

华泰柏瑞基金管理有限公司

华泰柏瑞景气回报一年持有期混合型证券投资基金

更新的招募说明书

2020 年第 2 号（基金合同变更）

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

二零二零年十二月

## 华泰柏瑞景气回报一年持有期混合型证券投资基金招募说明书

### 重要提示

华泰柏瑞景气回报一年持有期混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）根据 2019 年 11 月 15 日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予华泰柏瑞景气回报一年持有期混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2019]2331 号）的注册，进行募集。本基金的基金合同于 2019 年 12 月 18 日正式生效。

华泰柏瑞基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”或“管理人”或“本公司”）保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书在中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值和市场前景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，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

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，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、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、股指期货、国债期货投资风险、由于基金投资者连续大量赎回基金产生的流动性风险、基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险等等。本基金为混合型基金，在通常情况下其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。本基金将投资科创板的股票，需承担科创板机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。具体风险请查阅本招募说明书的“风险揭示”章节的具体内容。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。法律法规、监管机构另有规定的，从其规定。

本基金的投资范围包括存托凭证。存托凭证是新证券品种，本基金投资存托凭证在承担境内上市交易股票投资的共同风险外，还将承担与存托凭证、创新企业发行、境外发行人以及交易机制相关的特有风险。

本基金对每份基金份额设置 1 年的最短持有期限，基金份额在最短持有期内不办理赎回及转换转出业务。自最短持有期结束后即进入开放持有期，可以办理赎回及转换转出业务。

本基金每个开放日披露的各类基金份额净值为未扣除基金管理人业绩报酬前的基金份额净

值。投资者实际赎回金额，以登记机构确认数据为准。

本基金为逐笔计提业绩报酬的基金，由于管理人可能计提业绩报酬，投资者实际赎回份额净值可能低于每日披露的基金份额净值，投资者实际赎回金额以登记机构确认数据为准。

投资者认购本基金时应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同。基金管理人建议投资者根据自身的风险收益偏好，选择适合自己的基金产品，并且中长期持有。

本基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本更新招募说明书根据 2020 年 12 月 23 日发布的《华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞景气回报一年持有期混合型证券投资基金开通转换业务并修改基金合同的的公告》，对基金合同变更事项进行更新。

本更新招募说明书关于基金合同变更事项及基金管理人的内容截止日为 2020 年 12 月 23 日。除非另有说明，本更新招募说明书所载其余内容截止日为 2020 年 10 月 31 日，有关财务和业绩表现数据截止日为 2020 年 9 月 30 日，财务和业绩表现数据未经审计。

本基金托管人中国银行股份有限公司已对投资组合报告和业绩表现进行了复核确认。

## 目录

一 绪言.....	1
二 释义.....	2
三 基金管理人.....	6
四 基金托管人.....	14
五 相关服务机构.....	16
六 基金的募集.....	44
七 基金合同的生效.....	49
八 基金份额的申购与赎回.....	50
九 基金的投资.....	60
十 基金的财产.....	76
十一 基金资产估值.....	77
十二 基金的收益与分配.....	82
十三 基金的费用与税收.....	83
十四 基金的会计与审计.....	86
十五 基金的信息披露.....	87
十六 基金的风险揭示.....	93
十七 基金合同的变更、终止与基金财产的清算.....	99
十八 基金合同的内容摘要.....	101
十九 基金托管协议的内容摘要.....	114
二十 对基金份额持有人的服务.....	123
二十一 其他应披露事项.....	125
二十二 招募说明书存放及查阅方式.....	127
二十三 备查文件.....	128

## 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》）、《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》）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第5号<招募说明书的内容与格式>》等有关法律法规以及《华泰柏瑞景气回报一年持有期混合型证券投资基金基金合同》（以下简称基金合同）编写。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写，并在中国证监会注册。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人，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。基金投资者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。

本基金由基金管理人依照《基金法》、基金合同和其他有关法律法规规定募集，并在中国证监会注册。中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值和市场前景做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

## 二 释义

本招募说明书中除非文意另有所指，下列词语具有如下含义：

- 1、基金或本基金：指华泰柏瑞景气回报一年持有期混合型证券投资基金
- 2、基金管理人：指华泰柏瑞基金管理有限公司
- 3、基金托管人：指中国银行股份有限公司
- 4、基金合同：指《华泰柏瑞景气回报一年持有期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
- 5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《华泰柏瑞景气回报一年持有期混合型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
- 6、招募说明书：指《华泰柏瑞景气回报一年持有期混合型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《华泰柏瑞景气回报一年持有期混合型证券投资基金基金产品资料概要》及其更新
- 8、基金份额发售公告：指《华泰柏瑞景气回报一年持有期混合型证券投资基金基金份额发售公告》
- 9、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等
- 10、《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，经 2012 年 12 月 28 日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自 2013 年 6 月 1 日起实施，并经 2015 年 4 月 24 日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修正的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 11、《销售办法》：指中国证监会 2013 年 3 月 15 日颁布、同年 6 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 12、《信息披露办法》：指中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 13、《运作办法》：指中国证监会 2014 年 7 月 7 日颁布、同年 8 月 8 日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 14、《流动性风险管理规定》：指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订
- 15、中国证监会：指中国证券监督管理委员会
- 16、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行保险监督管理委员会
- 17、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

- 18、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人
- 19、机构投资者：指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织
- 20、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
- 21、人民币合格境外机构投资者：指按照《人民币合格境外机构投资者境内证券投资试点办法》及相关法律法规规定，运用来自境外的人民币资金进行境内证券投资的境外法人
- 22、投资人、投资者：指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称
- 23、基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人
- 24、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务
- 25、销售机构：指华泰柏瑞基金管理有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务协议，办理基金销售业务的机构
- 26、登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等
- 27、登记机构：指办理登记业务的机构。基金的登记机构为华泰柏瑞基金管理有限公司或接受华泰柏瑞基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构
- 28、基金账户：指登记机构为投资人开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户
- 29、基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构办理认购、申购、赎回、定期定额投资、转换及转托管等业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户
- 30、基金合同生效日：指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期
- 31、基金合同终止日：指基金合同规定的基金合同终止事由出现后，基金财产清算完毕，清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期
- 32、基金募集期：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过3个月
- 33、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限
- 34、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日
- 35、T日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日
- 36、T+n日：指自T日起第n个工作日(不包含T日)

37、开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

38、开放时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

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

40、认购：指在基金募集期内，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

41、申购：指基金合同生效后，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

42、赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为

43、销售服务费：指从基金资产中计提的，用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务的费用

44、基金份额类别：指本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别，各基金份额类别分别设置代码，分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值

45、基金转换：指基金份额持有人按照本基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金基金份额的行为

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

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

48、巨额赎回：指本基金单个开放日，基金净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一开放日基金总份额的 10%

49、元：指人民币元

50、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

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

52、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

53、基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

54、基金资产估值：指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份



## 额净值的过程

55、指定媒介：指中国证监会指定的用以进行信息披露的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

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、摆动定价机制：指当开放式基金遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待

58、最短持有期限：指本基金对每份基金份额设置 1 年的最短持有期限。即：自基金合同生效日（对认购份额而言，下同）或基金份额申购确认日（对申购份额而言，下同）至该日次年的年度对日的期间内，投资者不能提出赎回及转换转出申请；该日次年的年度对日之后，投资者可以提出赎回及转换转出申请。若该日历年实际不存在对应日期的，则顺延至下一日

59、不可抗力：指基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

### 三 基金管理人

#### (一) 基金管理人概况

名称：华泰柏瑞基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层

法定代表人：贾波

成立日期：2004 年 11 月 18 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】178 号

经营范围：发起设立基金、基金管理及中国证监会批准的其他业务

组织形式：有限责任公司

注册资本：贰亿元人民币

存续期间：持续经营

联系人：汪莹白

联系电话：400-888-0001，(021) 38601777

股权结构：柏瑞投资有限责任公司（原 AIGGIC）49%、华泰证券股份有限公司 49%、苏州新区高新技术产业股份有限公司 2%。

#### (二) 主要人员情况

##### 1、董事会成员

贾波先生：董事长，学士，曾任职于工商银行江苏省分行，2001 年 7 月至 2016 年 11 月在华泰证券工作，历任经纪业务总部技术主办、零售客户服务总部地区经理、南宁双拥路营业部总经理、南京长江路营业部总经理、企划部副总经理(主持工作)、北京分公司总经理、融资融券部总经理等职务。2016 年 12 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司。

陆春光先生：董事，学士，2009 年 5 月加入华泰证券，曾任网络金融部互联网运营团队负责人、用户体验与设计团队负责人、副总经理，现任华泰证券上海分公司副总经理（主持工作）。

Anthony Fasso 先生：董事，学士，1984 年加入 Bankers Trust，1995 年至 2000 年先后任 Bankers Trust Funds Management 董事（亚洲）、高级副总裁及常务董事（香港）。2000 年至 2001 年担任 iRegent Group Limited 营销经理（香港），2001 年至 2003 年担任 Julius Baer Investment Advisory (Asia) Ltd 行政总裁及机构资产管理部门主管（香港），2003 年至 2004 年担任 Deutsche Asset Management 私人财富管理董事（墨尔本），2005 年至 2010 年担任 AXA Investment Managers 亚太区行政总裁及全球执行委员会成员（巴黎/香港），2010 年至 2018 年担任 AMP Capital 国际业务行政总裁及全球客户部门（香港）主管，2019 年至今担任柏瑞投资行政总裁（亚洲，日本除外）。

杨智雅女士：董事，硕士，曾就职于升强工业股份有限公司，华之杰国际商业顾问有限

公司，1992年4月至1996年12月任AIG友邦证券投资顾问股份有限公司管理部经理，1997年1月至2001年7月任AIG友邦证券投资信托股份有限公司管理部经理、资深经理、协理，2001年7月至2010年2月任AIG友邦证券投资顾问股份有限公司副总经理、总经理、董事长暨总经理。2010年2月至今任柏瑞证券投资顾问股份有限公司董事长暨总经理、总经理。

韩勇先生：董事，博士，曾任职于君安证券有限公司、华夏证券有限公司和中国证券监督管理委员会，2007年7月至2011年9月任华安基金管理有限公司副总经理。2011年10月加入华泰柏瑞基金管理有限公司。

李晗女士：独立董事，硕士，2007年加入天元律师事务所，2015年至今任该律师事务所合伙人。

李亦宜女士：独立董事，硕士，曾任职于Lazard&Co.旧金山办事处以及LazardAsia香港办事处，2010年至2013年曾担任Japan Residential Assets Management Limited董事。2002年至今历任Argyle Street Management Limited基金经理、执行董事，2006年至今同时担任新加坡上市公司TIHLimited董事。

文光伟先生：独立董事，博士，1983年至2015年先后任中国人民大学会计系助教、会计系讲师、中国人民大学商学院会计系副教授、硕士生导师，1989年12月至1991年6月期间兼职于香港普华会计公司审计部。2015年3月从中国人民大学退休。

陆楨女士：独立董事，硕士，曾任中国金融租赁有限公司副总经理、北京启迪清云智慧能源有限公司高级副总裁，2018年至今任融讯商业保理（深圳）有限公司创始人兼CEO，2019年至今任北京清谊厚泽投资有限公司副总裁。

## 2、监事会成员

王永筠女士：监事长，硕士，香港会计师公会会员。2004年至2008年任职于德勤，2008年至2019年担任黑石集团（香港）有限公司财务部门董事，2019年起担任柏瑞投资财务部门高级副总裁（亚洲，日本及台湾除外）。

刘晓冰先生：监事，二十五年证券从业经历。1993年12月进入公司，曾任无锡解放西路营业部总经理助理、副总经理、总经理，无锡永乐路营业部负责人，无锡城市中心营业部总经理，无锡分公司总经理等职务。现任华泰证券股份有限公司苏州分公司总经理。

柳军先生：监事，硕士，2000-2001年任上海汽车集团财务有限公司财务，2001-2004年任华安基金管理有限公司高级基金核算员，2004年7月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任基金事务部总监、上证红利ETF基金经理助理。2009年6月起任华泰柏瑞（原友邦华泰）上证红利交易型开放式指数基金基金经理。2010年10月起担任指数投资部副总监。2011年1月至2020年2月任华泰柏瑞上证中小盘ETF基金、华泰柏瑞上证中小盘ETF联接基金基金经理。2012年5月起兼任华泰柏瑞沪深300ETF基金、华泰柏瑞沪深300ETF联接基金基金经理。2015年2月起任指数投资部总监。2015年5月起任华泰柏瑞中证500ETF

及华泰柏瑞中证 500ETF 联接基金的基金经理。2018 年 3 月至 2018 年 11 月任华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 3 月至 2018 年 10 月任华泰柏瑞泰利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 4 月起任华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2018 年 10 月起任华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2018 年 12 月起任华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 7 月起任华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019 年 9 月起任华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2020 年 2 月起任华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2020 年 9 月起任华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。

周俊梁先生：监事，硕士。历任普华永道中天会计师事务所审计经理、渣打银行（中国）有限公司国别财务部高级经理、大华银行（中国）有限公司财务部第一副总裁，2015 年 10 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，现任公司财务部兼综合管理部总监。

### 3、总经理及其他高级管理人员

韩勇先生：总经理，博士，曾任职于君安证券有限公司、华夏证券有限公司和中国证券监督管理委员会，2007 年 7 月至 2011 年 9 月任华安基金管理有限公司副总经理。2011 年 10 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司。

王溯舸先生：副总经理，硕士，1997-2000 年任深圳特区证券公司总经理助理、副总经理，2001-2004 年任华泰证券股份有限公司受托资产管理总部总经理。

陈晖女士：督察长，硕士，1993-1999 年任江苏证券有限责任公司北京代表处代表，1999-2004 年任华泰证券股份有限公司北京总部总经理。

房伟力先生：副总经理，硕士，1997-2001 年任上海证券交易所登记结算公司交收系统开发经理，2001-2004 年任华安基金管理有限公司基金登记及结算部门总监。2004-2008 年 5 月任华泰柏瑞基金管理有限公司总经理助理。

田汉卿女士：副总经理。曾在美国巴克莱全球投资管理有限公司（BGI）担任投资经理，2012 年 8 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，2013 年 8 月起任华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金的基金经理，2013 年 10 月起任公司副总经理，2014 年 12 月至 2020 年 7 月任华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2015 年 3 月起任华泰柏瑞量化先行混合型证券投资基金的基金经理的基金经理，2015 年 3 月至 2020 年 7 月任华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2015 年 6 月起任华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金的基金经理和华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金的基金经理。2016 年 5 月起任华泰柏瑞量化对冲稳健收益定期开放混合型发起式证券投资基金的基金经理。2017 年 3 月至 2018 年 11 月任华泰柏瑞惠利灵活配置混

合型证券投资基金的基金经理。2017年5月起任华泰柏瑞量化创优灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年9月起任华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年12月至2020年7月任华泰柏瑞港股通量化灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020年11月起任华泰柏瑞量化创盈混合型证券投资基金的基金经理。本科与研究生毕业于清华大学，MBA毕业于美国加州大学伯克利分校哈斯商学院。

董元星先生，副总经理，博士。2006.9-2008.12任巴克莱资本(纽约)债券交易员，2009.3-2012.8任华夏基金管理有限公司基金经理。2012年8月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，任固定收益部总监。2013年10月起任华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金的基金经理。2014年2月起任总经理助理。2015年12月起任公司副总经理。北京大学经济学学士，纽约大学 STERN 商学院金融学博士。

李晓西先生：副总经理，美国杜克大学工商管理硕士。曾任中银信托投资公司外汇交易结算员，银建实业股份有限公司证券投资经理，汉唐证券有限责任公司高级经理，美国信安环球股票有限公司董事总经理兼基金经理。2018年7月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，2018年8月起任公司副总经理。2020年2月起任华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金、华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020年3月起任华泰柏瑞质量成长混合型证券投资基金的基金经理。

刘万方先生：财政部财政科学研究所财政学博士。曾任中国普天信息产业集团公司项目投资经理，美国 MBP 咨询公司咨询顾问，中国证监会主任科员、副处长，上投摩根基金管理有限公司督察长，朱雀股权投资管理股份有限公司副总经理，朱雀基金管理有限公司总经理。2019年4月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，任公司副总经理。

童辉先生：首席信息官，硕士。1997-1998年任上海众恒信息产业有限公司程序员，1998-2004年任国泰基金管理有限公司信息技术部经理，2004年4月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，现任首席信息官兼信息技术部总监。

#### 4、本基金基金经理

张慧先生，经济学硕士，13年证券从业经历。2007年7月至2010年6月任国泰君安证券股份有限公司研究员。2010年6月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任研究员、高级研究员、基金经理助理，2013年9月至2018年5月任华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金的基金经理，2014年5月起任华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金的基金经理。2015年2月起任华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018年1月起任投资部副总监。2018年1月至2020年8月任华泰柏瑞战略新兴产业混合型证券投资基金的基金经理。2019年3月起任投资研究部副总监。2019年11月起任华泰柏瑞研究精选混合型证券投资基金的基金经理。2019年12月起任华泰柏瑞景气回报一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。2020年1月起任投资研究部总监。2020年6月起任华泰柏瑞景气优选混合型证券投资基金的基金经理。

#### 5、权益投资决策委员会成员

主席：总经理韩勇先生；

成员：副总经理王溯舸先生；副总经理田汉卿女士；副总经理李晓西先生；总经理助理兼专户投资部总监沈雪峰女士；投资研究部总监张慧先生；投资研究部副总监吕慧建先生。

列席人员：督察长陈晖女士；权益投资决策委员会主席指定的其他人员。

上述人员之间不存在近亲属关系。

#### （三）基金管理人的职责

1、依法募集基金，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、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，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、中期和年度报告；

7、计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回价格；按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；采取适当合理的措施使计算开放式基金份额认购、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；

8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；

9、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；

10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表、代表基金签订的重大合同及其他相关资料；

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、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；

