

东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金  
基金合同

基金管理人：东吴基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

二零一九年十月

# 目录

一、前言.....	1
二、释义.....	3
三、基金的基本情况.....	7
四、基金份额的发售与认购.....	8
五、基金备案.....	10
六、基金份额的申购与赎回.....	12
七、基金合同当事人及权利义务.....	21
八、基金份额持有人大会.....	28
九、基金管理人、基金托管人的更换条件和程序.....	36
十、基金的托管.....	39
十一、基金份额的注册登记.....	40
十二、基金的投资.....	41
十三、基金的财产.....	48
十四、基金资产的估值.....	49
十五、基金的费用与税收.....	54
十六、基金的收益与分配.....	56
十七、基金的会计和审计.....	58
十八、基金的信息披露.....	59
十九、基金合同的变更、终止与基金财产的清算.....	65
二十、违约责任.....	68
二十一、争议的处理.....	69
二十二、基金合同的效力.....	70
二十三、其他事项.....	71

## 一、前言

### (一)订立本基金合同的目的、依据和原则

1.订立本基金合同的目的是保护基金投资者合法权益，明确基金合同当事人的权利义务，规范基金运作，保障基金财产的安全。

2.订立本基金合同的依据是《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《中华人民共和国合同法》、《证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性风险管理规定》”)和其他有关法律法规。

3.订立本基金合同的原则是平等自愿、诚实信用、充分保护基金投资者合法权益。

(二)基金合同是规定基金合同当事人之间权利义务关系的基本法律文件，其他与基金相关的涉及基金合同当事人之间权利义务关系的任何文件或表述，如与基金合同有冲突，均以基金合同为准。本基金合同当事人包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人。

基金管理人和基金托管人自本基金合同签订并生效之日起成为本基金合同的当事人。基金投资者自依本基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，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。本基金合同的当事人按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。

(三)东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金由基金管理人依照《基金法》、基金合同及其他有关规定募集，并经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)核准。

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。

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。

(四)基金管理人、基金托管人在本基金合同之外披露涉及本基金的信息，其

内容涉及界定基金合同当事人之间权利义务关系的，如与基金合同有冲突，以基金合同为准。

基金合同应当适用《基金法》及相应法律法规之规定，若因法律法规的修改或更新导致基金合同的内容存在与届时有效的法律法规的规定不一致之处，应当以届时有效的法律法规的规定为准，及时作出相应得变更和调整，同时就该等变更或调整进行公告。

(五)本基金合同关于基金产品资料概要的编制、披露及更新等内容，将不晚于 2020 年 9 月 1 日起执行。

## 二、释义

在本基金合同中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

- 1.基金或本基金：指东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金
- 2.基金管理人或本基金管理人：指东吴基金管理有限公司
- 3.基金托管人或本基金托管人：指中国农业银行股份有限公司
- 4.基金合同或本基金合同：指《东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充
- 5.托管协议或本托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
- 6.招募说明书：指《东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金招募说明书》及其更新
- 7.基金产品资料概要：指《东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金基金产品资料概要》及其更新（本基金合同关于基金产品资料概要的编制、披露及更新等内容，将不晚于 2020 年 9 月 1 日起执行）
- 8.基金份额发售公告：指《东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金份额发售公告》
- 9.法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、司法解释、部门规章、地方性法规、地方政府规章及其他规范性文件及对该等法律法规不时作出的修订。
- 10.《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会议第五次会议通过，自 2004 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作出的修订
- 11.《销售办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 25 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》及对其不时作出的修订
- 12.《信息披露办法》：指中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及对其不时作出的修订
- 13.《运作办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 29 日颁布、同年 7 月 1 日实施

的《证券投资基金运作管理办法》及其不时作出的修订

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

15.中国：指中华人民共和国，就本基金合同而言，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区

16.中国证监会：指中国证券监督管理委员会或其地方派出机构

17.银行业监督管理机构：指中国银行业监督管理委员会

18.基金合同当事人：指受基金合同约束，根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人

19.个人投资者：指符合法律法规规定的条件可以投资证券投资基金的自然人

20.机构投资者：指符合法律法规规定可以投资证券投资基金的在中华人民共和国注册登记或经政府有关部门批准设立的机构

21.合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》及其他相关法律法规的可投资于中国境内证券的中国境外的机构投资者

22.基金投资者：指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者的合称

23.基金份额持有人：指依招募说明书和基金合同合法取得基金份额的基金投资者

24.基金销售业务：指基金的认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务

25.销售机构：指直销机构和代销机构

26.直销机构：指东吴基金管理有限公司

27.代销机构：指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金代销业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议，代为办理基金销售业务的机构

28.基金销售网点：指直销机构的直销中心及代销机构的代销网点

29.注册登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包  
括基金投资者基金账户的建立和管理、基金份额注册登记、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等

30.注册登记机构：指办理注册登记业务的机构。基金的注册登记机构为东吴基金管理有限公司或接受东吴基金管理有限公司委托代为办理注册登记业务的机构

31.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、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户

32.基金交易账户：指销售机构为基金投资者开立的、记录基金投资者通过该销售机构买卖基金份额的变动及结余情况的账户

33.基金合同生效日：指基金募集期结束后达到法律法规规定及基金合同约定的备案条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并收到其书面确认的日期

34.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，按照基金合同规定的程序终止基金合同的日期

35.基金募集期限：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

36.存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

37.工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

38.日：指公历日

39.月：指公历月

40.T日：指销售机构在规定时间受理基金投资者有效申请工作日

41.T+n日：指自T日起第n个工作日(不包含T日)

42.开放日：指为基金投资者办理基金份额申购、赎回或其他业务的日期

43.交易时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

44.认购：指在基金募集期间，基金投资者申请购买基金份额的行为

45.申购：指在基金存续期内，基金投资者申请购买基金份额的行为

46.赎回：指在基金存续期内基金份额持有人按基金合同规定的条件要求卖出基金份额的行为

47.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公告在本基金份额与基金管理人管理的其他基金份额间的转换行为

48.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变更所持基金份额销售机构的操作

49.巨额赎回：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)超过上一日基金总份额的 10%时

50.元：指人民币元

51.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

52.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

53.基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

54.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的数值

55.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

56.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

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

58.不可抗力：指本基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服，且在本基金合同由基金管理人、基金托管人签署之日后发生的，使本基金合同当事人无法全部或部分履行本基金合同的任何事件，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律法规变化、突发停电或其他突发事件、证券交易所非正常暂停或停止交易。



### 三、基金的基本情况

(一)基金的名称

东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金

(二)基金的类别

混合型

(三)基金的运作方式

契约型开放式

(四)基金的投资目标

本基金为混合型基金，在适度控制风险并保持良好流动性的前提下，以成长股作为投资对象，并对不同成长类型股票采取不同操作策略，追求超额收益。

(五)基金的最低募集份额总额和金额

基金募集份额总额不少于 2 亿份，基金募集金额不少于 2 亿元人民币。

(六)基金份额面值和认购费用

基金份额发售面值为人民币 1.00 元。

本基金的认购费率

认购金额的认购费率

认购金额	认购费率
M<100 万	0.012
100 万≤M<200 万	0.01
200 万≤M<500 万	0.006
M≥500 万	1000 元/笔

(七)基金存续期限

不定期

## 四、基金份额的发售与认购

### (一)基金份额的发售时间、发售方式、发售对象

#### 1.发售时间

自基金份额发售之日起，最长不得超过3个月，具体发售时间见基金份额发售公告。

#### 2.发售方式

本基金通过基金销售网点(包括基金管理人的直销中心及代销机构的代销网点，具体名单见基金份额发售公告)公开发售。除法律法规另有规定外，任何与基金份额发售有关的当事人不得预留和提前发售基金份额。

#### 3.发售对象

中国境内的个人投资者和机构投资者(法律法规禁止投资证券投资基金的除外)、合格境外机构投资者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者。

### (二)基金份额的认购

#### 1.认购费用

本基金以认购金额为基数采用比例费率计算认购费用，认购费率不得超过认购金额的1.2%。本基金的认购费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。基金认购费用不列入基金财产，主要用于基金的市场推广、销售、注册登记等基金募集期间发生的各项费用。

