

# 华宝资源优选混合型证券投资基金 招募说明书（更新）

2019年第2号

基金管理人:华宝基金管理有限公司

基金托管人:中国银行股份有限公司

**【重要提示】**

本基金经中国证券监督管理委员会证监许可〔2012〕685号的核准，进行募集。

基金管理人保证《华宝资源优选混合型证券投资基金招募说明书》(以下简称“招募说明书”或“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核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险，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，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险、本基金的特有风险等其他风险。本基金资产投资于科创板股票，会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于市场风险、流动性风险、信用风险、集中度风险、系统性风险、政策风险等。基金可根据投资策略需要或市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于科创板股票或选择不将基金资产投资于科创板股票，基金资产并非必然投资于科创板股票。

本基金是一只主动投资的混合型基金，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。

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》及《基金合同》等信息披露文件，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，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。

基金的过往业绩并不预示其未来表现，基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证投资于本基金一定盈利，也不保证最低收益。

投资有风险，投资者申购本基金时应认真阅读本招募说明书。

基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金

运营状况与基金净值变化导致的投资风险，由投资者自行承担。

本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的 50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过 50%的除外。

本招募说明书中有关基金经理变更事项的内容截止日为 2019 年 9 月 5 日；有关财务数据和净值表现数据截止日为 2019 年 6 月 30 日，财务数据未经审计；其他内容截止日为 2019 年 8 月 21 日。

## 目 录

|                           |     |
|---------------------------|-----|
| 一、绪 言.....                | 1   |
| 二、释 义.....                | 2   |
| 三、基金管理人.....              | 6   |
| 四、基金托管人.....              | 13  |
| 五、相关服务机构.....             | 15  |
| 六、基金的募集.....              | 35  |
| 七、基金合同的生效.....            | 36  |
| 八、基金份额的申购与赎回.....         | 37  |
| 九、与基金管理人管理的其他基金转换.....    | 46  |
| 十、基金的投资.....              | 49  |
| 十一、基金的业绩.....             | 62  |
| 十二、基金财产.....              | 63  |
| 十三、基金资产估值.....            | 64  |
| 十四、基金收益与分配.....           | 68  |
| 十五、基金的费用与税收.....          | 69  |
| 十六、基金的会计与审计.....          | 71  |
| 十七、基金的信息披露.....           | 72  |
| 十八、风险揭示.....              | 77  |
| 十九、基金合同的变更、终止与基金财产清算..... | 83  |
| 二十、基金合同的内容摘要.....         | 85  |
| 二十一、基金托管协议内容摘要.....       | 97  |
| 二十二、对基金份额持有人的服务.....      | 105 |
| 二十三、其他应披露事项.....          | 108 |
| 二十四、招募说明书存放及查阅方式.....     | 109 |
| 二十五、备查文件.....             | 110 |

## 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》”)、《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》”)、《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“《流动性规定》”)、其他有关规定及《华宝资源优选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华宝资源优选混合型证券投资基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资人投资决策有关的必要事项，投资人在作出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

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资料申请募集的。本招募说明书由本基金管理人解释。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出任何解释或者说明。

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

## 二、释 义

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：       | 指华宝资源优选混合型证券投资基金；   |
| 基金合同：         | 指《华宝资源优选混合型证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充；   |
| 招募说明书或本招募说明书： | 指《华宝资源优选混合型证券投资基金招募说明书》及其定期更新；  |
| 发售公告：         | 指《华宝资源优选混合型证券投资基金基金份额发售公告》；   |
| 托管协议          | 指《华宝资源优选混合型证券投资基金托管协议》及其任何有效修订和补充；  |
| 中国证监会：        | 指中国证券监督管理委员会；   |
| 中国银监会：        | 指中国银行保险监督管理委员会；   |
| 《基金法》：        | 指《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《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《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；  |
| 《信息披露办法》：     | 指《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；  |
| 《流动性规定》：      | 指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10 月 1 日起实施的《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；   |
| 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； |
| 元：            | 指人民币元；  |
| 基金管理人：        | 指华宝基金管理有限公司；  |

|            |  |
|------------|--|
| 基金托管人：     | 指中国银行股份有限公司；   |
| 注册登记业务：    | 指本基金登记、存管、清算和交收业务，具体内容包括投资者基金账户管理、基金份额注册登记、清算及基金交易确认、发放红利、建立并保管基金份额持有人名册、办理非交易过户业务等；   |
| 注册登记机构：    | 指办理本基金注册登记业务的机构。本基金的注册登记机构为华宝基金管理有限公司或接受华宝基金管理有限公司委托代为办理本基金注册登记业务的机构；                  |
| 投资者：       | 指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者；                                     |
| 个人投资者：     | 指年满 18 周岁，合法持有现时有效的中华人民共和国居民身份证、军人证件等有效身份证件的中国公民，以及依据有关法律法规规定或中国证监会批准可投资于证券投资基金的其他自然人； |
| 机构投资者：     | 指在中国境内合法注册登记或经有权政府部门批准设立和有效存续并依法可以投资于证券投资基金的企业法人、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；                   |
| 基金份额持有人大会： | 指按照基金合同第九部分之规定召集、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；   |
| 基金募集期：     | 指基金合同和招募说明书中载明，并经中国证监会核准的基金份额募集期限，自基金份额发售之日起最长不超过 3 个月；                                |
| 基金合同生效日：   | 指 2012 年 8 月 21 日；   |
| 存续期：       | 指基金合同生效至终止之间的不定期期限；  |
| 工作日：       | 指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日；  |
| 认购：        | 指在基金募集期内，投资者按照基金合同和招募说明书的规定申请购买本基金基金份额的行为；   |
| 申购：        | 指在基金合同生效后的存续期间，投资者按基金合同和招募说明书的规定申请购买本基金基金份额的行为；  |
| 赎回：        | 指在基金合同生效后的存续期间，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基金管理人将其持有                                      |

|           |  |
|-----------|--|
|           | 基金份额兑换成现金的行为；  |
| 基金转换：     | 指基金份额持有人按基金管理人规定的条件，申请将其持有的基金管理人管理的某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的、且由同一注册登记机构办理登记业务的其他基金的基金份额的行为； |
| 转托管：      | 指基金份额持有人将其基金账户内的某一基金的基金份额从一个销售机构托管到另一销售机构的行为；  |
| 指令：       | 指基金管理人在运用基金财产进行投资时，向基金托管人发出的资金划拨及实物券调拨等指令；   |
| 代销机构：     | 指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并接受基金管理人委托，代为办理基金认购、申购、赎回和其他基金业务的机构；                  |
| 销售机构：     | 指基金管理人及本基金代销机构；  |
| 基金销售网点：   | 指基金管理人的直销柜台及基金代销机构的代销网点；   |
| 基金网上交易系统： | 指直销机构的网上直销系统及代销机构的网上交易系统；  |
| 指定媒介：     | 指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊和互联网网站或其它媒体；   |
| 基金账户：     | 指注册登记机构为基金投资者开立的记录其持有的由该注册登记机构办理注册登记的基金份额余额及其变动情况的账户；                                  |
| 交易账户：     | 指销售机构为投资者开立的记录投资者通过该销售机构办理认购、申购、赎回、转换及转托管等业务而引起的基金份额的变动及结余情况的账户；                       |
| 开放日：      | 指为投资者办理基金申购、赎回等业务的工作日；   |
| T 日：      | 指投资者向销售机构提出申购、赎回或其他业务申请的开放日；   |
| T+n 日：    | 指 T 日后（不包括 T 日）第 n 个工作日，n 指自然数；  |
| 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；  |
| 基金资产总值：   | 指基金持有的各类有价证券、银行存款本息、应收款项以及以其他资产等形式存在的基金资产的价值总和；  |
| 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    | 指以计算日基金资产净值除以计算日基金份额余额所得   |



的单位基金份额的价值；

基金资产估值：指计算、评估基金财产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程；

法律法规：指中华人民共和国现行有效的法律、行政法规、司法解释、地方法规、地方规章、部门规章及其他规范性文件以及对于该等法律法规的不时修改和补充；

### 三、 基金管理人

#### （一）基金管理人概况

基金管理人：华宝基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼

法定代表人：孔祥清

总经理：HUANG Xiaoyi Helen（黄小薏）

成立日期：2003 年 3 月 7 日

注册资本：1.5 亿元

电话：021-38505888

联系人：章希

股权结构：中方股东华宝信托有限责任公司持有 51% 的股份，外方股东 Warburg Pincus Asset Management, L.P. 持有 49% 的股份。

#### （二）主要人员情况

##### 1、董事会信息

孔祥清先生，董事长，硕士，高级会计师。曾任宝钢计财部资金处主办、主管、副处长，宝钢集团财务有限公司总经理，华宝投资有限公司副总经理，中国宝武钢铁集团有限公司产业金融党工委副书记、纪工委书记、工会工委主席。现任华宝基金管理有限公司董事长、党委书记，法兴华宝汽车租赁（上海）有限公司董事长，华宝信托有限责任公司董事，华宝都鼎（上海）融资租赁有限公司董事长，中国太平洋保险（集团）股份有限公司董事。

HUANG Xiaoyi Helen（黄小薏）女士，董事，硕士。曾任加拿大 TD Securities 公司金融分析师，Acthop 投资公司财务总监。2003 年 5 月加入华宝基金管理有限公司，先后担任公司营运总监、董事会秘书、副总经理，现任华宝基金管理有限公司总经理。

魏臻先生，董事。曾任麦肯锡（上海）咨询公司分析师，摩根斯坦利亚洲公司分析师，香港人人媒体总监。现任华平投资集团董事总经理、神州租车控股公司董事、九月教育集团董事、中通快递董事。

周朗朗先生，董事，本科。曾任瑞士信贷第一波士顿（加拿大）分析师；花旗银行（香港）投资银行部分析师；现任美国华平集团中国金融行业负责人、董事总经理，华融资产管理股份有

限公司董事，上海灿谷投资管理咨询服务股份有限公司董事。

胡光先生，独立董事，硕士。曾任美国俄亥俄州舒士克曼律师事务所律师、飞利浦电子中国集团法律顾问、上海市邦信阳律师事务所合伙人。现任上海胡光律师事务所主任、首席合伙人。

尉安宁先生，独立董事，博士。曾任宁夏广播电视大学讲师，中国社会科学院经济研究所助理研究员，世界银行农业经济学家，荷兰合作银行东北亚区食品农业研究主管，新希望集团常务副总裁，比利时富通银行中国区 CEO 兼上海分行行长，山东亚太中慧集团董事长。现任上海谷旺投资管理有限公司执行董事兼总经理。

陈志宏先生，独立董事，硕士。曾任毕马威会计师事务所合伙人、普华永道会计师事务所合伙人，苏黎世金融服务集团中国区董事长，华彬国际投资（集团）有限公司高级顾问。

## 2、监事会信息

朱莉丽女士，监事，硕士。曾就职于美林投资银行部、德意志银行投资银行部；现任美国华平集团执行董事。

杨莹女士，监事，本科。曾在三九集团、中国平安保险（集团）股份有限公司、永亨银行（中国）有限公司、中国民生银行、华宝投资有限公司工作，现任华宝信托有限责任公司风险管理部副总经理。

贺桂先先生，监事，本科。曾任华宝信托有限责任公司研究部副总经理；现任华宝基金管理有限公司营运副总监兼北京分公司总经理兼综合管理部总经理。

王波先生，监事，硕士。曾任上海证券报记者；现任华宝基金管理有限公司互金业务总监兼互金策划部总经理。

## 3、总经理及其他高级管理人员

孔祥清先生，董事长，简历同上。

HUANG Xiaoyi Helen（黄小蕙）女士，总经理，简历同上。

向辉先生，副总经理，硕士。曾在武汉长江金融审计事务所任副所长、在长盛基金管理有限公司市场部任职。2002 年加入华宝基金公司参与公司的筹建工作，先后担任公司清算登记部总经理、营运副总监、营运总监，现任华宝基金管理有限公司副总经理。

欧江洪先生，副总经理，本科。曾任宝钢集团财务部主办，宝钢集团成本管理处主管，宝钢集团办公室（董事会办公室）主管/高级秘书，宝钢集团办公厅秘书室主任，华宝投资有限公司总经理助理兼行政人事部总经理、董事会秘书，宝钢金融系统党委组织部部长、党委办公室主任。现任华宝基金管理有限公司副总经理。

李慧勇先生，副总经理，硕士。曾在上海申银万国证券研究所有限公司担任董事总经理/所长助理/研究执行委员会副主任/首席分析师的职务。现任华宝基金管理有限公司副总经理。

刘月华先生，督察长，硕士。曾在冶金工业部、国家冶金工业局、中国证券业协会等单位工作。现任华宝基金管理有限公司督察长。

#### 4、本基金基金经理

蔡目荣，硕士。曾在金信研究、国金证券股份有限公司从事研究工作。2008年6月加入华宝基金管理有限公司，先后担任高级分析师、研究部总经理助理、基金经理助理和交易员等职务，现任国内投资部副总经理。2012年8月起任华宝资源优选混合型证券投资基金基金经理，2015年6月至2017年3月任华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015年11月任华宝多策略增长开放式证券投资基金基金经理，2018年1月起任华宝价值发现混合型证券投资基金基金经理，2018年9月起任华宝绿色主题混合型证券投资基金基金经理，2019年9月起任华宝绿色领先股票型证券投资基金基金经理。

