因子选股策略、事件投资策略、舆情监控投资策略、行业量化配置策略等。在不同的市场情况下，通过选择不同的策略或多种策略的互相搭配构建投资组合。同时，基金管理人量化投资团队将不断进行更有效策略的开发和测试，不断增强投资业绩。

### （1）多因子选股策略

多因子选股为市场上运用较多的选股方法，本基金通过对影响股票价格因素的分析，形成八大类别的因子库，包括成长类因子、营运类因子、资本结构类因子、盈利能力因子、金融行业因子、估值因子、一致预期因子、市场类因子。在完善以上因子库的基础上，将所有上市公司按申万一级行业分类并针对每个行业进行动态的因子分析和回归分析，确定每个行业最有效的因子的基础上筛选最有可能跑赢市场的股票组合。

多因子选股策略的所有数据均来自股票市场公开数据，包括上市公司定期公布的财务数据、上市公司基本资料、场内市场公开交易数据等。所有未经权威渠道披露的数据均不作为多因子选股策略的数据依据。

### （2）事件投资策略

资本市场的发展壮大和对资本市场有冲击效应的事件发生得越来越频繁，事件性投资机会层出不穷。影响股票价格变动的事件通常有增发、收购兼并、资产注入、整体上市、发行可转债、上市公司业绩公告等；对相关行业的影响事件通常有利率政策、行业政策、汇率政策、突发事件等；对商品市场的影响事件通常有地缘冲突、罢工事件、政策收储、公布重要经济数据、利率政策、货币政策等；对债券的影响事件通常有利率政策、货币政策、重要经济数据。通常这类事件都会短暂打破市场均衡价格，通过对历史数据的定量和定性分析，可以在预期发生的前后买入相关投资标的。

事件选股涉及的数据包括定增预案日期、公告日期、增发日期、业绩快报数据、业绩预告数据、股权激励预案日期、并购事件披露日期、利率准备金率调整幅度及调整公布日期等。所有涉及到数据均来自于上市公司公开公共内容及相关货币当局、统计局等。

### （3）舆情监控投资策略

所谓舆情监控，是指整合互联网信息采集技术及信息智能处理技术，通过对互联网海量信息自动抓取、自动分类聚类、主题检测、专题聚焦，实现用户的网络舆情监测和新闻专题追踪等信息需求，形成简报、报告、图表等分析结果，提供分析依据。

具体到舆情监控投资策略，主要对互联网涉及到股票相关的文章、评论进行语义分析，对市场主体投资情绪进行客观描述，在市场情绪过热时主动回避，避免泡沫化风险，同时，在市场情绪低迷时寻找市场潜在投资机会。

### （4）行业量化配置策略

从大的方面来分类，可以将行业分为周期性行业与非周期性行业，传统产业与战略新兴产业。从更细化的角度来看，可以将行业分为 20-30 个子行业。通过对关键量化指标的分析，比如行业景气指数、行业盈利指标、行业估值指标、行业动量指标、行业配置度指标等，通过量化模型综合判断进行行业的优化配置。

## 3、债券投资策略

本基金通过分析市场利率趋势、信用环境变化等因素，综合运用久期管理、收益率曲线策略、个券选择策略等策略，通过对不同券种收益率水平、信用分险、流动性等因素进行比较进行债券投资。以实现获取债券市场的长期稳定收益的目的。

## 4、资产支持证券投资策略

本基金通过对资产支持证券的市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等基本面因素，结合相关数量化定价模型，谨慎投资资产支持证券。

## 5、股指期货投资策略

本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研



究，结合股指期货的定价模型和基差水平进行股指期货投资，以期进行风险管理和流动性管理，提高组合收益的稳定性。

## 6、权证投资策略

本基金在严格控制风险的前提下谨慎进行权证投资。权证投资将以价值分析为基础，在采用数量化模型分析其合理定价的基础上，选择流动性好、交易活跃的期权合约进行投资，基金参与权证投资以套期保值为目的。

### （五）业绩比较基准

中证 800 指数收益率\*65%+中证综合债券指数收益率\*35%。

中证 800 指数由中证指数有限公司编制，该指数综合反映了沪深证券市场内大中小市值公司的整体状况，该指数编制合理、透明，有一定市场覆盖率，不易被操纵，并且有较高的知名度和市场影响力，适合作为本基金股票投资的业绩比较基准。中证综合债券指数由中证指数有限公司编制，该指数全面反映了我国债券市场的整体价格变动趋势，适合作为本基金债券投资的业绩比较基准。

如果今后证券市场中有其他代表性更强，或者指数编制单位停止编制该指数，或者更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时，基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，根据实际情况在按照监管部门要求履行适当程序并经基金托管人同意后对业绩比较基准进行相应调整。调整业绩比较基准应经基金托管人同意，并报中国证监会备案。基金管理人应在调整前在指定媒介上予以公告，而无需召开基金份额持有人大会。

本基金的业绩比较基准仅作为衡量本基金业绩的参照，不决定也不必然反映本年基金的投资策略。

### （六）风险收益特征

本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中高风险水平的投资品种。

### （七）投资限制

#### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

- （1）本基金股票投资占基金资产的比例范围为 0-95%；

(2) 本基金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，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、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%；

(5) 本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 15%。本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 30%；

(6) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的 15%。因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前述所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(7) 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%；

(8) 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%；

(9) 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%；

(10) 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%；

(11) 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；

(12) 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；

(13) 基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

(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%，债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；。

（15）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；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个交易日基金资产净值的20%；基金所持有的股票市值、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；