#### 2.募集期利息的处理方式

有效认购款项在基金募集期间形成的利息，在基金合同生效后，折算成基金份额计入基金投资者的账户，具体份额以注册登记机构的记录为准。

#### 3.基金认购份额的计算

计算公式如下：

净认购金额=认购金额/[1+认购费率]；

认购费用=认购金额-净认购金额

认购份额=(净认购金额+认购利息)/基金份额面值。

认购费用以人民币元为单位，计算结果按照四舍五入方法，保留到小数点后

两位；认购份额计算结果按照四舍五入方法，保留到小数点后两位，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。

### (三)基金份额认购原则及持有限额

- 1.基金投资者认购前，需按销售机构规定的方式全额缴款。
2. 基金投资者在基金募集期内可以多次认购基金份额，认购一经受理不得撤销。
- 3.基金管理人可以对每个账户的单笔最低认购金额进行限制，具体限制请参看招募说明书。
- 4.基金管理人可以对募集期间的单个基金投资者的累计认购金额进行限制，具体限制和处理方法请参看招募说明书。

## 五、基金备案

### (一)基金备案和基金合同生效

1.本基金自基金份额发售之日起3个月内，在基金募集份额总额不少于2亿份，基金募集金额不少于2亿元人民币，并且基金份额持有人的人数不少于200人的条件下，基金管理人依据法律法规和招募说明书的规定可以决定停止基金发售。基金管理人应当自基金募集期结束之日起10日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告之日起10日内，向中国证监会提交验资报告，办理基金备案手续。自中国证监会书面确认之日起，基金备案手续办理完毕，基金合同生效。基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日予以公告

2.基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对基金合同生效事宜予以公告。

3.本基金合同生效前，基金投资者的认购款项只能存入专用账户，任何人不得动用。认购资金在基金募集期形成的利息在本基金合同生效后折成基金投资者认购的基金份额，归基金投资者所有。利息转份额的具体数额以注册登记机构的记录为准。

### (二)基金募集失败

1.基金募集期届满，未达到基金合同的生效条件，或基金募集期内发生不可抗力使基金合同无法生效，则基金募集失败。

2.如基金募集失败，基金管理人应以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用，在基金募集期限届满后30日内退还基金投资者已缴纳的款项，并加计同期银行存款利息。

3.如基金募集失败，基金管理人、基金托管人及代销机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和代销机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。

### (三)基金存续期内的基金份额持有人数量和资金数额

基金合同生效后的存续期内，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，基金管理人应当及时报告中国证监会；基金份额持有人数量连续20个工作日达不到200人，或连续20个工作日基金资产净值低于5000

万元，基金管理人应当及时向中国证监会报告，说明出现上述情况的原因并提出解决方案。

## 六、基金份额的申购与赎回

### (一) 申购和赎回场所

本基金的申购与赎回将通过基金管理人的直销中心及代销机构的代销网点进行。具体的销售网点将由基金管理人在招募说明书或其他公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减代销机构，并在管理人网站公示。若基金管理人或其指定的代销机构开通电话、传真或网上等交易方式，投资人可以通过上述方式进行申购与赎回，具体办法由基金管理人另行公告。

### (二) 申购和赎回的开放日及时间

#### 1. 开放日及开放时间

基金投资者在开放日申请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。开放日的具体业务办理时间在招募说明书中载明。

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 3 个月开始办理申购，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。

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

在确定申购开始与赎回开始时间后，由基金管理人在开始日前两个工作日内在至少一种指定媒介和基金管理人的公司网站上公告。

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。基金投资者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，即基金份额的申购与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.基金采用金额申购和份额赎回的方式，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3.赎回遵循“先进先出”原则，即按照基金投资者认购、申购的先后次序进行顺序赎回；

4.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；

5.基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可更改上述原则，但最迟应在新的原则实施前依照有关规定在指定媒介及基金管理人网站上予以公告。

#### (四)申购与赎回的程序

##### 1.申购和赎回的申请

基金投资者必须根据销售机构规定的程序，在开放日的交易时间内提出申购或赎回的申请。

基金投资者在提交申购申请时须按销售机构规定的方式备足申购资金，基金投资者在提交赎回申请时须持有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回申请无效而不予成交。

##### 2.申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前收到申购和赎回申请的当日作为申购或赎回申请日(T日)，并在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，基金投资者可在T+2日后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。

##### 3.申购和赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式，若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功。若申购不成功或无效，基金管理人或基金管理人指定的代销机构将基金投资者已缴付的申购款项本金退还给投资者。

基金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，赎回款项的支付办法参照本基金合同和有关法律、法规规定处理。

#### (五)申购和赎回的金额

1.基金管理人可以规定基金投资者首次申购和每次申购的最低金额以及每次赎回的最低份额，具体规定请参见招募说明书。

2.基金管理人可以规定基金投资者每个交易账户的最低基金份额余额，具体规定请参见招募说明书。

3.基金管理人可以规定单个投资者累计持有的基金份额数量或持有的基金份额占基金份额总数的比例上限，具体规定请参见招募说明书。

4.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，具体规定请参见相关公告。

5.基金管理人可以根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整上述规定的数量或比例限制。基金管理人必须在调整前依照有关规定在指定媒介和基金管理人网站上公告。

#### (六)申购和赎回的价格、费用及其用途

申购本基金的申购费用采用“外扣法”计算，基金投资者的申购金额包括申购费用和净申购金额。

##### 1.基金申购份额的计算

基金的申购金额包括申购费用和净申购金额，其中：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

申购费用以人民币元为单位，计算结果按照四舍五入方法，保留至小数点后两位；申购份额计算结果按照四舍五入方法，保留到小数点后两位，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。

##### 2.基金赎回金额的计算

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



赎回费用以人民币元为单位，计算结果按照四舍五入方法，保留小数点后两位；赎回金额计算结果按照四舍五入方法，保留到小数点后两位，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。

3.T日的基金份额净值在当日收市后计算，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.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。

5.本基金的申购费用应在投资者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。赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，对持续持有期不少于7日的投资者收取的赎回费25%归基金财产，75%用于支付注册登记费和其他必要的手续费，对持续持有期少于7日的投资者收取不低于1.5%的赎回费并全额计入基金财产，具体费率详见招募说明书。

6.本基金的申购费率最高不超过申购金额的2%，赎回费率最高不超过基金份额赎回金额的1.5%。本基金的申购费率、赎回费率和收费方式由基金管理人根据基金合同的规定确定，并在招募说明书中列示。基金管理人可以在履行相关手续后，在基金合同约定的范围内调整申购、赎回费率或调整收费方式，基金管理人依照有关规定在最迟应于新的费率或收费方式实施日前在指定媒介和基金管理人网站上公告。

7.基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情况下根据市场情况制定基金促销计划，针对以特定交易方式（如网上交易、电话交易等）进行基金交易的基金投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，基金管理人可以在按中国证监会要求履行必要手续后，对基金投资者适当调整基金申购费率、赎回费率和转换费率。

#### (七)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基金投资者的申购申请：

- 1.因不可抗力导致基金无法正常工作；
- 2.证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；

3.发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况；

4.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，或基金管理人认为会损害已有基金份额持有人利益的申购；

5.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；

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数的比例达到或者超过基金份额总数的 50%，或者有可能导致投资者变相规避前述 50%比例要求的情形；

7.法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述暂停申购情形时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介和基金管理人网站上刊登暂停申购公告。如果基金投资者的申购申请全部或部分被拒绝的，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。

#### (八)暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受基金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.证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

3.连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

4.发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况。

5.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，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请。

6.法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形时，基金管理人应在当日向中国证监会报告，已接受的赎回申请，基金管理人应按时足额支付；如暂时不能足额支付，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,若连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回,延期支付最长不得超过 20 个工作日,并依照《信息披露办法》在至少一种中国证监会指定的信息披露媒介公告。投资者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。

#### (九)巨额赎回的情形及处理方式

##### 1.巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过前一日基金总份额的 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顺延赎回。