丁靖斐，硕士。曾在华泰证券研究所从事研究工作。2014年12月加入华宝基金管理有限公司，先后担任高级分析师、基金经理助理的职务。2019年9月起任华宝资源优选混合型证券投资基金基金经理。

#### 5、 权益投决会信息

闫旭女士，投资副总监、国内投资部总经理、华宝行业精选混合型证券投资基金基金经理、华宝稳健回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

胡戈游先生，助理投资总监、华宝宝康消费品证券投资基金基金经理、华宝核心优势灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

蔡目荣先生，国内投资部副总经理、华宝多策略增长开放式证券投资基金基金经理、华宝资源优选混合型证券投资基金基金经理、华宝价值发现混合型证券投资基金基金经理、华宝绿色主题混合型证券投资基金基金经理、华宝绿色领先股票型证券投资基金基金经理。

曾豪先生，研究部总经理，华宝先进成长混合型证券投资基金基金经理。

#### 6、上述人员之间不存在近亲属关系。

##### （三）基金管理人职责

基金管理人应严格依法履行下列职责：

1. 依法募集本基金，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. 办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；
9. 召集基金份额持有人大会；
10. 保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
11. 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
12. 中国证监会规定的其他职责。

#### （四）基金管理人承诺

1. 基金管理人将遵守《基金法》、《证券法》等法律法规的相关规定，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违法违规行为的发生。

2. 基金管理人不得从事下列行为：

将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；

不公平地对待其管理的不同基金财产；

利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；

向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；

依照法律、行政法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他行为。

3. 基金经理承诺

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

（2）不利用职务之便为自己、代理人、代表人、受雇人或任何其他第三人牟取不当利益；

（3）不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；

不得以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

#### （五）基金管理人内部控制制度

1、风险管理体系

本基金在运作过程中面临的风险主要包括市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险、

合规性风险、信誉风险和事件风险（如灾难）。

针对上述各种风险，本公司建立了一套完整的风险管理体系，具体包括以下内容：

（1）搭建风险管理环境。具体包括制定风险管理战略、目标，设置相应的组织机构、建立清晰的责任线路和报告渠道、配备适当的人力资源、开发适用的技术支持系统等内容。

（2）识别风险。辨识公司运作和基金管理中存在的风险。

（3）分析风险。检查存在的控制措施，分析风险发生的可能性及其引起的后果并将风险归类。

（4）度量风险。评估风险水平的高低，既有定性的度量手段，也有定量的度量手段。定性的度量是把风险水平划分为若干级别，每一种风险按其发生的可能性与后果的严重程度分别进入相应的级别。定量的方法则是设计一些风险指标，测量其数值的大小。

（5）处理风险。将风险水平与既定的标准相对比，对于那些级别较低、在公司所定标准范围以内的风险，控制相对宽松一点，但仍加以定期监控，以防其超过预定标准；而对较为严重的风险，则制定适当的控制措施；对于一些后果可能极其严重的风险，则除了严格控制以外，还准备了相应的应急处理措施。

（6）监视与检查。对已有的风险管理系统进行实时监视，并定期评价其管理绩效，在必要时结合新的需求加以改变。

（7）报告与咨询。建立风险管理的报告系统，使公司股东、公司董事会、公司高级管理人员及监管部门及时而有效地了解公司风险管理状况，并寻求咨询意见。

## 2、内部控制制度

### （1）内部风险控制原则

**健全性原则。**内部控制机制必须覆盖公司的各项业务、各个部门和各级岗位，并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个环节；

**有效性原则。**通过设置科学清晰的操作流程，结合程序控制，建立合理的内控程序，维护内部控制制度的有效执行；

**独立性原则。**公司必须在精简高效的基础上设立能充分满足公司经营运作需要的部门和岗位，各部门和岗位在职能上保持相对独立性；公司固有财产、各项委托基金财产、其他资产分离运作，独立进行；

**相互制约原则。**内部部门和岗位的设置必须权责分明、相互制约，并通过切实可行的相互制衡措施来消除内部控制中的盲点；

**防火墙原则。**公司基金管理、交易、清算登记、信息技术、研究、市场营销等相关部门，

应当在物理上和制度上适当隔离；对因业务需要必须知悉内幕信息的人员，应制定严格的批准程序和监督防范措施；

成本效益原则。公司应当充分发挥各部门及每位员工的工作积极性，尽量降低经营运作成本，保证以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果；

合法合规性原则。公司内控制度应当符合国家法律、法规、规章制度和各项规定，并在此基础上遵循国际和行业的惯例制订；

全面性原则。内部控制制度必须涵盖公司经营管理的各个环节，并普遍适用于公司每一位员工，不留有制度上的空白或漏洞；

审慎性原则。公司内部控制的核心是风险控制，内部控制制度的制订要以审慎经营、防范和化解风险为出发点；

适时性原则。内部控制制度的制订应当具有前瞻性，并且必须随着公司经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律法规、政策制度等外部环境的改变及时进行相应的修改或完善。

#### （2）内部风险控制的要求和内容

内部风险控制要求不相容职务分离、建立完善的岗位责任制和规范的岗位管理措施、建立完整的信息资料保全系统、建立授权控制制度、建立有效的风险防范系统和快速反应机制。

内部风险控制的内容包括投资管理业务控制、市场管理业务控制、信息披露控制、信息技术系统控制、会计系统控制、档案管理控制、建立保密制度以及内部稽核控制等。

#### （3）督察长制度

公司设督察长，督察长由公司总经理提名，董事会聘任，并应当经全体独立董事同意。督察长的任免须报中国证监会核准。

督察长应当定期或者不定期向全体董事报送工作报告，并在董事会及董事会下设的相关专门委员会定期会议上报告基金及公司运作的合法合规情况及公司内部风险控制情况。督察长发现基金及公司运作中存在问题时，应当及时告知公司总经理和相关业务负责人，提出处理意见和整改建议，并监督整改措施的制定和落实；公司总经理对存在问题不整改或者整改未达到要求的，督察长应当向公司董事会、中国证监会及相关派出机构报告。

#### （4）监察稽核及风险管理制度

监察稽核部和风险管理部依据公司的内部控制制度，在所赋予的权限内，按照所规定的程序和适当的方法，进行公正客观的检查和评价。

监察稽核部和风险管理部负责调查评价公司内控制度的健全性、合理性；负责调查、评价

公司有关部门执行公司各项规章制度的情况；评价各项内控制度执行的有效性，对内控制度的缺失提出补充建议；进行日常风险监控工作；协助评价基金财产风险状况；负责包括基金经理离任审查在内的各项内部审计事务等。

3、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）基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期：1983年10月31日

注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整

法定代表人：刘连舸

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

托管部门信息披露联系人：王永民

传真：(010) 66594942

中国银行客服电话：95566

### （二）基金托管部门及主要人员情况

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

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

### （三）证券投资基金托管情况

截至2019年6月30日，中国银行已托管716只证券投资基金，其中境内基金676只，QDII基金40只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型、FOF等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

### （四）托管业务的内部控制制度

中国银行托管业务部风险管理与控制工作是中国银行全面风险控制工作的组成部分，秉承中国银行风险控制理念，坚持“规范运作、稳健经营”的原则。中国银行托管业务部风险控制工作贯穿业务各环节，通过风险识别与评估、风险控制措施设定及制度建设、内外部检查及审计等措施强化托管业务全员、全面、全程的风险管控。

2007年起，中国银行连续聘请外部会计师事务所开展托管业务内部控制审阅工作。先后获得基于“SAS70”、“AAF01/06”“ISAE3402”和“SSAE16”等国际主流内控审阅准则的无保留意见的审阅报告。2017年，中国银行继续获得了基于“ISAE3402”和“SSAE16”双准则的内部控制审计报告。中国银行托管业务内控制度完善，内控措施严密，能够有效保证托管资产的安全。

#### （五）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

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

## 五、 相关服务机构

### （一）基金份额发售机构

#### 1、直销机构

##### （1）直销柜台

名称：华宝基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼

法定代表人：孔祥清

直销柜台电话：021-38505731、38505732、021-38505888-301 或 302

直销柜台传真：021-50499663、50988055

联系人：章希

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

##### （2）直销 e 网金

投资者可以通过华宝基金管理有限公司网上交易直销 e 网金系统办理本基金的认/申购、赎回、转换等业务，具体交易细则请参阅华宝基金管理有限公司网站公告。网上交易网址：[www.fsfund.com](http://www.fsfund.com)。

### （二）代销机构

#### （1）中国工商银行股份有限公司

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

邮编：100140

法定代表人：陈四清

联系电话：95588

客户服务电话：95588；010-66106114

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

#### （2）中国农业银行股份有限公司

办公地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

邮编：100005

法定代表人：周慕冰

联系电话：95599

客户服务电话：95599

公司网址：www.abchina.com

（3）中国银行股份有限公司

办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号中国银行总行办公大楼

邮编：100818

法定代表人：刘连舸

联系人：陈洪源

联系电话：95566

客户服务电话：95566

公司网址：www.boc.cn

（4）中国建设银行股份有限公司

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

邮编：100033

法定代表人：田国立

联系电话：95533

客户服务电话：95533

公司网址：www.ccb.com

（5）交通银行股份有限公司

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号

邮编：200120

法定代表人：彭纯

联系人：曹榕

联系电话：95559

传真：（021）58408483

客户服务电话：95559

公司网址：www.bankcomm.com

（6）招商银行股份有限公司

办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

邮编：518040

法定代表人：李建红

联系人：邓炯鹏

联系电话：95555

客户服务电话：95555

公司网址：www.cmbchina.com

（7）中国民生银行股份有限公司

办公地址：北京市西城区西绒线胡同 28 号天安国际办公楼

邮编：100031

法定代表人：洪崎

联系人：王志刚

联系电话：95568

传真：010-57092611

客户服务电话：95568

公司网址：www.cmbc.com.cn

（8）渤海银行股份有限公司

办公地址：天津市河东区海河东路 218 号渤海银行大厦

邮编：300012

法定代表人：李伏安

联系人：王星

联系电话：400-888-8811

客户服务电话：95541

公司网址：www.cbhb.com.cn

（9）上海浦东发展银行股份有限公司

办公地址：上海市中山东一路 12 号

邮编：200002

法定代表人：高国富

联系电话：95528

传真：021-61162165

客户服务电话：95528

公司网址：www.spdb.com.cn

（10）深圳众禄基金销售股份有限公司

办公地址：深圳市罗湖区梨园路8号HALO广场4楼

联系电话：400-678-8887

客户服务电话：400-678-8887

公司网址：www.zlfund.cn

（11）深圳前海微众银行股份有限公司

办公地址：广东省深圳市南山区沙河西路1819号深圳湾科技生态园7栋A座

法定代表人：顾敏

客户服务电话：400-999-8800

公司网址：www.webank.com

（12）中信银行股份有限公司

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街9号

邮编：100010

法定代表人：李庆萍

联系人：王晓琳

联系电话：95558

客户服务电话：95558

公司网址：www.citicbank.com

（13）通华财富

（14）上海万得基金销售有限公司

联系电话：400-821-0203

公司网址：www.520fund.com.cn

（15）腾安基金销售（深圳）有限公司

联系电话：95017

公司网址：www.tenganxinxi.com

（16）珠海盈米基金销售有限公司

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼B1201-1203

客户服务电话：020-89629099

公司网址：www.yingmi.cn

（17）北京汇成基金销售有限公司

联系电话：400-619-9059

公司网址：<http://www.hcjijin.com/>

（18）北京百度百盈基金销售有限公司

办公地址：北京市海淀区上地信息路甲9号奎科大厦

联系电话：95055

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

（19）安信证券股份有限公司

办公地址：深圳市福田区深南大道2008号中国凤凰大厦1号楼9层

邮编：518026

法定代表人：王连志

联系人：彭洁联

客户服务电话：95517

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

（20）渤海证券股份有限公司

办公地址：天津市南开区宾水西道8号（奥体中心北侧）

法定代表人：王春峰

联系人：王星

联系电话：400-651-5988

传真：022-28451958

客户服务电话：400-651-5988

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

（21）财通证券股份有限公司

办公地址：浙江省杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心  
201, 501, 502, 1103, 1601-1615, 1701-1716室