13、中国证监会规定的其他职责。

#### （四）基金管理人的承诺

1、本基金管理人承诺严格遵守现行有效的相关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会有关规定的行为发生。

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

（1）将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；

- (2) 不公平地对待其管理的不同基金财产；
- (3) 利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人谋取利益；
- (4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- (5) 法律法规或中国证监会禁止的其他行为。

3、本基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下活动：

- (1) 越权或违规经营；
- (2) 违反基金合同或托管协议；
- (3) 故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法利益；
- (4) 在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；
- (5) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
- (6) 玩忽职守、滥用职权；
- (7) 违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；
- (8) 违反证券交易所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；
- (9) 贬损同行，以抬高自己；
- (10) 以不正当手段谋求业务发展；
- (11) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；
- (12) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
- (13) 其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

#### 4、基金经理承诺

- (1) 依照有关法律、法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；
  - (2) 不利用职务之便为自己及其代理人、受雇人或任何第三人谋取利益；
  - (3) 不违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；
  - (4) 不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。
- (五) 基金管理人的内部控制制度

##### 1、内部控制的原则

- (1) 健全性原则。内部控制必须覆盖公司各个部门和各级岗位，并渗透到各项业务过程，涵盖决策、执行、监督、反馈等各个经营环节；

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

(3) 独立性原则。公司在精简的基础上设立能够充分满足经营运作需要的机构、部门和岗位，各机构、部门和岗位职能上保持相对独立。内部控制的检查评价部门必须独立于内部控制的建立和执行部门；

(4) 相互制约原则。公司内部部门和岗位的设置应权责分明、相互制衡，消除内部控制中的盲点；

(5) 防火墙原则。公司基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离，基金投资研究、决策、执行、清算、评估等部门和岗位，应当在物理上和制度上适当隔离，以达到风险防范的目的；

(6) 成本效益原则。公司运用科学化的经营管理方法降低运作成本，提高经济效益，以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

## 2、内部控制的主要内容

### (1) 控制环境

董事会下设风险管理与审计委员会，全面负责公司的风险管理、风险控制和财务监控，审查公司的内控制度，并对重大关联交易进行审计；董事会下设薪酬、考核与资格审查委员会，对董事、总经理、督察长、财务总监和其他高级管理人员的候选人进行资格审查以确保其具有中国证监会所要求的任职资格，制定董事、监事、总经理、督察长、财务总监、其他高级管理人员及基金经理的薪酬/报酬计划或方案。

公司管理层在总经理领导下，认真执行董事会确定的内部控制战略，为了有效贯彻公司董事会制定的经营方针及发展战略，设立了投资决策委员会和风险控制委员会，就基金投资和风险控制等发表专业意见及建议。

公司设立督察长，对董事会负责，主要负责对公司内部控制的合法合规性、有效性和合理性进行审查，发现重大风险事件时向公司董事长和中国证监会报告。

### (2) 风险评估

公司风险控制人员定期评估公司风险状况，范围包括所有能对经营目标产生负面影响的内部和外部因素，评估这些因素对公司总体经营目标产生影响的程度及可能性，并将评估报告报公司董事会及高层管理人员。

### (3) 控制活动

控制活动包括自我控制、职责分离、监察稽核、实物控制、业绩评价、严格授权、资产分离、危机处理等政策、程序或措施。

自我控制以各岗位的目标责任制为基础，是内部控制的第一道防线。在公司内部建立科学、严格的岗位分离制度，在相关部门和相关岗位之间建立重要业务处理凭据传递和信息沟通制度，后续部门及岗位对前部门及岗位负有监督责任，使相互监督制衡的机制成为内部



控制的第二道防线。充分发挥督察长和法律监察部对各岗位、各部门、各机构、各项业务全面监察稽核作用，建立内部控制的第三道防线。

#### （4）信息与沟通

公司建立了内部办公自动化信息系统与业务汇报体系，形成了自上而下的信息传播渠道和自下而上的信息呈报渠道。通过建立有效的信息交流渠道，保证了公司员工及各级管理人员可以充分了解与其职责相关的信息，并及时送达适当的人员进行处理。

#### （5）内部监控

内部监控由公司风险管理与审计委员会、督察长、风险控制委员会和法律监察部等部门在各自的职权范围内开展。本公司设立了独立于各业务部门的法律监察部，其中监察稽核人员履行内部稽核职能，检查、评价公司内部控制制度合理性、完备性和有效性，监督公司内部控制制度的执行情况，揭示公司内部管理及基金运作中的风险，及时提出改进意见，促进公司内部管理制度有效地执行。

### 3、基金管理人关于内部控制的声明

- （1）基金管理人确知建立、实施和维持内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任；
- （2）本公司承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确；
- （3）本公司承诺将根据市场环境的变化及公司的发展不断完善内部控制制度。

## 四 基金托管人

### （一）基金托管人基本情况

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：许俊

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2020年3月31日，中国银行已托管780只证券投资基金，其中境内基金735只，QDII基金45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

基金份额发售机构包括基金管理人的直销机构和代销机构的销售网点。

#### 1、直销机构：

华泰柏瑞基金管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层

法定代表人：贾波

电话：（021）38784638

传真：（021）50103016

联系人：汪莹白

客服电话：400-888-0001，（021）38784638

公司网址：[www.huatai-pb.com](http://www.huatai-pb.com)

#### 2、代销机构

代销 A 类基金份额：

##### 1) 中国银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：刘连舸

传真：（010）66594853

客服电话：95566

公司网址：[www.boc.cn](http://www.boc.cn)

##### 2) 交通银行股份有限公司

注册地址：上海市银城中路 188 号

办公地址：上海市银城中路 188 号

法定代表人：任德奇

联系人：曹榕

电话：（021）58781234

传真：（021）58408483

客服电话：95559

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

##### 3) 平安银行股份有限公司

注册地址：广东省深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦

办公地址：广东省深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦

法定代表人：谢永林

联系人：施艺帆

电话：（021）50979384

传真：（021）58585432

客服电话：95511-3

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

4) 中信银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

法定代表人：李庆萍

联系人：杨宁

电话：（010）65556612

传真：（010）65550828

客服电话：95558

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

5) 中国民生银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街2号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街2号

法定代表人：洪崎

联系人：董云巍

客服电话：95568

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

6) 安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元

办公地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元

深圳市福田区深南大道2008号中国凤凰大厦1栋9层

法定代表人：王连志

联系人：陈剑虹

电话：（0755）82825551

传真：（0755）82558355

客服电话：400-800-1001

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

7) 渤海证券股份有限公司

注册地址：天津市经济技术开发区第二大街42号写字楼101室

办公地址：天津市南开区宾水西道 8 号

法定代表人：王春峰

联系人：王星

电话：(022) 28451922

传真：(022) 28451892

客服电话：400-651-5988

公司网址：www.ewww.com.cn

8) 长江证券股份有限公司

注册地址：湖北省武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

办公地址：湖北省武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：尤习贵

联系人：奚博宇

电话：(021) 61118795

传真：(021) 68751151

客服电话：95579 或 4008-888-999

公司网址：www.95579.com

9) 光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：薛峰

联系人：周洁瑾

电话：(021) 22169999

传真：(021) 22169134

客服电话：95525

公司网址：www.ebscn.com

10) 中信证券华南股份有限公司

注册地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层

办公地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层

法定代表人：胡伏云

联系人：陈靖

电话：(020) 88836999

传真：(020) 88836654

客服电话：95396

公司网址：www.gzs.com.cn

11) 国都证券股份有限公司

注册地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层

办公地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层

联系人：黄静

电话：(010) 84183333

传真：(010) 84183311-3389

客服电话：400-818-8118

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

12) 国信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址：广东省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：周杨

电话：(0755) 82130833

传真：(0755) 82133952

客服电话：95536

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

13) 恒泰证券股份有限公司

注册地址：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号

办公地址：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号

法定代表人：庞介民

联系人：扬子莹

电话：(0471) 4974437

客服电话：4001966188

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

14) 申万宏源西部证券有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路35号大成国际大厦20楼2005室

办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区北京南路358号大成国际大厦20楼

法定代表人：韩志谦

联系人：王怀春

电话：0991-2307105

传真：0991-2301802

客服电话：400-800-0562

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

15) 华福证券有限责任公司

注册地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层

办公地址：福建省福州市五四路 157 号新天地大厦 7-10 层

法定代表人：黄金琳

联系人：徐松梅

电话：(0591) 83893286

传真：(0591) 87383610

客服电话：96326（福建省外请加拨 0591）

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

16) 华泰证券股份有限公司

注册地址：南京市江东中路 228 号

办公地址：南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场、深圳市福田区深南大道 4011 号港中旅大厦 18 楼

法定代表人：张伟

联系人：庞晓云

电话：025-883389093

传真：0755-82492962（深圳）

客服电话：95597

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

17) 华西证券股份有限公司

注册地址：四川省成都市高新区天府二街 198 号华西证券大厦

办公地址：四川省成都市高新区天府二街 198 号华西证券大厦

法定代表人：杨炯洋

联系人：周志茹

电话：028-86135991

传真：028-86150040

客服电话：95584

公司网址：[www.hx168.com.cn](http://www.hx168.com.cn)

18) 华鑫证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01 (b)单元

办公地址：上海市肇家浜路 750 号

法定代表人：俞洋

联系人：陈敏



电话：（021）64316642

传真：（021）64333051

客服电话：400-109-9918、021—32109999、029-68918888

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

19) 平安证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

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（518048）

法定代表人：谢永林

联系人：石静武

电话：（021）38631117

传真：（021）58991896

客服电话：95511\*8

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

20) 中泰证券股份有限公司

注册地址：山东省济南市经七路 86 号

办公地址：山东省济南市经七路 86 号 23 层

法定代表人：李玮

联系人：吴阳

电话：（0531）68889155

传真：（0531）68889752

客服电话：95538

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

21) 上海证券有限责任公司

注册地址：上海市西藏中路 336 号

办公地址：上海市四川中路 213 号久事商务大厦 7 楼

法定代表人：龚德雄

联系人：许曼华

电话：021-53686888

传真：021-53686100，021-53686200

客服电话：021-962518

公司网址：[www.962518.com](http://www.962518.com)

22) 申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人：李梅

联系人：黄莹

电话：（021）33389888

传真：（021）33388224

客服电话：95523 或 4008895523

公司网址：www.swhysc.com

23) 西南证券股份有限公司

注册地址：重庆市江北区桥北苑 8 号

办公地址：重庆市江北区桥北苑 8 号西南证券大厦

法定代表人：吴坚

联系人：张煜

电话：（023）63786141

传真：（023）63810422

客服电话：400-809-6096

公司网址：www.swsc.com.cn

24) 新时代证券股份有限公司

注册地址：北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501

办公地址：北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501

法定代表人：叶顺德

联系人：田芳芳

电话：010-83561146

传真：（010）83561094

客服电话：95399

公司网址：www.xsdzq.cn

25) 信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人：张志刚

联系人：尹旭航

电话：010-63081000

传真：010-63080978

客服电话：95321

公司网址：www.cindasc.com

26) 中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：陈有安

联系人：宋明

电话：（010）66568450

传真：（010）66568990

客服电话：400-888-8888

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

27) 中国国际金融股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

办公地址：北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

法定代表人：丁学东

联系人：杨涵宇

电话：（010）6505 1166 - 6493

传真：（010）8567 9535

客服电话：410-910-1166

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

28) 中国中金财富证券有限公司

注册地址：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 层-21 层及第 04 层 01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23 单元

办公地址：深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 04、18 层至 21 层

法定代表人：高涛

联系人：刘毅

电话：（0755）82023442

传真：（0755）82026539

客服电话：95532

公司网址：[www.china-invs.cn](http://www.china-invs.cn)

29) 中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：王常青

联系人：权唐

电话：400-8888-108

传真：（010）65182261

客服电话：400-888-8108

公司网址：[www.csc108.com](http://www.csc108.com)

30) 中信证券(山东)有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层(266061)

法定代表人：杨宝林

联系人：赵艳青

电话：(0532) 85022326

传真：(0532) 85022605

客服电话：95548

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

31) 中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人：张佑君

联系人：郑慧

电话：010-60838888

传真：010-60836029

客服电话：95548

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

32) 中银国际证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层

办公地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层

法定代表人：宁敏

联系人：许慧琳

电话：(021) 20328531

传真：(021) 50372474

客服电话：400-620-8888

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

33) 华安证券股份有限公司

注册地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

办公地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号财智中心 B1 座

法定代表人：李工

联系人：范超

电话：0551-65161821

传真：0551-65161672

客服电话：400-809-6518（全国） 96518（安徽）

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

34) 嘉实财富管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心办公楼二期46层4609-10单元

办公地址：北京市朝阳区建国路91号金地中心A座6层

法定代表人：赵学军

联系人：余永健

电话：010-85097570

传真：010-85097308

客服电话：400-021-8850

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

35) 太平洋证券股份有限公司

注册地址：云南省昆明市青年路389号志远大厦18层

办公地址：北京市西城区北展北街9号华远企业号D座3单元

法定代表人：李长伟

联系人：唐昌田

电话：010-88321717

传真：010-88321763

客服电话：400-665-0999

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

36) 上海基煜基金销售有限公司

注册地址：上海市崇明县长兴镇路潘园公路1800号2号楼6153室

办公地址：上海市杨浦区昆明路518号北美广场A座1002室

法定代表人：王翔

联系人：俞申莉

电话：021-65370077

传真：021-55085991

客服电话：4008-205-369

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

37) 江苏银行股份有限公司

注册地址：中国江苏省南京市中华路26号

办公地址：中国江苏省南京市中华路26号

法定代表人：夏平

联系人：张洪玮

电话：025-58587036

传真：025-58588720

客服电话：95319

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

38) 民生证券股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 18 层

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 18 层

法定代表人：冯鹤年

联系人：李微

电话：010-85127570

传真：010-85127641

客服电话：95376

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

39) 广发银行股份有限公司

注册地址：广东省广州市越秀区东风东路 713 号

办公地址：广东省广州市越秀区东风东路 713 号

法定代表人：杨明生

传真：无

客服电话：4008308003

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

40) 大通证券股份有限公司

注册地址：辽宁省大连市沙河口区会展路 129 号大连国际金融中心 A 座-大连期货大厦

38、39 层

办公地址：辽宁省大连市沙河口区会展路 129 号大连国际金融中心 A 座-大连期货大厦

38、39 层

法定代表人：赵玺

联系人：谢立军

电话：0411-39991807

客服电话：4008-169-169

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

41) 西部证券股份有限公司

注册地址：西安市东大街 232 号陕西信托大厦 16-17 层

办公地址：西安市东大街 232 号陕西信托大厦 16-17 层

法定代表人：刘建武

联系人：梁承华

电话：029-87211526

传真：029-87406710

客户服务电话：95582

网站：[www.westsecu.com](http://www.westsecu.com)

42) 财达证券股份有限公司

注册地址：河北省石家庄市桥西区自强路 35 号

办公地址：河北省石家庄市桥西区自强路 35 号

法定代表人：翟建强

联系人：胡士光

电话：(0311) 66006403

传真：(0311) 66006249

客服电话：400-612-8888

公司网址：[www.s10000.com](http://www.s10000.com)

43) 东方证券股份有限公司

注册地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 21-29 层

办公地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 21-29 层

法定代表人：潘鑫军

联系人：胡月茹

电话：(021) 63325888

传真：(021) 63327888

客服电话：95503

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

44) 东兴证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 12-15 层

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：徐勇力

联系人：汤漫川

电话：(010) 66555316

传真：(010) 66555246

客服电话：400-888-8993

公司网址：[www.dxzq.net](http://www.dxzq.net)

45) 方正证券股份有限公司

注册地址：湖南省长沙市芙蓉中路 2 段华侨国际大厦 22-24 层

办公地址：湖南省长沙市芙蓉中路 2 段华侨国际大厦 22-24 层

法定代表人：雷杰

联系人：郭军瑞

电话：(0731) 85832503

传真：(0731) 85832214

客服电话：95571

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

46) 广发证券股份有限公司

注册地址：广州天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼（4301-4316 房）

办公地址：广州市天河区马场路 26 号广发证券大厦

法定代表人：孙树明

联系人：黄岚

电话：(020) 87555888

传真：(020) 87555305

客服电话：95575

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

47) 国元证券股份有限公司

注册地址：安徽省合肥市寿春路 179 号

办公地址：安徽省合肥市寿春路 179 号

法定代表人：凤良志

联系人：李蔡

电话：(0551) 2207939

传真：(0551) 2645709

客服电话：95578

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

48) 海通证券股份有限公司

注册地址：上海市淮海中路 98 号

办公地址：上海市广东路 689 号

法定代表人：王开国

电话：(021) 23219000

传真：(021) 23219100

联系人：金芸、李笑鸣



客服电话：95553

公司网址：www.htsec.com

49) 万联证券股份有限公司

注册地址：广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 F 栋 18、19 层

办公地址：广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 F 栋 18、19 层

法定代表人：张建军

联系人：甘蕾

电话：(020) 38286026

传真：(020) 37865008

客服电话：95322

公司网址：www.wlzq.cn

50) 湘财证券股份有限公司

注册地址：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼

办公地址：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼

法定代表人：孙永祥

联系人：李欣

电话：021-38784580-8918

传真：021-68865680

客服电话：95351

公司网址：www.xcsc.com

51) 中原证券股份有限公司

注册地址：郑州市郑东新区商务外环路 10 号

办公地址：郑州市郑东新区商务外环路 10 号

法定代表人：菅明军

联系人：程月艳、范春艳

电话：(0371) 69099882

传真：(0371) 65585899

客服电话：95377

公司网址：www.ccnew.com

52) 上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区浦东南路 500 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：高国富

联系人：胡子豪

电话：021—61618888

传真：021—63604199

服务电话：95528

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

53) 中国人寿保险股份有限公司

注册地址：中国北京市西城区金融大街 16 号

办公地址：中国北京市西城区金融大街 16 号

法定代表人：王滨

传真：010-66573255

服务电话：95519

公司网址：[www.e-chinalife.com](http://www.e-chinalife.com)