(1)全额赎回:当基金管理人认为有能力支付基金投资者的赎回申请时,按正常赎回程序执行。

(2)部分顺延赎回:当基金管理人认为支付基金投资者的赎回申请有困难或认为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,基金管理人应当在当日接受赎回比例不低于上一日基金总份额的 10%的前提下,对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请,应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例,确定当日受理的赎回份额;基金投资者未能赎回部分,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,当日未获赎回的部分申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理,无优先权并以该开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额。如基金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。

(3)如发生单个开放日内单个基金份额持有人申请赎回的基金份额占前一开放日基金总份额的比例超过 20%时,本基金管理人可以对该单个基金份额持有人超过前述约定比例的赎回申请实施延期赎回。

对该单个基金份额持有人不超过前述比例的赎回申请,与当日其他赎回申请

一起，按上述“（1）全额赎回”或“（2）部分延期赎回”方式处理。如下一开放日，该单一基金份额持有人剩余未赎回部分仍旧超出前述比例约定的，继续按前述规则处理，直至该单一基金份额持有人单个开放日内申请赎回的基金份额占前一开放日基金总份额的比例低于前述比例。

在不违反法律法规的前提下，基金管理人在履行适当程序后，有权根据当时市场环境调整前述比例及处理规则，并在指定媒介上进行公告。

### 3.巨额赎回的公告

当发生巨额赎回并顺延赎回时，基金管理人应在 2 日内通过中国证监会指定媒介、基金管理人的公司网站或代销机构的网点刊登公告，并通过邮寄、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，并说明有关处理方法。

若连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受赎回申请；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，并应当在指定媒介和基金管理人网站上进行公告。

#### (十)暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

1.发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人应依照有关规定在指定媒介和基金管理人网站上刊登暂停公告。

2.如发生暂停的时间为 1 日，第 2 个工作日基金管理人应依照有关规定在指定媒介和基金管理人网站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 个工作日在指定媒介和基金管理人网站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 个工作日在指定媒介和基金管理人网站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，并及时告知基金托管人与相关机构。

#### (十二)基金的非交易过户

基金的非交易过户指基金注册登记机构受理继承、捐赠、司法强制执行而产生的非交易过户和经注册登记机构认可、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投资者。

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注册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注册登记机构的规定办理，并按基金注册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在届时发布公告或更新的招募说明书中确定。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

基金账户和基金份额冻结、解冻的业务，由注册登记机构办理。

基金注册登记机构只受理国家有关机关依法要求的基金账户或基金份额的冻结与解冻以及注册登记机构认可的其他情况的基金账户或基金份额的冻结与解冻。基金账户或基金份额被冻结的，被冻结基金份额所产生的权益一并冻结，法律法规、中国证监会或法院判决、裁定另有规定的除外。

当基金份额处于冻结状态时，基金注册登记机构或其他相关机构应拒绝该部

分基金份额的赎回申请、非交易过户以及基金的转托管。

## 七、基金合同当事人及权利义务

### (一)基金管理人

#### 1、基金管理人简况

名称：东吴基金管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区源深路 279 号

办公地址：上海市浦东新区源深路 279 号

邮政编码：200135

法定代表人：王炯

成立时间：2004 年 9 月 2 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监基金字[2004]132 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：一亿元人民币

存续期间：永久存续

#### 2、基金管理人的权利

(1) 自本基金合同生效之日起，依照有关法律法规和本基金合同的规定独立运用基金财产；

(2) 获得基金管理人报酬；

(3) 依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

(4) 在符合有关法律法规和本基金合同的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则，决定基金的除调高托管费和管理费之外的费率结构和收费方式；

(5) 根据本基金合同及有关规定监督基金托管人，对于基金托管人违反了本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金财产、其他基金当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会和银行业监督管理机构，并采取必要措施保护基金及相关基金当事人的利益；

(6) 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购、赎回和转换申请；

(7) 自行承担基金注册登记机构或选择、更换注册登记机构，并对注册登

记机构的代理行为进行必要的监督和检查；

(8) 选择、更换代销机构，并依据销售代理协议和有关法律法规，对其行为进行必要的监督和检查；

(9) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

(10) 依法召集基金份额持有人大会；

(11) 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；

(12) 根据国家有关规定，在法律法规允许的前提下，以基金的名义依法为基金融资、融券；

(13) 法律法规规定的其他权利。

### 3、基金管理人的义务

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；如认为基金代销机构违反基金合同、基金销售与服务代理协议及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

(2) 办理基金备案手续；

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

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

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

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

(7) 依法接受基金托管人的监督；

(8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的



方法符合基金合同等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回的价格；

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(10) 编制季度报告、中期报告和年度报告；

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

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

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

(14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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

(16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上；

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

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

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

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

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

(22) 当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基

金事务的行为承担责任；但因第三方责任导致基金财产或基金份额持有人利益受到损失，而基金管理人首先承担了责任的情况下，基金管理人有权向第三方追偿；

(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定；

(26) 建立并保存基金份额持有人名册，根据托管协议的约定向基金托管人提供基金份额持有人名册；

(27) 法律法规、基金合同规定的以及中国证监会要求的其他义务。

## (二)基金托管人

### 1、基金托管人简况

名称：中国农业银行股份有限公司

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：周慕冰

成立时间：2009 年 1 月 15 日

批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复[2009]13 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：32,479,411.7 万元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]23 号

### 2、基金托管人的权利

(1) 获得基金托管费；

(2) 监督基金管理人对本基金的投资运作；

(3) 自本基金合同生效之日起，依法保管基金财产；

(4) 在基金管理人更换时，提名新任基金管理人；

(5) 根据本基金合同及有关规定监督基金管理人，对于基金管理人违反本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金财产、其他基金合同当事人的利益

造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关基金合同当事人的利益；

- (6) 依法召集基金份额持有人大会；
- (7) 按规定取得基金份额持有人名册；
- (8) 法律法规规定的其他权利。

### 3、基金托管人的义务

- (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，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；对所托管的不同基金财产分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在名册登记、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；
- (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应予保密，不得向他人泄露；
- (8) 对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；
- (9) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料不少于 15 年；
- (10) 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；
- (11) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

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

(13) 按照规定监督基金管理人的投资运作；

(14) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

(15) 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；

(16) 按照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自行召集基金份额持有人大会；

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

(18) 按规定监督基金管理人按照法律法规规定和基金合同履行其义务，基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿；

(19) 根据本基金合同和托管协议规定建立并保存基金份额持有人名册；

(20) 参加基金财产清算组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

(21) 面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告中国证监会和中国银监会，并通知基金管理人；

(22) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；

(23) 法律法规、基金合同规定的以及中国证监会要求的其他义务。

### (三) 基金份额持有人

基金投资者自依招募说明书、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，直至其不再持有本基金的基金份额，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的完全承认和接受。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》及其他有关法律法规的规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：

(1) 分享基金财产收益；

(2) 参与分配清算后的剩余基金财产；

(3) 依法转让或者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、基金份额代销机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；
- (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》及其他有关法律法规的规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：

- (1) 遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；
- (2) 缴纳基金认购、申购款项及法律法规、基金合同和招募说明书规定的费用；
- (3) 在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；
- (4) 不从事任何有损基金及其他基金份额持有人合法权益的活动；
- (5) 执行生效的基金份额持有人大会决议；
- (6) 返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人、基金托管人及基金管理人的代理人处获得的不当得利；
- (7) 法律法规和基金合同规定的其他义务。

(四) 本基金合同当事人各方的权利义务以本基金合同为依据，不因基金账户名称而有所改变。

## 八、基金份额持有人大会

(一)基金份额持有人大会由基金份额持有人或基金份额持有人的合法授权代表共同组成。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

(二)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)转换基金运作方式；

(3)变更基金类别；

(4)变更基金投资目标、投资范围或投资策略；

(5)变更基金份额持有人大会议事程序；

(6)更换基金管理人、基金托管人；

(7)提高基金管理人、基金托管人的报酬标准。但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；

(8)本基金与其他基金的合并；

(9)对基金合同当事人权利、义务产生重大影响，需召开基金份额持有人大会的变更基金合同等其他事项；

(10)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；

(11)法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

2.出现以下情形之一的，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、其他应由基金或基金份额持有人承担的费用；

(2)在法律法规和本基金合同规定的范围内变更基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式；

(3)因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；

(4)法律法规要求增加的基金费用的收取；

(5)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基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化；