法定代表人：沈继宁

联系人：陶志华

客户服务电话：95336 ， 4008696336

公司网址：www.ctsec.com

（22）长城证券股份有限公司

办公地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 16-17 层

邮编：518034

法定代表人：丁益

联系人：王涛

客户服务电话：400-6666-888

公司网址：www.cgws.com

（23）长江证券股份有限公司

办公地址：湖北省武汉市江汉区新华路特 8 号

邮编：430015

法定代表人：李新华

联系人：奚博宇

传真：027-85481900

客户服务电话：95579

公司网址：www.95579.com

（24）北京创金启富投资管理有限公司

办公地址：北京市西城区民丰胡同 31 号 5 号楼 215A

联系人：宋春

客户服务电话：400-6262-818

公司网址：www.5irich.com

（25）上海大智慧基金销售有限公司

办公地址：上海市浦东新区杨高南路 428 号 1 号楼 10-11 层

联系人：裘爱萍

客户服务电话：021-20219931

公司网址：<https://8.gw.com.cn/>

（26）北京蛋卷基金销售有限公司

办公地址：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507



法定代表人：钟斐斐

传真：010-61840699

客户服务电话：4000618518

公司网址：<https://danjuanapp.com/>

（27）德邦证券股份有限公司

办公地址：上海市福山路 500 号城建国际中心 26 楼

法定代表人：武晓春

联系人：刘熠

传真：862168767981

客户服务电话：400-8888-128

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

（28）东北证券股份有限公司

办公地址：长春市生态大街 6666 号

邮编：130118

法定代表人：李福春

联系人：付静雅

传真：0431-85096795

客户服务电话：95360

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

（29）东方证券股份有限公司

办公地址：上海市中山南路 318 号东方国际金融广场 2 号楼 21-29 层

邮编：200010

法定代表人：潘鑫军

联系人：朱琼玉

传真：021-63326729

客户服务电话：95503

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

（30）东海证券股份有限公司

办公地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦

法定代表人：赵俊

联系人：王一彦

传真：021-50498825

客户服务电话：95531；400-8888-588

公司网址：www.longone.com.cn

（31）东吴证券股份有限公司

办公地址：苏州工业园区星阳街5号

邮编：215021

法定代表人：范力

联系人：陆晓

联系电话：400-860-1555

传真：0512-62938527

客户服务电话：95330

公司网址：www.dwzq.com.cn

（32）东兴证券股份有限公司

办公地址：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

联系人：和志鹏

联系电话：400-888-8993

传真：010-66555246

客户服务电话：400-8888-993、95309

公司网址：www.dxzq.net.cn

（33）光大证券股份有限公司

办公地址：上海市静安区新闻路1508号3楼

法定代表人：周健男

联系人：李晓哲

联系电话：95525

传真：021-22169134

客户服务电话：95525

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

（34）广发证券股份有限公司

办公地址：广东省广州市天河北路 183 号大都会广场 43 楼

法定代表人：孙树明

联系人：马梦洁

客户服务电话：95575

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

（35）国都证券股份有限公司

办公地址：北京市东城区东直门内大街 3 号国华投资大厦 9 层

邮编：100007

法定代表人：王少华

联系人：司琪

传真：010-84183311

客户服务电话：400-818-8118

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

（36）国泰君安证券股份有限公司

办公地址：上海市静安区新闻路 669 号博华广场 21 层

法定代表人：杨德红

联系人：钟伟镇

传真：021-38670666

客户服务电话：95521

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

（37）国信证券股份有限公司

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人：何如

联系人：李颖

联系电话：95536

传真：0755-82133952

客户服务电话：95536

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

（38）国元证券股份有限公司

法定代表人：凤良志

联系电话：95578

客户服务电话：4008888777 或 95578

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

（39）海通证券股份有限公司

办公地址：上海广东路 689 号

法定代表人：周杰

联系人：李楠

联系电话：95553

客户服务电话：95553、400—8888—001 或拨打各城市营业网点咨询电话

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

（40）上海好买基金销售有限公司

办公地址：上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903~906 室

客户服务电话：400-700-9665

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

（41）和讯信息科技有限公司

办公地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

客户服务电话：400-920-0022

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

（42）恒泰证券股份有限公司

办公地址：呼和浩特市新城区海拉尔东街满世书香苑办公楼 7 楼

邮编：010010

法定代表人：庞介民

联系人：熊丽

客户服务电话：400-196-6188

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

（43）申万宏源西部证券有限公司

办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室

邮编：830002

法定代表人：李琦

联系人：陈飙

传真：0991-2301927

客户服务电话：400-800-0562

公司网址：www.hysec.com

（44）华安证券股份有限公司

办公地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

邮编：230081

法定代表人：章宏韬

联系人：范超

联系电话：400-809-6518

传真：0551-65161672

客户服务电话：95318

公司网址：www.hazq.com

（45）华宝证券有限责任公司

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 57 楼

邮编：200120

法定代表人：陈林

传真：021-68777822

客户服务电话：400-820-9898

公司网址：www.cnhbstock.com

（46）华福证券有限责任公司

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1088 号招商银行上海大厦 18-19 层

法定代表人：黄金琳

联系人：王虹

联系电话：0591-96326

传真：021-20655196

客户服务电话：95547

公司网址：www.hfzq.com.cn

（47）华泰证券股份有限公司

办公地址：南京市江东中路 288 号

邮编：210019

法定代表人：周易

联系人：胡子豪

传真：021-83387254

客户服务电话：95597

公司网址：www.htsc.com.cn

（48）上海华夏财富投资管理有限公司

客户服务电话：400-817-5666

（49）上海基煜基金销售有限公司

办公地址：上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 1503 室

法定代表人：王翔

客户服务电话：400-820-5369

公司网址：www.jiyufund.com.cn

（50）江海证券有限公司

办公地址：哈尔滨市松北区创新三路 833 号

邮编：150028

法定代表人：赵宏波

联系人：姜志伟

联系电话：400-666-2288

传真：0451-82337279

客户服务电话：400-666-2288

公司网址：www.jhzq.com.cn

（51）深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

办公地址：北京市西城区宣武门外大街 28 号富卓大厦 A 座 7 层

客户服务电话：400-166-1188

公司网址：<http://8.jrj.com.cn>

（52）北京肯特瑞基金销售有限公司

办公地址：北京市海淀区海淀东三街2号4层401-15

客户服务电话：4000988511

公司网址：<http://kenterui.jd.com>

（53）上海联泰资产管理有限公司

办公地址：上海市长宁区福泉北路518号8座3层

客户服务电话：4000-466-788

公司网址：[www.66zichan.com](http://www.66zichan.com)

（54）上海陆金所资产管理有限公司

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼

客户服务电话：4008219031

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

（55）蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路18号黄龙时代广场B座6F

联系电话：4000-776-123

客户服务电话：4000-776-123

公司网址：<http://www.fund123.cn/>

（56）民生证券股份有限公司

办公地址：北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-20层

邮编：100005

法定代表人：冯鹤年

联系人：胡梦雅

传真：010-85127917

客户服务电话：95376

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

（57）诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

办公地址：上海杨浦区秦皇岛路32号C栋2楼

客户服务电话：400-821-5399

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

（58）平安证券股份有限公司

办公地址：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

法定代表人：何之江

联系人：周一涵

传真：0755-82435367

客户服务电话：95511-8

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

（59）山西证券股份有限公司

办公地址：山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

法定代表人：侯巍

联系人：韩笑

联系电话：400-666-1618

传真：0351-8686619

客户服务电话：400-666-1618、95573

公司网址：[www.i618.com.cn](http://www.i618.com.cn)

（60）上海证券有限责任公司

办公地址：上海市黄浦区四川中路 213 号久事商务大厦 7 楼

法定代表人：李俊杰

联系人：邵珍珍

传真：021-53686100，021-53686200

客户服务电话：400-891-8918

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

（61）申万宏源证券有限公司

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号世纪商贸广场 40 楼

邮编：200031

法定代表人：李梅

联系人：陈颀

传真：021-33388224



客户服务电话：95523

公司网址：www.swhysc.com

（62）南京苏宁基金销售有限公司

客户服务电话：95177

公司网址：www.snjijin.com

（63）深圳腾元基金销售有限公司

办公地址：深圳市福田区金田路 2028 号卓越世纪中心 1 号楼 1806-1810

法定代表人：曾革

联系人：杨苗苗

联系电话：400-877-899

客户服务电话：4006-877-899

公司网址：www.tenyuanfund.com

（64）上海天天基金销售有限公司

办公地址：上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 9 楼

客户服务电话：400-1818-188

公司网址：www.1234567.com.cn

（65）浙江同花顺基金销售有限公司

办公地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903 室

联系人：张丽琼

客户服务电话：4008-773-772

公司网址：www.5ifund.com

（66）上海挖财金融信息服务有限公司

客户服务电话：021-50810673

公司网址：www.wacaijijin.com

（67）西南证券股份有限公司

办公地址：重庆市江北区桥北苑 8 号西南证券大厦

邮编：400023

法定代表人：廖庆轩

联系人：周青

传真：023-63786212

客户服务电话：4008-096-096

公司网址：www.swsc.com.cn

（68）北京新浪仓石基金销售有限公司

办公地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2 地块新浪总部科研楼 5 层 518 室

客户服务电话：010-62675369

公司网址：www.xincai.com

（69）信达证券股份有限公司

办公地址：北京市西城区宣武门西大街甲 127 号大成大厦 6 层

法定代表人：张志刚

联系人：张晓辰

联系电话：400-800-8899

传真：010-63081344

客户服务电话：95321

公司网址：www.cindasc.com

（70）兴业证券股份有限公司

办公地址：上海市浦东新区长柳路 36 号

法定代表人：杨华辉

联系人：（公邮）

联系电话：95562

客户服务电话：95562

公司网址：www.xyzq.com.cn

（71）宜信普泽（北京）基金销售有限公司

办公地址：北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809

联系电话：400-6099-200

客户服务电话：400-6099-200

公司网址：www.yixinfund.com

（72）奕丰金融服务（深圳）有限公司

客户服务电话：400-684-0500

公司网址：www.ifastps.com.cn

（73）中国银河证券股份有限公司

办公地址：中国北京西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

邮编：100033

法定代表人：陈共炎

联系人：辛国政

传真：010-83574807

客户服务电话：4008-888-888 或 95551

公司网址：www.chinastock.com.cn

（74）招商证券股份有限公司

办公地址：深圳市福田区福华一路 111 号招商证券大厦 23 楼

邮编：518033

法定代表人：霍达

联系人：黄婵君

联系电话：95565

传真：0755-82943227

客户服务电话：95565

公司网址：www.newone.com.cn

（75）中航证券有限公司

办公地址：北京市朝阳区望京东园四区 2 号 中航资本大厦 35 层

邮编：100102

法定代表人：王晓峰

联系人：王紫雯

联系电话：400-886-6567

传真：010-59562637

客户服务电话：400-8866-567

公司网址：www.avicsec.com

（76）中国国际金融股份有限公司

办公地址：北京市建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

法定代表人：毕明建

联系人：杨涵宇

联系电话：010-65051166

传真：010-65058065

客户服务电话：400-910-1166

公司网址：www.cicc.com

（77）中经北证（北京）资产管理有限公司

办公地址：北京市西城区车公庄大街 4 号 5 号楼 1 层

客户服务电话：400-600-0030

公司网址：www.bzfunds.com

（78）中泰证券股份有限公司

办公地址：上海市浦东新区花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 18 层

法定代表人：李玮

联系人：朱琴

联系电话：95538

传真：021-20315125

客户服务电话：95538

公司网址：www.zts.com.cn

（79）中国中投证券有限责任公司

办公地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18-21 层及第 04 层

01. 02. 03. 05. 11. 12. 13. 15. 16. 18. 19. 20. 21. 22. 23 单元

法定代表人：高涛

联系人：胡芷境

传真：0755-82026539

客户服务电话：95532 或 400-600-8008

公司网址：www.china-invs.cn

（80）中信建投证券股份有限公司

办公地址：北京东城区朝内大街 2 号凯恒中心 B 座 18 层

法定代表人：王常青

联系人：许梦园

客户服务电话：95587

公司网址：www.csc108.com

（81）中信期货有限公司

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

法定代表人：张皓

联系人：刘宏莹

联系电话：010-60838677

传真：0755-83217421

客户服务电话：400-990-8826

公司网址：www.citicsf.com

（82）中银国际证券股份有限公司

办公地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 31 楼

邮编：200120

法定代表人：宁敏

联系人：许慧琳

联系电话：400-620-8888

传真：021-50372474

客户服务电话：400-620-8888

公司网址：www.bocichina.com

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时更新基金管理人披露的基金销售机构名录。

（二）注册登记机构：华宝基金管理有限公司（同上）

（三）律师事务所和经办律师

名称：通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：韩炯

联系电话：（86 21）3135 8666

传真：（86 21）3135 8600

联系人：黎明

经办律师：吕红、黎明

（四）会计师事务所和经办注册会计师

名称：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

注册地址：中国上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

办公地址：中国上海市黄浦区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼

执行事务合伙人：李丹

联系电话：(021) 23238888

传真：(021) 23238800

联系人：曹阳

经办注册会计师：薛竞、曹阳

## 六、 基金的募集

本基金经中国证券监督管理委员会证监许可〔2012〕685号《关于同意华宝资源优选股票型证券投资基金募集的批复》核准，由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定募集。募集期从2012年7月16日起，至2012年8月17日止，共募集502,977,780.46份基金份额，有效认购户数为1,409户。