（16）本基金持有一家公司发行的流通受限证券，其市值不得超过基金资产净值的2%；本基金持有的所有流通受限证券，其市值不得超过该基金资产净值的10%；经基金管理人和托管人协商，可对以上比例进行调整；

（17）本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

（18）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%；

（19）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%；

（20）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%；

（21）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）、（6）、（11）、（17）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不符合上述规定的投资比例的，基金管理人应当在十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另有规定的，从其规定。

如果法律法规或监管部门对上述投资组合比例限制进行变更的，在履行适当程序后，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消或调整上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按调整后的规定执行。经与基金托管人协商一致，在履行适当程序后，基金管理人可依据法律法规或监管部门规定直接对基金合同进行变更，该变更无须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，但是国务院证券监督管理机构另有规定的除外；
- （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。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合本基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先的原则，防范利益冲突，建立健全内部审核机制和评估机制，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。

法律法规或监管部门取消或调整上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资按照取消或调整后的规定执行。

### （八）基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

- 1、不谋求对所投资公司的控股，不参与所投资公司的经营管理；
- 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，保护基金投资者的利益。

（九）基金的投资组合报告

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 5 月 16 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始于 2019 年 1 月 1 日，截至 2019 年 3 月 31 日（财务资料未经审计）。

1、报告期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	10,980,203.00	91.51
	其中：股票	10,980,203.00	91.51
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	898,901.12	7.49
8	其他资产	119,315.26	0.99
9	合计	11,998,419.38	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	代码 公允价值(元) 行业类别	占基金资产净值比例 (%)
----	------	-----------------------	---------------

公允价值(元)

占基金资产净值比例 (%)

A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,098,880.00	18.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,872,205.00	16.11
J	金融业	6,449,798.00	55.51
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	559,320.00	4.81
S	综合	-	-
	合计	10,980,203.00	94.50

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	002138	顺络电子	50,000	945,500.00	8.14
2	600155	华创阳安	50,000	633,000.00	5.45
3	601555	东吴证券	60,000	607,200.00	5.23
4	000783	长江证券	79,100	595,623.00	5.13
5	600030	中信证券	23,600	584,808.00	5.03
6	601881	中国银河	49,400	584,402.00	5.03
7	002555	三七互娱	42,000	583,800.00	5.02
8	601211	国泰君安	28,800	580,320.00	4.99
9	002518	科士达	46,000	578,680.00	4.98
10	601901	方正证券	75,000	576,000.00	4.96

#### 4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

#### 9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资股指期货。

#### 10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

11. 投资组合报告附注

(1) 本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

(2) 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

(3)其他资产构成

序号	名称	序号	金额(元)
1	存出保证金	名称	15,205.49
2	应收证券清算款	金额(元)	-
3	应收股利		-
4	应收利息	1	248.44
5	应收申购款		103,861.33
6	其他应收款		19,179.25
7	其他	2	-
应收证券清算款			119,315.26

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

3  
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。  
应收股利

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

4	应收利息	811.08
5	应收申购款	998.50
6	其他应收款	-
7	其他	-
52		-



## 九、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。

### 1. 基金净值表现

#### 本报告期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

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
过去三个月	8.22%	1.65%	19.78%	1.00%	-11.56%	0.65%

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

东兴量化多策略灵活配置混合型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注：1、本基金基金合同生效日为2016年10月27日，根据相关法律法规和基金合同，本基金建仓期为基金合同生效之日起6个月内；

2、建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

## 十、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、期货及票据价值、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和。

### （二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### （三）基金财产的账户

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

### （四）基金财产的保管及处分

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

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

## 十一、基金资产的估值

### （一）估值目的

基金资产的估值目的是客观、准确地反映资产的价值。

### （二）估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券、期货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。

### （三）估值对象

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

### （四）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，确定公允价值。

（2）交易所上市实行净价交易的债券按估值日第三方估值机构提供的相应品种的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值；

（3）交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全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或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价减去债券收盘价或估值全价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值；

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

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

（2）首次公开发行未上市的股票和权证，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，以第三方估值机构提供的价格数据估值。

4、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。

5、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。

6、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

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

8、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。

（五）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。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本基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将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。

#### （六）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。

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。

##### 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，并报中国证监会备案。

(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。

### (七) 暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券/期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

3、当前一估值日基金资产净值 50% 以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，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；

4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

#### （八）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工作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。

#### （九）特殊情形的处理

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

2、由于证券、期货交易所及其登记结算公司发送的数据错误，或由于不可抗力等原因，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可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

## 十二、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，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的30%，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为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；选择采取红利再投资形式的，分红资金将按红利发放日的基金份额净值转成相应的基金份额，红利再投资的份额免收申购费。如投资者在不同销售机构选择的分红方式不同，则登记机构将以投资者在各销售机构最后一次选择的分红方式为准；

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

6、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 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者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金份额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《业务规则》执行。

## 十三、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、仲裁费和诉讼费；
- 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、基金的证券、期货账户开户费用、账户维护费用；
- 9、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 1.5% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

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，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月前 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、公休假等，支付日期顺延。

#### 2、基金托管人的托管费

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月前 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。

上述“（一）基金费用的种类中第 3—9 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）基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## 十四、基金的会计和审计

### （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日内在指定媒介公告并报中国证监会备案。

## 十五、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、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：

- 1、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者重大利益的事项的法律文件。

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

(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。

## 2、基金份额发售公告

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

## 3、《基金合同》生效公告

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

## 4、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开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在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。