(6)按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

### (三)召集人和召集方式

1.除法律法规或本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。基金管理人未按规定召集或者不能召集时，由基金托管人召集。

2.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，应当自行召集。

3.代表基金份额 10%以上（以上含本数，下同）的基金份额持有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。

4.代表基金份额 10%以上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，代表基金份额 10%以上的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会，但应当至少提前 30 日向中国证监会备案。

5.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。

### (四)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.基金份额持有人大会的召集人(以下简称“召集人”)负责选择确定开会时

间、地点、方式和权益登记日。召开基金份额持有人大会，召集人必须于会议召开日前 30 日在指定媒介和基金管理人网站公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容：

- (1)会议召开的时间、地点和出席方式；
- (2)会议拟审议的主要事项；
- (3)会议形式；
- (4)议事程序；
- (5)有权出席基金份额持有人大会的权益登记日；
- (6)授权委托书的内容要求(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；
- (7)表决方式；
- (8)会务常设联系人姓名、电话；
- (9)出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- (10)召集人需要通知的其他事项。

2.采用通讯方式开会并进行表决的情况下，由召集人决定通讯方式和表决方式，并在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、表决意见的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书面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书面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书面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，不影响计票和表决效力。

#### (五)基金份额持有人出席会议的方式

##### 1.会议方式

(1)基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会。

(2)现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席，基金管理人或基金托管人拒不派代表出席的，不影响表决效力。



(3)通讯方式开会指按照本基金合同的相关规定以非现场方式进行表决。

## 2.召开基金份额持有人大会的条件

### (1)现场开会方式

在同时符合以下条件时，现场会议方可举行：

1) 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，全部有效凭证所对应的基金份额应占权益登记日基金总份额的 50% 以上；

2) 亲自出席会议者持有基金份额持有人凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及授权委托书等文件符合有关法律法规和基金合同及会议通知的规定。

未能满足上述条件的情况下，则召集人可另行确定并公告重新开会的时间(至少应在 25 个工作日后)和地点，但确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不变。

(2)通讯开会方式。通讯开会系指基金份额持有人或其受托人将其对表决事项的投票在表决截至日以前送达至召集人指定的地址。

在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

1)召集人按本基金合同规定公布会议通知后，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和统计基金份额持有人的表决意见，基金管理人或基金托管人经通知拒不参加收取和统计表决意见的，不影响表决效力；

3)本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额应占权益登记日基金总份额的 50% 以上；

4)直接出具表决意见的基金份额持有人或受托代表他人出具表决意见的代表，同时提交的持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与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。

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；表面符合法律法规和会议通知规定的表决意见即视为有效的表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

如果开会条件达不到上述的条件，则召集人可另行确定并公告重新表决的时间(至少应在 25 个工作日后)，且确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不变。

#### (六)议事内容与程序

##### 1. 议事内容及提案权

(1) 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。

(2) 基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日基金总份额 10% (含 10%) 以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案；也可以在会议通知发出后向大会召集人提交临时提案，临时提案应当在大会召开日至少 35 天前提交召集人并由召集人公告。

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日 30 天前公告。

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。

召集人对于基金管理人、基金托管人和基金份额持有人提交的临时提案进行审核，符合条件的应当在大会召开日 30 天前公告。

(3) 对于基金份额持有人提交的提案(包括临时提案)，大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

关联性。大会召集人对于基金份额持有人提案涉及事项与基金有直接关系，并且不超出法律法规和基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的，应提交大会审议；对于不符合上述要求的，不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会

上进行解释和说明。

程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题作出决定。如将其提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会作出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

(4)单独或合并持有权益登记日基金总份额 10%以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案、基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于 6 个月。法律法规另有规定的除外。

(5)基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后，如果需要对原有提案进行修改，应当最迟在基金份额持有人大会召开日前 30 日公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有 30 日的间隔期。

## 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规定程序宣布会议议事程序及注意事项，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，经合法执业的律师见证后形成大会决议。

大会由基金管理人授权代表主持。在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权代表主持；如果基金管理人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以所代表的基金份额 50% 以上多数选举产生一名代表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。

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)、身份证号码、住所地址、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名(或单位名称)等事项。

### (2) 通讯方式开会

在通讯表决开会的方式下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的

表决截止日期第 2 日在公证机构监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。如监督人经通知但拒绝到场监督，不影响决议效力。

3.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。

(七)决议形成的条件、表决方式、程序

1.基金份额持有人所持每一基金份额享有平等的表决权。

2.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

一般决议须经出席会议的基金份额持有人及其代理人所持表决权的 50% 以上通过方为有效，除下列(2)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

特别决议须经出席会议的基金份额持有人及代理人所持表决权的三分之二以上通过方为有效；更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式、提前终止基金合同必须以特别决议通过方为有效。

3.基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会核准，或者备案，并予以公告。

4.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，否则表面符合法律法规和会议通知规定的表决意见即视为有效的表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

5.基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

6.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。

(八)计票

1.现场开会

(1)如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，则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推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和代理人中推举 3 名基金份额持有人担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力及表决效力。

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

(3) 如会议主持人对于提交的表决结果有怀疑，可以对投票数进行重新清点；如会议主持人未进行重新清点，而出席会议的基金份额持有人或代理人对会议主持人宣布的表决结果有异议，其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点，会议主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

(4) 计票过程应由公证机关予以公证。

## 2. 通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，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(如果基金托管人为召集人，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不派代表监督计票的，不影响计票效力及表决效力。但基金管理人或基金托管人应当至少提前两个工作日通知召集人，由召集人邀请无直接利害关系的第三方担任监督计票人员。

(九) 基金份额持有人大会决议报中国证监会核准或备案后的公告时间、方式

1. 基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效，并在生效后方可执行。

2. 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。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定。

3. 基金份额持有人大会决议应自生效之日起 2 日内在指定媒介和基金管理人网站公告。

4. 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、公证机关、公证员姓名等一同公告。

## 九、基金管理人、基金托管人的更换条件和程序

### (一)基金管理人的更换

#### 1.基金管理人的更换条件

有下列情形之一的，经中国证监会核准，基金管理人职责终止：

- (1)基金管理人被依法取消其基金管理资格的；
- (2)基金管理人解散、依法撤销或依法宣告破产；
- (3)基金管理人被基金份额持有人大会解任；
- (4)法律法规和基金合同规定的其他情形。

#### 2.基金管理人的更换程序

更换基金管理人必须依照如下程序进行：

(1)提名：新任基金管理人由基金托管人或者由单独或合计持有基金总份额10%以上的基金份额持有人提名；

(2)决议：基金份额持有人大会在基金管理人职责终止后6个月内对被提名的新任基金管理人形成决议，新任基金管理人应当符合法律法规及中国证监会规定的资格条件；

(3)核准：新任基金管理人产生之前，由中国证监会指定临时基金管理人，更换基金管理人的基金份额持有人大会决议应经中国证监会核准生效后方可执行；

(4)交接：基金管理人职责终止的，应当妥善保管基金管理业务资料，及时办理基金管理业务的移交手续，新任基金管理人应当及时接收，并与基金托管人核对基金财产总值；

(5)审计：基金管理人职责终止的，应当按照法律法规规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报中国证监会备案；审计费用在基金财产中列支；

(6)公告：基金管理人更换后，由基金托管人在获得中国证监会核准后2日内在指定媒介上公告；

(7)基金名称变更：基金管理人退任后，应原任基金管理人要求，本基金应替换或删除基金名称中与原任基金管理人有关的名称字样。

## (二)基金托管人的更换

### 1.基金托管人的更换条件

有下列情形之一的，经中国证监会核准，基金托管人职责终止：

- (1)基金托管人被依法取消其基金托管资格的；
- (2)基金托管人解散、依法撤销或依法宣布破产；
- (3)基金托管人被基金份额持有人大会解任；
- (4)法律法规和基金合同规定的其他情形。