## 七、 基金合同的生效

本基金基金合同于 2012 年 8 月 21 日生效。本基金基金合同生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。

法律法规另有规定时，从其规定。



## 八、基金份额的申购与赎回

### （一）申购与赎回的场所

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。具体的销售网点将由基金管理人在招募说明书或其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并及时更新基金管理人披露的基金销售机构名录。基金投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。

### （二）申购与赎回办理的开放日及时间

#### 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、申购与赎回的开始时间

本基金自 2012 年 9 月 20 日起开始办理日常申购、赎回业务。

在确定申购开始时间与赎回开始时间后，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、赎回或转换申请且登记机构确认接受的，其基金份额申购、赎回价格为下一开放日基金份额申购、赎回的价格。

### （三）申购与赎回的原则

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

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；

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

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

#### （四）申购与赎回的程序

##### 1、申购和赎回的申请方式

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

##### 2、申购和赎回的款项支付

投资人申购基金份额时，必须全额交付申购款项，投资人交付款项，申购成立；登记机构确认基金份额的，申购生效。

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

##### 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）及时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者。

基金销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购、赎回申请的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资者应及时查询。

#### （五）申购与赎回的数额限制

##### 1、申请申购基金的金额

通过代销网点和直销 e 网金申购本基金单笔最低金额为 1 元人民币（含申购费）。通过直销柜台首次申购的最低金额为 10 万元人民币（含申购费），追加申购最低金额为 1 元人民币（含申购费）。已在基金管理人直销柜台购买过基金管理人管理的其他基金的投资者，不受直销柜台首次申购最低金额的限制，但受追加申购最低金额的限制。各销售机构对最低申购限额及交易级差有其他规定的，以各销售机构的业务规定为准。

其他销售机构的投资者欲转入直销柜台进行交易要受直销柜台最低金额的限制。基金管理人可根据市场情况，调整首次申购的最低金额。

除招募说明书第八部分“拒绝或暂停申购的情形”另有约定外，投资者可多次申购，对单个投资者累计持有份额不设上限限制。

##### 2、申请赎回基金的份额

投资人可将其全部或部分基金份额赎回。本基金按照份额进行赎回，申请赎回份额精确到小数点后两位，单笔赎回份额不得低于 1 份。基金持有人赎回时或赎回后在销售机构（网点）保留

的基金份额余额不足 1 份的，在赎回时需一次全部赎回。

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

#### （六）申购费与赎回费

##### 1、申购费

本基金采用前端收费模式收取基金申购费用。投资者可以多次申购本基金，申购费率按每笔申购申请单独计算。本基金的申购费率表如下：

| 申购金额                | 申购费率      |
|---------------------|-----------|
| 50 万以下              | 1.5%      |
| 大于等于 50 万，小于 100 万  | 1.2%      |
| 大于等于 100 万，小于 200 万 | 1.0%      |
| 大于等于 200 万，小于 500 万 | 0.5%      |
| 500 万（含）以上          | 每笔 1000 元 |

申购费用由投资人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

##### 2、赎回费

本基金的赎回费随基金持有时间的增加而递减。本基金的赎回费率表如下：

| 持有基金份额期限         | 赎回费率(%) |
|------------------|---------|
| 小于 7 日           | 1.50%   |
| 大于等于 7 日，小于 30 日 | 0.75%   |
| 大于等于 30 日，小于 1 年 | 0.50%   |
| 大于等于 1 年，小于 2 年  | 0.25%   |
| 大于等于 2 年         | 0       |

注：此处一年按 365 天计算

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。对于收取的持续持有期少于 30 日的投资人的赎回费，基金管理人将其全额计入基金财产。对于收取的持续持有期大于等于 30 日的投资人的赎回费，基金管理人将不低于其总额的 25% 计入基金财产，其余用于支付登记结算费和其他必要的手续费。

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

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

5、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。

#### （七）申购份额与赎回金额的计算方式

##### 1、申购份额的计算方式

本基金的申购金额包括申购费用和净申购金额。其中，

申购费用适用比例费率的情形下：

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

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

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

申购费用适用固定金额的情形下：

$$\text{申购费用} = \text{固定金额}$$

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

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

申购份额的计算结果均按舍去尾数方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。申购费用、净申购金额的计算按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此误差产生的收益或损失由基金资产承担。

例：假定 T 日基金份额净值为 1.086 元，某投资者当日投资 10 万元申购本基金，对应的本次前端申购费率为 1.5%，该投资者可得到的基金份额为：

$$\text{净申购金额} = 100000 / (1 + 1.5\%) = 98522.17 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 100000 - 98522.17 = 1477.83 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 98522.17 / 1.086 = 90720.23 \text{ 份}$$

即：投资者投资 10 万元申购本基金，假定申购当日基金份额净值为 1.086 元，可得到 90720.23

份基金份额。

## 2、赎回金额的计算方式

本基金的赎回金额为赎回总额扣减赎回费用。其中，

赎回总额=赎回份额×T 日基金份额净值

赎回费用=赎回总额×赎回费率

赎回金额=赎回总额-赎回费用

上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。例：投资者赎回 10,000 份基金份额，持有期限一年九个月，对应的赎回费率为 0.25%，假设赎回当日基金份额净值是 1.1615 元，则其可得到的赎回金额为：

赎回总额=10,000×1.1615=11,615.00 元

赎回费用=11,615.00×0.25%=29.04 元

赎回金额=11,615.00-29.04=11,585.96 元

即：投资者赎回 10,000 份基金份额，持有期限一年九个月，对应的赎回费率为 0.25%，假设赎回当日基金份额净值是 1.1615 元，则其可得到的赎回金额为 11,585.96 元。

3、本基金份额净值的计算，保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。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。

## （八）申购与赎回的登记

1、经基金销售机构同意，基金投资者提出的申购和赎回申请，在基金管理人规定的时间之前可以撤销。

2、投资者 T 日申购基金成功后，基金注册登记机构在 T+1 日为投资者增加权益并办理注册登记手续，投资者自 T+2 日起有权赎回该部分基金份额。

3、投资者 T 日赎回基金成功后，基金注册登记机构在 T+1 日为投资者扣除权益并办理相应的注册登记手续。

4、基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述注册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上公告。

## （九）拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资者的申购申请：

1、因不可抗力导致基金无法正常运作。

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资者的申购申请。当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停基金估值并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会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，或发生其他损害现有基金份额持有人利益的情形。

6、基金管理人、基金托管人、基金销售机构或登记机构的异常情况导致基金销售系统、基金登记系统或基金会计系统无法正常运行。

7、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额数的比例达到或者超过基金份额总数的 50%，或者变相规避 50%集中度的情形时。

8、申请超过基金管理人设定的基金总规模、单日净申购比例上限、单一投资者单日或单笔申购金额上限的。

9、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

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

#### （十）暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资者的赎回申请或延缓支付赎回款项：

1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资者的赎回申请或延缓支付赎回款项。当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金赎回申请或延缓支付赎回款项。

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

## 6、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

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

### （十一）巨额赎回的情形及处理方式

#### 1、巨额赎回的认定

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

#### 2、巨额赎回的处理方式

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

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

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

在单个基金份额持有人超过基金总份额20%以上的赎回申请情形下，本基金将按照以下规则实施延期办理赎回申请：若发生巨额赎回，存在单个基金份额持有人超过基金总份额20%以上（“大额赎回申请人”）的赎回申请情形，基金管理人可以按照保护其他赎回申请人（“普通赎回申请人”）利益的原则，优先确认普通赎回申请人的赎回申请，在当日可接受赎回的范围内对普通赎回申请人的赎回申请予以全部确认或按单个账户赎回申请量占普通赎回申请人赎回申请总量的比例确认；在普通赎回申请人的赎回申请全部确认且当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的10%的前提下，在仍可接受赎回申请的范围内对大额赎回申请人的赎回申请按比例确认。

对于未能赎回部分，投资者在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资者在提交赎回申请时未作明确选择，投资者未能赎回部分作自动延期赎回处理。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。

#### （十二）暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

1、发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人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，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。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。

#### （十三）基金转换

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

#### （十四）基金的非交易过户

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

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

#### （十五）基金的转托管



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

#### （十六）定期定额投资计划

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

#### （十七）基金的冻结和解冻

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。

## 九、与基金管理人管理的其他基金转换

### （一）基金转换申请人的范围

本基金的持有人均可以按照基金合同的规定申请和办理本基金与基金管理人管理的其他基金的转换。

### （二）基金转换受理场所

基金转换只能在同一销售机构进行，转换的两只基金必须都是该销售机构代理销售的本公司管理的基金。基金转换业务的具体办理时间、流程以销售机构及其网点的安排和规定为准。

### （三）基金转换受理时间

投资人可以在基金开放日的交易时间段申请办理基金转换业务，具体办理时间与基金申购、赎回业务办理时间一致。

### （四）基金转换费用

本基金与公司管理的其他基金转换，转换费用由二部分组成：转出基金赎回费和转入基金与转出基金的申购补差费。

赎回费：按转出基金正常赎回时的赎回费率收取费用。

申购补差费：按照转入基金与转出基金的申购费率的差额收取补差费。转出基金金额所对应的转出基金申购费率低于转入基金的申购费率的，补差费率为转入基金和转出基金的申购费率差额；转出基金金额所对应的转出基金申购费率高于转入基金的申购费率的，补差费为零。

### （五）基金转换公式

1、基金转换公式为：

转出费用=转出份额×转出基金单位净值×转出基金赎回费率

转出总金额=转出份额×转出基金单位净值

净转出金额=转出总金额-转出费用

净转入金额=净转出金额/（1+补差费率）

（当转出基金金额所对应的转出基金申购费率低于转入基金的申购费率，补差费率=转入基金的申购费率-转出基金的申购费率；当转出基金金额所对应的转出基金申购费率高于转入基金的申购费率，补差费率=0）

转换补差费用=净转出金额-净转入金额

转入份额=净转入金额/转入基金单位净值

转入份额保留小数点后两位，小数点后两位以后的余额对应的部分计入基金财产。

2、基金管理人在不损害本基金份额持有人权益的情况下可更改上述公式，但应最迟在新的公式适用前3个工作日予以公告。

（六）不同基金之间的转换不影响投资者的持有基金时间的计算。

（七）基金转换的程序

1、基金转换的申请方式

基金份额持有人必须根据基金管理人和基金销售代理人规定的手续，在开放日的交易时间段内提出基金转换申请。

2、基金转换申请的确认

基金管理人以收到基金转换申请的当天作为基金转换申请日（T日），并在T+1工作日对该交易的有效性进行确认。投资人可在T+2工作日及之后到其提出基金转换申请的网点进行成交查询。

基金份额持有人申请转换时，基金管理人按先进先出的原则对该持有人基金账户在该销售机构托管的基金份额进行处理，即先确认的份额先转换，后确认的份额后转换。

（八）基金转换的数额限制

基金转换遵循“份额转换”的原则，转换申请份额精确到小数点后两位。单笔转换申请份额不得低于1份。因为转换等非赎回原因导致投资人在销售机构（网点）保留的基金份额余额少于该基金最低保留份额数量限制的，注册登记机构不作强制赎回处理。

（九）基金转换的注册登记

1、基金投资人提出的基金转换申请，在当日交易时间内可以撤销，交易时间结束后不得撤销。

2、基金注册登记机构在T+1日内对基金份额持有人基金转换申请进行确认，确认成功后为基金份额持有人办理相关的注册登记手续。

3、基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，并最迟于开始实施前3个工作日予以公告。

（十）拒绝或暂停基金转换的情形及处理方式

1、除非出现如下情形，基金管理人不得拒绝或暂停接受基金份额持有人的基金转换申请：

- （1）不可抗力；
- （2）证券交易所在交易时间非正常停市；
- （3）基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔转换；
- （4）暂停估值；

(5) 法律、法规规定或中国证监会认定的其他情形。

如果基金份额持有人的基金转换申请被拒绝，基金份额持有人持有的原基金份额不变。

2、发生上述情形之一的，基金管理人应在当日立即向中国证监会备案。

3、发生基金合同或招募说明书中未予载明的事项，但基金管理人无正当理由认为需要拒绝或暂停接受基金转换申请的，应当报中国证监会备案。

4、暂停基金转换，基金管理人应立即在至少一种指定媒体上公告。

5、暂停期结束，基金管理人应当公告最新的基金收益和转份额的情况。

如果发生暂停的时间为1日，基金管理人应于重新开放日在至少一种指定信息披露媒体上刊登基金重新开放基金转换的公告，并公告最新的基金收益情况。

如果发生暂停的时间超过1日但少于两周，暂停结束，重新开放基金转换时，基金管理人应提前1个工作日在至少一种指定媒体刊登基金重新开放基金转换的公告，并在重新开放基金转换日公告最新的基金收益情况。