## 5、基金份额申购、赎回价格

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

## 6、基金定期报告，包括基金年度报告、基金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。

基金管理人应当在基金年度报告和半年度报告中披露基金组合资产情况及流动性风险分析等。

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

## 7、临时报告

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，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；
- （5）基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- （6）基金管理人股东及其出资比例发生变更；
- （7）基金募集期延长；
- （8）基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动；
- （9）基金管理人的董事在一年内变更超过百分之五十；
- （10）基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过百分之三十；
- （11）涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼；
- （12）基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查；
- （13）基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚，基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚；
- （14）重大关联交易事项；
- （15）基金收益分配事项；
- （16）管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- （17）基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；
- （18）基金改聘会计师事务所；
- （19）变更基金销售机构；
- （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支付；
- （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) 与其他基金合并；

(27) 本基金发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项；

(28) 基金管理人采用摆动定价机制进行估值；

(29) 中国证监会规定的其他事项。

## 8、澄清公告

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

## 9、基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

## 10、中国证监会规定的其他信息。

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

基金管理人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。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。

## （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报刊。

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。

## 十六、风险揭示

基金业绩受证券市场价格波动的影响，投资者持有本基金可能盈利，也可能亏损。基金份额持有人须了解并承受以下风险：

### （一）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，产生风险，主要包括：

1、政策风险。因国家宏观经济政策（如货币政策、财政政策、产业政策、地区发展政策等）发生变化，导致证券价格波动，影响基金收益。

2、经济周期风险。随着经济运行的周期性变化，证券市场也呈现出周期性变化，从而引起债券价格波动，基金的收益水平也会随之发生变化。

3、利率风险。当金融市场利率水平变化时，将会引起债券的价格和收益率变化，进而影响基金的净值表现。例如当市场利率上升时，基金所持有的债券价格将下降，若基金组合久期较长，则基金资产面临损失。

4、信用风险。基金所投资债券的发行人如果不能或拒绝支付到期本息，或者不能履行合约规定的其他义务，或者其信用等级降低，将会导致债券价格下降，进而造成基金资产损失。

5、购买力风险。基金投资于债券所获得的收益将主要通过现金形式来分配，而现金可能受通货膨胀的影响以致购买力下降，从而使基金的实际收益下降。

6、债券收益率曲线变动风险。该种风险是指收益率曲线没有按预期变化导致基金投资决策出现偏差。

7、再投资风险。该风险与利率风险互为消长。当市场利率下降时，基金将投资于固定收益类金融工具所得的利息收入进行再投资将获得较低的收益率，再投资的风险加大；反之，当市场利率上升时，利息的再投资收益会上升。

8、估值风险：本基金采用的估值方法有可能不能充分的反映和揭示利率风险，或经济环境发生了重大变化时，在一定时期内可能高估或者低估基金资产的净值。基金管理人和基金托管人将共同协商，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，使调整后的基金资产净值更能公允的反映基金资产价值，确保基金资产净值不对基金份额持有人造成实质性的损害。

9、经营风险：它与基金所投资债券的发行人的经营活动所引起的收入现金流的不稳定性有关。债券发行人期间运营收入变化越大，经营风险就越大；反之，运营收入越稳定，经营风险就越小。

## （二）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，造成管理风险。基金管理人的管理水平、管理手段和管理技术等对基金收益水平也存在影响。

## （三）流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险，风险管理的目标是确保基金组合资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。

### 1、基金申购、赎回安排

本基金通过设定单一投资者申购金额上限、收取强制赎回费、拒绝大额申购、暂停基金申购、暂停赎回或延缓支付赎回款项等措施控制基金申购、赎回中的流动性风险，具体详见基金合同第六部分基金份额的申购与赎回。

### 2、拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

本基金的投资市场主要为证券交易所、全国银行间债券市场等流动性较好的规范型交易场所，主要投资对象为具有良好流动性的金融工具（包括国内依法发行上市的股票、债券和货币市场工具等），同时本基金基于分散投资的原则在行业 and 个券方面未有高集中度的特征，综合评估在正常市场环境下本基金的流动性风险适中。

### 3、巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

本基金在发生巨额赎回时，将通过部分延期赎回、暂停赎回、延缓支付赎回款项、摆动定价及中国证监会认定的其他措施对于巨额赎回情形下的流动性风险进行管理控制，具体控制措施及程序详见基金合同第六部分基金份额的申购与赎回。

### 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

本基金运作过程中，将使用延期办理赎回申请、暂停接受赎回申请、收取短期赎回费、暂停基金估值、摆动定价及中国证监会认定的其他措施控制流动性风险，具体使用情形及程序详见基金合同第六部分基金份额的申购与赎回。

（1）延期办理赎回申请、暂停接受赎回申请能够在巨额赎回时，因变现需求过大，市场交易量不足，导致证券不能低成本地转变为现金，进而对基金资产净值造成较大波动的情形，对基金份额持有人来说，存在不能及时赎回基金份额的风险。

（2）收取短期赎回费能够控制资金短期频繁的申购赎回，避免净值大幅的波动，维护净值稳定。

（3）在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采取暂停基金估值，通过延缓支付赎回款项或暂停接受基金申购赎回申请等措施可避免基金份额净值虚高或虚低给申购、赎回客户或存量客户造成损失，对基金份额持有人来说，存在不能及时赎回基金份额的风险。

（4）通过摆动定价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，当日参与申购和赎回交易的投资者存在承担申购或者赎回产生的交易及其他成本的风险。

#### （四）合规性风险

指本基金的管理和投资运作不符合相关法律、法规的规定和基金合同的约定而带来的风险。

#### （五）操作和技术风险

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

此外，在开放式基金的后台运作中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行甚至导致基金份额持有人利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理人、基金托管人、登记机构、销售机构、证券交易所和证券登记结算机构等。