### 2.基金托管人的更换程序

(1)提名：新任基金托管人由基金管理人或者由单独或合计持有基金总份额10%以上的基金份额持有人提名；

(2)决议：基金份额持有人大会在基金托管人职责终止后6个月内对被提名的新任基金托管人形成决议；

(3)核准：新任基金托管人产生之前，由中国证监会指定临时基金托管人，更换基金托管人的基金份额持有人大会决议应经中国证监会核准生效后方可执行；

(4)交接：基金托管人职责终止的，应当妥善保管基金财产和基金托管业务资料，及时与新任基金托管人办理基金财产和托管业务移交手续，新任基金托管人应当及时接收，并与基金管理人核对基金财产总值；

(5)审计：基金托管人职责终止的，应当按照规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计，并予以公告，同时报中国证监会备案；审计费用从基金财产中列支；

(6)公告：基金托管人更换后，由基金管理人在获得中国证监会核准后2日内在指定媒介上公告。

## (三)基金管理人与基金托管人同时更换

1.提名：如果基金管理人和基金托管人同时更换，由单独或合计持有基金总份额10%以上的基金份额持有人提名新的基金管理人和基金托管人；

2.基金管理人和基金托管人的更换分别按上述程序进行；

3.公告：新任基金管理人和新任基金托管人应在更换基金管理人和基金托管人的基金份额持有人大会决议获得中国证监会核准后2日内在指定媒介上联合

公告。

(四)新基金管理人接受基金管理业务或新基金托管人接受基金财产和基金托管业务前,原基金管理人或原基金托管人应依据法律法规和基金合同的规定继续履行相关职责,并保证不对基金份额持有人的利益造成损害。



## 十、基金的托管

基金财产由基金托管人保管。基金管理人应与基金托管人按照《基金法》、基金合同及有关规定订立《东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金托管协议》。

订立托管协议的目的是明确基金托管人与基金管理人之间在基金份额持有人名册登记、基金财产的保管、基金财产的管理和运作及相互监督等相关事宜中的权利义务及职责，确保基金财产的安全，保护基金份额持有人的合法权益。

## 十一、基金份额的注册登记

(一)本基金的注册登记业务指基金登记、存管、清算和结算业务，具体内容  
包括基金投资者基金账户建立和管理、基金份额注册登记、基金份额销售业务的  
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等。

(二)本基金的注册登记业务由基金管理人或基金管理人委托的其他符合条  
件的机构负责办理。基金管理人委托其他机构办理本基金注册登记业务的，应与  
代理机构签订委托代理协议，以明确基金管理人和代理机构在注册登记业务中的  
权利义务，保护基金投资者和基金份额持有人的合法权益。

(三)注册登记机构享有如下权利：

- 1.建立和管理基金投资者基金份额账户；
- 2.取得注册登记费；
- 3.保管基金份额持有人开户资料、交易资料、基金份额持有人名册等；
- 4.在法律法规允许的范围内，对注册登记业务的办理时间进行调整，并依照  
有关规定在指定媒介上公告；
- 5.法律法规规定的其他权利。

(四)注册登记机构承担如下义务：

- 1.配备足够的专业人员办理本基金的注册登记业务；
- 2.严格按照法律法规和基金合同规定的条件办理基金的注册登记业务；
- 3.保存基金份额持有人名册及相关的申购、赎回与转换等业务记录 15 年以  
上；
- 4.对基金份额持有人的基金账户信息负有保密义务，因违反该保密义务对投  
资者或基金造成的损失，须承担相应的赔偿责任，但司法强制检查情形除外；
- 5.按基金合同和招募说明书规定为投资者办理非交易过户业务、转托管和提  
供其他必要服务；
- 6.法律法规规定的其他义务。

## 十二、基金的投资

### (一)投资目标

本基金为混合型基金，在适度控制风险并保持良好流动性的前提下，以成长股作为投资对象，并对不同成长类型股票采取不同操作策略，追求超额收益。

### (二)投资理念

以成长为导向，策略操作提高投资收益。

### (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、债券、权证、以及法律法规或经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金为灵活配置混合型基金，投资组合中股票类资产投资比例为基金资产的 30%-80%，固定收益类资产投资比例为基金资产的 0-70%，现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金投资于权证、以及其它金融工具投资比例遵从法律法规及监管机构的规定。

对于中国证监会允许投资的创新类金融产品（包括未来将推出的股指期货等衍生金融产品），将依据有关法律法规进行投资管理。如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

### (四)投资策略

本基金采取自上而下策略，根据对宏观经济、政策和证券市场走势的综合分析，对基金资产在股票、债券、现金和衍生产品上的投资比例进行灵活配置。在股票投资策略上，本基金根据上市公司成长特征，将上市公司分成三种类型：长期快速成长型公司；周期成长型公司；转型成长型公司。对于不同成长类型的股票，本基金将采取买入持有操作策略（兼顾波段操作策略）、或者周期持有策略进行投资组合管理，提高投资收益。

本基金的投资策略主要体现在资产配置策略、选股策略、股票操作策略、债券投资策略、权证投资策略等几方面。

#### 1、资产配置策略

对于大类资产的配置，本基金主要是由投资研究团队根据宏观经济运行态势、宏观经济政策变化、证券市场运行状况、国际市场变化情况等因素的深入研究，判断证券市场的发展趋势和风险收益水平。在各大类资产投资比例限制前提下，根据大类资产风险收益分析结果，并结合本基金风险收益目标，灵活确定基金资产在股票、债券、现金和衍生产品上的配置比例。

## 2、选股策略

本基金以成长为导向，选取未来快速成长的股票作为投资对象。企业业绩成长可以分为两类：内涵式增长和外延式增长。内涵式增长是指企业依靠自身技术、管理等能力而获得业绩的增长。根据企业成长对宏观经济的敏感性不同，内涵式增长又可分为稳定型增长和周期型增长。稳定型增长是指企业业绩增长与经济周期敏感性相对较低；周期型增长是指企业业绩增长与经济周期敏感性相对较高。外延式增长是指企业通过收购、兼并、或者重组等方式带来业绩增长，这类增长方式能带来企业业绩短期爆发增长。

根据上市公司成长特征，可将成长型上市公司分成三种类型：长期快速成长型公司；周期成长型公司；转型成长型公司。对于不同成长型公司，本基金将根据相应价值投资评价体系精选投资价值高的股票，进入本基金的股票池。

## 3、股票操作策略

对于不同成长特征的股票，在经济周期不同阶段内，其股价表现是不同的。本基金根据以上三种类型股票股价与经济周期之间的关系，确定股票资产的配置。具体策略是：

(1)在经济周期上升阶段，加大周期成长型股票配置比例，并保持适度的稳定型行业中快速成长型股票的配置比例。

(2)在经济周期下降阶段，加大稳定型行业中快速成长型股票的配置比例；降低周期型股票配置比例。

(3)对于转型类股票的配置，由于其股价走势基本不受经济周期的约束，所以，只要能够确定转型成功，并将使公司业绩发生根本变化，就可以买入持有，但最高配置比例不超过股票资产的 30%。

为了规避股票资产配置过度集中于某一类型股票而带来投资风险，本基金对不同成长类型股票投资比例进行了一定限制：

- (1)对于长期快速成长型股票，配置比例不低于股票资产的 30%；
- (2)对于周期成长型股票，最高配置比例不超过股票资产的 60%；
- (3)对于转型成长型股票，最高配置比例不超过股票资产的 30%。

从实际投资经验看，股票操作策略主要有两种：一种是买入持有操作策略；另一种是周期持有策略。本基金对具有不同成长特征的股票将采取不同操作策略进行投资组合管理，具体原则是：

(1)对于快速成长型股票，采取中长期买入持有操作策略，但不片面强调中长期静态持有。具体而言：本基金根据对上市公司成长性动态变化的分析预测，兼顾考虑当时的市场趋势，通过对股票价格与价值相对偏离程度的分析，对快速成长型股票适时进行一定比例仓位的波段操作。

(2)对于周期成长型股票，采取周期持有策略。在行业景气复苏和上升阶段，逐步增加周期型股票配置比例；在行业景气达到顶峰之前逐步降低周期型股票配置比例。

(3)对转型成长型股票，采取中短期买入持有操作策略。

#### 4、债券投资策略

本基金将根据利率变化的大周期、市场运行的小周期和中国债券市场的扩张特征，制定相应的债券投资策略，以获取利息收益为主、资本利得为辅。

#### 5、权证投资策略

本基金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，把握市场的短期波动，进行积极操作，追求在风险可控的前提下实现稳健的超额收益。