如果发生暂停的时间超过两周，暂停期间，基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次；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，重新开放基金转换时，基金管理人应提前3个工作日在至少一种指定媒体上连续刊登基金重新开放基金转换的公告，并在重新开放基金转换日公告最新的基金收益的情况。

## 十、基金的投资

### （一）投资目标

把握资源相关行业的投资机会，力争在长期内为基金份额持有人获取超额回报。

### （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 A 股股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。

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

本基金的股票投资比例为基金资产的 60%–95%，其中，投资于资源相关股票的比例不低于股票资产的 80%。现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产比例为 5%–40%，其中，持有现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

其它金融工具的投资比例依照法规和监管机构的规定执行。

### （三）投资策略

#### 1、大类资产配置策略

本基金采取积极的大类资产配置策略，通过宏观策略研究，对相关资产类别的预期收益进行动态跟踪，决定大类资产配置比例。

在大类资产配置过程中，本基金主要考虑以下三类指标：

（1）宏观经济方面：季度 GDP 增速、消费价格指数、采购经理人指数、月度工业增加值、工业品价格指数、月度进出口数据以及汇率等因素；

（2）宏观经济政策方面：财政政策、货币政策等；

（3）市场流动性方面：市场资金的供需等。

#### 2、股票投资策略

本基金采用自上而下和自下而上相结合的方法，通过对资源相关子行业的精选以及对行业内相关股票的深入分析，挖掘该类型企业的投资价值，分享资源稀缺性所带来的行业高回报。

##### （1）资源行业的界定

本基金所指的资源是指在一定的时间和技术条件下，能够被企业占有和利用，为企业创造经

济价值，具有战略发展意义的自然资源。包括矿产资源、土地资源、水资源、旅游资源、气候资源、生物资源和海洋资源等。

具体来说，本基金中的资源行业主要包括拥有自然资源或可以直接从自然资源的稀缺性中获益的相关子行业和上市公司，包括：拥有矿产资源的采掘，有色、黑色金属和化工行业；拥有土地资源、水资源或生物资源的农林牧渔业；掌握景区等自然资源的旅游类上市公司；拥有矿产资源、水利资源的公用事业类上市公司等。

## （2）子行业配置

资源相关的各个子行业由于所处的商业周期不同，面临的上下游市场环境也各不相同，因此，其相关行业表现也并非完全同步，在不同子行业之间进行资产配置有助于提高基金投资组合的总体收益，配置过程中需要考虑的具体因素如下：

### 1) 经济周期因素

资源行业的发展与经济周期有较大的关联性，在经济周期的不同阶段，各个子行业所面临的市场环境和发展机遇会有明显的差异，本基金将根据基金管理人经济周期所处阶段的判断，重点投资那些收益较大的子行业。

### 2) 政策因素

资源行业的发展会受到政府产业政策、环保政策、价格管制、贸易管制等政策的影响，不同子行业会因为相关政策的出台而面临或正面或负面的影响，本基金管理人将密切跟踪政府政策的变化，重点配置于那些受益于当时政策或者未来政策变化预期的子行业。

### 3) 资源稀缺性因素

资源相关子行业的长期发展趋势很大程度上取决于子行业所拥有的特定种类自然资源的长期稀缺性，本基金将重点投资那些控制的资源具有较强稀缺性，并且中长期来看能使这种稀缺性反映到产品价格上的子行业。

### 4) 技术发展因素

技术的发展与变革可能对相关资源品的稀缺性造成深远的影响，新技术工艺的出现可能会使得原本稀缺的资源品变得不再稀缺，也可能使得原本并不稀缺的资源品变稀缺。鉴于此，本基金管理人将密切关注相关科学技术领域的最新进展，并重点配置于那些受益于新技术新工艺发展的子行业。

### 5) 经济社会因素

随着人均收入水平的提高，人口年龄结构的变化而出现的消费结构和消费习惯的变化，会对资源相关子行业产生较大的影响，本基金管理人将动态地跟踪这些变化，积极配置于符合经济社

会发展趋势的相关子行业。

#### 6) 市场短期因素

中短期内，各个子行业所面临的市场需求弹性也各不相同，基金管理人将在分析短期宏观经济形势，及子行业产品价格变化的基础上，积极配置于各个阶段预期收益率较高的子行业。

#### (3) 个股选择

本基金将资源类的上市公司分为以下两类：一类是以资源开发利用相关业务为主业的上市公司；另一类是当前资源开发利用业务非主业但是未来可能成为其主要利润来源的上市公司。基金管理人将对两类公司分别进行系统地分析，最终确定投资标的股票，构建投资组合。

##### 1) 以资源开发利用业务为主业的上市公司

对于以资源开发利用业务为主业的上市公司，本基金将依靠定量与定性相结合的方法。

定量的方法包括分析相关的财务指标和市场指标，选择财务健康，成长性好，估值合理的股票。具体分析的指标为：

I 成长指标：预测未来两年主营业务收入、主营业务利润复合增长率等；

II 盈利指标：毛利率、净利率、净资产收益率等；

III 价值指标：PE、PB、PEG、PS 和单位资源储量市值等。

定性的方法则是结合本基金研究团队的案头研究和实地调研，深入分析企业的基本面和长期发展前景，及短期重大影响事件，精选符合以下一项或数项定性判断标准的股票：

##### I 资源控制能力强

控制资源的规模和能力是衡量资源行业相关上市公司最为重要的指标，并直接影响资源类上市公司的盈利能力。本基金将深入研究上市公司控制相关资源品的规模和能力，精选资源储量较大、并且对资源的控制力强的上市公司进行投资。

##### II 资源开发的能力强

资源开发的能力是指通过勘探，收购等方式获得新的资源控制权，或通过技术革新等提高资源开采量的能力，这也是资源类上市公司未来发展潜力的重要来源。本基金管理人将通过密切跟踪，动态选择资源开发能力强的上市公司进行投资。

##### III 资源利用能力强

资源的利用能力主要是指资源类上市公司通过对其控制的资源进行加工或直接销售从而获利的能力。本基金将重点投资那些有能力对资源品进行深加工从而提高获利能力或对所控制资源品具有定价权的上市公司。

##### IV 公司治理结构稳定高效

公司法人治理结构稳定明晰，且拥有一支高效稳定的管理团队，在战略管理、生产管理、质量管理、技术管理、成本管理等方面具有明显并且可持续的竞争优势的公司。

#### V 有正面事件推动

整体上市、集团公司优质资产注入、并购重组、股权激励等事件对公司未来发展可能会有正面的影响。

#### 2) 与资源开发利用密切相关的上市公司

部分上市公司虽然主营业务并不属于资源相关行业，但是却与资源的开发与利用有着密切的联系。如：公司通过收购等方式涉足资源领域，且相关业务成长迅速，有望为公司总体业绩做出重要贡献；或未来资源开发利用业务有望成长为公司的主营业务等。

对于此类上市公司，除了使用 1) 中提到的定量和定性分析方法外，还会重点关注该公司的业务构成指标和行业占比指标，分析公司主营业务与资源开发利用相关业务的比例；资源开发利用相关业务产生的利润占比；以及该公司资源开发利用相关业务未来的成长性等。

### 3、债券投资策略

本基金采取自上而下的方法确定投资组合久期，结合自下而上的个券选择方法构建债券投资组合。

首先，本基金将密切关注国内外宏观经济走势与我国财政、货币政策动向，预测未来利率变动走势，自上而下地确定投资组合的久期。

其次，债券投资组合的构建与调整是一个自下而上的过程，需综合评价个券收益率、波动性、到期期限、票息、赋税条件、流动性、信用等级以及债券持有人结构等决定债券价值的影响因素。同时，本基金将运用系统化的定量分析技术和严格的投资管理制度等方法管理风险，通过久期、平均信用等级、个券集中度等指标，将组合的风险控制在合理的水平。在此基础上，通过各种积极投资策略的实施，追求组合较高的回报。主要运用的策略有：

#### (1) 利率预期策略

基于对宏观经济环境的深入研究，预期未来市场利率的变化趋势，结合基金未来现金流的分析，确定投资组合平均剩余期限。如果预测未来利率将上升，则可以通过缩短组合平均剩余期限的办法规避利率风险，相反，如果预测未来利率下降，则延长组合平均剩余期限，赚取利率下降带来的超额回报。

#### (2) 估值策略

通过比较债券的内在价值和市场价格而做出投资决策。当内在价值高于市场价格时，买入债券；当内在价值低于市场价格时，卖出债券。



### （3）利差策略

基于不同债券市场板块间利差而在组合中分配资产的方法。收益率利差包括信用利差、可提前赎回和不可提前赎回证券之间的利差等表现形式。信用利差存在于不同债券市场，如国债和企业债利差、国债与金融债利差、金融债和企业债利差等；可提前赎回和不可提前赎回证券之间的利差形成的原因是基于利率预期的变动。

### （4）互换策略

为加强对投资组合的管理，在卖出组合中部分债券的同时买入相似债券。该策略可以用来达到提高当期收益率或到期收益率、提高组合质量、合理避税等目的。

### （5）信用分析策略

根据宏观经济运行周期阶段,分析债券发行人所处行业发展前景、发展状况、市场地位、财务状况、管理水平和债务水平等因素,评价债券发行人的信用风险,并根据特定债券的发行契约,评价债券的信用级别,确定债券的信用风险。

## 4、其他品种投资策略

本基金将根据市场的实际情况及基金的申购赎回状况，将部分资产投资于中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具，包括但不限于可转换债券、央行票据、以捕捉市场机会，提高基金资产的使用效率。央行票据的投资策略见债券投资策略；可转换债券采用自上而下的两层次配置策略，在对宏观经济、行业分析的基础上，选择有成长性、前景看好的行业进行配置。最后落实到个券分析、转债具体条款分析、股性、债性分析上。利用转债的债性规避股市系统性风险和个股风险、追求投资组合的安全和稳定收益，并利用其股性在股市上涨中分享到行业和公司成长带来的收益。

另外，本基金具备投资权证的条件。本基金在权证投资中将对权证标的证券的基本面进行研究，结合期权定价模型和我国证券市场的交易制度估计权证价值，主要考虑运用的策略包括：杠杆策略、价值挖掘策略、获利保护策略、价差策略、双向权证策略、卖空有保护的认购权证策略、买入保护性的认沽权证策略等。

## （四）投资决策流程

### 1、投资决策机制

公司的投资决策实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制，由基金经理根据投资决策委员会的授权具体承担基金管理工作。投资总监负责监督管理基金日常投资活动。公司投资决策机制为分级授权机制，即：

第一级，投资决策委员会

投资决策委员会是公司基金投资的最高决策机构，以定期或不定期（会议频率每月不少于一次）会议的形式讨论和决定基金投资的重大问题，审定基金经理的投资组合配置提案和重点投资。

#### 第二级，投资研究联席会议

研究部、国内投资管理部定期或不定期（会议频率双周一次或更多）召开投资一研究联席会议，研究、交流投资信息，探讨、解决投资业务的有关问题。双周投资一研究联席会议就研究部提交的宏观及行业策略，以及研究员提交的资源相关行业模拟组合、备选股票库、重点投资品种等进行充分讨论。基金经理根据联席会议的成果及自身判断确定投资组合配置提案。

#### 第三级，基金经理

基金经理有权在各自的权限内执行和优化组合配置方案。

## 2、投资流程

### （1）投资决策委员会负责投资决策

投资决策委员会定期和不定期召开会议，负责就基金重大战略、资产配置做出决策。

### （2）研究部负责投资研究和分析

宏观研究人员通过研究其他证券公司和基金管理公司的报告，通过走访政府决策部门和研究部门，研究经济形势、经济政策（货币政策、财政政策、区域政策、产业政策等），撰写宏观研究报告，就基金的股票、债券、现金比例提出建议。

行业研究人员对各行业进行深入细致的分析，考查资源相关子行业未来一段时间的投资机会，同时，对经过金融工程研究人员量化筛选的股票进行细致的案头和实地调研，撰写研究报告及上市公司调研报告，对个股买卖提出具体建议。

### （3）基金经理小组负责投资执行

基金经理小组根据宏观经济、政策和产业研究，结合量化分析等工具对股市做出判断，提出投资组合的资产配置比例和资源相关各个子行业的配置比例建议，同时结合股票排序和研究员的报告，形成投资计划提交投资决策委员会，并根据投资决策委员会的决策，具体实施投资计划。

经投资决策委员会审核投资组合方案后，基金经理向交易部下达具体的投资指令，交易员根据投资决定书执行指令。

### （4）绩效评估

主要包括四项核心功能：风险评估、投资绩效的风险调整和业绩归因分析，由绩效评估人员利用相关工具评估。

### （5）内部控制

内部控制委员会、督察长、监察稽核部和风险管理部负责内控制度的制定，并检查执行情况。

### （五）业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：

$80\% \times \text{中证内地资源主题指数收益率} + 20\% \times \text{上证国债指数收益率}$ 。

中证内地资源主题指数是中证内地主题系列指数之一，用以反映沪深 A 股中资源相关的综合性油气、油气的勘探与生产、煤炭与消费用燃料、铝、黄金、多种金属与采矿、贵金属与矿石等相关行业上市公司股票的整体表现，该指数于 2009 年 10 月 28 日正式发布。