## （六）本基金特有的风险

1、本基金为混合型基金，基金资产主要投资于股票市场与债券市场，因此股市、债市的变化将影响到基金业绩表现。本基金股票投资占基金资产的比例为0-95%，在灵活调整资产配置比例时，不能完全抵御市场整体下跌风险，基金净值表现因此可能受到影响。本基金管理人将发挥专业研究优势，加强对市场、上市公司基本面和固定收益类产品的深入研究，持续优化组合配置，以控制特定风险。此外，由于本基金还可以投资其他品种，这些品种的价格也可能因市场中的各类变化而出现一定幅度的波动，产生特定的风险，并影响到整体基金的投资收益。

2、本基金可投资股指期货，股指期货采用保证金交易制度，由于保证金交易具有杠杆性，当出现不利行情时，股价指数微小的变动就可能会使投资人权益遭受较大损失。股指期货采用每日无负债结算制度，如果没有在规定的时间内补足保证金，按规定将被强制平仓，可能给投资带来重大损失。

3、本基金开放期可能出现巨额赎回，导致基金资产变现困难，进而出现延缓支付赎回款项的风险。

## （七）其他风险

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

2、因技术因素而产生的风险，如计算机系统不可靠产生的风险；

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

4、因人为因素而产生的风险，如内幕交易、欺诈行为等产生的风险；

5、对主要业务人员如基金经理的依赖可能产生的风险；

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

7、其他意外导致的风险。

## 十七、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表决通过之日起生效，自决议生效后两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、在基金财产清算小组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应依照《基金合同》和本托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

3、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。

4、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。

#### 5、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。

6、基金财产清算的期限为 6 个月。

#### (四) 清算费用

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

#### (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。



## 十八、基金合同的内容摘要

### 一、基金合同当事人及权利义务

#### （一）基金管理人

名称：东兴证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街5号（新盛大厦）12、15层

法定代表人：魏庆华

成立日期：2008年5月28日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监机构字【2007】53号

组织形式：股份有限公司

注册资本：275796.0657万元人民币

存续期限：持续经营

联系电话：010-57307309

#### （二）基金托管人

名称：中国工商银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街55号（100140）

法定代表人：陈四清

成立时间：1984年1月1日

批准设立机关和批准设立文号：国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》（国发[1983]146号）

注册资本：人民币34,932,123.46万元

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会和中国人民银行证监基字【1998】3号

#### （三）基金份额持有人

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

#### （四）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）依法募集基金；
- （2）自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
- （3）依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- （4）销售基金份额；
- （5）按照规定召集基金份额持有人大会；
- （6）依据《基金合同》及有关法律、法规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律、法规规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- （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，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）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；
- （14）选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商、期货经纪机构或其他为基金提供服务的外部机构；
- （15）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、转换和非交易过户的业务规则；
- （16）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）依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

（2）办理基金备案手续；

（3）自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、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；

（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。

(五) 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》、《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和证券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；

(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》及《托管协议》的规定进行；如果基金管理人未执行《基金合同》及《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) 从基金管理人或其委托的登记机构处接受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》及《托管协议》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。

(六) 基金份额持有人的权利与义务

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。若将来法律法规对基金份额持有人大会另有规定的，以届时有效的法律法规为准。

本基金未设立基金份额持有人大会日常机构。

（一）召开事由

1、除法律法规、中国证监会另有规定外，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》；
- （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）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；
- （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、在不违背法律法规规定和基金合同约定且对现有基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

- （1）法律法规要求增加的基金费用的收取；



(2) 基金管理人、登记机构、代销机构在法律法规规定或中国证监会许可的范围内调整有关基金认购、申购、赎回、转换、收益分配、非交易过户、转托管等业务的规则；

(3) 于中国证监会许可的范围内推出新业务或服务；

(4) 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、调低赎回费率或在不影响现有投资者利益的前提下变更收费方式；

(5) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；

(6) 增加、减少、调整本基金的份额类别设置；

(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) 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、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、通讯开会方式以及法律法规或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50%（含50%）。

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）本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的50%（含50%）；

（4）上述第（3）项中直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面意见的

代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并与基金登记注册机构记录相符；

（5）会议通知公布前报中国证监会备案。

### 3、重新召集基金份额持有人大会的条件

如果参加基金份额持有人大会的持有人的基金份额低于在权益登记日基金总份额的50%，则召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月后、六个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应有代表三分之一以上（含三分之一）基金份额的持有人或其代理人参加，方可召开。

4、在不与法律法规冲突的前提下，基金份额持有人大会可通过网络、电话或其他方式召开，基金份额持有人可以采用书面、网络、电话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。

5、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、电话或其他方式，具体方式在会议通知中列明。

## （五）议事内容与程序

### 1、议事内容及提案权

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

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

### 2、议事程序

#### （1）现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权

代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的 50% 以上（含 50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

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

## （2）通讯开会

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

## （六）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

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

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、提前终止《基金合同》、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异议，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或法律法规增加新的持有人大会机制的，基金管理人提前公告后，可直接对本部分内容进行修改、调整或补充，无需召开基金份额持有人大会审议。

### 三、基金收益与分配

#### （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，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 30%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为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；选择采取红利再投资形式的，分红资金将按红利发放日的基金份额净值转成相应的基金份额，红利再投资的份额免收申购费。如投资者在不同销售机构选择的分红方式不同，则登记机构将以投资者在各销售机构最后一次选择的分红方式为准；

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

6、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 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者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金份额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《业务规则》执行。