54) 财通证券股份有限公司

注册地址：浙江省杭州市杭大路 15 号嘉华国际商务中心

办公地址：浙江省杭州市杭大路 15 号嘉华国际商务中心

法定代表人：沈继宁

联系人：夏吉慧

电话：(0571) 87925129

传真：(0571) 87818329

客服电话：96336（浙江）,400-869-6336（全国）

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

55) 浙商证券股份有限公司

注册地址：浙江省杭州市杭大路 1 号黄龙世纪广场 A 座 6-7 楼

办公地址：浙江省杭州市杭大路 1 号黄龙世纪广场 A 座 6-7 楼

法定代表人：吴承根

联系人：张梦莹

电话：(021) 64718888

传真：(0571) 87901913

客服电话：(0571) 95345

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

56) 上海长量基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区东方路 1267 号 11 层

法定代表人：张跃伟

联系人：党敏

电话：021-20691831

传真：021-2069-1861

客服电话：400-820-2899

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

57) 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号

办公地址：上海市浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903~906室

法定代表人：杨文斌

联系人：周天雪

电话：021-20211847

传真：021-68596916

客服电话：400-700-9665

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

58) 上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路190号二号楼2层

办公地址：上海市徐汇区宛平南路88号东方财富大厦26楼

法定代表人：其实

联系人：王超

传真：021-54509953

客服电话：400-181-8188

公司网址：[www.1234567.com.cn](http://www.1234567.com.cn)

59) 深圳众禄基金销售股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼

办公地址：深圳市罗湖区梨园路8号HALO广场4楼

法定代表人：薛峰

联系人：龚江江

电话：0755-33227950

传真：0755-33227951

客服电话：4006-788-887

公司网址：[www.jjmmw.com](http://www.jjmmw.com)；[www.zlfund.cn](http://www.zlfund.cn)

60) 北京展恒基金销售股份有限公司

注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街6号

办公地址：北京市朝阳区安苑路15-1号邮电新闻大厦6层

法定代表人：闫振杰

联系人：李晓芳

联系电话：010-59601366 转 7167

客服电话：400-818-8000

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

61) 浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903 室

办公地址：杭州市余杭区五常街道同顺街 18 号同花顺大楼

法定代表人：吴强

联系人：董一锋

电话：0571—88911818

传真：0571-86800423

客服电话：4008-773-772

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

62) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

注册地址：杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 栋 202 室

办公地址：杭州市西湖区万塘路 18 号黄龙时代广场 B 座 2 楼

法定代表人：祖国明

联系人：韩爱彬

客服电话：4000-766-123

公司网站：<http://www.fund123.cn>

63) 和讯信息科技有限公司

注册地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

办公地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

法定代表人：王莉

联系人：陈慧慧

电话：010-85657353

客服电话：400-920-0022

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

64) 浦领基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区望京东园四区 2 号楼 10 层 1001 号 04 室

办公地址：北京市朝阳区望京浦项中心 A 座 9 层 04-08

法定代表人：聂婉君

联系人：李艳

电话：010-59497361

客服电话：400-012-5899

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

65) 上海大智慧基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区杨高南路 428 号 1 号楼 10-11 层

办公地址：上海市浦东新区杨高南路 428 号 1 号楼 10-11 层

法定代表人：申健

联系人：张蜓

电话：(021) 20219988\*37492

公司网址：<https://8.gw.com.cn/>

客服电话：021-20219931

66) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道民田路 178 号华融大厦 27 层 2704

办公地址：北京市西城区宣武门外大街 28 号富卓大厦 16 层

法定代表人：洪弘

联系人：文雯

电话：010-83363101

公司网址：<http://8.jrj.com.cn/>

客服电话：400-166-1188

67) 上海利得基金销售有限公司

住所：上海市浦东新区峨山路 91 弄 61 号 1 幢 12 层(陆家嘴软件园 10 号楼)

法定代表人：李兴春

联系人：张佳慧

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

客服电话：400-921-7755

68) 诺亚正行基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

办公地址：中国上海市杨浦区昆明路 508 号 B 座 12F

法定代表人：汪静波

联系人：郭哲晗

电话：021-80358749

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

客服电话：400-821-5399

69) 上海陆金所基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

法定代表人：王之光

联系人：程晨

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

客服电话：4008219031

70) 北京虹点基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区工人体育场北路甲 2 号裙房 2 层 222 单元

办公地址：北京市朝阳区工人体育场北路甲 2 号裙房 2 层 222 单元

法定代表人：何静

联系人：王重阳

公司网址：<https://www.hongdianfund.com/>

客服电话：400-068-1176

71) 珠海盈米基金销售有限公司

注册地址：珠海横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

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

法定代表人：肖雯

联系人：邱湘湘

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

客服电话：020-89629066

72) 上海联泰基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室

办公地址：上海市长宁区福泉北路 518 号 8 座 3 层

法定代表人：尹彬彬

联系人：陈东

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

客服电话：4000-466-788

73) 深圳前海微众银行股份有限公司

注册地址：广东省深圳市南山区田厦金牛广场 A 座 36 楼、37 楼

办公地址：广东省深圳市南山区田厦金牛广场 A 座 36 楼、37 楼

法定代表人：顾敏

联系人：赵云

公司网址：<https://www.webank.com/>

客服电话：400-999-8800

74) 深圳市金斧子基金销售有限公司

注册地址：深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路 15 号科兴科学园 B 栋 3 单元 11 层 1108

办公地址：深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路 15 号科兴科学园 B 栋 3 单元 11 层 1108

法定代表人：赖任军

联系人：陈丽霞

电话：0755-84355914

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

客服电话：400-9302-888

75) 上海万得基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

办公地址：上海市浦东新区浦明路 1500 号万得大厦 11 楼

法定代表人：黄祎

联系人：徐亚丹

联系电话：021-51327185

客服电话：400-799-1888

76) 北京蛋卷基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层

办公地址：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院望京 SOHO 塔 3 19 层

法定代表人：钟斐斐

联系人：袁园

公司网址：<https://danjuanapp.com/>

客服电话：4000618518

77) 东方财富证券股份有限公司

注册地址：西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城 10 栋楼

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号金座东方财富大厦

法定代表人：陈宏

联系人：付佳

客服电话：95357

公司网址：<http://www.18.cn>

78) 中证金牛(北京)投资咨询有限公司

注册地址：北京市丰台区东管头 1 号 2 号楼 2-45 室

办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲 1 号环球财讯中心 A 座 5 层

法定代表人：钱昊旻

联系人: 沈晨

联系电话: 010-59336544

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

客服电话: 4008-909-998

79) 京东肯特瑞基金销售有限公司

注册地址: 北京市海淀区西三旗建材城中路 12 号 17 号平房 157

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

层

法定代表人: 王苏宁

联系人: 李丹

公司网址: [kenterui.jd.com](http://kenterui.jd.com)

客服电话: 95518

80) 通华财富(上海)基金销售有限公司

注册地址: 上海市虹口区同丰路 667 弄 107 号 201 室

办公地址: 上海市浦东新区杨高南路 799 号陆家嘴世纪金融广场 3 号楼 9 楼

法定代表人: 沈丹义

联系人: 庄洁茹

客服电话: 400-101-9301

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

81) 玄元保险代理有限公司

注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区张杨路 707 号 1105 室

办公地址: 中国(上海)自由贸易试验区张杨路 707 号 1105 室

法定代表人: 马永谱

联系人: 卢亚博

客服电话: 400-080-8208

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

代销 C 类基金份额:

1) 中国银行股份有限公司

注册地址: 北京市西城区复兴门内大街 1 号

办公地址: 北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人: 刘连舸

传真: (010) 66594853

客服电话: 95566



公司网址：[www.boc.cn](http://www.boc.cn)

2)嘉实财富管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心办公楼二期46层4609-10单元

办公地址：北京市朝阳区建国路91号金地中心A座6层

法定代表人：赵学军

联系人：余永健

电话：010-85097570

传真：010-85097308

客服电话：400-021-8850

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

3)上海基煜基金销售有限公司

注册地址：上海市崇明县长兴镇路潘园公路1800号2号楼6153室

办公地址：上海市杨浦区昆明路518号北美广场A座1002室

法定代表人：王翔

联系人：俞申莉

电话：021-65370077

传真：021-55085991

客服电话：4008-205-369

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

4)华泰证券股份有限公司

注册地址：南京市江东中路228号

办公地址：南京市建邺区江东中路228号华泰证券广场、深圳市福田区深南大道4011号港中旅大厦18楼

法定代表人：张伟

联系人：庞晓云

电话：025-883389093

传真：0755-82492962（深圳）

客服电话：95597

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

5)中国人寿保险股份有限公司

注册地址：中国北京市西城区金融大街16号

办公地址：中国北京市西城区金融大街16号

法定代表人：王滨

传真：010-66573255

服务电话：95519

公司网址：www.e-chinalife.com

6) 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号

办公地址：上海市浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903~906室

法定代表人：杨文斌

联系人：周天雪

电话：021-20211847

传真：021-68596916

客服电话：400-700-9665

公司网址：www.ehowbuy.com

7) 上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路190号二号楼2层

办公地址：上海市徐汇区宛平南路88号东方财富大厦26楼

法定代表人：其实

联系人：王超

传真：021-54509953

客服电话：400-181-8188

公司网址：www.1234567.com.cn

8) 深圳众禄基金销售股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼

办公地址：深圳市罗湖区梨园路8号HALO广场4楼

法定代表人：薛峰

联系人：龚江江

电话：0755-33227950

传真：0755-33227951

客服电话：4006-788-887

公司网址：www.jjmmw.com；www.zlfund.cn

9) 浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室

办公地址：杭州市余杭区五常街道同顺街18号同花顺大楼

法定代表人：吴强

联系人：董一锋

电话：0571—88911818

传真：0571-86800423

客服电话：4008-773-772

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

10) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

注册地址：杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1栋202室

办公地址：杭州市西湖区万塘路18号黄龙时代广场B座2楼

法定代表人：祖国明

联系人：韩爱彬

客服电话：4000-766-123

公司网站：<http://www.fund123.cn>

11) 浦领基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区望京东园四区2号楼10层1001号04室

办公地址：北京市朝阳区望京浦项中心A座9层04-08

法定代表人：聂婉君

联系人：李艳

电话：010-59497361

客服电话：400-012-5899

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

12) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道民田路178号华融大厦27层2704

办公地址：北京市西城区宣武门外大街28号富卓大厦16层

法定代表人：洪弘

联系人：文雯

电话：010-83363101

公司网址：<http://8.jrj.com.cn/>

客服电话：400-166-1188

13) 上海利得基金销售有限公司

住所：上海市浦东新区峨山路91弄61号1幢12层(陆家嘴软件园10号楼)

法定代表人：李兴春

联系人：张佳慧

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

客服电话：400-921-7755

14) 诺亚正行基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室

办公地址：中国上海市杨浦区昆明路 508 号 B 座 12F

法定代表人：汪静波

联系人：郭哲晗

电话：021-80358749

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

客服电话：400-821-5399

15) 上海陆金所基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

法定代表人：王之光

联系人：程晨

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

客服电话：4008219031

16) 珠海盈米基金销售有限公司

注册地址：珠海横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

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

法定代表人：肖雯

联系人：邱湘湘

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

客服电话：020-89629066

17) 上海联泰基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室

办公地址：上海市长宁区福泉北路 518 号 8 座 3 层

法定代表人：尹彬彬

联系人：陈东

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

客服电话：4000-466-788

18) 和耕传承基金销售有限公司

注册地址：河南自贸试验区郑州片区（郑东）东风东路东、康宁街北 6 号楼 6 楼 602、603 房间

办公地址：北京市朝阳区酒仙桥路 6 号国际电子城 360 大厦 B 座

法定代表人：王旋

联系人：胡静华

联系电话：0371-5521 3196

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

客服电话：4000555671

19) 深圳市金斧子基金销售有限公司

注册地址：深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路 15 号科兴科学园 B 栋 3 单元 11 层 1108

办公地址：深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路 15 号科兴科学园 B 栋 3 单元 11 层 1108

法定代表人：赖任军

联系人：陈丽霞

电话：0755-84355914

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

客服电话：400-9302-888

20) 上海万得基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

办公地址：上海市浦东新区浦明路 1500 号万得大厦 11 楼

法定代表人：黄祎

联系人：徐亚丹

联系电话：021-51327185

客服电话：400-799-1888

21) 北京蛋卷基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层

办公地址：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院望京 SOHO 塔 3 19 层

法定代表人：钟斐斐

联系人：袁园

公司网址：<https://danjuanapp.com/>

客服电话：4000618518

22) 东方财富证券股份有限公司

注册地址：西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城 10 栋楼

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号金座东方财富大厦

法定代表人：陈宏

联系人：付佳

客服电话：95357

公司网址：<http://www.18.cn>

23) 中证金牛(北京)投资咨询有限公司

注册地址：北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室

办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲1号环球财讯中心A座5层

法定代表人：钱昊旻

联系人：沈晨

联系电话：010-59336544

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

客服电话：4008-909-998

24) 京东肯特瑞基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区西三旗建材城中路12号17号平房157

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

法定代表人：王苏宁

联系人：李丹

公司网址：[kenterui.jd.com](http://kenterui.jd.com)

客服电话：95518

25) 通华财富（上海）基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区同丰路667弄107号201室

办公地址：上海市浦东新区杨高南路799号陆家嘴世纪金融广场3号楼9楼

法定代表人：沈丹义

联系人：庄洁茹

客服电话：400-101-9301

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

26) 玄元保险代理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区张杨路707号1105室

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区张杨路707号1105室

法定代表人：马永谱

联系人：卢亚博

客服电话：400-080-8208

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

3、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，并在网站进行公示。

（二）注册登记机构

名称：华泰柏瑞基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层

法定代表人：贾波

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层

电话：400-888-0001，（021）38601777

传真：（021）50103016

联系人：赵景云

（三）律师事务所和经办律师

名称：上海源泰律师事务所

住所：上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 1405 室

负责人：廖海

电话：（021）51150298

传真：（021）51150398

经办律师：刘佳、范佳斐

（四）会计师事务所和经办注册会计师

机构名称：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）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 507 单元 01 室

办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

执行事务合伙人：李丹

经办注册会计师：张炯、朱宏宇

联系人：朱寅婷

联系电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

## 六 基金的募集

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定，并于 2019 年 11 月 15 日在中国证监会《关于准予华泰柏瑞景气回报一年持有期混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2019]2331 号）注册募集。

### （一）基金类型

混合型证券投资基金

### （二）基金存续期

不定期

### （三）基金运作方式

契约型，开放式。本基金每个工作日开放申购，但本基金对每份基金份额设置 1 年的最短持有期限，即：自基金合同生效日（对认购份额而言，下同）或基金份额申购确认日（对申购份额而言，下同）至该日次年的年度对日的期间内，投资者不能提出赎回或转换转出申请；该日次年的年度对日之后，投资者可以提出赎回或转换转出申请。若该日历年度实际不存在对应日期的，则顺延至下一日。

### （四）基金份额类别

本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购基金份额时收取认购、申购费用而不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资者认购、申购基金份额时不收取认购、申购费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。

本基金 A 类、C 类基金份额分别设置基金代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值和基金份额累计净值并单独公告。

投资者可自行选择认购、申购的基金份额类别。本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。

根据基金销售情况，在符合法律法规且不损害已有基金份额持有人权益的情况下，基金管理人在履行适当程序后可以增加新的基金份额类别、或者在基金合同规定的范围内变更现有基金份额类别的收费方式、调整基金份额分类办法及规则等，无需召开基金份额持有人大会，但调整前基金管理人需及时公告并报中国证监会备案。

### （五）募集方式和销售场所

本基金通过基金管理人的直销和中国银行股份有限公司等代销机构的销售网点公开发售。

投资者还可在与本公司达成网上交易的相关协议、接受本公司有关服务条款后，通过登录本公司网站（www.huatai-pb.com）办理开户、认购等业务，有关基金网上交易的开通范围和具体业务规则请登录本公司网站查询（目前仅对个人投资者开通网上交易）。

销售机构联系方式以及发售方案以发售公告及代销机构的相关公告为准，请投资者就募



集和认购的具体事宜仔细阅读《华泰柏瑞景气回报一年持有期混合型证券投资基金基金份额发售公告》及代销机构的相关公告。

#### （六）募集期限

本基金自 2019 年 11 月 28 日至 2019 年 12 月 13 日公开发售。根据《运作办法》的规定，如果本基金在上述时间段内未达到基金合同生效的法定条件、或基金管理人根据市场情况需要延长基金份额发售的时间，本基金可继续销售，但募集期自基金份额发售之日起最长不超过 3 个月。同时也可根据认购和市场情况提前结束发售。

#### （七）募集对象

本基金的发售对象为符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。

#### （八）基金的最低募集份额总额及金额

本基金的募集份额总额应不少于 2 亿份，基金募集金额应不少于 2 亿元人民币。

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

#### （九）基金的面值

本基金基金份额初始面值为人民币 1.00 元，以初始面值发售。

#### （十）投资人对基金份额的认购

##### 1、认购方法

投资者认购时间安排、投资者认购应提交的文件和办理的手续，由基金管理人根据相关法律法规及本基金基金合同，在发售公告中确定并披露。

##### 2、认购的方式及确认

（1）本基金认购采取全额缴款认购的方式。

（2）销售网点（包括直销和代销网点）受理申请并不表示对该申请是否成功的确认，而仅代表销售网点确实收到了认购申请。申请是否有效应以基金注册登记机构的确认为准。投资者可在基金合同生效后到各销售网点查询最终成交确认情况和认购的份额。