上证国债指数是以上海证券交易所上市的所有固定利率国债为样本，按照国债发行量加权而成。它推出的目的是反映我们债券市场整体变动状况，是我们债券市场价格变动的“指示器”。

随着市场环境的变化，如果上述指数不适用本基金时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，履行适当的程序变更本基金的业绩比较基准。此项变更需要征得基金托管人同意后，报中国证监会备案，并应至少提前 30 个工作日在中国证监会指定的信息披露媒体上刊登公告。

### （六）风险收益特征

本基金是一只主动投资的混合型基金，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。

### （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）本基金的股票投资比例为基金资产的 60%–95%，其中，投资于资源相关股票的比例不低于股票资产的 80%。现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产比例为 5%–40%；

（2）保持不低于基金资产净值 5% 的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券；

（3）本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；

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

（5）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

（6）本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

（7）本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；

（8）本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；

（9）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

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

（11）本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

（12）本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

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

（14）本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；

（15）本基金资产总值不超过本基金资产净值的 140%；

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

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

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

除上述第（2）、（12）、（16）、（18）项外，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。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。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消上述限制，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。

## 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) 向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者

债券；

(6) 买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；

(7) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

(8) 依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

(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、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金份额持有人的利益；

2、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；

3、有利于基金财产的安全与增值；

4、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

(九) 基金的融资

在法律法规允许的前提下，基金管理人可以为基金的利益依法为基金进行融资。

(十) 基金的投资组合报告

本基金的投资组合报告所载的数据截至 2019 年 6 月 30 日，本报告中所列财务数据未经审计。

#### 1、报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额（元）          | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 256,010,884.05 | 81.62        |
|    | 其中：股票             | 256,010,884.05 | 81.62        |
| 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 | 56,707,177.03  | 18.08  |
| 8 | 其他资产         | 955,329.47     | 0.30   |
| 9 | 合计           | 313,673,390.55 | 100.00 |

## 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

### (1) 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）        | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|----------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -              | -            |
| B  | 采矿业              | 135,478,472.90 | 43.62        |
| C  | 制造业              | 87,792,992.29  | 28.27        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 2,492,000.00   | 0.80         |
| E  | 建筑业              | 10,644,775.00  | 3.43         |
| 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  | 12,811,381.32  | 4.12         |
| J  | 金融业              | 6,768,155.94   | 2.18         |
| 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        | 23,106.60      | 0.01         |
| S  | 综合               | -              | -            |
|    | 合计               | 256,010,884.05 | 82.43        |

### (2) 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）     | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|-----------|---------------|--------------|
| 1  | 600028 | 中国石化 | 3,351,202 | 18,331,074.94 | 5.90         |
| 2  | 601600 | 中国铝业 | 4,498,083 | 17,632,485.36 | 5.68         |
| 3  | 000983 | 西山煤电 | 2,465,474 | 14,940,772.44 | 4.81         |
| 4  | 601857 | 中国石油 | 2,161,399 | 14,870,425.12 | 4.79         |

|    |        |      |           |               |      |
|----|--------|------|-----------|---------------|------|
| 5  | 601899 | 紫金矿业 | 3,724,031 | 14,039,596.87 | 4.52 |
| 6  | 601699 | 潞安环能 | 1,667,187 | 13,237,464.78 | 4.26 |
| 7  | 600348 | 阳泉煤业 | 2,206,840 | 12,821,740.40 | 4.13 |
| 8  | 002128 | 露天煤业 | 1,278,792 | 11,061,550.80 | 3.56 |
| 9  | 002531 | 天顺风能 | 1,513,800 | 9,143,352.00  | 2.94 |
| 10 | 000807 | 云铝股份 | 1,760,586 | 8,257,148.34  | 2.66 |

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投资。

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投资。

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

（1）报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金未投资股指期货。

（2）本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

（1）本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

（2）报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金未投资国债期货。

（3）本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

11、投资组合报告附注

（1）本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

基金管理人没有发现本基金投资的前十名证券的发行主体在报告期内被监管部门立案调查，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚，无证券投资决策程序需特别说明。

（2）基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

（3）其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）      |
|----|---------|------------|
| 1  | 存出保证金   | 169,673.47 |
| 2  | 应收证券清算款 | 559,107.77 |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | 11,816.63  |
| 5  | 应收申购款   | 214,731.60 |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 待摊费用    | -          |
| 8  | 其他      | -          |
| 9  | 合计      | 955,329.47 |



（4）报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

（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。

（6）投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，合计数可能不等于分项之和。

## 十一、基金的业绩

基金业绩截止日为 2019 年 6 月 30 日，所列数据未经审计。净值增长率与同期比较基准收益率比较如下：

| 阶段                    | 净值增长率<br>① | 净值增长率标准差<br>② | 业绩比较基准收益率<br>③ | 业绩比较基准收益率标准差<br>④ | ①-③    | ②-④    |
|-----------------------|------------|---------------|----------------|-------------------|--------|--------|
| 2012/08/21-2012/12/31 | 2.40%      | 0.54%         | 2.59%          | 1.38%             | -0.19% | -0.84% |
| 2013/01/01-2013/12/31 | -25.78%    | 1.38%         | -33.26%        | 1.24%             | 7.48%  | 0.14%  |
| 2014/01/01-2014/12/31 | 32.63%     | 1.24%         | 25.43%         | 1.13%             | 7.20%  | 0.11%  |
| 2015/01/01-2015/12/31 | 6.25%      | 2.52%         | -5.71%         | 2.25%             | 11.96% | 0.27%  |
| 2016/01/01-2016/12/31 | 16.34%     | 1.84%         | -1.71%         | 1.51%             | 18.05% | 0.33%  |
| 2017/01/01-2017/12/31 | 24.67%     | 1.08%         | 17.86%         | 0.97%             | 6.81%  | 0.11%  |
| 2018/01/01-2018/12/31 | -18.43%    | 1.22%         | -27.43%        | 1.17%             | 9.00%  | 0.05%  |
| 2019/01/01-2019/06/30 | 16.99%     | 1.25%         | 12.18%         | 1.27%             | 4.81%  | -0.02% |
| 2012/08/21-2019/06/30 | 48.23%     | 1.56%         | -23.63%        | 1.43%             | 71.86% | 0.13%  |

## 十二、基金财产

### （一）基金资产总值

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

### （二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### （三）基金财产的账户

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

### （四）基金财产的保管和处分

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

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

## 十三、基金资产估值

### （一）估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券交易场所的交易日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非交易日。

### （二）估值对象

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

### （三）估值方法

#### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

（1）交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，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的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

（2）交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

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

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

#### 2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

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

（3）首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股

票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

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

4、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。

5、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

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

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

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

#### （四）估值程序

1、基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到 0.001 元，小数点后第四位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，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 3 位以内(含第 3 位)发生估值错误时，视为基金份额净值错误。

本基金合同的当事人应按照以下约定处理：

##### 1、估值错误类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或登记机构、或销售机构、或投资人自身的过错造成估值错误，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该估值错误

遭受损失当事人(“受损方”)的直接损失按下述“估值错误处理原则”给予赔偿,承担赔偿责任。

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

## 2、估值错误处理原则

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

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

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

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

## 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后,有关的当事人应当及时进行处理,处理的程序如下:

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

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

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

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

## 4、基金份额净值估值错误处理的方法如下:

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

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

（3）前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

#### （六）暂停估值的情形

- 1、基金投资所涉及的证券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，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。

## 十四、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 6 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资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；

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

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

### （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。



## 十五、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、律师费和诉讼费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、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

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

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

上述“一、基金费用的种类中第 3—7 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。

## 十六、基金的会计与审计

### （一）基金会计政策

- 1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；
- 2、基金的会计年度为公历年度的 1 月 1 日至 12 月 31 日；
- 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 个工作日内在指定媒介公告并报中国证监会备案。

## 十七、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。

### （二）信息披露义务人

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

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

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的媒体和基金管理人、基金托管人的互联网网站（以下简称“网站”）等媒介披露，并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

（三）本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

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

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

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

### （五）公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

#### 一）基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议

1、《基金合同》是界定《基金合同》当事人的各项权利、义务关系，明确基金份额持有人大会召开的规则及具体程序，说明基金产品的特性等涉及基金投资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核准后，基金管理人在基金份额发售的 3 日前，将基金招募说明书、《基金合同》摘要登载在指定媒介上；基金管理人、基金托管人应当将《基金合同》、基金托管协议登载在网站上。

#### 二）基金份额发售公告

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

#### 三）《基金合同》生效公告

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

#### 四）基金资产净值、基金份额净值

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

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在每个开放日的次日，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。

#### 五）基金份额申购、赎回价格

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

#### 六）基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告

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

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

正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定媒介上。

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

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

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

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

本基金持续运作过程中，应当在基金年度报告和半年度报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。

#### 七) 临时报告

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

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

- 1、基金份额持有人大会的召开；
- 2、终止《基金合同》；
- 3、转换基金运作方式；
- 4、更换基金管理人、基金托管人；
- 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、涉及基金管理人、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、发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；
- 27、中国证监会规定的其他事项。

#### 八) 澄清公告

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

#### 九) 基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

#### 十) 中国证监会规定的其他信息。

#### （六）信息披露事务管理

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

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

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

基金管理人、基金托管人应当在指定媒介中选择披露信息的报刊。

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体披露信息，但是其他公共媒体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》终止后十五年。

#### （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。



## 十八、风险揭示

### （一）投资于本基金的风险

#### 1、市场风险

证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响，导致基金收益水平变化，产生风险，主要包括：

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

**经济周期风险：**随经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化。基金投资于国债与上市公司的股票，收益水平也会随之变化，从而产生风险。

**利率风险：**金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着国债的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。基金投资于国债和股票，其收益水平会受到利率变化的影响。

#### 2、流动性风险

本基金属于开放式基金，基金管理人有权接受投资者的申购和赎回。不断变化的申购和赎回，尤其是发生大额申购和赎回时，即使市场行情没有发生显著变化的趋势，本基金也要进行股票买卖。然而，市场的流动性是变化的，不同时间段、不同的股票，其流动性都各不相同。如果市场流动性较差，导致本基金无法顺利买进或卖出股票，或者必须付出较高成本才能买进或卖出股票，这样，就在两个方面产生了风险：

当发生巨额申购时，本基金由于不能顺利买进股票，使得本基金的持仓比例被动地发生变化，可能导致行情上涨时不能实现预期的投资收益目标，影响本基金的最终投资业绩；

当发生巨额赎回时，如果市场流动性较差，本基金为了兑现持有人的赎回，必须以较高的代价卖出股票，从而影响本基金的投资业绩。

#### （1）基金申购、赎回安排

投资人具体请参见基金合同“第六部分、基金份额的申购与赎回”和本招募说明书“八、基金份额的申购与赎回”，详细了解本基金的申购以及赎回安排。

在本基金发生流动性风险时，基金管理人可以综合利用备用的流动性风险管理工具以减少或应对基金的流动性风险，投资者可能面临赎回申请被暂停接受、赎回款项被延缓支付、被收取短期赎回费、基金估值被暂停、基金采用摆动定价等风险。投资者应该了解自身的流动性偏好，并

评估是否与本基金的流动性风险匹配。

#### （2）拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、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、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。标的资产大部分为股票资产，一般情况下具有较好的流动性。同时，本基金严格控制投资于流动受限资产和不存在活跃市场需要采用估值技术确定公允价值的投资品种的比例。除此之外，本基金管理人将根据历史经验和市场情况动态调整基金中高流动性资产的比例并通过组合管理、分散投资对各类标的资产进行合理配置，以防范流动性风险。

#### （3）巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

基金管理人已建立内部巨额赎回应对机制，对基金巨额赎回情况进行严格的事前监测、事中管控与事后评估。当基金发生巨额赎回时，基金管理人需要根据实际情况进行流动性评估，确认是否可以接受所有赎回申请。当发现现金类资产不足以支付赎回款项时，需充分评估基金组合资产变现能力、投资比例变动与基金单位份额净值波动的基础上，审慎接受、确认赎回申请，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。巨额赎回情形下，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况或巨额赎回份额占比情况决定全额赎回、部分延期赎回或暂停赎回。同时，如本基金单个基金份额持有人在单个开放日申请赎回基金份额超过前一工作日基金总份额20%的，基金管理人按照保护其他赎回申请人利益的原则，优先确认普通赎回申请人的赎回申请，在当日可接受赎回的范围内对普通赎回申请人的赎回申请予以全部确认或按单个账户赎回申请量占普通赎回申请人赎回申请总量的比例确认。