#### (五)业绩比较基准

65%\*沪深 300 指数+35%\*中信标普全债指数。

根据相关法律法规定义，本基金为混合型基金。因此，本基金总体业绩比较基准中，股票类资产业绩比较基准给予了 65%的权重，而固定收益类资产业绩比较基准给予了 35%的权重。本基金选择沪深 300 指数作为股票类资产业绩比较基准，沪深 300 指数成份股涵盖沪深两市，是由沪深两市流通市值最大并且流动性好、业绩良好的股票组成，剪表性强；并且该指数采用流通市值分级靠档加权方式编制，能够真实反映沪深两市市场走势。因此，本基金股票类资产业绩比较基

准选择沪深 300 指数。本基金的固定收益类资产业绩比较基准为中信标普全债指数，是因为本基金在固定收益类资产的投资范围方面不仅包括国债，而且也包括企业债和金融债等，中信标普全债指数能较好地反映本基金在固定收益类资产方面的投资范围。

如果指数编制单位停止计算编制该指数或更改指数名称、或有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，经与基金托管人协商一致，基金管理人履行相关的程序后，可变更业绩比较基准并及时公告。

#### (六) 风险收益特征

本基金是一只进行主动投资的混合型基金，其风险和预期收益要低于股票型基金，高于货币市场基金和债券型基金，在证券投资基金中属于风险较高、预期收益也较高的基金产品。

#### (七) 投资决策流程

本基金具有严密科学的投资决策流程和明确的分级授权体系，具体见图 3-3。

1、投资决策委员会：决策基金总体战略、资产配置、审议股票池、对基金经理提出的仓位与组合预案进行审议与决策，就风险事项与风险管理委员会沟通；

2、基金经理：参与构建股票池、提出资产配置方案、实施具体投资计划。

基金经理必须严格按照《投资管理流程》进行操作，资产配置方案经投资决策委员会审议通过后，以《资产配置方案决议》的形式形成书面结果，作为基金经理投资操作的依据，同时给分管领导、投资管理部总经理及风险控制部门备案，以便监控。

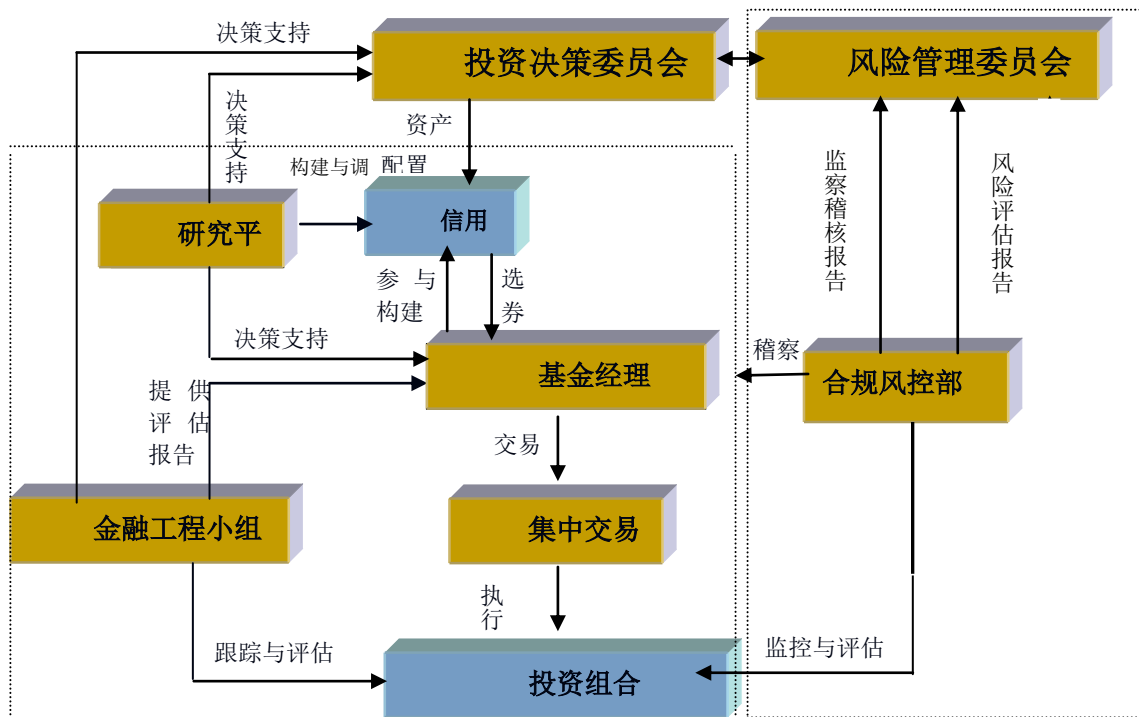
3、集中交易室：执行基金经理的交易指令、反馈交易指令的执行情况、监督交易指令的合规合法性；

4、研究平台：构建股票池、为投资决策委员会提供投资决策咨询支持、为基金经理投资提供支持；

5、金融工程小组：通过对投资组合的跟踪与评估，为投资决策委员会和基金经理提供投资实际效果的反馈意见，以优化改进投资决策；

6、风险控制部门（右边虚线框内）：由风险管理委员会、监察稽核部、绩效与风险评估小组等构成。监察稽核部对投资决策及实际投资进行全程监控（左边

虚线框内)，并定期和不定期向风险管理委员会提供风险事项报告；绩效与风险评估小组定期评估投资组合风险与收益水平，向风险管理委员会提供投资组合风险评估报告。风险管理委员会就风险事项和风险评估报告进行审议并与投资决策



委员会沟通，以监控投资决策流程和各级决策权限的行使是否合法合规及科学合理。

图 3-3 投资决策流程示意图

资料来源：东吴基金

#### (八)投资限制

本基金的投资组合将遵循以下限制：

- (1)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%；
- (2)本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；
- (3)进入全国银行间同业市场的债券回购融入的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；
- (4)本基金参与股票发行申购，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；
- (5)本基金股票类资产投资比例为基金资产的 30%-80%，固定收益类资产投

资比例为基金资产的 0-70%，现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

(6) 本基金投资股权分置改革中产生的权证，在任何交易日买入的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，本基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%。投资于其他权证的投资比例，遵从法律法规或监管部门的相关规定。

(7) 本基金投资资产支持证券的，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%；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，不得超过该基金资产净值的 10%；基金管理人管理的全部证券投资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%；本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过该基金资产净值的 20%。

(8) 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%；

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

(10) 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；

(11) 本基金不得违反基金合同中有关投资范围、投资策略、投资比例的规定；

(12) 法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。在符合相关法律法规规定的前提下，除第（5）项中“现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%”及第（9）、（10）



项外，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等非本基金管理人的因素致使基金的投资组合不符合上述规定的投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

若法律法规或监管部门取消上述限制，履行适当程序后，本基金投资可不受上述规定限制。

#### (九)禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

- 1、承销证券；
- 2、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、向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- 6、买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、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。

若法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，履行适当程序后，本基金投资可不受上述规定限制。

#### (十)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。

#### (十一)基金的融资、融券

本基金可以根据有关法律法规和政策的规定进行融资、融券。

## 十三、基金的财产

### (一)基金资产总值

基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款以及其他资产的价值总和。

### (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金额。

### (三)基金财产的账户

本基金财产以基金名义开立银行存款账户，以基金托管人的名义开立证券交易清算资金的结算备付金账户，以基金托管人和本基金联名的方式开立基金证券账户，以本基金的名义开立银行间债券托管账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和注册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)基金财产的处分

基金财产独立于基金管理人、基金托管人和代销机构的固有财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益归入基金财产。基金管理人、基金托管人可以按基金合同的约定收取管理费、托管费以及其他基金合同约定的其他费用。基金管理人、基金托管人以其自有财产承担法律责任，其债权人不得对基金财产行使请求冻结、扣押和其他权利。

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。

基金财产的债权，不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债务相抵消；不同基金财产的债权债务，不得相互抵消。