### 四、基金费用

#### （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、仲裁费和诉讼费；
- 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、基金的证券、期货账户开户费用、账户维护费用
- 9、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 1.5% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

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，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月前 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、公休假等，支付日期顺延。

## 2、基金托管人的托管费

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月前 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。

上述“一、基金费用的种类中第 3—9 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）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

#### 五、基金财产的投资方向和投资限制

##### （一）投资目标

本基金通过数量化的方法进行积极的组合管理与风险控制，力争实现超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。

##### （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（包括中小板、创业板和其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、地方政府债、企业债券、公司债券、短期融资券、超短期融资券、中期票据、次级债、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换公司债券等）、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、权证、资产支持证券、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）。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。

本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%；在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，每个交易日日终现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。

##### （三）投资限制

###### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

- （1）本基金股票投资占基金资产的比例范围为 0-95%；
- （2）本基金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，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、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%；

（5）本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 15%。本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 30%；

（6）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的 15%。因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前述所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

（7）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%；

（8）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%；

（9）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%；

（10）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%；

（11）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；

（12）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；

（13）基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

（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%，债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

（15）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；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%；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；

（16）本基金持有一家公司发行的流通受限证券，其市值不得超过基金资产净值的2%；本基金持有的所有流通受限证券，其市值不得超过该基金资产净值的10%；经基金管理人和托管人协商，可对以上比例进行调整；

（17）本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

（18）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%；

（19）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%；

（20）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%；

（21）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）、（6）、（11）、（17）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不符合上述规定的投资比例的，基金管理人应当在十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。

如果法律法规或监管部门对上述投资组合比例限制进行变更的，在履行适当程序后，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消或调整上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按调整后的规定执行。经与基金托管人协商一致，在履行适当程序后，基金管理人可依据法律法规或监管部门规定直接对基金合同进行变更，该变更无须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，应当符合本基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，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。

法律法规或监管部门取消或调整上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资按照取消或调整后的规定执行。

## 六、基金资产净值的计算方法及公告方式

### （一）估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券、期货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、权证、债券、资产支持证券、股指期货合约和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

### （三）估值方法

#### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

（1）交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未

发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值；

（2）交易所上市实行净价交易的债券按估值日第三方估值机构提供的相应品种的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值；

（3）交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全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或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价减去债券收盘价或估值全价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值；

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

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

（2）首次公开发行未上市的股票和权证，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，以第三方估值机构提供的价格数据估值。

4、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。

5、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。

6、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

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

8、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。

#### （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。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本基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将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。

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。

## 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，并报中国证监会备案。

(3) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

#### (六) 暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券/期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

3、当前一估值日基金资产净值 50% 以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，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；

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) 特殊情形的处理

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

2、由于证券、期货交易所及其登记结算公司发送的数据错误，或由于不可抗力等原因，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可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

## 七、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表决通过之日起生效，自决议生效后两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、在基金财产清算小组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应依照《基金合同》和本托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

3、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。

4、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。

5、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。

6、基金财产清算的期限为 6 个月。

(四) 清算费用

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

(五) 基金财产清算剩余资产的分配

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

(六) 基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经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、争议的处理和适用的法律

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，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会，根据该会

当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京市，仲裁裁决是终局的并对各方当事人均有约束力，除非仲裁裁决另有规定，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。

#### 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。

## 十九、基金托管协议的内容摘要

### 一、基金托管协议当事人

#### （一）基金管理人

名称：东兴证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街5号（新盛大厦）12、15层

法定代表人：魏庆华

设立日期：2008年5月28日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监机构字【2007】53号

组织形式：股份有限公司

注册资本：275796.0657万元人民币

存续期限：持续经营

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；证券资产管理；融资融券；证券投资基金销售；代销金融产品；公开募集证券投资基金管理业务；保险兼业代理（企业依法自主选择经营项目，开展经营活动；依法须经批准的项目，经相关部门批准后依批准的内容开展经营活动；不得从事本市产业政策禁止和限制类项目的经营活动。）

#### （二）基金托管人

名称：中国工商银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街55号（100140）

法定代表人：陈四清

成立时间：1984年1月1日

组织形式：股份有限公司

批准设立机关和设立文号：国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》（国发[1983]146号）

注册资本：人民币34,932,123.46万元

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）基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权

1、基金托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定，对下述基金投资范围、投资对象进行监督。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板和其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、地方政府债、企业债券、公司债券、短期融资券、超短期融资券、中期票据、次级债、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换公司债券等）、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、权证、资产支持证券、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）。

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。

本基金股票资产的投资比例占基金资产的0-95%；在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，每个交易日日终现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。

本基金不得投资于相关法律、法规、部门规章及《基金合同》禁止投资的投资工具。

2、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投融资比例进行监督：

（1）本基金股票投资占基金资产的比例范围为0-95%；

（2）本基金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，保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、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）本基金管理人管理且由基金托管人托管的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的10%；

（5）本基金管理人管理且由本基金托管人托管的全部开放式基金持有一家公司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%。本基金管理人管理且由本基金托管人托管的全部投资组合持有一家公司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%；

（6）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的 15%。

（7）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%；

（8）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%；

（9）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%；

（10）本基金管理人管理且由基金托管人托管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%；

（11）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；

（12）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；

（13）基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

（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%，债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

（15）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；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%；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；

（16）本基金持有一家公司发行的流通受限证券，其市值不得超过基金资产净值的 2%；本基金持有的所有流通受限证券，其市值不得超过该基金资产净值的 10%；经基金管理人和托管人协商，可对以上比例进行调整；