#### （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

在市场大幅波动、流动性枯竭等极端情况下发生无法应对投资者巨额赎回的情形时，基金管理人将以保障投资者合法权益为前提，严格按照法律法规及基金合同的规定，谨慎选取延期办理巨额赎回申请、暂停接受赎回申请、延缓支付赎回款项、收取短期赎回费、暂停基金估值、摆动定价等流动性风险管理工具作为辅助措施。对于各类流动性风险管理工具的使用，基金管理人将依照严格审批、审慎决策的原则，及时有效地对风险进行监测和评估，使用前经过内部审批程序并与基金托管人协商一致。在实际运用各类流动性风险管理工具时，可能对投资者有以下潜在影

响：投资者的部分或全部赎回申请可能被拒绝，同时投资者完成基金赎回时的基金份额净值可能与其提交赎回申请时的基金份额净值不同；投资者接收赎回款项的时间将可能比一般正常情形下有所延迟；对持续持有期少于7日的投资者收取不低于1.5%的赎回费；投资者没有可供参考的基金份额净值，同时赎回申请可能被延期办理、或被暂停接受、或被延缓支付赎回款项等。

### 3、本基金的特有风险

(1)本基金为混合型基金，存在大类资产配置风险，有可能受到经济周期、市场环境或管理人对市场所处的经济周期和产业周期的判断不足等因素的影响，导致基金的大类资产配置比例偏离最优化水平，给基金投资组合的绩效带来风险。本基金在股票选择上具有一定的主观性，将在个股投资决策中给基金带来一定的不确定性，因而存在个股选择风险。

#### (2) 股指期货等金融衍生品投资风险

投资于金融衍生品需承受市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险和法律风险等。由于衍生品通常具有杠杆效应，价格波动比标的工具更为剧烈，有时候比投资标的资产要承担更高的风险。并且由于衍生品定价相当复杂，不适当的估值有可能使基金资产面临损失风险。

投资股指期货可能面临如下风险：

1)杠杆风险：因股指期货采用保证金交易而存在杠杆，基金财产可能因此产生更大的收益波动。

2)基差风险：在利用股指期货对冲市场系统风险时，基金资产可能因为股指期货合约与标的指数价格变动方向不一致而承担基差风险。因存在基差风险，在股指期货合约展期操作时，基金资产可能因股指期货合约之间价差的异常变动而遭受展期风险。

3)股指期货展期时的流动性风险：本基金持有的股指期货头寸需要进行展期操作，平仓持有的股指期货合约，换成其它月份股指期货合约，当股指期货市场流动性不佳、交易量不足时，将会导致展期操作执行难度提高、交易成本增加，从而可能对基金资产造成不利的影响。

4)期货盯市结算制度带来的现金管理风险：股指期货采取保证金交易制度，保证金账户实行当日无负债结算制度，资金管理要求高。当市场持续向不利方向波动导致期货保证金不足，如果未能在规定的时间内补足保证金，按规定将被强制平仓，可能给基金资产带来超出预期的损失。

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

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

7) 连带风险：为基金资产进行结算的结算会员或该结算会员下的其他投资者出现保证金不足、又未能在规定的时间内补足，或因其他原因导致中国金融期货交易所对该结算会员下的经纪账户强行平仓时，基金资产可能因被连带强行平仓而遭受损失。

8) 未平仓合约不能继续持有风险：由于国家法律、法规、政策的变化、中国金融期货交易所交易规则的修改、紧急措施的出台等原因，基金资产持有的未平仓合约可能无法继续持有，基金资产必须承担由此导致的损失。

### （3）资产支持证券的投资风险

本基金可投资于资产支持证券，可能面临价格波动风险、流动性风险、信用风险等风险。价格波动风险是指市场利率波动会导致资产支持证券的收益率和价格波动。流动性风险是指受资产支持证券市场规模及交易活跃程度的影响，资产支持证券可能无法在同一价格水平上进行较大数量的买入或卖出，从而存在流动性风险。信用风险是指可能因资产支持证券的债务人违约，或在交易过程中发生交收违约，或由于资产支持证券信用质量降低导致证券价格下降，造成基金财产损失。

## 4、投资科创板股票存在的风险包括：

### （1）市场风险

科创板个股集中来自新一代信息技术、高端装备、新材料、新能源、节能环保及生物医药等高新技术和战略新兴产业领域。大多数企业为初创型公司，企业未来盈利、现金流、估值均存在不确定性，与传统二级市场投资存在差异，整体投资难度加大，个股市场风险加大。

科创板个股上市前五日无涨跌幅限制，第六日开始涨跌幅限制在正负 20%以内，个股波动幅度较其他股票加大，市场风险随之上升。

（2）流动性风险科创板整体投资门槛较高，个人投资者必须满足交易满两年并且资金在 50 万以上才可参与，二级市场上个人投资者参与度相对较低，机构持有个股大量流通盘导致个股流动性较差，基金组合存在无法及时变现及其他相关流动性风险。

### （3）退市风险

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

### （4）集中度风险

科创板为新设板块，初期可投标的较少，投资者容易集中投资于少量个股，市场可能存在高

集中度状况，整体存在集中度风险。

#### （5）系统性风险

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

#### （6）政策风险

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

### 5、管理风险

在基金管理运作过程中，基金管理人的研究水平、投资管理水平直接影响基金收益水平，如果基金管理人对经济形势和证券市场判断不准确、获取的信息不全、投资操作出现失误，都会影响基金的收益水平。

### 6、信用风险

信用风险是指债券发行人是否能够实现发行时的承诺，按时足额还本付息的风险。一般认为：国债的信用风险可以视为零，而其它债券的信用风险可按专业机构的信用评级确定，信用等级等级的变化或市场对某一信用等级水平下债券率的变化都会迅速的改变债券的价格，从而影响到基金资产。

### 7、操作或技术风险

在开放式基金的各种交易行为或者后台运作中，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或者导致投资者的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理人、登记机构、销售机构、证券/期货交易所、证券登记结算机构等。

### 8、合规性风险

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

### 9、其他风险

战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致基金财产的损失。

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

## （二）声明

1、本基金未经任何一级政府、机构及部门担保。投资者自愿投资于本基金，须自行承担投

资风险。

2、除基金管理人直接办理本基金的销售外，本基金还通过其他销售机构销售，但是，基金并不是销售机构的存款或负债，也没有经销售机构担保或者背书，销售机构并不能保证其收益或本金安全。

## 十九、基金合同的变更、终止与基金财产清算

### （一）《基金合同》的变更

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

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自生效后执行，自决议生效之日起在指定媒体媒介公告。

### （二）《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

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

### （三）基金财产的清算

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

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

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

#### 4、基金财产清算程序：

- （1）《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；
- （2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- （3）对基金财产进行估值和变现；
- （4）制作清算报告；

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

（6）将清算报告报中国证监会备案并公告。

（7）对基金财产进行分配；

5、基金财产清算的期限由基金财产清算小组成立后，根据基金持仓情况确定。

（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。



## 二十、基金合同的内容摘要

### （一）基金合同当事人的权利及义务

#### I 基金管理人

##### 一）基金管理人简况

名称：华宝基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼

邮政编码：200121

法定代表人：孔祥清

成立时间：2003 年 3 月 7 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证券监督管理委员会中国证监会证监基金字[2003]19 号

组织形式：有限责任公司（中外合资）

注册资本：1.5 亿元人民币

存续期间：持续经营

联系电话：021-38505888

##### 二）基金管理人的权利与义务

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

- （1）依法募集基金；
- （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）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》及有关法律的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）在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；

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

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

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

（17）法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

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。

## II 基金托管人

一）基金托管人简况

名称：中国银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街1号

法定代表人：田国立

成立时间：1983年10月31日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

存续期间：持续经营

二）基金托管人的权利与义务

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

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

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

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

（4）根据相关市场规则，为基金开设证券账户、为基金办理证券交易资金清算。

（5）提议召开或召集基金份额持有人大会；

（6）在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

（7）法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

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

（1）以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

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

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

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

- （5）保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
- （6）按规定开设基金财产的资金账户和证券账户,按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
- （7）保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；
- （8）复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、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》的规定进行；如果基金管理人未执行《基金合同》规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；
- （11）保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；
- （12）建立并保存基金份额持有人名册；
- （13）按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
- （14）依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；
- （15）依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
- （16）按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；
- （17）参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- （18）面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人；
- （19）因违反《基金合同》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- （20）按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿；
- （21）执行生效的基金份额持有人大会的决定；
- （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。

### III 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。

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

决权；

- （6）查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- （7）监督基金管理人的投资运作；
- （8）对基金管理人、基金托管人、基金销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；
- （9）法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

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》；
- （2）了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，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、赎回款项及法律法规和《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定；
- （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

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。

一）召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

- （1）终止《基金合同》；

- (2) 更换基金管理人；
- (3) 更换基金托管人；
- (4) 转换基金运作方式；
- (5) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；
- (6) 变更基金类别；
- (7) 本基金与其他基金的合并；
- (8) 变更基金投资目标、范围或策略；
- (9) 变更基金份额持有人大会程序；
- (10) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- (11) 单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；
- (12) 对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；
- (13) 法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

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

- (1) 调低基金管理费、基金托管费；
- (2) 法律法规要求增加的基金费用的收取；
- (3) 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；
- (4) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；
- (5) 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生变化；
- (6) 按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

## 二）会议召集人及召集方式

- 1、除法律法规规定或《基金合同》另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集；
- 2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集；
- 3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起

60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集。

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

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

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

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

三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 30 日，在指定媒介公告。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或通讯开会方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

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

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

（2）经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）。

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二分之一（含二分之一）；

（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。

## 五) 议事内容与程序

### 1、议事内容及提案权

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

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

### 2、议事程序

#### (1) 现场开会

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

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

#### (2) 通讯开会

在通讯开会的情况下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后 5 个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

## 六) 表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1、一般决议，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过方为有效；除下列第 2 项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之

二以上（含三分之二）通过方可做出。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》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怀疑，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

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

### 2、通讯开会

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

## 八) 生效与公告

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

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起2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。[《证券投资基金运作管理办法》第四十三条]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。

### （三）争议的处理和适用的法律

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

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

《基金合同》受中国法律管辖。

### （四）基金合同的效力

《基金合同》是约定基金当事人之间、基金与基金当事人之间权利义务关系的法律文件。

1、《基金合同》经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字并在募集结束后经基金管理人向中国证监会办理基金备案手续，并经中国证监会书面确认后生效。

2、《基金合同》的有效期自其生效之日起至基金财产清算结果报中国证监会批准并公告之日止。

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

4、《基金合同》正本一式六份，除上报有关监管机构一式二份外，基金管理人、基金托管人各持有二份，每份具有同等的法律效力。

5、《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。

## 二十一、基金托管协议内容摘要

### （一）托管协议当事人

#### 1、基金管理人

名称：华宝基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼

邮政编码：200120

法定代表人：孔祥清

成立时间：2003 年 3 月 7 日

批准设立机关：中国证监会

批准设立文号：中国证监会基金字[2003]19 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：1.5 亿元人民币

存续期间：持续经营

经营范围：基金募集；基金销售；资产管理以及中国证监会许可的其它业务。

#### 2、基金托管人

名称：中国银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：田国立

成立时间：1983 年 10 月 31 日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

经营范围：吸收人民币存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；从事同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱服务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代客外汇买卖；外汇信用卡的发行和代理国外信用卡的发行及付款；资信调查、咨询、

见证业务；组织或参加银团贷款；国际贵金属买卖；海外分支机构经营与当地法律许可的一切银行业务；在港澳地区的分行依据当地法令可发行或参与代理发行当地货币；经中国人民银行批准的其他业务。

存续期间：持续经营

（二）基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

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

（1）对基金的投资范围、投资对象进行监督。

本基金的股票投资比例为基金资产的 60%–95%，其中，投资于资源相关股票的比例不低于股票资产的 80%。现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产比例为 5%–40%，其中，持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

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

（2）对基金投融资比例进行监督；

1）本基金的股票投资比例为基金资产的 60%–95%，其中，投资于资源相关股票的比例不低于股票资产的 80%。现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产比例为 5%–40%；

2）保持不低于基金资产净值 5% 的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券；

3）本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%；

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

5）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

6）本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

7）本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；

8）本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；

9）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

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

11) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

12) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

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

14) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；

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

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

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

除上述第（2）、（12）、（16）、（18）项外，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。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。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消上述限制，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。

(3) 为对基金禁止从事的关联交易进行监督，基金管理人和基金托管人应相互提供与本机构有控股关系的股东或与本机构有其他重大利害关系的公司名单。

(4) 基金管理人向基金托管人提供其银行间债券市场交易的交易对手库，交易对手库由银行间交易会员中财务状况较好、实力雄厚、信用等级高的交易对手组成。基金管理人可以根据实际情况的变化，及时对交易对手库予以更新和调整，并通知基金托管人。基金管理人参与银行间债券市场交易的交易对手应符合交易对手库的范围。基金托管人对基金管理人参与银行间债券市

场交易的交易对手是否符合交易对手库进行监督；

（5）基金托管人对银行间市场交易的交易方式的控制按如下约定进行监督。

基金管理人应按照审慎的风险控制原则，对银行间交易对手的资信状况进行评估，控制交易对手的资信风险，确定与各类交易对手所适用的交易结算方式，在具体的交易中，应尽力争取对基金有利的交易方式。由于交易对手资信风险引起的损失，基金托管人不承担赔偿责任。