（3）基金投资者在募集期内可以多次认购，A 类基金份额的认购费按每笔 A 类基金份额的认购申请单独计算，认购申请一经受理不得撤消。

（4）若投资者的认购申请被确认为无效，基金管理人应当将投资者已支付的认购金额本金退还投资者。

##### 3、认购的限额

（1）在募集期内，投资者可多次认购，但单一投资人经登记机构确认的认购份额不得达到或者超过本基金确认总份额的 50%，对于超过部分的认购份额，登记机构不予确认。

（2）认购最低限额：在基金募集期内，除发售公告另有规定，基金管理人的网上交易

系统每个基金账户首次最低认购金额为 10 元人民币，单笔认购最低金额为 10 元人民币；代销机构以代销机构的规定为准；直销柜台每个基金账户首次最低认购金额为 50,000 元人民币，已在直销柜台有认/申购本公司旗下基金记录的投资者不受首次认购最低金额的限制，单笔认购最低金额为 10 元人民币。

各代销机构对最低认购限额及交易级差有其他规定的，以各代销机构的业务规定为准。

#### 4、认购费率

本基金采取金额认购方式，A 类基金份额在投资者认购时收取认购费，C 类基金份额在认购时不收取认购费。

投资者在认购 A 类基金份额时，具体的认购费率安排如下表所示。

认购金额（M，含认购费，元）	认购费率
M<100 万	1.20%
100 万≤M<200 万	0.80%
200 万≤M<500 万	0.60%
M≥500 万	1000 元/笔

投资者重复认购 A 类基金份额的，须按每次认购所对应的费率档次分别计费。认购费将用于支付募集期间会计师费、律师费、注册登记费、销售费及市场推广等支出，不计入基金财产。

C 类基金份额认购费率为 0。

#### 5、认购份额的计算

认购本基金 A 类基金份额的认购费用采用前端收费模式，即在认购 A 类基金份额时缴纳认购费。投资者的认购金额包括认购费用和净认购金额。有效认购资金在基金募集期间所产生的利息折成基金份额，归投资者所有。

##### （1）认购 A 类基金份额

当认购费用适用比例费率时，投资者的总认购份额的计算方式如下：

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

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

$$\text{认购份额} = (\text{净认购金额} + \text{募集期利息}) / \text{基金份额初始面值}$$

当认购费用适用固定金额时，投资者的总认购份额的计算方式如下：

$$\text{认购费用} = \text{固定金额}$$

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

$$\text{认购份额} = (\text{净认购金额} + \text{募集期利息}) / \text{基金份额初始面值}$$

净认购金额以人民币元为单位，计算结果按照四舍五入方法，保留小数点后两位；认购份额的计算结果按照四舍五入方法，保留小数点后两位，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

例：某投资者投资 10,000 元认购本基金 A 类基金份额，如果募集期内认购资金获得的

利息为 10 元，则其可得到的 A 类基金份额计算如下：

$$\text{净认购金额} = 10,000 / (1 + 1.20\%) = 9,881.42 \text{ 元}$$

$$\text{认购费用} = 10,000 - 9,881.42 = 118.58 \text{ 元}$$

$$\text{认购份额} = (9,881.42 + 10) / 1.00 = 9,891.42 \text{ 份}$$

即投资者投资 10,000 元认购本基金 A 类基金份额，加上认购资金在募集期内获得的利息，可得到 9,891.42 份 A 类基金份额。

(2) 认购 C 类基金份额时，投资者的总认购份额的计算方式如下：

$$\text{认购金额} = \text{净认购金额}$$

$$\text{认购份额} = (\text{净认购金额} + \text{募集期利息}) / \text{基金份额初始面值}$$

例：某投资者投资 10,000 元认购本基金 C 类基金份额，如果募集期内认购资金获得的利息为 10 元，则其可得到的 C 类基金份额计算如下：

$$\text{认购份额} = (10,000.00 + 10) / 1.00 = 10,010.00 \text{ 份}$$

即投资者投资 10,000 元认购本基金 C 类基金份额，加上认购资金在募集期内获得的利息，可得到 10,010.00 份 C 类基金份额。

(十一) 募集资金及利息的处理

1、基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。

2、有效认购资金在募集期间产生的利息折成基金份额，归投资者所有。利息折算成基金份额，计算结果按照四舍五入方法，保留小数点后两位。利息的计算和折算的基金份额的具体数额以注册登记机构的计算结果为准。该部分份额享受免除认购费的优惠。

(十二) 募集结果

本基金募集工作已于 2019 年 12 月 13 日顺利结束。经普华永道中天会计师事务所有限公司验资，本次募集的有效净认购金额为 1,270,803,538.33 元人民币，折合为 1,270,803,538.33 份华泰柏瑞景气回报基金份额（其中 A 类基金份额为 1,268,343,750.23 份，C 类基金份额为 2,459,788.10 份）；认购款项在基金验资确认日之前产生的银行利息共计 703,570.24 元人民币，折合基金份额 703,570.24 份（其中 A 类基金份额为 702,690.08 份，C 类基金份额为 880.16 份）。本次募集资金已于 2019 年 12 月 17 日划入本基金在基金托管人中国银行股份有限公司开立的基金托管专户。

本次募集有效认购户数为 12,325 户，按照每份基金份额发售面值 1.00 元人民币计算，本次募集资金及其产生的利息结转的基金份额共计 1,271,507,108.57 份（其中 A 类基金份额为 1,269,046,440.31 份，C 类基金份额为 2,460,668.26 份），已分别计入各基金份额持有人的基金账户，归各基金份额持有人所有。按照有关法律规定，本基金募集期间的信息披露费、会计师费、律师费及其他费用，不从基金财产中列支。

根据《基金法》、《运作办法》和《基金合同》、《招募说明书》的有关规定，本基金募集符合有关条件，本基金管理人已向中国证监会办理完毕基金备案手续，并于 2019 年 12 月

18 日获确认，基金合同自该日起正式生效。基金合同生效之日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

## 七 基金合同的生效

### （一）基金备案的条件

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

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

### （二）基金合同不能生效时募集资金的处理方式

如果募集期限届满，未满足基金备案条件，基金管理人应当承担下列责任：

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

### （三）基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

基金合同生效后，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，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，基金管理人应当在10个工作日内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，并在6个月内召开基金份额持有人大会进行表决。

法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

## 八 基金份额的申购与赎回

### （一）基金的运作方式

本基金每个工作日开放申购，但对每份基金份额设置 1 年的最短持有期限，即：自基金合同生效日（对认购份额而言，下同）或基金份额申购确认日（对申购份额而言，下同）至该日次年的年度对日的期间内，投资者不能提出赎回及转换转出申请；该日次年的年度对日之后，投资者可以提出赎回或转换转出申请。若该日历年实际不存在对应日期的，则顺延至下一日。

### （二）申购和赎回场所

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。具体的销售机构将由基金管理人在招募说明书“五相关服务机构”或其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并在管理人网站公示。基金投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。

### （三）申购和赎回的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或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或相关公告中载明。

基金合同生效后，若出现不可抗力或者新的证券交易市场、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。

认购份额的最短持有期限到期（即基金管理人自基金合同生效之日次年的年度对日）后，基金管理人开始办理赎回，具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。

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

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的，其基金份额申购、赎回或转换价格为下一开放日基金份额申购、赎回或转换的价格。

### （四）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该类基金份额净值为基准进行计算；

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；

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

5、投资者在申购本基金时可自行选择所申购的基金份额类别；基金管理人可以根据相关法律法规以及基金合同的规定，未来在条件成熟和准备完备的情况下提供本基金不同类别之间的转换服务，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；

6、基金管理人有权决定基金份额持有人持有本基金的最高限额和本基金的总规模限额，但应最迟在新的限额实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告；

7、办理申购、赎回业务时，应当遵循基金份额持有人利益优先原则，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待。

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。

#### （五）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，投资人交付申购款项的，申购成立；登记机构确认基金份额时，申购生效。若申购款项在规定时间内未全额到账，则申购不成立。

基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；登记机构确认赎回时，赎回生效。投资者在提交赎回申请时，必须有足够的基金份额余额，否则所提交的赎回申请不成立。投资人赎回申请生效后，基金管理人将在 T+7 日(包括该日)内支付赎回款项。在发生巨额赎回或基金合同载明的其他暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。

遇证券、期货交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其它非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程时，赎回款项顺延至上述情形消除后的下一个工作日划出。

##### 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，投资人应在 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。如相关法律法规以及中国证监会另有规定，则依规定执行。

基金销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构已

经接收到申购、赎回申请。申购与赎回的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资者应及时查询并妥善行使合法权利。若申购不成立或无效，则申购款项本金退还给投资者。

基金管理人可在法律法规允许的范围内、在不对基金份额持有人利益造成损害的前提下，对上述业务的办理时间、方式等规则进行调整。基金管理人应在新规则开始实施前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

#### （六）申购与赎回的数额限制

1、基金管理人的网上交易系统每个账户首次申购的最低金额为 10 元人民币；单笔申购的最低金额为 10 元人民币；代销机构以代销机构的规定为准；

2、直销柜台每个账户首次申购的最低金额为 50,000 元人民币；已在直销柜台有认/申购本公司旗下基金记录的投资者不受首次申购最低金额的限制，单笔申购的最低金额为 10 元人民币；

3、基金份额持有人可将其全部或部分基金份额赎回，但某笔赎回导致单个交易账户的基金份额余额少于 1 份时，余额部分基金份额必须一同赎回。赎回申请的最低份额为 10 份，但基金份额持有人单个交易账户内的基金份额余额少于 10 份并申请全部赎回时，可不受前述最低 10 份的申请限制，代销机构以代销机构的规定为准。赎回申请的具体处理结果以注册登记中心确认结果为准；

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。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。具体见基金管理人相关公告。

5、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。

#### （七）申购和赎回的价格、费用及其用途

1、本基金各类基金份额净值的计算，保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，经履行适当程序，可以适当延迟计算或公告。如相关法律法规以及中国证监会另有规定，则依规定执行。

#### 2、申购份额、余额以及赎回金额的处理方式：

申购的有效份额为净申购金额除以当日的该类基金份额净值，有效份额单位为份，上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日该类基金份额的基金份额净值并扣除应计提的业绩报酬（如有）及其他相应的费用，赎回金额单位为元，上述计算结果均按四舍



五入方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

### 3、申购费和赎回费

#### (1) 申购费

投资者在申购 A 类基金份额时，申购费率如下表：

申购金额（M，含申购费，元）	申购费率
M<100 万	1.50%
100 万≤M<200 万	1.00%
200 万≤M<500 万	0.80%
M≥500 万	1,000 元/笔

在申购费按金额分档的情况下，如果投资者多次申购 A 类基金份额的，申购费适用单笔申购金额所对应的费率。本基金 A 类基金份额的申购费用由 A 类基金份额的申购人承担，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用，不列入基金财产。

C 类基金份额申购费率为 0。

#### (2) 赎回费

对于本基金每份基金份额，设置 1 年最短持有期限，1 年后方可赎回，赎回时不收取赎回费。

(3) 基金管理人可以在法律法规和基金合同规定范围内调整申购费率、赎回费率或收费方式，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刊登公告。

(4) 当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。

(5) 基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，在对存量基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，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销售费率。

### 4、申购份额的计算

(1) 申购本基金 A 类基金份额的申购费用采用前端收费模式（即申购 A 类基金份额时缴纳申购费），投资者的 A 类基金份额申购金额包括申购费用和净申购金额。

当申购费用适用比例费率时，A 类基金份额申购份额的计算方式如下：

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

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

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

当申购费用适用固定金额时，A 类基金份额申购份额的计算方式如下：

申购费用=固定金额

净申购金额=申购金额-申购费用

申购份额=净申购金额/T日A类基金份额净值

例：某投资者投资 50,000 元申购本基金 A 类基金份额，假设 T 日 A 类基金份额净值为 1.0520 元，则可得到的 A 类基金份额的申购份额为：

净申购金额=50,000/(1+1.50%)=49,261.08 元

申购费用=50,000-49,261.08=738.92 元

申购份额=49,261.08/1.0520=46,826.12 份

即：投资者投资 50,000 元申购本基金 A 类基金份额，其对应费率为 1.50%，假设 T 日 A 类基金份额净值为 1.0520 元，则其可得到 46,826.12 份 A 类基金份额。

(2) 本基金的 C 类基金份额申购时不收取申购费用，申购金额即为净申购金额。

申购金额=净申购金额

申购份额=净申购金额/T日C类基金份额净值

例：某投资者投资 50,000 元申购本基金 C 类基金份额，假设 T 日 C 类基金份额净值为 1.0520 元，则可得到的 C 类基金份额的申购份额为：

申购份额=50,000/1.0520=47,528.52 份

即：投资者投资 50,000 元申购本基金 C 类基金份额，假设 T 日 C 类基金份额净值为 1.0520 元，则其可得到 47,528.52 份 C 类基金份额。

#### 5、净赎回金额的计算

投资者在赎回本基金时不收取赎回费。其中，

赎回金额=赎回份额×T日A类或C类基金份额净值

赎回费用=赎回金额×赎回费率

净赎回金额=赎回金额-赎回费用-业绩报酬

(业绩报酬计算公式详见“十三基金的费用与税收”)

例 1：某投资者赎回本基金 10,000 份 A 类基金份额，该笔基金份额申购当天 A 类基金份额净值为 1.0000 元，A 类基金份额累计净值为 1.0000 元，持有时间为 400 天，假设 T 日 A 类基金份额净值是 1.2000 元，A 类基金份额累计净值为 1.2000 元，则该笔基金份额的年化收益率为：

基金份额的年化收益率= $\frac{1.2000-1.0000}{1.0000} \times \frac{365}{400} \times 100\% = 18.25\%$

该笔基金份额的业绩报酬= $(18.25\% - 8\%) \times 20\% \times 1.0000 \times 10,000 \times \frac{400}{365} = 224.66$ 元

其可得到的净赎回金额为：

赎回总金额=10,000×1.2000=12,000.00 元

赎回费用=12,000.00×0=0 元

业绩报酬=224.66 元

净赎回金额=12,000.00 - 0 - 224.66 =11,775.34 元

即：投资者赎回本基金 10,000 份 A 类基金份额，持有时间为 400 天，假设 T 日 A 类基金份额累计净值是 1.2000 元，则其可得到的净赎回金额为 11,775.34 元。

例 2：某投资者赎回本基金 10,000 份 A 类基金份额，该笔基金份额申购当天 A 类基金份额净值为 1.0000 元，A 类基金份额累计净值为 1.0000 元，持有时间为 400 天，假设 T 日 A 类基金份额净值是 1.0500 元，A 类基金份额累计净值为 1.0500 元，则该笔基金份额的年化收益率为：

$$\text{基金份额的年化收益率} = \frac{1.0500 - 1.0000}{1.0000} \times \frac{365}{400} \times 100\% = 4.5625\%$$

该笔基金份额的业绩报酬= 0 元

其可得到的净赎回金额为：

赎回总金额=10,000×1.0500=10,500.00 元

赎回费用=10,500.00×0=0 元

业绩报酬=0 元

净赎回金额=10,500.00 - 0 - 0 =10,500.00 元

即：投资者赎回本基金 10,000 份 A 类基金份额，持有时间为 400 天，假设 T 日 A 类基金份额累计净值是 1.0500 元，则其可得到的净赎回金额为 10,500.00 元。

## 6、基金份额净值计算

T 日某类基金份额净值=T 日该类基金资产净值/T 日该类发行在外的基金份额总数。

各类基金份额净值单位为元，计算结果保留小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

T 日的各类基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 内日公告。遇特殊情况，经履行适当程序，可以适当延迟计算或公告。如相关法律法规以及中国证监会另有规定，则依规定执行。

### （八）申购与赎回的注册登记

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。

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人的申购申请：

- 1、因不可抗力导致基金无法正常运作。
- 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。
- 3、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、接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。
- 5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或发生其他损害现有基金份额持有人利益的情形。
- 6、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。
- 7、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。
- 8、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过 50%，或者变相规避 50%集中度的情形。
- 9、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、单一投资人单日或单笔申购金额上限的。
- 10、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第 1、2、3、5、6、7、10 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人申购申请时，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。

发生上述第 4、8 项暂停申购情形之一的，为保护基金份额持有人的合法权益，基金管理人有权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。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，也可以采取上述措施对基金规模予以控制。

如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的，被拒绝的申购款项本金将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

#### （十）暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

- 1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。
- 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的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、发生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，基金管理人可暂停接受基金份额持有人的赎回申请。

6、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。

7、基金份额持有人持有基金份额的期限不满足基金合同约定的最短持有期限的。

8、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形（第 7 项除外）之一且基金管理人决定暂停赎回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，具体计算标准由基金管理人届时确定并公告。若出现上述第 4 项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

#### （十一）巨额赎回的情形及处理方式

##### 1、巨额赎回的认定

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

##### 2、巨额赎回的处理方式

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

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

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

（3）若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额的 20%，基金管理人可以先行对该单个基金份额持有人超出 20%的赎回申请实施延期

办理。而对该单个基金份额持有人 20%以内（含 20%）的赎回申请，基金管理人根据前述“（1）全额赎回”或“（2）部分延期赎回”的约定方式与其他基金持有人的赎回申请一并办理。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上一开放日基金总份额 20%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上一开放日基金总份额的比例低于 20%。

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

### 3、巨额赎回的公告

当发生上述巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个工作日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，并在 2 日内在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，基金管理人应依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上刊登暂停公告。

2、上述暂停申购或赎回情况消除的，基金管理人应于重新开放日公布最近 1 个开放日的各类基金份额净值。

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

#### （十三）基金份额的转让

在法律法规允许且条件具备的情况下，基金管理人可受理基金份额持有人通过中国证监会认可的交易场所或者交易方式进行份额转让的申请并由登记机构办理基金份额的过户登记。基金管理人拟受理基金份额转让业务的，将提前公告，基金份额持有人应根据基金管理人公告的业务规则办理基金份额转让业务。

#### （十四）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，或者按照相关法律法规或国家有权机关要求的方式进行处理的行为。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标准收取转托管费。