（17）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%；

（18）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%；

（19）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%。

除上述第（2）、（6）、（11）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不符合上述规定的投资比例的，基金管理人应当在十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另有规定的，从其规定。

如果法律法规或监管部门对上述投资组合比例限制进行变更的，在履行适当程序后，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消或调整上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按调整后的规定执行。经与基金托管人协商一致，在履行适当程序后，基金管理人可依据法律法规或监管部门规定直接对基金合同进行变更，该变更无须召开基金份额持有人大会审议。

3、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述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）向基金管理人、基金托管人出资；

法律法规或监管部门取消或调整上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资按照取消或调整后的规定执行。

4、基金托管人依据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定对于基金关联投资限制进行监督。



基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有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。

如果基金托管人在运作中严格遵循了监督流程，基金管理人仍违规进行关联交易，并造成基金资产损失的，由基金管理人承担责任。

5、基金托管人依据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。

(1) 基金托管人按以下方式对基金管理人参与银行间市场交易的交易对手资信风险控制措施进行监督。

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

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

(2) 基金托管人对于基金管理人参与银行间市场交易的交易方式的控制

基金管理人在银行间市场进行现券买卖和回购交易时，需按交易对手名单中约定的该交易对手所适用的交易结算方式进行交易。如果基金托管人发现基金管理人没有按照事先约定的交易方式进行交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人与交易对手重新确定交易方式，经提醒后仍未改正时造成基金资产损失的，基金托管人不承担责任。

(3) 基金管理人参与银行间市场交易的核心交易对手为中国工商银行、中国银行、中国建设银行、中国农业银行和交通银行，基金管理人在通知基金托管人后，可以根据当时的市场情况调整核心交易对手名单。基金管理人有责任控制交易对手的资信风险，在与核心交易对手以外的交易对手进行交易时，由于交易对手资信风险引起的损失先由基金管理人承担，其后有权要求相关责任人进行赔偿。基金托管人的监督责任仅限于根据已提供的名单，审核交易对手是否在名单内列明。

#### 6、基金托管人对基金管理人选择存款银行进行监督。

本基金投资银行存款的信用风险主要包括存款银行的信用等级、存款银行的支付能力等涉及到存款银行选择方面的风险。本基金核心存款银行名单为中国工商银行、中国银行、中国建设银行、中国农业银行和交通银行，本基金投资除核心存款银行以外的银行存款出现由于存款银行信用风险而造成的损失时，先由基金管理人负责赔偿，之后有权要求相关责任人进行赔偿。基金管理人在通知基金托管人后，可以根据当时的市场情况对于核心存款银行名单进行调整。基金托管人的监督责任仅限于根据已提供的名单，审核核心存款银行是否在名单内列明。

#### 7、基金托管人对基金投资流通受限证券的监督

(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) 基金管理人应在基金首次投资流通受限证券前，向基金托管人提供经基金管理人董事会批准的有关基金投资流通受限证券的投资决策流程、风险控制制度。基金投资非公开发行股票，基金管理人还应提供基金管理人董事会批准的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。

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

（4）基金投资流通受限证券前，基金管理人应向基金托管人提供符合法律法规要求的有关书面信息，包括但不限于拟发行证券主体的中国证监会批准文件、发行证券数量、发行价格、锁定期，基金拟认购的数量、价格、总成本、总成本占基金资产净值的比例、已持有流通受限证券市值占资产净值的比例、资金划付时间等。基金管理人应保证上述信息的真实、完整，并应至少于拟执行投资指令前两个工作日将上述信息书面发至基金托管人，保证基金托管人有足够的时间进行审核。

（5）基金托管人应按照《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》规定，对基金管理人是否遵守法律法规进行监督，并审核基金管理人提供的有关书面信息。基金托管人认为上述资料可能导致基金出现风险的，有权要求基金管理人在投资流通受限证券前就该风险的消除或防范措施进行补充书面说明，并保留查看基金管理人风险管理部门就基金投资流通受限证券出具的风险评估报告等备查资料的权利。否则，基金托管人有权拒绝执行有关指令。因拒绝执行该指令造成基金财产损失的，基金托管人不承担任何责任，并有权报告中国证监会。

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

（二）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。

（三）基金托管人发现基金管理人的投资运作及其他运作违反《基金法》、《基金合同》、基金托管协议有关规定时，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，进行解释或举证。

在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。基金托管人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。

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，必须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。

基金托管人发现基金管理人重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

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

### 三、基金管理人对于基金托管人的业务核查

基金管理人对于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、证券账户和期货账户等投资所需账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、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。

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、无故未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、《基金合同》、本托管协议及其他有关规定时，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确认并以书面形式向基金管理人发出回函。在限期内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正，并予协助配合。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。基金管理人对于基金托管人赔偿基金因此所遭受的损失。

基金管理人发现基金托管人重大违规行为，应立即报告中国证监会和银行业监督管理机构，同时通知基金托管人限期纠正。

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。

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

#### 四、基金财产的保管

##### （一）基金财产保管的原则

- 1、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。
- 2、基金托管人应安全保管基金财产。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、期货账户等投资所需的其他账户。
- 4、基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，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、对于因基金认（申）购、基金投资过程中产生的应收财产，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托管人处的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失，基金托管人对此不承担责任。

##### （二）募集资金的验证

募集期内销售机构按销售与服务代理协议的约定，将认购资金划入基金管理人在具有托管资格的商业银行开设的基金认购专户。该账户由基金管理人开立并管理。基金募集期满，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》等有关规定后，由基金管理人聘请具有从事证券业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的2名以上（含2名）中国注册会计师签字有效。验资完成，基金管理人应将募集的属于本基金财产的全部资金划入基金托管人为基金开立的资产托管专户中，基金托管人在收到资金当日出具确认文件。