除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定处分外，基金财产不得被处分。

非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

## 十四、基金资产的估值

### （一）估值目的

基金资产估值的目的是客观、准确地反映基金资产是否保值、增值，依据经基金资产估值后确定的基金资产净值而计算出的基金份额净值，是计算基金申购与赎回价格的基础。

### （二）估值日

本基金的估值日为相关的证券交易所的正常营业日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非营业日。

### （三）估值对象

基金所拥有的股票、债券、权证和银行存款本息等资产和负债。

### （四）估值程序

基金日常估值由基金管理人进行。基金管理人完成估值后，将估值结果加盖业务公章以书面形式加密传真至基金托管人，基金托管人按法律法规、《基金合同》规定的估值方法、时间、程序进行复核，复核无误后在基金管理人传真的书面估值结果上加盖业务公章返回给基金管理人，由基金管理人依据本基金合同和有关法律法规的规定予以公布。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。

### （五）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，确定公允价值；

(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市价（收盘价）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市价（收盘价）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、因持有股票而享有的配股权，从配股除权日起到配股确认日止，如果收盘价高于配股价，按收盘价高于配股价的差额估值。收盘价等于或低于配股价，则估值为零。

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

5、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、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、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。

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，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对于基金资产净值的计算结果对外予以公布。

#### (六)基金份额净值的确认和估值错误的处理

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。当估值或份额净值计价错误实际发生时，基金管理人应当立即纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。当错误达到或超过基金资产净值的0.25%时，基金管理人应报中国证监会备案；当估值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。因基金估值错误给投资者造成损失的，应先由基金管理人承担，基金管理人对其不应由其承担的责任，有权向过错人追偿。

关于差错处理，本基金合同的当事人按照以下约定处理：

##### 1、差错类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或注册登记机构、或代销机构、或投资者自身的过错造成差错，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该差错遭受损失的当事人（“受损方”）按下述“差错处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

上述差错的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等；对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平不能预见、不能避免、不能克服，则属不可抗力，按照下述规定执行。

由于不可抗力原因造成投资者的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

##### 2、差错处理原则

(1) 差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已产生的差错，给当事人造成损失的，由差错责任方承担；若差错责

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。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正；

(2) 差错的责任方对可能导致有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对差错的有关直接当事人负责，不对第三方负责；

(3) 因差错而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但差错责任方仍应对差错负责。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，则差错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差错责任方；

(4) 差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式；

(5) 差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人的行为造成基金财产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人的行为造成基金财产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。基金管理人、基金托管人及基金销售机构之外的第三方造成基金财产损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错方追偿；追偿过程中产生的有关费用，应列入基金费用，从基金资产中支付；

(6) 如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿，并且依据法律法规、基金合同或其他规定，基金管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任，则基金管理人有权向有责任的当事人进行追索，并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失；

(7) 按法律法规规定的其他方式处理差错。

### 3、差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

(1) 查明差错发生的原因，列明所有的当事人，并根据差错发生的原因确定差错的责任方；

(2) 根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；

(3) 根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失；

(4) 根据差错处理的方法，需要修改基金注册登记机构交易数据的，由基金注册登记机构进行更正，并就差错的更正向有关当事人进行确认；

(5) 基金管理人及基金托管人基金份额净值计算错误偏差达到基金份额净值的 0.25% 时，基金管理人应当报告中国证监会；基金管理人及基金托管人基金份额净值计算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。

#### (七) 暂停估值的情形

1、与本基金投资有关的证券交易场所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、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一致后，基金管理人应当暂停基金估值；

4、中国证监会认定的其他情形。

#### (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、由于证券交易所及其登记结算公司发送的数据错误，或由于其他不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

## 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.基金合同生效后的信息披露费用；
- 4.基金份额持有人大会费用；
- 5.基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
- 6.基金的证券交易费用；
- 7.基金财产拨划支付的银行费用；
- 8.按照国家有关规定可以在基金财产中列支的其他费用。

(二)上述基金费用由基金管理人在法律法规规定的范围内按照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

### (三)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

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$ ，本基金年管理费率为 1.5%

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，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，经基金托管人复核后于次月首日起 3 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、休息日，支付日期顺延。

#### 2.基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$ ，本基金年托管费率为 0.25%

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值



基金托管费每日计提，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，经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

3.上述(一)中3到7项费用由基金托管人根据其他有关法律法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

#### (四)不列入基金费用的项目

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，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。

基金募集期间所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付，基金收取认购费的，可以从认购费中列支。

(五)基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。降低基金管理费率和基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率实施日前在指定媒介和基金管理人网站上刊登公告。

#### (六)基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

## 十六、基金的收益与分配

### (一)基金收益的构成

- 1.买卖证券差价；
- 2.基金投资所得红利、股息、债券利息；
- 3.银行存款利息；
- 4.已实现的其他合法收入。

因运用基金财产带来的成本或费用的节约应计入收益。

### (二)基金净收益

基金净收益为基金收益扣除按国家有关规定可以在基金收益中扣除的费用后的余额。

### (三)收益分配原则

本基金收益分配应遵循下列原则：

- 1.本基金的每份基金份额享有同等分配权；
- 2.基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值；收益分配时所发生的银行转帐或其他手续费用由投资人自行承担，当投资人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转帐或其他手续费时，基金注册登记机构可将投资人的现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额；
- 3.若基金合同生效不满3个月，可不进行收益分配；
- 4.基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；
- 5.基金当期收益应先弥补上期累计亏损后，才可进行收益分配；
- 6.本基金收益每年最多分配八次，每次基金收益分配比例不低于可分配收益的25%；
- 7.本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，基金投资者可选择现金红利或将现金红利按除息日的基金份额净值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；
- 8.法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

在不影响投资者利益的情况下，基金管理人可在法律法规允许的前提下酌情调整以上基金收益分配原则，但应于变更实施日前在指定媒介和基金管理人网站

公告。

#### (四)收益分配方案

基金收益分配方案中应载明基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配

#### (五)收益分配的时间和程序

1.本基金收益分配方案由基金管理人拟定、由基金托管人核实后确定，基金管理人按法律法规的规定公告。

2.在分配方案公布后(依据具体方案的规定)，基金管理人就支付的现金红利向基金托管人发送划款指令，基金托管人按照基金管理人的指令及时进行分红资金的划付。

#### (六)收益分配中发生的费用

1、收益分配采用红利再投资方式免收再投资的费用。

2、收益分配时发生的银行转账等手续费用由基金份额持有人自行承担；如果基金份额持有人所获现金红利不足支付前述银行转账等手续费用，注册登记机构自动将该基金份额持有人的现金红利按除权日的基金份额净值转为基金份额。

## 十七、基金的会计和审计

### (一)基金的会计政策

- 1.基金管理人为本基金的会计责任方；
- 2.本基金的会计年度为公历每年的1月1日至12月31日，如果基金合同生效所在的会计年度，基金合同生效少于3个月，可以并入下一个会计年度；
- 3.本基金的会计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的会计制度；
- 5.本基金独立建账、独立核算；
- 6.基金管理人及基金托管人分别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.基金托管人定期与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并书面确认。

### (二)基金的审计

- 1.基金管理人聘请具有从事证券、期货相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金年度财务报表及其他规定事项进行审计。会计师事务所及其注册会计师与基金管理人、基金托管人相互独立。
- 2.会计师事务所更换经办注册会计师时，应事先征得基金管理人和基金托管人同意。
- 3.基金管理人(或基金托管人)认为有充足理由更换会计师事务所，经基金托管人(或基金管理人)同意后可以更换。基金管理人应当在更换会计师事务所后的2日内公告。

## 十八、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及其日常机构等法律、行政法规和中国证监会规定的自然人、法人和非法人组织。

本基金信息披露义务人以保护基金份额持有人利益为根本出发点,按照法律法规和中国证监会的规定披露基金信息,并保证所披露信息的真实性、准确性、完整性、及时性、简明性和易得性。

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内,将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的全国性报刊(以下简称“指定报刊”)及指定互联网网站(以下简称“指定网站”)等媒介披露,并保证基金投资者能够按照基金合同约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

(三)本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息,不得有下列行为:

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

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

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字;除特别说明外,货币单位为人民币元。

### (五)公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括:

### 1.招募说明书、基金合同、托管协议、基金产品资料概要

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 3 日前，将招募说明书、基金合同摘要登载在指定媒介和基金管理人网站上；基金管理人、基金托管人应当将基金合同、托管协议登载在网站上。