#### （十六）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。

#### （十七）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。

#### （十八）基金份额的冻结和解冻

基金登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻，以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。基金账户或基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益一并冻结，被冻结部分份额仍然参与收益分配与支付。法律法规或监管部门另有规定的除外。

如相关法律法规允许基金管理人办理基金份额的其他基金业务，基金管理人将制定和实施相应的业务规则。

## 九 基金的投资

### （一）投资目标

在控制风险的前提下，力争控制基金的回撤水平，追求资产净值的长期稳健增值，为投资人提供超越业绩比较基准的投资回报。

### （二）投资范围

本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括主板、中小板、创业板、科创板以及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、存托凭证、债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、政府支持债券、政府支持机构债、公开发行的次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、可交换债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、衍生工具（股指期货、国债期货等）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金还可以根据相关法律法规的规定参与融资业务。

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

基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为 60%-95%；每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如果法律法规对该比例要求有变更的，在履行适当程序后，以变更后的比例为准，本基金的投资比例会做相应调整。

### （三）投资策略

本基金在宏观经济分析基础上，结合政策面、市场资金面等情况，在经济周期不同阶段，依据市场不同表现，在大类资产中进行配置，把握各类资产的投资机会，保证整体投资业绩的持续性。

#### 1、大类资产配置

本基金将通过研究宏观经济、国家政策等可能影响证券市场的重要因素，对股票、债券和货币资产的风险收益特征进行深入分析，合理预测各类资产的价格变动趋势，确定不同资产类别的投资比例。在此基础上，积极跟踪由于市场短期波动引起的各类资产的价格偏差和风险收益特征的相对变化，动态调整各大类资产之间的投资比例，在保持总体风险水平相对平稳的基础上，获取相对较高的基金投资收益。

#### 2、股票投资策略

本基金希望通过对具备较高景气度的行业以及个股的选择，实现较好的投资回报。公司和行业基本面盈利能力的提升，或持续保持较高的盈利能力，是高景气特征的典型代表。但除此之外，对高景气的认知包括但不限于以下几个方面：首先，尽管盈利可能尚未体现，但



行业供需结构已经发生实质性改善，后续盈利方向可预期性的改善，这种情况属于对行业景气有领先性的预判。其次，尽管行业本身表现平淡，公司在行业内话语权的提升，或能够持续保持较高的护城河，也代表了公司景气度的改善。最后，政策景气度的改善也需要考虑，对于很多高科技类的公司，尽管尚处在行业或公司的导入期，从利润等财务指标尚无法确立景气，但符合国家发展扶持的政策支持方向，属于政策性景气。

#### (1) 行业精选策略

本基金根据行业周期轮动特征以及行业相对投资价值，精选具备较高景气度的行业进行重点配置。

从中国经济发展阶段特征角度来看，中国经济从高速增长阶段转入到高质量增长阶段，结构性增长特征越来越凸显。在新阶段，存在行业景气时钟和宏观经济景气时钟不同步的情况，为股票市场投资提供了结构性投资机会。通过自下而上的微观分析，结合中观分析行业景气时钟观察，可以帮助我们较好地把握投资机会。所以，景气时钟上行行业、盈利增长良好的投资标的，是本基金重要的投资方向。

从投资决策过程的角度，经典的定性分析、定量分析是行之有效的分析工具，具体如下：

##### ①定性分析：

根据宏观经济运行特征、经济景气周期以及行业周期轮动特征，从经济周期因素、行业发展政策因素、产业结构变化趋势因素、行业生命周期因素以及行业景气周期等多个维度把握不同行业的景气度变化情况和趋势，具体如下：

**经济周期：**根据美林投资时钟理论，按照经济增长与通胀的不同搭配，将经济周期划分为四个阶段：经济上行通胀下行构成复苏阶段；经济上行通胀上行构成过热阶段；经济下行，通胀上行构成滞胀阶段；经济下行通胀下行构成衰退阶段。随着经济发展周期的轮动，各个行业的配置价值有所变化，例如当经济增长加快时，周期性增长行业如有色金属、钢铁、煤炭、电力、工程机械等因为与宏观经济相关度很高，在此阶段市场的需求高涨，更容易受到投资者的青睐。当经济增长放缓时，景气低迷，固定投资下滑，对周期性行业的产品需求下降，后周期行业具有良好防御性，如医药、常用消费品、公共事业等会更适合作为投资组合标的。

**行业发展政策：**产业政策导致产业结构出现调整，导致其细分行业的发展出现显著变化。基金管理人将从产业政策出台背景、时机和政策取向出发，评估产业政策对行业的影响程度，发掘受产业政策鼓励及受益于产业结构升级的细分行业。如中国着力发展的新兴战略产业、先进制造业；健康养老，教育娱乐等新业态和新模式行业；环保产业、新能源、保护资源等行业。

**产业结构变化趋势：**产业结构不仅是一个国家各产业之间构成的比例关系，而且反映了一个国家的产业演进和经济发展水平，而我国目前三大产业已经出现了不同的发展趋势，从而需重点关注产业结构变化利好的相关细分行业，如第一产业中已成为普遍的农业发展模式

的现代农业和生态农业行业，成为第二产业发展的重要支柱的高端制造业和绿色制造业，成为我国第三产业发展关键的消费型服务业和知识型服务业。

**行业生命周期：**行业的生命周期分为四个阶段，即初创期、成长期、成熟期和衰退期。其中，成长期行业的利润增长率将超过市场平均水平，投资于该阶段行业获得超额收益的可能性将有较大提高。对于处于衰退期的行业，随着经济的复苏、产业创新或技术突破，将产生新的市场需求，降低生产成本，提高生产效率，这些行业将阶段性的繁荣或者重新获得长期成长。本基金将根据行业指数变化、行业整体增长率、销售额、利润率、竞争状况、定价方式、进入壁垒等方面进行综合分析，判断行业所处的生命周期，确定行业中长期发展前景和投资价值，把握行业生命周期的变化所带来的投资机会。

**行业景气周期：**市场环境变化会引发行业盈利产生波动。这种情况在行业成长期表现为增速的波动，在成熟期表现为企业盈利的上升或者下降，而领先型企业和跟随型企业的表现一般会出现分化。把握优势企业的盈利增长加速阶段，可以为投资带来良好的超额收益。

## ②定量分析：

利用行业的估值、业绩等多个方面指标进行筛选，如行业相对估值水平（行业估值/市场估值）、行业相对利润增长率（行业利润增长率/市场利润增长率）、行业 PEG（行业估值/行业利润增长率）等。而针对不同行业适用于不同的估值指标进行分析。

市盈率估值方法适合于盈利相对稳定，周期性较弱的行业，如消费品行业、公共服务业等。市净率估值方法适合于周期性较强，拥有大量固定资产并且账面价值相对较为稳定的行业，如钢铁业、航空业、航运业、化工业，或者流动资产比例高的行业，如银行、保险等。但是市净率不适用于账面价值的重置成本变动较快的公司，和固定资产较少、商誉或知识产权较多的服务行业。高科技企业的核心竞争要素在资产负债表上难以准确计价，也不适合市净率衡量。

另外，行业不同发展阶段，合理的估值指标会有所不同。比如，在发展期的行业，和行业景气上行阶段的行业，企业盈利增速较高，股票估值往往存在一定估值溢价，用 PEG 衡量会更合理一些。

对行业、公司的定量分析，还需要综合考虑行业盈利增长、估值的历史变化，和市场横向比较，以及盈利增速、估值增速的相互关系，做出合理判断。

## （2）个股选择策略

本基金主要采用“自下而上”的个股选择策略，重点具备较高景气度的个股。具体而言，本基金将从以下几个方面进行综合筛选：

①**公司主营业务鲜明，具备行业竞争优势：**公司主营业务收入不低于行业平均水平，能够在管理、品牌、资源、技术、创新等方面具备比较优势；

②**公司商业模式具备可持续性：**考察公司业务规划和发展战略，公司的核心商业模式具有稳定性和可持续性，具有较好发展前景；

③公司财务状况良好：利用公司各项财务指标，综合考察上市公司的资产负债情况、盈利能力、成长能力、估值水平等，选取财务状况良好的上市公司；

④公司治理结构健全规范：能够建立完善、科学的公司治理结构，包括管理团队稳定、高效，股东结构稳定，注重中小股东利益，信息披露透明，具有合理的激励与约束机制等。

⑤政策扶持：以高科技类企业代表的按照财务指标尚无法确立景气的公司来说，由于符合国家发展扶持的政策支持方向，此类上市公司也将纳入本基金的投资范围。

### （3）科创板股票投资策略

本基金通过制定科技创新成长类股票估值定价的量化指标，结合前述个股精选的策略，筛选符合较高景气度标准的个股。

### 3、存托凭证投资策略

本基金将根据投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。

### 4、债券投资策略

本基金将在对宏观经济走势、利率变化趋势、收益率曲线形态变化和发债主体基本面分析的基础上，综合运用久期管理策略、期限结构配置策略、骑乘策略、息差策略等主动投资策略，选择合适的时机和品种构建债券组合。

#### （1）久期管理策略

本基金通过对宏观经济变量以及宏观经济政策等因素进行分析判断，形成对未来利率走势的合理预测，根据利率水平的预期变化主动调整债券组合的久期，有效控制基金组合整体风险，以达到优化资产收益率的目的。

如果判断未来利率水平将下降，本基金可通过增加组合的久期，获得债券收益率下降带来的收益；反之，如果预测未来利率水平将上升，本基金可缩短组合的久期，以减小债券收益率上升带来的损失。

#### （2）期限结构配置策略

在确定组合久期的基础上，运用统计和数量分析技术、对市场利率期限结构历史数据进行分析检验和情景测试，并综合考虑债券市场微观因素如历史期限结构、新债发行、回购及市场拆借利率等，形成对债券收益率曲线形态及其发展趋势的判断，从而在子弹型、杠铃型或阶梯型配置策略中进行选择并动态调整。其中，子弹型策略是将偿还期限高度集中于收益率曲线上的某一点；杠铃型策略是将偿还期限集中于收益率曲线的两端；而阶梯型策略是每类期限债券所占的比重基本一致。在收益率曲线变陡时，本基金将采用子弹型配置；当预期收益率曲线变平时，将采用哑铃型配置；在预期收益率曲线平移时，则采用阶梯型配置。

#### （3）骑乘策略

通过分析收益率曲线各期限段的利差情况，当债券收益率曲线比较陡峭时，买入期限位于收益率曲线陡峭处右侧的债券。在收益率曲线不变动的情况下，随着债券剩余期限的缩短，

债券的收益率水平将会较投资期初有所下降,这样可同时获得该债券持有期的稳定的票息收入以及收益率下降带来的价差收入;即使收益率曲线上升或进一步变陡,这一策略也能够提供更多的安全边际。

#### (4) 息差策略

根据市场利率水平,收益率曲线的形态以及对利率期限结构的预期,通过采用长期债券和短期回购相结合,获取债券票息收益和回购利率成本之间的利差。当回购利率低于债券收益率时,可以将正回购所获得的资金投资于债券,利用杠杆放大债基投资的收益。

#### (5) 信用债券投资策略

发债主体的资信状况以及信用利差曲线的变动将直接决定信用债的收益率水平。本基金将利用内部信用评级体系对债券发行人及其发行的债券进行信用评估,分析违约风险以及合理信用利差水平,识别投资价值。

本基金将重点分析发债主体的行业发展前景、市场地位、公司治理、财务质量(主要是财务指标分析,包括资产负债水平、偿债能力、运营效率以及现金流质量等)、融资目的等要素,综合评价其信用等级。本基金还将定期对上述指标进行更新,及时识别发债主体信用状况的变化,从而调整信用等级,对债券重新定价。

本基金还将关注信用利差曲线的变动趋势,通过对宏观经济周期的判断结合对信用债在不同市场中的供需状况、市场容量、债券结构和流动性因素的分析,形成信用利差曲线变动趋势的合理预测,确定信用债整体和分行业的配置比例。

#### (6) 可转换债券投资策略

可转换债券结合了权益类证券与固定收益类证券的特性,具有下行风险有限同时可分享基础股票价格上涨的特点。本基金将运用二叉树模型以及 B-S 期权定价模型等量化工具评估其内在投资价值,结合对可转换债券市场上的溢价率及其变动趋势、行业资金的配置以及基础股票基本面的综合分析,最终确定其投资权重及具体品种。

### 5、资产支持证券投资策略

本基金将深入研究资产支持证券的发行条款、市场利率、支持资产的构成及质量、支持资产的现金流变动情况以及提前偿还率水平等因素,评估资产支持证券的信用风险、利率风险、流动性风险和提前偿付风险,通过信用分析和流动性管理,辅以量化模型分析,精选那些经风险调整后收益率较高的品种进行投资,力求获得长期稳定的投资收益。

### 6、衍生品投资策略

#### (1) 股指期货投资策略

在法律法规允许的范围内,本基金可基于谨慎原则运用股指期货对基金投资组合进行管理,以套期保值为目的,对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险,提高投资效率。本基金主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金在进行股指期货投资时,将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研

究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

#### （2）国债期货投资策略

本基金将按照相关法律法规的规定，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在追求基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的中长期稳定增值。

未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，基金可在履行适当程序后，相应调整和更新相关投资策略。

#### 7、融资业务的投资策略

本基金参与融资业务，将综合考虑融资成本、保证金比例、冲抵保证金证券折算率、信用资质等条件，选择合适的交易对手方。同时，在保障基金投资组合充足流动性以及有效控制融资杠杆风险的前提下，确定融资比例。

#### （四）投资决策依据

- 1、国家有关法律、法规、基金合同等的有关规定；
- 2、根据投研团队对于市场中可获得相应数据的研究分析所构建的投资模型以及投资经理和投研团队对市场状态的判断；
- 3、基于风险估测模型的投资风险分析。

#### （五）投资决策机制

- 1、投资决策委员会负责审定基金经理的投资策略和原则；审定基金经理定期调整计划；审定基金定期投资检讨报告；决定基金禁止的投资事项等。
- 2、基金经理：在投资决策委员会的授权范围内，根据基金的投资政策实施投资管理，确定具体的投资品种、数量、策略，构建优化和调整投资组合，进行投资组合的日常分析和管理工作。
- 3、基金经理助理/投资分析员：通过内部调研和参考外部研究报告，编写有关公司分析、行业分析、宏观分析、市场分析的各类报告，提交基金经理，作为投资决策的依据。

#### （六）投资程序

- 1、投研团队对市场中可获得的相应数据进行研究分析，并构建投资模型，为本基金的投资管理提供决策依据。
- 2、投资决策委员会依据投研团队的研究结果对基金的资产配置比例等提出指导性意见。
- 3、基金经理根据投资决策委员会的决议，利用投资模型，并结合对宏观政策、证券市场和上市公司等的分析判断，形成基金投资计划。
- 4、集中交易室依据基金经理的指令，制定交易策略，统一执行证券投资组合计划，进

行具体品种的交易。

5、法律监察部对投资组合计划的执行过程进行监控。

6、基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下有权根据环境变化和实际需要对上述投资程序做出调整。

#### （七）业绩比较基准

本基金业绩比较基准为：中证 800 指数收益率\*80%+上证国债指数收益率\*10%+银行活期存款利率(税后)\*10%。

中证 800 指数由中证指数有限公司编制，由中证 500 指数和沪深 300 指数样本股一起构成，综合反映中国 A 股市场上市股票价格的整体表现，适合作为本基金股票组合的业绩比较基准。

上证国债指数由上海证券交易所发布，由在上海证券交易所上市的剩余期限在一年以上的国债构成。根据本基金的投资范围和投资比例，选用上述业绩比较基准能够客观、合理地反映本基金的风险收益特征。

如果今后法律法规发生变化，或者相关数据编制单位停止计算编制该指数或更改指数名称，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金业绩比较基准时，经与基金托管人协商一致，本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告，而无需召开基金份额持有人大会。

#### （八）风险收益特征

本基金为混合型基金，在通常情况下其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。

本基金还可投资科创板的股票，需承担科创板机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

#### （九）投资禁止行为与限制

1、为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

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

上述禁止行为是基于基金合同生效时法律法规而约定，如法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，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以变更后的规定为准；基金管理人应提前三个交易日公告。

2、基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

### 3、基金投资组合比例限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

- (1) 本基金股票资产的投资比例占基金资产的 60%-95%；
- (2) 本基金每个交易日日终，在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；
- (3) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；
- (4) 本基金持有一家公司发行的科创板股票，其市值不超过基金资产净值的 5%，且不得超过该股票总流通市值的 5%；
- (5) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；
- (6) 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%；
- (7) 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%；
- (8) 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%；
- (9) 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%；
- (10) 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；
- (11) 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；
- (12) 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%；进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

(13) 本基金参与股指期货、国债期货交易，应当遵守下列要求：

① 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的 15%；

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

③ 本基金在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过本基金持有的股票总市值的 20%；本基金在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%；

④ 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例为 60%-95%；

⑤ 本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 30%；

(14) 本基金可以参与融资业务，在任何交易日日终，本基金持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；

(15) 本基金资产总值不得超过基金资产净值的 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本基金资产净值的 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合该比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

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

(18) 本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行，与境内上市交易的股票合并计算；

(19) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他投资限制。

除上述第（2）、（10）、（16）、（17）条外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金



托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。

法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准，但须提前公告。

(十) 基金管理人代表基金行使股东或债权人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或债权人权利，保护基金份额持有人的利益；

2、不谋求对上市公司的控股；

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) 基金投资组合报告

投资组合报告截止日为 2020 年 9 月 30 日。

1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,706,166,754.76	87.66
	其中：股票	1,706,166,754.76	87.66
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	226,231,775.89	11.62
8	其他资产	13,933,472.43	0.72
9	合计	1,946,332,003.08	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	40,404.00	0.00
B	采矿业	354,338.35	0.02