若基金募集期限届满，未能达到《基金合同》生效的条件，由基金管理人按规定办理退款事宜。

### （三）基金的银行账户的开立和管理

基金托管人以基金托管人的名义在其营业机构开设资产托管专户，保管基金的银行存款。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，均需通过基金托管人的资产托管专户进行。

资产托管专户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立其他任何银行账户；亦不得使用基金的任何银行账户进行本基金业务以外的活动。

资产托管专户的管理应符合《人民币银行结算账户管理办法》、《现金管理暂行条例》、《人民币利率管理规定》、《利率管理暂行规定》、《支付结算办法》以及银行业监督管理机构的其他规定。

### （四）基金证券账户与证券交易资金账户的开设和管理

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

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上海分公司/深圳分公司开立基金证券交易资金账户，用于证券清算。

基金证券账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借和未经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。

### （五）债券托管账户的开立和管理

1、《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开设银行间债券市场债券托管自营账户，并由基金托管人负责基金的债券的后台匹配及资金的清算。

2、基金管理人和基金托管人应一起负责为基金对外签订全国银行间债券市场回购主协议，正本由基金托管人保管，基金管理人保存副本。

### （六）其他账户的开设和管理

在本托管协议订立日之后，本基金被允许从事符合法律法规规定和《基金合同》约定的其他投资品种的投资业务时，如果涉及相关账户的开设和使用，由基金管理人协助托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定，开立有关账户。该账户按有关规则使用并管理。

### （七）基金财产投资的有关实物证券、银行定期存款存单等有价凭证的保管

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的保管库；其中实物证券也可存入中央国债登记结算有限责任公司或中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司或票据营业中心的代保管库。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。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。基金托管人对基金托管人以外机构实际有效控制或保管的证券不承担保管责任。

#### （八）与基金财产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同的原件分别应由基金托管人、基金管理人保管。除本协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时，应保证基金一方持有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人在合同签署后5个工作日内通过专人送达、挂号邮寄等安全方式将合同原件送达基金托管人处。合同原件应存放于基金管理人和基金托管人各自文件保管部门15年以上。

### 五、基金资产净值计算与复核

#### （一）基金资产净值的计算

##### 1、基金资产净值的计算、复核的时间和程序

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该计算日基金总份额后的数值。基金份额净值的计算保留到小数点后4位，小数点后第5位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

基金管理人应每工作日对基金资产估值。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工作日交易结束后计算当日的基金份额资产净值并以双方认可的方式发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核后以双方认可的方式发送给基金管理人，由基金管理人对外予以公布。

根据《基金法》，基金管理人计算并公告基金资产净值，基金托管人复核、审查基金管理人计算的基金资产净值。因此，本基金的会计责任方是基金管理人，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。法律

法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

## （二）基金资产估值方法

### 1、估值对象

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

### 2、估值方法

本基金的估值方法为：

#### （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，确定公允价值；

②交易所上市实行净价交易的债券按估值日第三方估值机构提供的相应品种的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值；

③交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全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或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价减去债券收盘价或估值全价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值；

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

#### （2）处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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



②首次公开发行未上市的股票和权证，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，以第三方估值机构提供的价格数据估值。

(4) 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。

(5) 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。

(6) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

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

(8) 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。

### (三) 估值差错处理

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。

## 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，并报中国证监会备案。

（3）前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

#### （四）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，应按照相关各方约定的同一记账方法和会计处理原则，分别独立地设置、登录和保管本基金的全套账册，对相关各方各自的账册定期进行核对，互相监督，以保证基金资产的安全。若双方对会计处理方法存在分歧，应以基金管理人的处理方法为准。

经对账发现相关各方的账目存在不符的，基金管理人和基金托管人必须及时查明原因并纠正，保证相关各方平行登录的账册记录完全相符。若当日核对不符，暂时无法查找到错账的原因而影响到基金资产净值的计算和公告的，以基金管理人的账册为准。

#### （五）基金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。

在《基金合同》生效后每六个月结束之日起45日内，基金管理人对招募说明书更新一次并登载在网站上，并将更新后的招募说明书摘要登载在指定媒介上。基金管理人在每个季度结束之日起15个工作日内完成季度报告编制并公告；在会计年度半年终了后60日内完成半年报告编制并公告；在会计年度结束后90日内完成年度报告编制并公告。

基金管理人在5个工作日内完成月度报告，在月度报告完成当日，对报告加盖公章后，以加密传真方式将有关报告提供基金托管人复核；基金托管人在3个工作日内进行复核，并将复核结果及时书面通知基金管理人。基金管理人在7个工作日内完成季度报告，在季度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到后7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30日内完成半年度报告，在半年报完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到后30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45日内完成年度报告，在年度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到后45日内复核，并将复核结果书面通知基金管理人。

基金托管人在复核过程中，发现相关各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，调整以相关各方认可的账务处理方式为准。核对无误后，基金托管人在基金管理人提供的报告上加盖业务印鉴或者出具加盖托管业务部门公章的复核意见书，相关各方各自留存一份。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。

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

基金定期报告应当在公开披露的第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。

## 六、基金份额持有人名册的登记与保管

基金管理人和基金托管人须分别妥善保管的基金份额持有人名册，包括《基金合同》生效日、《基金合同》终止日、基金份额持有人大会权利登记日、每年6月30日、12月31日的基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容必须包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册由基金的基金注册登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，基金管理人和基金托管人应按照目前相关规则分别保管基金份额持有人名册。保管方式可以采用电子或文档的形式。保存期限自基金账户销户之日起不得少于二十年。