(1)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。本基金合同生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在指定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。

(2)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。

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

(4)基金产品资料概要是基金招募说明书的摘要文件，用于向投资者提供简明的基金概要信息。《基金合同》生效后，基金产品资料概要的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金产品资料概要，并登载在指定网站及基金销售机构网站或营业网点；基金产品资料概要其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金产品资料概要。

### 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和基金管理人网站上。

### 3.基金合同生效公告

基金管理人应当在本基金合同生效的次日在指定媒介和基金管理人网站上登载基金合同生效公告。

### 4.基金开始申购、赎回公告

基金管理人应于申购开始日、赎回开始日前 2 日在指定媒介及基金管理人网

站上公告。

#### 5.基金净值信息公告

本基金合同生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周在指定网站披露一次基金份额净值和基金份额累计净值。

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

基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在指定网站披露半年度和年度最后一日的基金份额净值和基金份额累计净值。

#### 6.基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告

基金管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载在指定网站上，并将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计。

基金管理人应当在上半年结束之日起两个月内，编制完成基金中期报告，将中期报告登载在指定网站上，并将中期报告提示性公告登载在指定报刊上。

基金管理人应当在季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，将季度报告登载在指定网站上，并将季度报告提示性公告登载在指定报刊上。

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

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

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

#### 7.临时报告

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

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

- (1)基金份额持有人大会的召开及决定的事项；
- (2)基金合同终止、基金清算；
- (3)转换基金运作方式、基金合并；
- (4)更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；
- (5)基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；
- (6)基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- (7)基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人的实际控制人变更；
- (8)基金募集期延长或提前结束募集；
- (9) 基金管理人的高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；
- (10)基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十，基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十；
- (11)涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁；
- (12)基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；
- (13)基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易事项，但中国证监会另有规定的除外；
- (14)基金收益分配事项；
- (15)管理费、托管费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- (16)基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；



- (17)本基金开始办理申购、赎回；
- (18)本基金发生巨额赎回并延期办理；
- (19)本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；
- (20)本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；
- (21)基金推出新业务或服务；
- (22)发生涉及本基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；
- (23)基金信息披露义务人认为可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的其他事项或中国证监会规定的其他事项。

#### 8.澄清公告

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

#### 9.基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会核准或者备案，并予以公告。召开基金份额持有人大会的，召集人应当至少提前 30 日公告基金份额持有人大会的召开时间、会议形式、审议事项、议事程序和表决方式等事项。

基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会，基金管理人、基金托管人对基金份额持有人大会决定的事项不依法履行信息披露义务的，召集人应当履行相关信息披露义务。

#### 10.清算报告

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

#### 11.中国证监会规定的其他信息。

##### (六)信息披露事务管理

基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度，指定专门部门及高级管理人员负责管理信息披露事务。

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

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和基金合同的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购、赎回价格、基金定期报告、更新的招募说明书、基金产品资料概要、基金清算报告等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人进行书面或电子确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定报刊中选择一家报刊披露本基金信息。基金管理人、基金托管人应当向中国证监会基金电子披露网站报送拟披露的基金信息，并保证相关报送信息的真实、准确、完整、及时。

基金管理人、基金托管人除依法在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。

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

#### (七)信息披露文件的存放与查阅

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

#### (八)本基金信息披露事项以法律法规规定及本章节约定的内容为准。

## 十九、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.下列涉及到基金合同内容变更的事项应召开基金份额持有人大会并经基金份额持有人大会决议同意：

(1)终止基金合同；

(2)转换基金运作方式；

(3)变更基金类别；

(4)变更基金投资目标、投资范围或投资策略；

(5)变更基金份额持有人大会议事程序；

(6)更换基金管理人、基金托管人；

(7)提高基金管理人、基金托管人的报酬标准。但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；

(8)本基金与其他基金的合并；

(9)对基金合同当事人权利、义务产生重大影响，需召开基金份额持有人大会的变更基金合同等其他事项；

(10)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；

(11)法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

但出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会决议，由基金管理人和基金托管人同意变更后公布经修订的基金合同，并报中国证监会备案：

(1)调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；

(2)在法律法规和本基金合同规定的范围内变更基金的申购费率、调低赎回费率或收费方式；

(3)因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；

(4)法律法规要求增加的基金费用的收取；

(5)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基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化；

(6)按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

2.关于变更基金合同的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准或备案，并经中国证监会核准或出具无异议意见之日起生效。基金管理人应在上述基金份额持有人大会决议生效后2日内在指定媒介和基金管理人网站公告。

## (二)本基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同经中国证监会核准后将终止：

- 1.基金份额持有人大会决定终止的；
- 2.基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在6个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务；
- 3.基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而在6个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务；
- 4.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

(1)基金合同终止时，成立基金清算小组，基金清算小组在中国证监会的监督下进行基金清算。

(2)基金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。基金清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

### 2.基金财产清算程序

基金合同终止，应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。基金财产清算程序主要包括：

- (1)基金合同终止后，发布基金财产清算公告；
- (2)基金合同终止时，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- (3)对基金财产进行清理和确认；
- (4)对基金财产进行估价和变现；

- (5)聘请会计师事务所对清算报告进行审计；
- (6)聘请律师事务所出具法律意见书；
- (7)将基金财产清算结果报告中国证监会；
- (8)参加与基金财产有关的民事诉讼；
- (9)公布基金财产清算结果；
- (10)对基金剩余财产进行分配。

### 3.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。

### 4.基金财产按下列顺序清偿：

- (1)支付清算费用；
- (2)交纳所欠税款；
- (3)清偿基金债务；
- (4)按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款(1)－(3)项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

### 5.基金财产清算的公告

基金财产清算报告于基金合同终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金清算小组公告，基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算结果由基金财产清算小组经中国证监会备案后 3 个工作日内公告。

### 6.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、违约责任

(一)基金管理人、基金托管人在履行各自职责的过程中,违反《基金法》规定或者本基金合同约定,给基金财产或者基金份额持有人造成损害的,应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任;因共同行为给基金财产或者基金份额持有人造成损害的,应当承担连带赔偿责任。但是发生下列情况的,当事人可以免责:

1.不可抗力;

2.基金管理人和/或基金托管人按照有效的法律法规或中国证监会的规定作为或不作为而造成的损失等;

3.在没有故意或重大过失的情况下,基金管理人由于按照基金合同规定的投资原则行使或不行使其投资权而造成的损失等。

(二)基金合同当事人违反基金合同,给其他当事人造成经济损失的,应当承担赔偿责任。在发生一方或多方违约的情况下,基金合同能继续履行的,应当继续履行。

(三)本基金合同当事一方造成违约后,其他当事方应当采取适当措施防止损失的扩大;没有采取适当措施致使损失扩大的,不得就扩大的损失要求赔偿。守约方因防止损失扩大而支出的合理费用由违约方承担。

(四)因当事人之一违约而导致其他当事人损失的,基金份额持有人应先于其他受损方获得赔偿。

(五)由于基金管理人、基金托管人不可控制的因素导致业务出现差错,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,但是未能发现错误的,由此造成基金财产或投资人损失,基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但是基金管理人和基金托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

## 二十一、争议的处理

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，对当事人均有约束力。

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。

本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

## 二十二、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。

(一)本基金合同经基金管理人和基金托管人加盖公章以及双方法定代表人或法定代表人授权的代理人签字，在基金募集结束，基金备案手续办理完毕，并获中国证监会书面确认后生效。基金合同的有效期限自其生效之日起至该基金财产清算结果报中国证监会批准并公告之日止。

(二)本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。

(三)本基金合同正本一式六份，除上报相关监管部门两份外，基金管理人和基金托管人各持有两份。每份均具有同等的法律效力。

(四)本基金合同可印制成册，供基金投资者在基金管理人、基金托管人、代销机构和注册登记机构办公场所查阅。基金合同条款及内容应以基金合同正本为准。



## 二十三、其他事项

本基金合同如有未尽事宜，由本基金合同当事人各方按有关法律法规和规定协商解决。

东吴基金管理有限公司

二零一九年十月