C	制造业	1,172,971,079.82	61.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	13,029.12	0.00
F	批发和零售业	45,867,477.50	2.41
G	交通运输、仓储和邮政业	33,535.60	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	79,367,386.15	4.17
J	金融业	133,017,595.91	6.98
K	房地产业	159,402.64	0.01
L	租赁和商务服务业	138,570,284.97	7.27
M	科学研究和技术服务业	24,813.00	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	41,958.98	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	135,560,192.95	7.12
Q	卫生和社会工作	91,458.51	0.00
R	文化、体育和娱乐业	53,797.26	0.00
S	综合	-	-
	合计	1,706,166,754.76	89.55

## 2) 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

## 3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601888	中国中免	621,267	138,505,264.98	7.27
2	002607	中公教育	4,154,465	135,560,192.95	7.12
3	002050	三花智控	5,752,165	127,698,063.00	6.70
4	600519	贵州茅台	71,509	119,312,766.50	6.26
5	000333	美的集团	1,587,017	115,217,434.20	6.05
6	603338	浙江鼎力	1,128,968	111,937,177.20	5.88
7	300502	新易盛	1,728,968	111,086,194.00	5.83
8	601100	恒立液压	1,344,404	95,990,445.60	5.04
9	600570	恒生电子	798,108	78,685,467.72	4.13
10	000739	普洛药业	2,843,770	67,795,476.80	3.56

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：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

注：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

注：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

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

2) 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

1) 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

2) 本基金投资国债期货的投资政策

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

3) 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

11、投资组合报告附注

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

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

注：基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情形。

3) 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	610,535.09
2	应收证券清算款	13,279,691.72
3	应收股利	-
4	应收利息	22,029.85
5	应收申购款	21,215.77
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	13,933,472.43

4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：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

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的股票。

## 十 基金的业绩

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

基金的业绩报告截止日为 2020 年 9 月 30 日。

### 1、本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华泰柏瑞景气回报一年持有期混合 A

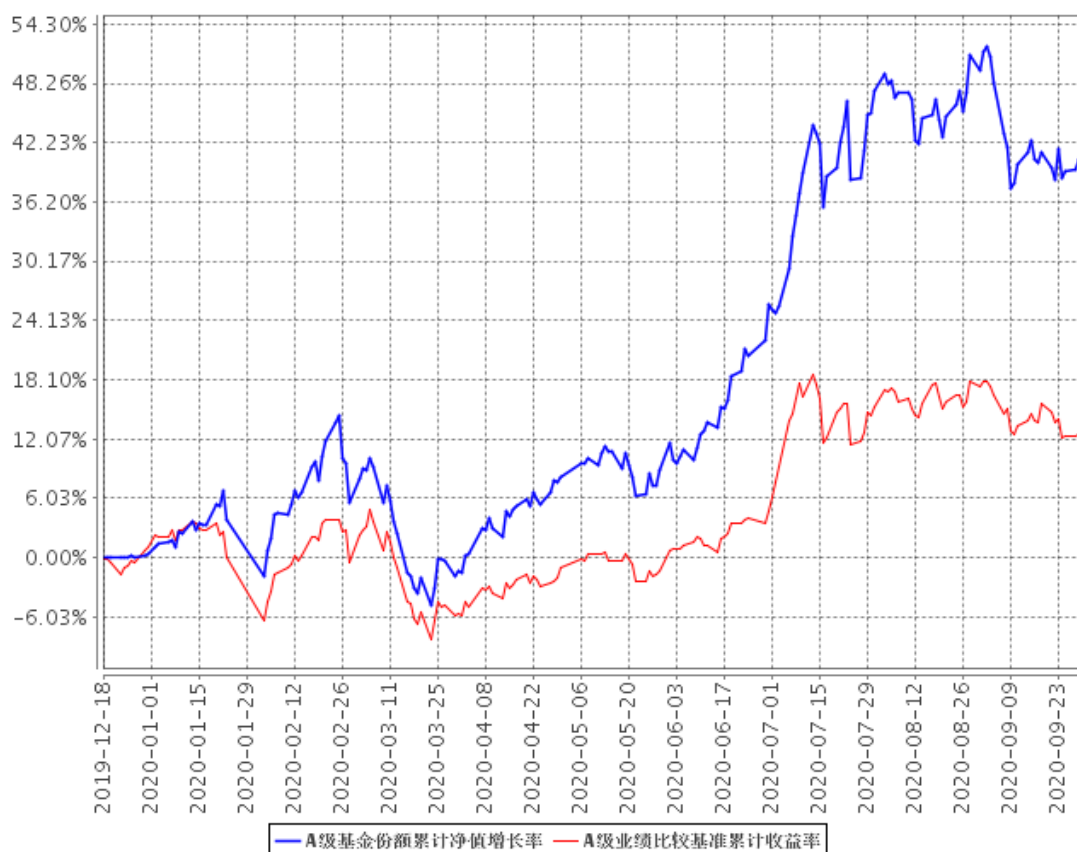
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	12.02%	1.73%	7.35%	1.29%	4.67%	0.44%
过去六个月	42.63%	1.48%	19.17%	1.06%	23.46%	0.42%
2019 年	0.43%	0.10%	0.98%	0.64%	-0.55%	-0.54%

华泰柏瑞景气回报一年持有期混合 C

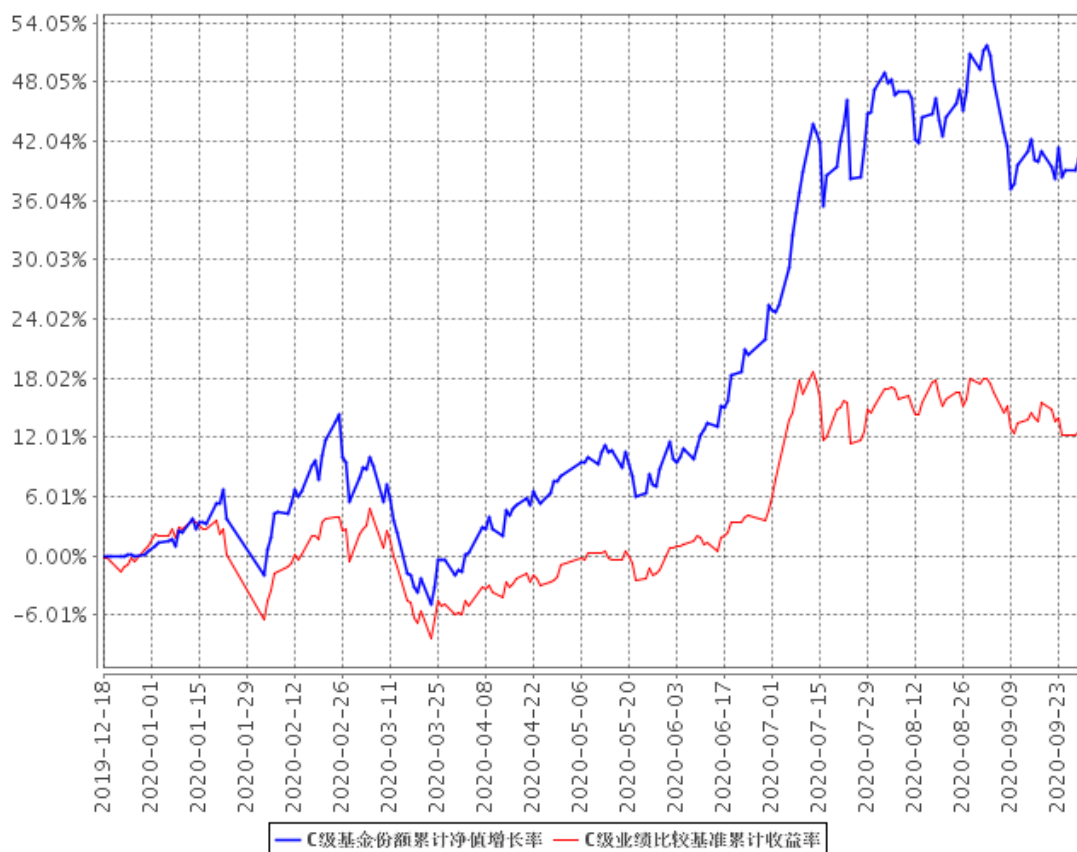
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	11.94%	1.73%	7.35%	1.29%	4.59%	0.44%
过去六个月	42.46%	1.48%	19.17%	1.06%	23.29%	0.42%
2019 年	0.42%	0.10%	0.98%	0.64%	-0.56%	-0.54%

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

**A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图**



**C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图**



- 注：1、图示日期为 2019 年 12 月 18 日至 2020 年 9 月 30 日。
- 2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期，截至报告期末本基金的各项投资比例已达到基金合同投资范围中规定的比例。
- 3、自基金合同生效起至本报告期末不满一年。

## 十一 基金的财产

### （一）基金资产总值

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

### （二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### （三）基金财产的账户

基金托管人根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立资金账户、证券账户、期货结算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。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。



## 十二 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、债券、股指期货合约、国债期货合约和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

### （三）估值原则

基金管理人在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，应符合《企业会计准则》、监管部门有关规定。

1、对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会计准则规定的例外情况外，应将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

2、对不存在活跃市场的投资品种，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

3、如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25%以上的，应对估值进行调整并确定公允价值。

### （四）估值方法

#### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

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

（2）交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构

提供的相应品种当日的估值净价进行估值；

(3) 交易所上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价进行估值；

(4) 交易所上市交易的可转换债券，按估值日收盘价减去可转换债券收盘价中所含债券应收利息（税后）后得到的净价进行估值；

(5) 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。交易所市场挂牌转让的资产支持证券，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；

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

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，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) 在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3、全国银行间市场交易品种的估值

(1) 对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种，回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值；

(2) 对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异，未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。

4、同一证券同时在两个或两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。

5、因持有股票而享有的配股权，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。

6、股指期货合约、国债期货合约以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

7、本基金投资存托凭证的估值核算依照境内上市交易的股票执行。

8、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。

9、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。

10、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，按照基金管理人对于基金净值信息的计算结果对外予以公布。

#### （五）估值程序

1、各类基金份额净值是按照每个交易日闭市后，该类基金资产净值除以当日该类基金份额的余额数量计算，各类基金份额净值均精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入。基金管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人于每个交易日计算基金资产净值及各类基金份额净值，并按规定公告。

2、基金管理人应每个交易日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个交易日对基金资产估值后，将各类基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人按约定对外公布。

#### （六）估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当任一类基金份额净值小数点后 4 位以内(含第 4 位)发生估值错误时，视为该类基金份额净值错误。

基金合同的当事人应按照以下约定处理：

##### 1、估值错误类型

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

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

## 2、估值错误处理原则

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

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

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

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

## 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后,有关的当事人应当及时进行处理,处理的程序如下:

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

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

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

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

## 4、基金份额净值估值错误处理的方法如下:

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

(2) 错误偏差达到该类基金份额净值的 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;错误偏差达到该类基金份额净值的 0.5%时,基金管理人应当公告,并报中国证监会备案;

(3) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的,从其规定处理。

## (七) 暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场或外汇市场遇法定节假日或因其他原因暂停

营业时；

2、因不可抗力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确认后，基金管理人应当暂停估值；

4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

#### （八）基金净值的确认

用于基金信息披露的基金资产净值和各类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交易日交易结束后计算当日的基金资产净值和各类基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金净值予以公布。

#### （九）特殊情况的处理

1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 8 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理；

2、由于不可抗力，或证券、期货交易所、登记结算公司发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等非基金管理人与基金托管人原因，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，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

### 十三 基金的收益与分配

#### （一）基金利润的构成

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

#### （二）基金可供分配利润

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

#### （三）基金收益分配原则

- 1、本基金不进行收益分配。
- 2、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在遵守法律法规和监管部门的规定，且在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人履行适当程序后，可对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

如日后本基金根据调整后的收益分配原则进行收益分配的，应当根据基金合同约定进行，每次收益分配比例详见届时基金管理人发布的公告。

#### （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，依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

#### （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相应类别的基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。

## 十四 基金的费用与税收

### （一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的固定管理费；
- 2、基金管理人的业绩报酬；
- 3、基金托管人的托管费；
- 4、本基金从 C 类基金份额的基金财产中计提的销售服务费；
- 5、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；
- 6、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费；
- 7、基金份额持有人大会费用；
- 8、基金的证券/期货交易费用及因基金投资产生的费用等；
- 9、基金的银行汇划费用；
- 10、证券账户开户费用、账户维护费用；
- 11、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、基金管理人的固定管理费

本基金的固定管理费按前一日基金资产净值的 0.80% 年费率计提。固定管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金固定管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金固定管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，支付日期顺延。

#### 2、基金管理人的业绩报酬

##### （1）业绩报酬的计提原则

- 1) 业绩报酬在投资者赎回或基金合同终止情形发生时提取。
- 2) 按基金份额持有人每笔认/申购份额分别计算年化收益率并计提业绩报酬。
- 3) 在赎回时提取业绩报酬的，业绩报酬从赎回款项中扣除；在基金合同终止情形发生时提取业绩报酬的，业绩报酬从清算资金中扣除。

4) 基金份额持有人申请赎回时，按“先进先出”的原则，即按照基金份额持有人认/申购的先后次序进行顺序赎回的方式确定赎回份额，计算、提取赎回份额对应的业绩报酬。

##### （2）业绩报酬的计算方法

每笔基金份额的年化收益率计算方法如下：

$$R = \frac{\text{Nav}_1 - \text{Nav}_0}{\text{Nav}_0^*} \times \frac{365}{D} \times 100\%$$

R 为该笔份额的年化收益率；

Nav<sub>1</sub>为该笔基金份额赎回申请日或基金最后运作日的基金份额累计净值；

Nav<sub>0</sub>为该笔基金份额认/申购申请日的基金份额累计净值；募集期内认购的基金份额，以基金合同生效日为该笔基金份额业绩报酬计提起始日；存续期内申购的基金份额，以申购日为该笔基金份额业绩报酬计提起始日；

Nav<sub>0</sub><sup>\*</sup>为该笔基金份额业绩报酬计提起始日的基金份额净值；

D 为该笔基金份额认/申购申请确认日（含当日，募集期认购的为基金合同生效日，基金合同存续期申购的基金份额为该笔基金份额申购申请确认日）到该笔基金份额赎回申请确认日（不含）或基金最后运作日（含）的天数。

基金管理人每笔基金份额年化收益率 R 超过 8% 的部分，按比例提取业绩报酬，计算方法如下：

年化收益率（R）	计提比例	业绩报酬（H）计算方法
R ≤ 8%	0	H = 0
R > 8%	20%	$H = (R - 8\%) \times 20\% \times \text{Nav}_0^* \times N \times \frac{D}{365}$ 其中： N 为该笔基金份额的基金份额数量。

业绩报酬的计算采用四舍五入的方法保留到小数点后 2 位。

### （3）业绩报酬的支付

在基金份额持有人赎回基金份额或基金合同终止时，基金托管人根据与基金管理人协商一致的方式将赎回款项、终止清算款项划拨给登记机构，由登记机构将对应的业绩报酬支付给基金管理人。业绩报酬由基金管理人负责计算，不需要经过基金托管人复核。因基金管理人计算错误导致的一切法律后果由基金管理人承担，与基金托管人无关。

因法规政策调整而需要修订业绩报酬相关基准比例的，无需召开基金份额持有人大会。

### 3、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 0.20% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，支付日期顺延。



#### 4、C类基金份额的销售服务费

本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金资产净值的0.25%年费率计提。计算方法如下：

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

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日基金资产净值

C类基金份额销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令，再由基金管理人代付给销售机构。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，支付日期顺延。

本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务，基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。

上述“（一）基金费用的种类”中第5—12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，由基金托管人根据基金管理人指令并参照行业惯例从基金财产中支付。

#### （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

本基金支付给基金管理人、基金托管人的各项费用均为含税价格，具体税率适用中国税务主管机关的规定。

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。基金财产投资的相关税收，由基金份额持有人承担，基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

## 十五 基金的会计与审计

### （一）基金会计政策

- 1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；
- 2、基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日；基金首次募集的会计年度按如下原则：如果基金合同生效少于2个月，可以并入下一个会计年度披露；
- 3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
- 4、会计制度执行国家有关会计制度；
- 5、本基金独立建账、独立核算；
- 6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；
- 7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以托管协议约定或双方认可的其他方式确认。

### （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、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按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

## 十六 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》、《流动性风险管理规定》、基金合同及其他有关规定。相应法律法规关于信息披露的规定发生变化时，本基金从其最新规定。

### (二) 信息披露义务人

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

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。如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、基金招募说明书、基金合同、基金托管协议、基金产品资料概要

(1) 基金合同是界定基金合同当事人的各项权利、义务关系，明确基金份额持有人大会召开的规则及具体程序，说明基金产品的特性等涉及基金投资者重大利益的事项的法律文件。

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

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

(4) 基金产品资料概要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。

基金募集申请经中国证监会注册后，基金管理人应当在基金份额发售的三日前，将基金份额发售公告、基金招募说明书提示性公告和基金合同提示性公告登载在指定报刊上，将基金份额发售公告、基金招募说明书、基金产品资料概要、《基金合同》和基金托管协议登载在指定网站上，并将基金产品资料概要登载在基金销售机构网站或营业网点；基金托管人应当同时将基金合同、基金托管协议登载在网站上。

## 2、基金份额发售公告

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

## 3、基金合同生效公告

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

## 4、基金净值信息

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

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，通过其指定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日的各类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各类基金份额净值和基金份额累计净值。

本基金每个开放日披露的各类基金份额净值为未扣除基金管理人业绩报酬前的基金份额净值。投资者实际赎回金额，以登记机构确认数据为准。

## 5、基金份额申购、赎回价格

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

## 6、基金定期报告，包括基金年度报告、基金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，并将中期报告登载在指定网站上，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，为保障其他投资者的权益，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。

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。

基金管理人应当在基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告中，披露业绩报酬收取情况，包括业绩报酬提取的总金额和分层提取比例等。

## 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，予以公告，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) 涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼或仲裁；

(12) 基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其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、业绩报酬、申购费、赎回费、销售服务费等费用计提标准、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) 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；