基金管理人应当及时向基金托管人提交下列日期的基金份额持有人名册：

《基金合同》生效日、《基金合同》终止日、基金份额持有人大会权利登记日、每年6月30日、每年12月31日的基金份额持有人名册。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。其中每年12月31日的基金份额持有人名册应于下月前十个工作日内提交；《基金合同》生效日、《基金合同》终止日等涉及到基金重要事项日期的基金份额持有人名册应于发生日后十个工作日内提交。

基金托管人以电子版形式妥善保管基金份额持有人名册，并定期刻成光盘备份，保存期限为20年。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。

## 七、争议解决方式

相关各方当事人同意，因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议，除经友好协商可以解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点在北京，仲裁裁决是终局性的并对相关各方均有约束力，仲裁费、律师费用由败诉方承担。

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

本协议受中国法律管辖。

## 八、托管协议的修改与终止

### （一）托管协议的变更与终止

#### 1、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报中国证监会备案后生效。

#### 2、基金托管协议终止的情形

发生以下情况，本托管协议终止：

- （1）《基金合同》终止；
- （2）基金托管人解散、依法被撤销、破产或有其他基金托管人接管基金资产；
- （3）基金管理人解散、依法被撤销、破产或有其他基金管理人接管基金管理权；
- （4）发生法律法规或《基金合同》规定的终止事项。

### （二）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、在基金财产清算小组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应依照《基金合同》和本托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

3、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。

4、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。

5、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) 将清算报告报告中国证监会备案并公告；

(7) 对基金剩余财产进行分配；

6、基金财产清算的期限为6个月。

7、清算费用

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

8、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。

### **(三) 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。

**（四）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。

## 二十、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。以下是主要的服务内容，基金管理人将根据基金份额持有人的需要和市场的变化，增加或变更服务项目。主要服务内容如下：

### （一）基金份额持有人投资交易确认服务

登记机构保留基金份额持有人名册上列明的所有基金份额持有人的基金投资记录。

基金管理人直销中心应根据在基金管理人直销中心进行交易的投资者的要求提交成交确认单。

基金代销机构应根据在其网点进行交易的投资者的要求提交成交确认单。

### （二）基金份额持有人交易记录查询服务

基金份额持有人可通过基金管理人的客户服务中心查询历史交易记录。

### （三）基金份额持有人交易对账单寄送服务

基金份额持有人交易对账单包括季度对账单与年度对账单。季度对账单在每季度结束后 10 个工作日内向本季度有交易的投资人寄送；年度对账单在每年度结束后 20 个工作日内向所有持有本基金份额或本年度内有交易的投资人寄送。

### （四）信息查询

基金管理人为每个基金账户提供一个基金账户查询密码，基金份额持有人可以凭基金账号和该密码通过基金管理人的客户服务热线查询客户基金账户信息；同时可以修改通信地址、电话、电子邮件等信息；另外还可登录本基金管理人网站查询基金申购与赎回的交易情况、账户余额、基金产品信息。

### （五）投诉受理

投资者可以拨打东兴证券股份有限公司客户服务中心电话 95309，或客服信箱：[dxfund@dxzq.net.cn](mailto:dxfund@dxzq.net.cn) 投诉直销机构和代销机构的人员和服务。



## 二十一、其他应披露事项

一、本基金的其他应披露事项将严格按照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》等相关法律法规规定的内容与格式进行披露，并在指定媒介上公告。

二、本招募说明书将按中国证监会有关规定定期进行更新。招募说明书解释与基金合同不一致时，以基金合同为准。

三、从上次《招募说明书》截止日 2018 年 10 月 27 日到本次《招募说明书（更新）》截止日 2019 年 4 月 27 日之间的信息披露事项。

1、东兴量化多策略灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）

2018-12-11

2、东兴量化多策略灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（摘要）

2018-12-11

3、东兴证券股份有限公司关于参加部分银行渠道费率优惠的公告

2018-12-29

4、东兴量化多策略灵活配置混合型证券投资基金 2018 年度最后一个市场交易日净值公告 2019-01-02

5、东兴量化多策略灵活配置混合型证券投资基金 2018 年第四季度报告

2019-01-19

6、东兴量化多策略灵活配置混合型证券投资基金 2018 年年度报告

2019-03-29

7、东兴量化多策略灵活配置混合型证券投资基金 2018 年年度报告摘要

2019-03-29

8、东兴量化多策略灵活配置混合型证券投资基金 2019 年第一季度报告

2019-04-22

## 二十二、招募说明书存放及查阅方式

招募说明书分别置备于基金管理人、基金托管人和基金份额发售机构的住所，投资者可在办公时间查阅、复制；投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。对投资者按此种方式所获得的文件及其复印件，基金管理人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

投资者还可以直接登录基金管理人的网站(<http://www.dxzq.net>)查阅和下载招募说明书。

## 二十三、备查文件

（一）本基金备查文件包括下列文件：

- 1、中国证监会注册东兴量化多策略灵活配置混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《东兴量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《东兴量化多策略灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《东兴量化多策略灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、关于申请募集东兴量化多策略灵活配置混合型证券投资基金之法律意见书；
- 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。

（二）备查文件的存放地点和投资者查阅方式

- 1、存放地点：基金合同、托管协议存放在基金管理人和基金托管人处；其余备查文件存放在基金管理人处。
- 2、查阅方式：投资者可在营业时间免费到存放地点查阅，也可按工本费购买复印件。

东兴证券股份有限公司

2019 年 6 月 11 日