（6）基金如投资银行存款，基金管理人应根据法律法规的规定及基金合同的约定，事先确定符合条件的所有存款银行的名单，并及时提供给基金托管人，基金托管人据以对基金投资银行存款的交易对手是否符合上述名单进行监督。

（7）对法律法规规定及《基金合同》约定的基金投资的其他方面进行监督。

2、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复核。

3、基金托管人在上述第 1、2 款的监督和核查中发现基金管理人违反法律法规的规定、《基金合同》及协议的约定，应及时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确认并以书面形式对基金托管人发出回函并改正。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查。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，基金托管人应及时向中国证监会报告。

4、基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律法规、《基金合同》及协议的规定，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并依照法律法规的规定及时向中国证监会报告。基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律法规和其他有关规定，或者违反《基金合同》、协议约定的，应当立即通知基金管理人，并依照法律法规的规定及时向中国证监会报告。

5、基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查，包括但不限于：在规定时间内答复基金托管人并改正，就基金托管人的疑义进行解释或举证，对基金托管人按照法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

（三）基金管理人应对基金托管人的业务核查

1、在协议的有效期限内，在不违反公平、合理原则以及不妨碍基金托管人遵守相关法律法规及其行业监管要求的基础上，基金管理人有权对基金托管人履行协议的情况进行必要的核查，核查事项包括但不限于基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。



2、基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、无正当理由未执行或延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反法律法规、《基金合同》及协议有关规定时，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正，基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式对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。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应依照法律法规的规定报告中国证监会。

3、基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复基金管理人并改正。

#### （四）基金财产保管

##### 1、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，未经基金管理人的合法合规指令或法律法规、《基金合同》及协议另有规定，不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。

（3）基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户。

（4）基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立。

（5）除依据《基金法》、《运作办法》、《基金合同》及其他有关法律法规规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

##### 2、基金合同生效前募集资金的验资和入账

（1）基金募集期满或基金管理人依据法律法规及招募说明书决定停止基金发售时，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定的，由基金管理人在法定期限内聘请具有从事相关业务资格的会计师事务所对基金进行验资，并出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的2名以上（含2名）中国注册会计师签字方为有效。

（2）基金管理人应将属于本基金财产的全部资金划入在基金托管人处为本基金开立的基金银行账户中，并确保划入的资金与验资确认金额相一致。

##### 3、基金的银行账户的开设和管理

（1）基金托管人应负责本基金的银行账户的开设和管理。

（2）基金托管人以本基金的名义开设本基金的银行账户。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。本基金的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益、收取申购款，均需通过本基金的银行账户进行。

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

（4）基金银行账户的管理应符合法律法规的有关规定。

#### 4、基金进行定期存款投资的账户开设和管理

基金托管人根据基金管理人的指令以基金名义在基金托管人认可的存款银行的指定营业网点开立存款账户，并负责该账户的日常管理以及银行预留印鉴的保管和使用。基金管理人应派专人协助办理开户事宜。在上述账户开立和账户相关信息变更过程中，基金管理人应提前向基金托管人提供开户或账户变更所需的相关资料，并对基金托管人给予积极配合和协助。

#### 5、基金证券账户、结算备付金账户及其他投资账户的开设和管理

（1）基金托管人应当代表本基金，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责任公司开设证券账户。

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

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

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

#### 6、债券托管专户的开设和管理

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

#### 7、基金财产投资的有关有价凭证的保管

基金财产投资的实物证券、银行定期存款存单等有价凭证由基金托管人负责妥善保管。基金托管人对其以外机构实际有效控制的有价凭证不承担责任。

#### 8、与基金财产有关的重大合同及有关凭证的保管

基金托管人按照法律法规保管由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同及有关凭证。基金管理人代表基金签署有关重大合同后应在收到合同正本后 30 日内将一份正本的原件提交给基金托管人。除协议另有规定外，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。重大合同由基金管理人与基金托管人按规定各自保管至少 15 年。

#### （五）基金资产净值计算与复核

1、基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的净资产值。基金份额净值是指计算日基金资产净值除以计算日基金份额余额所得的单位基金份额的价值。

2、基金管理人应在基金合同约定的估值日对基金财产估值。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结束后计算得出当日的该基金份额净值，并以双方约定的方式发送给基金托管人。基金托管人应对净值计算结果进行复核，并以双方约定的方式将复核结果传送给基金管理人，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

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

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

#### （六）基金份额持有人名册的保管

##### 1、基金份额持有人名册的内容

基金份额持有人名册的内容包括但不限于基金份额持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册包括以下几类：

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

##### 2、基金份额持有人名册的提供

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

在相关的名册生成后 5 个工作日内向基金托管人提供。

### 3、基金份额持有人名册的保管

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

#### （七）争议解决方式

1、协议适用中华人民共和国法律并从其解释。

2、基金管理人与基金托管人之间因协议产生的或与协议有关的争议可通过友好协商解决。但若自一方书面提出协商解决争议之日起 60 日内争议未能以协商方式解决的，则任何一方有权将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会，并按其时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。

3、除争议所涉的内容之外，协议的当事人仍应履行协议的其他规定。

#### （八）托管协议的变更与终止

##### 1、托管协议的变更

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

##### 2、托管协议的终止

发生以下情况，托管协议应当终止：

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

## 二十二、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。基金管理人有权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及内容。主要服务内容如下：

### （一）资料寄送

投资人更改个人信息资料，请及时到原开立华宝基金账户的销售网点更改。

在从销售机构获取准确的客户地址、邮编和电子邮箱地址的前提下，基金管理人将负责寄送以下资料：

#### 1、基金投资人对账单

基金管理人将在每月度结束后的3个工作日内，向已经定制了电子对账单服务的基金份额持有人提供电子对账单。如基金持有人因特殊原因需要获取指定期间的纸质对账单，可拨打我公司客服电话400-700-5588（免长途话费）、021-38924558，按“0”转人工服务，提供姓名、开户证件号码或基金账号、邮寄地址、邮政编码、联系电话，客服人员核对信息无误后，为基金持有人免费邮寄纸质对账单。

#### 2、其他相关的信息资料

基金管理人以说明或电子形式向投资人寄送基金其他信息资料。

### （二）红利再投资

本基金收益分配时，基金份额持有人可以选择将所获红利再投资于本基金，登记注册机构将其所获红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额。红利再投资免收申购费用。

### （三）定期定额投资计划

#### 1、定义

本基金的“定期定额投资计划”是指投资人可通过本基金管理人指定的销售机构提交申请，约定每月扣款时间、扣款金额，由指定的销售机构于每月约定扣款日在投资人指定资金账户内自动完成扣款和基金申购申请的一种长期投资方式。投资者在办理本业务的同时，仍然可以进行日常申购、赎回业务。

#### 2、办理时间

本业务申请受理时间为开放式基金法定开放日 9：30—15：00

#### 3、办理场所

目前，我公司直销 e 网金及部分代销机构已开通本基金的定期定额投资业务。其中，中国建

设银行只接受个人投资者的申请。

本公司新增其他销售机构开办此业务时，将另行公告。

#### 4、申请方式

(1) 凡申请办理本业务的投资者，须先开立本公司开放式基金账户（已开户者除外），具体开户程序应遵循销售机构的相关规定。

(2) 已开立本公司开放式基金账户的投资者，请到销售机构的各营业网点申请办理此项业务，具体办理程序应遵循各销售机构的相关规定。

#### 5、扣款日期

投资者应按照销售机构的业务规则，与销售机构约定每月固定扣款日期，该扣款日期视为申购申请日（T日）；若遇约定的固定扣款日期为非基金申购开放日，则下一基金申购开放日为实际扣款日（T日）。

#### 6、扣款金额

投资者应与销售机构就申请开办本业务约定每月固定扣款（申购）金额，具体最低扣款金额以各代销机构的规定为准。投资者通过本公司直销e网金办理本业务时，每期扣款金额最低不少于人民币1元（含申购费）。

#### 7、扣款方式

销售机构将按照投资者申请时所约定的每月固定扣款日、扣款金额扣款，若遇非基金开放日则顺延到下一基金开放日；如因投资者提交变更、解约等申请而使扣款信息与注册登记机构确认的约定信息不符或基金管理人发布暂停定期定额投资业务公告等情况，则此次扣款不成功。投资者需指定一个销售机构认可的资金账户作为每月固定扣款账户。如投资者账户余额不足的，应遵循相关销售机构的规定处理。

#### 8、申购费率

若无另行公告，定期定额申购费率与正常的申购业务相同。部分销售机构处于定期定额申购费率优惠活动（包括网上交易）期间的，本基金将依照各销售机构的相关规定执行。本公司直销e网金的定期定额优惠申购费率详见本公司的公告及网站。

#### 9、交易确认

以每月实际扣款日（T日）的基金份额净值为基准计算申购份额。基金份额确认日为T+1日，投资者可在T+2日到销售机构各销售网点查询基金申购确认情况。

#### 10、本业务的变更和终止

(1) 投资者变更每月扣款金额、扣款日期、扣款账户等信息，须到原销售网点申请办理业务

变更手续，具体办理程序应遵各销售机构的相关规定；

（2）投资者终止本业务，须携带本人有效身份证件及相关业务资料到原销售机构申请办理业务终止手续，具体办理程序应遵循各销售机构的相关规定；

（3）本业务变更和终止的生效日应遵循各销售机构的具体规定。

#### （四）基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及基金合同的规定，在条件成熟的情况下提供本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换服务。基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及基金合同的规定制定并公告。

#### （五）在线服务

基金管理人利用自己的网站（[www.fsfund.com](http://www.fsfund.com)）为基金投资人提供网上查询、网上资讯服务。

#### （六）资讯服务

1、投资人如果了解申购与赎回的交易情况、基金账户份额、基金产品与服务等信息，可拨打华宝基金管理有限公司如下电话：

电话呼叫中心：4007005588，021-38924558该电话可转人工座席。

直销柜台电话：021-38505888-301或302、38505731、38505732

传真：021-50499663，50988055

#### 2、互联网站

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

电子信箱：[fsf@fsfund.com](mailto:fsf@fsfund.com)

#### （七）客户投诉和建议处理

投资人可以通过基金管理人提供的呼叫中心人工座席、书信、电子邮件、传真等渠道对基金管理人和销售机构所提供的服务进行投诉或提出建议。投资人还可以通过代销机构的服务电话对该代销机构提供的服务进行投诉。

（八）如本招募说明书存在任何您/贵机构无法理解的内容，请联系基金管理人。请确保投资前，您/贵机构已经全面理解了本招募说明书。

## 二十三、其他应披露事项

（一）本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产的诉讼；基金未进行收益分配；基金管理人及其高级管理人员未受监管部门的稽查与处罚。

（二）本报告期内，本基金在指定媒介刊登的公告如下：

| 公告日期       | 公告名称  |
|------------|---|
| 2019/08/07 | 华宝基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加上海大智慧基金销售有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告    |
| 2019/07/19 | 华宝资源优选混合型证券投资基金暂停大额申购（含定投及转换转入）业务的公告                      |
| 2019/07/17 | 华宝资源优选混合型证券投资基金 2019 年第 2 季度报告                            |
| 2019/06/30 | 华宝基金管理有限公司旗下基金资产净值公告                                      |
| 2019/06/22 | 华宝基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票的公告                             |
| 2019/06/18 | 关于华宝现金宝 E 货币基金定期转换、定期赎回转申购业务费率优惠公告                        |
| 2019/06/18 | 华宝基金关于华宝资源优选混合型证券投资基金新增第一创业为代销机构的公告                       |
| 2019/06/12 | 华宝基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加通华财富（上海）基金销售有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告 |
| 2019/04/19 | 华宝资源优选混合型证券投资基金 2019 年第 1 季度报告                            |
| 2019/04/15 | 关于华宝现金宝 E 货币基金 E 类份额转换、赎回转申购业务费率优惠公告                      |
| 2019/03/30 | 华宝资源优选混合型证券投资基金 2018 年度报告                                 |
| 2019/03/30 | 华宝资源优选混合型证券投资基金 2018 年度报告（摘要）                             |



## 二十四、招募说明书存放及查阅方式

本招募说明书公布后，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，供公众查阅、复制。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与公告的内容完全一致。

## 二十五、备查文件

以下文件存于基金管理人及基金托管人办公场所备投资人查阅。

- （一）中国证监会核准华宝资源优选混合型证券投资基金募集的文件
- （二）《华宝资源优选混合型证券投资基金基金合同》
- （三）《华宝资源优选混合型证券投资基金托管协议》
- （四）《华宝基金管理有限公司开放式基金业务规则》
- （五）法律意见书
- （六）基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- （七）基金托管人业务资格批件和营业执照
- （八）中国证监会要求的其他文件

投资人可以通过基金管理人网站，查阅或下载基金合同、招募说明书、托管协议及基金的各种定期和临时公告。

华宝基金管理有限公司

2019年9月30日