(22) 基金管理人采用摆动定价机制进行估值；

(23) 本基金调整基金份额类别；

(24) 基金推出新业务或服务；

(25) 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备案，并予以公告。

## 10、资产支持证券的投资情况

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

### 11、投资于股指期货、国债期货的信息

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

### 12、参与融资业务的信息披露

基金管理人应当在季度报告、中期度报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露基金参与融资交易情况，包括投资策略、业务开展情况、损益情况、风险及其管理情况等。

### 13、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披露信息的报刊。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

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

#### （七）信息披露文件的存放与查阅

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于各自住所，供社会公众查阅、复制。

(八) 暂停或延迟披露基金相关信息的情形

- 1、基金投资所涉及的证券、期货交易所或外汇市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 2、因不可抗力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、法律法规规定、中国证监会或基金合同认定的其他情形。



## 十七 基金的风险揭示

本基金的投资风险包括投资组合的风险、管理风险、投资合规性风险、本基金特有的风险和其它风险。

### （一）投资组合的风险

投资组合风险主要包括系统性风险、非系统性风险、流动性风险等。

#### 1、系统性风险

证券市场价格因受各种影响市场整体的因素如经济因素、政治因素、投资心理和交易监管制度等的影响而引起波动，从而导致基金收益水平变化，使本基金资产面临的风险。主要包括：

（1）政策风险：货币政策、财政政策、产业政策等国家宏观经济政策的变化导致证券市场价格波动，影响基金收益而产生风险；

（2）经济周期风险：经济运行具有周期性的特点，证券市场的收益水平受到宏观经济运行状况的影响，也呈现周期性变化，基金投资于债券与上市公司的股票，收益水平也会随之发生变化，从而产生风险；

（3）利率风险：金融市场利率的波动会导致股票市场及债券市场的价格和收益率的变动，同时直接影响企业的融资成本和利润水平。基金投资于股票和债券，收益水平会受到利率变化的影响，从而产生风险；

（4）购买力风险：基金持有人的收益将主要通过现金形式来分配，如果发生通货膨胀，现金的购买力会下降，从而影响基金的实际收益。

#### 2、非系统性风险

非系统性风险是指单个证券特有的风险，包括企业的信用风险、经营风险、财务风险等。上市公司的经营状况受到多种因素影响，如管理能力、财务状况、市场前景、行业竞争能力、技术更新、研究开发、人员素质等，都会导致公司盈利发生变化。如果基金所投资股票和债券的发行人经营不善，导致其股票价格下跌、股息、红利减少，或者存在所投资的企业债券发行人无法按时偿付本息，从而使基金投资收益下降。

#### 3、流动性风险

流动性风险是指因市场交易量不足，导致不能以适当价格及时进行证券交易的风险，或基金无法应付基金赎回支付的要求所引起的违约风险。本基金是开放式基金，基金规模将随着基金投资人对基金份额的申购和赎回而不断变化。基金投资人的连续大量赎回可能使基金资产难以按照预先期望的价格变现，而导致基金的投资组合流动性不足；或者投资组合持有的证券由于外部环境影响或基本面发生重大变化而导致流动性降低，造成基金资产变现的损失，从而产生流动性风险。

##### （1）基金申购、赎回安排

本基金的申购、赎回安排详见本招募说明书“八、基金份额的申购与赎回”章节。

## （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（包括主板、中小板、创业板、科创板以及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、存托凭证、债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、政府支持债券、政府支持机构债、公开发行的次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、可交换债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、衍生工具（股指期货、国债期货等）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金还可以根据相关法律法规的规定参与融资业务。

基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为 60%-95%；每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金基于分散投资的原则，在行业和个券方面未有高度集中的特征，综合评估在正常市场环境下本基金的流动性风险适中。

## （3）巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

为应对巨额赎回情形下可能发生的流动性风险，基金管理人在认为支付投资人的赎回申请困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，可能采取部分延期赎回或者对赎回比例过高的单一投资者延期办理部分赎回申请的流动性风险管理措施，详细规则参见招募说明书第八章第（十一）条的相关约定。

## （4）本基金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

在特殊情形下，基金管理人可能会实施备用流动性风险管理工具，包括但不限于延期办理巨额赎回申请、暂停接受赎回申请、延缓支付赎回款项、暂停基金估值、摆动定价机制以及中国证监会认定的其他措施。如果基金管理人实施备用流动性风险管理工具当中的一种或几种，基金投资人可能会面临赎回效率降低、赎回款延期到账以及暂时无法获取基金净值等风险。提示投资者了解自身的流动性偏好、合理做好投资安排。

## （二）管理风险

基金的管理风险主要包括两个方面：一是在基金管理运作过程中，基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的占有以及对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平。另一方面，基金管理人和基金托管人的管理手段和管理技术等因素的变化也会影响基金收益水平。

基金的管理风险包括以下几种具体风险：

### 1、交易风险

由于交易权限或业务流程设置不当导致交易执行流程不畅通，交易指令的执行产生偏差

或错误；或者由于故意或重大过失未能及时准确执行交易指令，事后也未能及时通知相关人员或部门；或者银行间债券市场交易对手未能履约导致基金利益的直接损失。

## 2、系统故障风险

当计算机系统、通信网络等技术保障系统出现异常情况，可能导致基金日常的申购赎回无法按正常时限完成、注册登记系统瘫痪、核算系统无法按正常时限产生净值、基金的投资交易指令无法及时传输等风险。

## 3、交易结算风险

在基金的投资交易中，因交易的对手方无法履行对一位或多位的交易对手方的支付义务而使得基金在投资交易中蒙受损失的可能性。

## 4、会计核算风险

会计核算风险主要是指由于会计核算及会计管理上违规操作形成的风险或错误，通常是指基金管理人在计算、整理、制证、填单、登账、编表、保管及其相关业务处理中，由于客观原因与非主观故意所造成的行为过失，从而对基金收益造成影响的风险。

### （三）投资合规性风险

投资合规性风险是指因公司及员工违反法律法规、行业准则、职业操守和职业道德而可能引起法律制裁、重大财务损失或者声誉损失的风险，主要合规风险包括如下具体风险：

#### 1、法律风险

法律风险是指基金管理人违反法律法规、基金合同从而给基金份额持有人利益带来损失的风险。

#### 2、道德风险

道德风险是指员工违背职业道德、法规和公司制度，通过内幕信息、利用工作程序中的漏洞或其他不法手段谋取不正当利益所带来的风险。

### （四）本基金特有的风险

本基金在类别资产配置中，可能受到经济周期、市场环境、公司治理、制度建设等因素的不同影响，导致资产配置偏离最优化，这可能为基金投资绩效带来风险。

1、在股票市场投资中，本基金特有的风险来自于以下几个方面：（1）对国家颁布的政策法规研究是否准确深入；（2）对上市公司的研究是否符合市场预期，该类型股票的波动会受到宏观经济环境、行业周期和公司自身经营状况等因素的影响。在研究过程中存在的投资人与上市公司之间的信息不对称问题同样值得关注；（3）在股票投资方面的时间点选择是否恰当，基金经理、交易员在指令的发送时间、交易处理时间都会影响基金的净值情况。因此，本基金整体表现可能在特定时期内低于其他基金。本基金坚持价值和长期投资理念，重视股票投资风险的防范，但是基于投资范围的规定，本基金无法完全规避股票市场和债券市场的下跌风险；（4）本基金对股票市场的筛选与判断是否科学、准确。基本面研究以及定性分析可能都无法使得本基金所选券种符合预期投资目标。

2、在债券投资中，本基金特有的风险主要来自以下几个方面：（1）对宏观经济趋势、政策以及债券市场基本面研究是否准确、深入；（2）对企业类债券的优选和判断是否科学、准确。基本面研究及企业类债券分析的错误均可能导致所选择的证券不能完全符合本基金的预期目标；（3）本基金所投资的企业类债券承载的信用风险要高于高信用等级的债券（如国债），若债券发行人出现违约、不能按时或全额支付本金和利息，将导致基金资产损失，发生信用风险。

### 3、股指期货投资风险

本基金将股指期货纳入到投资范围中，股指期货是一种挂钩股票指数的金融衍生工具，带有一定的投资杠杆，可放大指数的损益；同时，股指期货可进行反向卖空交易。股指期货采用保证金交易制度，由于保证金交易具有杠杆性，当出现不利行情时，微小的变动就可能会使投资人权益遭受较大损失。同时，股指期货采用每日无负债结算制度，如果没有在规定的时间内补足保证金，按规定将被强制平仓，可能给基金净值带来重大损失。因此，其投资风险高于传统证券。本基金将以套期保值为目的，严格遵守法律法规规定和基金合同约定的投资比例，控制股指期货的投资风险。

### 4、国债期货投资风险

国债期货交易采用保证金交易方式，基金资产可能由于无法及时筹措资金满足建立或者维持国债期货头寸所要求的保证金而面临保证金风险。同时，该潜在损失可能成倍放大，具有杠杆性风险。另外，国债期货在对冲市场风险的使用过程中，基金资产可能因为国债期货合约与合约标的价格波动不一致而面临基差风险。

### 5、资产支持证券投资风险

（1）与基础资产相关的风险有信用风险、现金流预测风险和原始权益人的风险等。

1）信用风险是指被购买的基础资产的信用风险将全部从原始权益人处最终转移至资产支持证券持有人，如果借款人的履约意愿下降或履约能力恶化，将可能给资产支持证券持有人带来投资损失。

2）现金流预测风险是指，对基础资产未来现金流的预测可能会出现一定程度的偏差，优先级资产支持证券持有人可能面临现金流预测偏差导致的资产支持证券投资风险。

3）原始权益人的风险，如果原始权益人转让的标的资产项下的债权存在权利瑕疵或转让资产行为不真实，将会导致资产支持证券持有人产生损失。

（2）与资产支持证券相关的风险有市场利率风险、流动性风险、评级风险、提前偿付及延期偿付风险等。

1）市场利率将随宏观经济环境的变化而波动，利率波动可能会影响优先级收益。当市场利率上升时，资产支持证券的相对收益水平就会降低。

2）流动性风险指资产支持证券持有人可能面临无法在合理的时间内以公允价格出售资产支持证券而遭受损失的风险。

3) 评级机构对资产支持证券的评级不是购买、出售或持有资产支持证券的建议, 而仅是对资产支持证券预期收益和/或本金偿付的可能性作出的判断, 不能保证资产支持证券的评级将一直保持在该等级, 评级机构可能会根据未来具体情况撤销资产支持证券的评级或降低资产支持证券的评级。评级机构撤销或降低资产支持证券的评级可能对资产支持证券的价值带来负面影响。

4) 提前偿付及延期偿付风险指, 资产支持证券持有人可能在各档资产支持证券预期到期日之前或之后获得本金及收益偿付, 导致实际投资期限短于或长于资产支持证券预期期限。

## 6、科创板投资风险

本基金可投资于科创板, 所面临的特有风险包括但不限于:

### (1) 流动性风险

科创板投资者门槛较高, 流动性可能弱于 A 股其他板块, 且机构投资者可能在特定阶段对科创板个股形成一致性预期, 存在基金持有股票无法正常成交的风险。

### (2) 退市风险

科创板执行比 A 股其他板块更为严格的退市标准, 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, 可能给基金净值带来不利影响。

### (3) 投资集中风险

因科创板上市企业均为科技创新成长型, 其商业模式、盈利风险、业绩波动等特征较为相似, 基金难以通过分散投资降低投资风险, 若股票价格同向波动, 将引起基金净值波动。

### (4) 投资战配股票风险

战略配售股票在发行时, 明确了一定期限锁定期。该类证券在锁定期内, 流动性较差, 存在市场或个券出现大幅调整时无法及时卖出的风险。

## 7、本基金的认知风险

本基金采用了固定管理费加提取业绩报酬的模式, 这类收费模式与大多数国内市场上现存的固定管理费收取模式不同, 投资者存在对该产品认识不足而导致投资决策不适当的风险。

(1) 本基金对于每份基金份额设置 1 年最短持有期限, 不收取赎回费, 基金份额在最短持有期内不办理赎回及转换转出, 存在无法赎回及转换转出风险;

(2) 本基金最终提取业绩报酬的不确定风险。本基金以逐笔计提的方式计算业绩报酬, 每笔认/申购的基金份额在赎回或者基金合同终止时, 计提的业绩报酬时无法预先确定的, 其结果根据持有期内基金的投资收益而定;

(3) 在基金份额赎回或者基金合同终止时, 若持有期内单笔基金份额的年化收益率未超过 8%, 则该笔基金份额不计提业绩报酬;

(4) 本基金虽然采用了固定管理费加提取业绩报酬的模式, 但这并不代表基金的收益

保证，即在赎回或者基金合同终止时，存在收益率低于 8%甚至为负的可能性；

（5）本基金每个开放日披露的各类基金份额净值为未扣除基金管理人业绩报酬前的基金份额净值。投资者实际赎回金额，以登记机构确认数据为准。

#### （五）投资于存托凭证的风险

本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与存托凭证发行机制相关的风险，包括存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险；存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险；存托协议自动约束存托凭证持有人的风险；因多地上市造成存托凭证价格差异以及波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；存托凭证退市的风险；已在境外上市的基础证券发行人，在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险；境内外法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险。

#### （六）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，可能导致基金资产的损失。金融市场危机、行业竞争、代理商违约、托管行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。

## 十八 基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### （一）基金合同的变更

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

2、关于基金合同变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，自决议生效后两日内在指定媒介公告。

### （二）基金合同的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，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 个工作日内成立基金财产清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

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

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

#### 4、基金财产清算程序：

- （1）基金合同终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；
- （2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- （3）对基金财产进行估值和变现；
- （4）制作清算报告；
- （5）聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- （6）将清算报告报中国证监会备案并公告；
- （7）对基金剩余财产进行分配。

5、基金财产清算的期限为 6 个月，但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的，清算期限相应顺延。

#### （四）清算费用

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

#### （五）基金财产清算剩余资产的分配

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

#### （六）基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经具有证券、期货相关业务资格的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，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。

#### （七）基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。



## 十九 基金合同的内容摘要

(一) 基金管理人、基金托管人和基金份额持有人的权利、义务

### 1、基金管理人的权利

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

- (1) 依法募集资金；
- (2) 自基金合同生效之日起，根据法律法规和基金合同独立运用并管理基金财产；
- (3) 依照基金合同收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- (4) 销售基金份额；
- (5) 按照规定召集基金份额持有人大会；
- (6) 依据基金合同及有关法律规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了基金合同及国家有关法律规规定，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规规定决定基金收益的分配方案；
- (11) 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；
- (12) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- (13) 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、非交易过户、转托管和定期定额投资等业务规则；
- (17) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他权利。

### 2、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) 依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
- (2) 办理基金备案手续；
- (3) 自基金合同生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；

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

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

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

(7) 依法接受基金托管人的监督；

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

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(10) 编制季度报告、中期报告和年度报告；

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

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

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

(14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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

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

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

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

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

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

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

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

为承担责任；

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

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

(25)执行生效的基金份额持有人大会的决议;

(26)建立并保存基金份额持有人名册;

(27)法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

### 3、基金托管人的权利

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,有权呈报中国证监会,并采取必要措施保护基金投资者的利益;

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

(5)提议召开或召集基金份额持有人大会;

(6)在基金管理人更换时,提名新的基金管理人;

(7)法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他权利。

### 4、基金托管人的义务

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、证券账户、期货结算账户等投资所需账户,按照基金合同的约定,根据基金管理人的投资指令,及时办理清算、交割事宜;

(7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露，因向审计、法律等外部专业顾问提供的情况除外；

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

(9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

(10) 对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

(11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；

(12) 从基金管理人或其委托的登记机构处接收基金份额持有人名册；

(13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

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

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

(16) 按照法律法规和基金合同的规定监督基金管理人的投资运作；

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

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

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

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

(21) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(22) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

## 5、基金份额持有人的权利

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基金份额，即成为本基金份额持有人和基金合同的当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为基金合同当事人并不以在基金合同上书面签章或签字为必要条件。

同一类别每份基金份额具有同等的合法权益。

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

(1) 分享基金财产收益；

(2) 参与分配清算后的剩余基金财产；

- (3) 依法转让或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或者召集基金份额持有人大会；
- (5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- (6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- (7) 监督基金管理人的投资运作；
- (8) 对基金管理人、基金托管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他权利。

#### 6、基金份额持有人的义务

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

- (1) 认真阅读并遵守基金合同、招募说明书等信息披露文件；
- (2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；
- (3) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；
- (4) 交纳基金认购、申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用；
- (5) 在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；
- (6) 不从事任何有损基金及其他基金合同当事人合法权益的活动；
- (7) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- (8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
- (9) 遵守基金管理人、销售机构和登记机构的相关交易及业务规则；
- (10) 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。

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同一类别每一基金份额拥有平等的投票权。

本基金未设立基金份额持有人大会的日常机构，如今后设立基金份额持有人大会的日常机构，日常机构的设立按照相关法律法规的要求执行。

#### 1、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，法律法规、中国证监会另有规定或基金合同另有约定的除外：

- 1) 终止基金合同；
- 2) 更换基金管理人；
- 3) 更换基金托管人；
- 4) 转换基金运作方式；

- 5) 调整基金管理人、基金托管人的报酬标准或提高业绩报酬计提基准;
- 6) 变更基金类别;
- 7) 本基金与其他基金的合并;
- 8) 变更基金投资目标、范围或策略;
- 9) 变更基金份额持有人大会程序;
- 10) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会;

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

- 12) 对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项;
- 13) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

(2) 在法律法规规定和基金合同约定的范围内且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下,以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改,不需召开基金份额持有人大会:

- 1) 法律法规要求增加的基金费用的收取;
- 2) 调整本基金的申购费率、调低赎回费率、调低报酬标准或者变更收费方式,或基金管理人、基金托管人主动调低基金固定管理费、基金托管费;
- 3) 因法规政策调整而需要修订业绩报酬相关基准比例;
- 4) 调整基金份额类别的设置;
- 5) 因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改;
- 6) 对基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生重大变化;
- 7) 经中国证监会允许,基金推出新业务或服务;
- 8) 按照法律法规和基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

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

(4) 代表基金份额 10%以上(含 10%)的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会,应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日

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

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

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

### 3、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

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

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

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

### 4、基金份额持有人出席会议的方式

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

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

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

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

(2) 通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式或基金合同约定的其他方式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式或基金合同约定的其他方式进行表决。

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

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。

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

(4) 基金份额持有人授权他人代为出席会议并表决的，授权方式可以采用书面、网络、电话或其他监管机构允许的方式，具体方式在会议通知中列明。

## 5、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 7 条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

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

#### 2) 通讯开会

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

## 6、表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

(1) 一般决议，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过方为有效；除下列第（2）项所规定的须以特别决议通过事

项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

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

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面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。

## 7、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。

## 8、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依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。如果采用通讯方式进行表决,在公告基金份额持有人大会决议时,必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决议。生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。

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

### (三) 基金合同的变更、终止与基金财产的清算

#### 1、基金合同的变更

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

(2) 关于基金合同变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行,自决议生效后两日内在指定媒介公告。

#### 2、基金合同的终止事由

有下列情形之一的,经履行相关程序后,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。

#### 3、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个工作日内成立基金财产清算小组,基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

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

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

(4) 基金财产清算程序:

- 1) 基金合同终止情形出现时, 由基金财产清算小组统一接管基金;
- 2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认;
- 3) 对基金财产进行估值和变现;
- 4) 制作清算报告;
- 5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计, 聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书;
- 6) 将清算报告报中国证监会备案并公告;
- 7) 对基金剩余财产进行分配。

(5) 基金财产清算的期限为 6 个月, 但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的, 清算期限相应顺延。

4、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。

5、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。

6、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具有证券、期货相关业务资格的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, 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。

7、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。

(四) 争议解决方式

各方当事人同意, 因基金合同而产生的或与基金合同有关的一切争议, 如经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, 应提交中国国际经济贸易仲裁委员会按照当时有效的仲裁规则进行仲裁, 仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的, 对仲裁各方当事人均具有约束力。仲裁费和律师费由败诉方承担。

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

基金合同受中国法律管辖。

(五) 基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

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

## 二十 基金托管协议的内容摘要

### （一）托管协议当事人

#### 1、基金管理人（或简称“管理人”）

名称：华泰柏瑞基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层

法定代表人：贾波

成立时间：2004 年 11 月 18 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】178 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：贰亿元人民币

经营范围：发起设立基金、基金管理及中国证监会批准的其他业务

存续期间：持续经营

#### 2、基金托管人（或简称“托管人”）

名称：中国银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：刘连舸

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：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整

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对基金管理人的下列投资运作进行监督：

（1）本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括主板、中小板、创业板、

科创板以及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、存托凭证、债券(包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、政府支持债券、政府支持机构债、公开发行的次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券(含超短期融资券)、可交换债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括定期存款、协议存款、通知存款等)、同业存单、衍生工具(股指期货、国债期货等)以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金还可以根据相关法律法规的规定参与融资业务。

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

基金的投资组合比例为:股票投资占基金资产的比例为 60%-95%;每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如果法律法规对该比例要求有变更的,在履行适当程序后,以变更后的比例为准,本基金的投资比例会做相应调整。

(2) 对基金投融资比例进行监督;

1) 本基金股票资产的投资比例占基金资产的 60%-95%;

2) 本基金每个交易日日终,在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;

3) 本基金持有一家公司发行的证券,其市值不超过基金资产净值的 10%;

4) 本基金持有一家公司发行的科创板股票,其市值不超过基金资产净值的 5%,且不得超过该股票总流通市值的 5%;

5) 本基金管理人管理的且由本基金托管人托管的全部基金持有一家公司发行的证券,不超过该证券的 10%;本基金管理人管理的且由本基金托管人托管的全部开放式基金(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且由本基金托管人托管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%;

6) 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%;

7) 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%;

8) 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%;

9) 本基金管理人管理的且由本基金托管人托管的全部基金投资于同一原始权益人的各

类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

10) 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；

11) 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；

12) 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%；进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

13) 本基金参与股指期货、国债期货交易，应当遵守下列要求：

① 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的 15%；

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

③ 本基金在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过本基金持有的股票总市值的 20%；本基金在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%；

④ 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例为 60%-95%；

⑤ 本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 30%；

14) 本基金可以参与融资业务，在任何交易日日终，本基金持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；

15) 本基金资产总值不得超过基金资产净值的 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本基金资产净值的 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合该比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

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

18) 本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行，与境内上市交易的股票合并计算；

19) 法律法规及中国证监会规定的其他投资比例限制。



除上述第 2)、10)、16)、17) 条外, 因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的, 基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整, 但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的, 从其规定。

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

法律法规或监管部门取消或变更上述限制, 如适用于本基金, 基金管理人在履行适当程序后, 则本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准, 但须提前公告。

(3) 基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券, 或者从事其他重大关联交易的, 应当符合基金的投资目标和投资策略, 遵循基金份额持有人利益优先原则, 防范利益冲突, 建立健全内部审批机制和评估机制, 按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意, 并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议, 并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

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、各类基金份额净值计算、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上述约定, 应及时提示基金管理人, 基金管理人收到提示后应及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函并改正。在限期内, 基金托管人有权随时对提示事项进行复查。基金管理人对基金托管人提示的违规事项未能在限期内纠正的, 基金托管人应及时向中国证监会报告。

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

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, 提供相关数据资料和制度等。

### (三) 基金管理人对于基金托管人的业务核查

1、在本协议的有效期限内, 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本协议的情况进行必

要的核查，核查事项包括但不限于基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户等投资所需账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和各类基金份额净值、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》及本协议有关规定时，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正，基金托管人收到通知后应及时核对并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）基金财产的保管

##### 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》及本协议另有规定，不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。
- （3）基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户等投资所需账户。
- （4）基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，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宣布停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定的，由基金管理人在法定期限内聘请具有从事相关业务资格的会计师事务所对基金进行验资，并出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的2名以上（含2名）中国注册会计师签字方为有效。

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

（3）若基金募集期限届满，未能达到《基金合同》备案的条件，由基金管理人按规定办理退款等事宜，基金托管人应提供协助。

##### 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

基金管理人以基金名义在基金托管人认可的存款银行的指定营业网点开立存款账户，基金托管人负责该账户银行预留印鉴的保管和使用。在上述账户开立和账户相关信息变更过程中，基金管理人应提前向基金托管人提供开户或账户变更所需的相关资料。

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

#### 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；由基金管理人负责向中国人民银行报备，在上述手续办理完毕之后，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。

#### 7、其他账户的开设和管理

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

#### 8、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。

#### 9、与基金财产有关的重大合同及有关凭证的保管

基金托管人按照法律法规保管由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同及有关凭证。基金管理人代表基金签署有关重大合同后应在收到合同正本后 30 日内将一份正本的原件提交给基金托管人。除本协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时应当保证基金一方持有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。重大合同由基金管理人与基金托管人按规定各自保管至少 15 年，法律法规或监管规则另有规定的，从其规定。

对于无法取得两份以上的正本的，基金管理人应向基金托管人提供加盖公章的合同复印件，并确保复印件与原件一致。未经双方协商或未在合同约定范围内，合同原件不得转移。

#### （五）基金资产净值计算和会计核算

##### 1、基金资产净值的计算和复核

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

（2）基金管理人应每个交易日对基金财产估值，但基金管理人根据法律法规或基金合同的规定暂停估值时除外。估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算业务指引》及其他法律法规的规定。基金资产净值和各类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交易日结束后计算得出当日的各类基金份额净值，并在盖章后以双方约定的方式发送给基金托管人。基金托管人应对净值计算结果进行复核，并以双方约定的方式将复核结果传送给基金管理人，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

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

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

（5）当基金资产的估值导致任一类基金份额净值小数点后四位内（含第四位）发生差错时，视为该类基金份额净值估值错误。当基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当计价错误达到该类基金份额净值的 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；当计价错误达到该类基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应当在报中国证监会备案的同时并及时进行公告。如法律法规或监管机关对前述内容另有规定的，按其规定处理。

（6）由于基金管理人对外公布的任何基金净值数据错误，导致该基金财产或基金份额持有人的实际损失，基金管理人应对此承担责任。若基金托管人计算的净值数据正确，则基金托管人对该损失不承担责任；若基金托管人计算的净值数据也不正确，则基金托管人也应承担部分未正确履行复核义务的责任。如果上述错误造成了基金财产或基金份额持有人的不

当得利，且基金管理人及基金托管人已各自承担了赔偿责任，则基金管理人应负责向不当得利之主体主张返还不当得利。如果返还金额不足以弥补基金管理人和基金托管人已承担的赔偿金额，则双方按照各自赔偿金额的比例对返还金额进行分配。

(7) 由于证券交易所、期货交易所、登记结算公司、第三方估值机构发送的数据错误，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免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

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

## 2、基金会计核算

### (1) 基金账册的建立

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

### (2) 会计数据和财务指标的核对

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

### (3) 基金财务报表和定期报告的编制和复核

基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。月度报表的编制，应于每月终了后 5 个工作日内完成；季度报告应在每个季度结束之日起 10 个工作日内编制完毕并于每个季度结束之日起 15 个工作日内予以公告；中期报告在会计年度半年终了后 40 日内编制完毕并于会计年度半年终了后 2 个月内予以公告；年度报告在会计年度结束后 60 日内编制完毕并于会计年度终了后 3 个月内予以公告。基金合同生效不足两个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。

基金托管人在复核过程中，发现双方的报表存在不符时，基金管理人和基金托管人应共同查明原因，进行调整，调整以双方认可的账务处理方式为准；若双方无法达成一致以基金管理人的账务处理为准。核对无误后，基金托管人在基金管理人提供的报告上加盖托管业务部门公章或者出具加盖托管业务部门公章的复核意见书，双方各自留存一份。如果基金管理人与基金托管人不能于应当发布公告之日之前就相关报表达成一致，基金管理人有权按照其编制的报表对外发布公告，基金托管人有权就相关情况报中国证监会备案。

### (六) 基金份额持有人名册的保管

基金份额持有人名册至少应包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。基金份额持有人名册由基金登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，基金管理人和基金托管人应分别保管基金份额持有人名册，基金登记机构保存期不少于 20 年，法律法规另有规定或有权机关另有要求的除外。如不能妥善保管，则按相关法规承担责任。

在基金托管人要求或编制中期报告和年报前，基金管理人应将有关资料送交基金托管人，不得无故拒绝或延误提供，并保证其的真实性、准确性和完整性。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。

#### （七）适用法律与争议解决方式

1、本协议适用中华人民共和国法律（为本协议之目的，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区法律）并从其解释。

2、基金管理人与基金托管人之间因本协议产生的或与本协议有关的争议可通过友好协商解决。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。仲裁费和律师费由败诉方承担。

3、除争议所涉的内容之外，本协议的当事人仍应履行本协议的其他规定。

#### （八）基金托管协议的变更、终止与基金财产的清算

##### 1、托管协议的变更

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

##### 2、托管协议的终止

发生以下情况，本托管协议应当终止：

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

##### 3、基金财产的清算

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

## 二十一 对基金份额持有人的服务

对基金份额持有人的服务主要由基金管理人、发售机构及销售机构提供，以下是基金管理人提供的主要服务内容。基金管理人根据基金份额持有人的需要和市场的变化，有权在符合法律法规的前提下，增加和修改相关服务项目。如因系统、第三方或不可抗力等原因，导致下述服务无法提供，基金管理人不承担任何责任。

### 一、网上开户及交易服务

机构投资者可通过基金管理人直销柜台，个人投资者可通过基金管理人网站或 APP 客户端办理开户、认购/申购、赎回及信息查询等业务。有关基金管理人电子直销具体规则请参见基金管理人网站相关公告和业务规则。

### 二、账户及信息查询服务

机构投资者通过基金管理人网站，个人投资者通过基金管理人网站、微信公众号或 APP 客户端，可享受基金交易查询、账户查询和基金管理人依法披露的各类基金信息等服务，包括基金产品基本信息（包括基金名称、管理人名称、基金代码、风险等级、持有份额、单位净值等）、基金的法律文件、基金公告、定期报告和基金管理人最新动态等各类资料。

### 三、账单及资讯服务

#### （一）对账单服务

基金管理人通过电子邮件形式向投资者定期发送交易电子邮件对账单（包括基金名称、基金代码、持有份额等基金保有情况信息），电子邮件地址不详及退订的除外。

#### （二）资讯服务

投资者知悉并同意基金管理人不定期通过电话、短信、邮件、微信等方式提供与投资者相关的账户服务通知、交易确认通知、重要公告通知、活动消息、营销信息等资讯服务。如需取消相应资讯服务，可按照相关指引退订，或通过基金管理人客户服务中心热线 400-888-0001、在线客服等人工服务方式退订。

### 四、客户服务中心电话及在线服务

#### （一）电话服务

投资人拨打基金管理人客户服务中心热线 400-888-0001 可享受如下服务：

1、自助语音服务（7×24 小时）：提供基金净值信息、账户信息等自助查询服务。

2、人工服务：提供交易日上午 9：00—11：30 下午 13：00—17：30 的人工服务。投资人可以通过该热线获得业务咨询、信息查询、服务投诉及建议、信息定制等专项服务。

## （二）在线服务

投资人通过基金管理人网站、微信公众号或 APP 客户端提供交易日上午 9：00—11：30 下午 13：00—17：30 的在线服务人工服务。投资人可通过该方式获得业务咨询、信息查询、服务投诉及建议、信息定制等专项服务。

## 五、投诉及建议受理服务

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

## 六、联系基金管理人

1、网址：[www.huatai-pb.com](http://www.huatai-pb.com)

2、客服邮箱：[cs4008880001@huatai-pb.com](mailto:cs4008880001@huatai-pb.com)

3、客服热线：400—888—0001（免长途话费），或 021-38784638

4、传真：021-50103016

5、联系地址：中国（上海）自由贸易试验区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层

七、如本招募说明书存在任何您/贵机构无法理解的内容，请及时通过上述方式联系基金管理人。请确保投资前，您/贵机构已经全面理解本招募说明书，并同意全部内容。



## 二十二 其他应披露事项

本基金及基金管理人的有关公告（自 2019 年 12 月 18 日至 2020 年 10 月 31 日），下列公告在指定媒介披露：

公告内容	披露时间
华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加北京恒天明泽基金销售有限公司为旗下华泰柏瑞景气回报一年持有期混合型证券投资基金代销机构同时开通基金定投业务的通知	2020-10-29
华泰柏瑞基金管理有限公司旗下部分基金季度报告提示性公告	2020-10-28
华泰柏瑞景气回报一年持有期混合型证券投资基金 2020 年第 3 季度报告	2020-10-28
华泰柏瑞景气回报一年持有期混合型证券投资基金 2020 年中期报告	2020-08-29
华泰柏瑞景气回报一年持有期混合型证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要（更新）	2020-08-28
华泰柏瑞基金管理有限公司旗下部分基金季度报告提示性公告	2020-07-21
华泰柏瑞景气回报一年持有期混合型证券投资基金 2020 年第 2 季度报告	2020-07-21
关于华泰柏瑞景气回报一年持有期混合型证券投资基金规模控制的公告	2020-07-13
华泰柏瑞基金管理有限公司关于参加交通银行手机银行渠道申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	2020-06-30
华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金获配非公开发行的公告	2020-05-21
华泰柏瑞基金管理有限公司旗下部分基金季度报告提示性公告	2020-04-20
华泰柏瑞景气回报一年持有期混合型证券投资基金 2020 年第 1 季度报告	2020-04-20
华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参加上海基煜基金销售有限公司费率优惠活动的公告	2020-04-07
华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国人寿保险股份有限公司费率优惠活动的公告	2020-04-01
华泰柏瑞关于旗下基金持有停牌证券估值调整的提示性公告	2020-03-19
华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金参加中国国际期货有限公司费率优惠活动的公告	2020-03-18
华泰柏瑞基金管理有限公司关于调整旗下基金最低申购金额、最低赎回份额和最低持有份额的公告	2020-03-09
华泰柏瑞景气回报基金开放日常申购（赎回、转换、定期定额投资）业务公告	2020-03-05
华泰柏瑞基金行业高级管理人员变更公告	2020-02-14
华泰柏瑞基金管理有限公司关于参加交通银行手机银行渠道申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	2019-12-31
华泰柏瑞景气回报一年持有期混合型证券投资基金基金合同生效公告	2019-12-19

华泰柏瑞景气回报一年持有期混合型证券投资基金基金合同	2019-11-22
华泰柏瑞景气回报一年持有期混合型证券投资基金招募说明书	2019-11-22
华泰柏瑞景气回报一年持有期混合型证券投资基金托管协议	2019-11-22
华泰柏瑞景气回报一年持有期混合型证券投资基金份额发售公告	2019-11-22
华泰柏瑞景气回报一年持有期混合型证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告	2019-11-22

### 二十三 招募说明书存放及查阅方式

本招募说明书存放在基金管理人、基金托管人及基金代销机构住所，投资者可在营业时间内免费查阅，也可按工本费购买复印件。基金管理人和基金托管人保证其所提供的文本的内容与所公告的内容完全一致。

#### 二十四 备查文件

- (一) 在中国证监会注册华泰柏瑞景气回报一年持有期混合型证券投资基金募集的文件；
- (二) 《华泰柏瑞景气回报一年持有期混合型证券投资基金基金合同》；
- (三) 《华泰柏瑞景气回报一年持有期混合型证券投资基金托管协议》；
- (四) 法律意见书；
- (五) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (六) 基金托管人业务资格批件、营业执照；
- (七) 中国证监会要求的其他文件。

备查文件存放地点为基金管理人、基金托管人的住所；投资者如需了解详细的信息，可在营业时间前往相应场所免费查阅，也可按工本费购买复印件。

华泰柏瑞基金管理有限公司

二〇二〇年十二月二十五日