



前海开源基金  
First Seafront Fund

前海开源事件驱动灵活配置

混合型发起式

证券投资基金招募说明书

(20210312 更新)

基金管理人：前海开源基金管理有限公司

基金托管人：上海银行股份有限公司

## 重要提示

本基金经 2013 年 11 月 04 日中国证券监督管理委员会下发的证监许可[2013]1399 号文准予注册募集，基金合同已于 2013 年 12 月 19 日正式生效。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。中国证监会对本基金募集的准予注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

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，投资人在投资本基金前，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，包括但不限于：市场风险、流动性风险、管理风险、操作或技术风险、大额赎回风险、顺延或暂停赎回风险、本基金特有风险、本法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险及其他风险等。

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

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行承担。投资有风险，投资人在投资本基金前应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同、基金产品资料概要等信息披露文件。

本招募说明书已经本基金托管人复核（不属于基金托管人法定复核责任范围且其不掌握相关信息的内容除外），有关财务数据和净值表现截止日为 2020 年 12 月 31 日（未经审计）。

## 目 录

一、绪言	1
二、释义	2
三、基金管理人	6
四、基金托管人	15
五、相关服务机构	19
六、基金的募集	40
七、基金合同的生效	41
八、基金份额的申购与赎回	42
九、基金的投资	50
十、基金的财产	63
十一、基金资产的估值	64
十二、基金的收益分配	68
十三、基金的费用与税收	69
十四、基金的会计与审计	71
十五、基金的信息披露	72
十六、风险揭示	77
十七、基金的终止与清算	81
十八、基金合同的内容摘要	83
十九、基金托管协议的内容摘要	104
二十、对基金份额持有人的服务	119
二十一、其他应披露事项	121
二十二、招募说明书的存放及查阅方式	123
二十三、备查文件	124

## 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》”）等有关法律法规的规定，以及《前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称基金合同）的约定编写。

本招募说明书阐述了前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”或“基金”）的投资目标、策略、风险、费率等与投资人的投资决策有关的必要事项，投资人在做出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

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

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

本招募说明书关于基金产品资料概要的编制、披露及更新等内容，将不晚于 2020 年 9 月 1 日起执行。

## 二、释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

- 1、基金或本基金：指前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金
- 2、基金管理人：指前海开源基金管理有限公司
- 3、基金托管人：指上海银行股份有限公司
- 4、基金合同或本基金合同：指《前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充
- 5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
- 6、招募说明书：指《前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书》及其更新
- 7、基金份额发售公告：指《前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金基金份额发售公告》
- 8、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
- 9、《基金法》：指2003年10月28日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，自2004年6月1日起实施，并经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》修改的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 10、《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
- 11、《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日起实施的《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
- 12、《运作办法》：指中国证监会2014年7月7日颁布、同年8月8日起实施的《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
- 13、《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日起施行的《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
- 14、中国证监会：指中国证券监督管理委员会
- 15、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会

16、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

17、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

18、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

19、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

20、投资人：指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称

21、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

22、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、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务

23、销售机构：指前海开源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代理协议，代为办理基金销售业务的机构

24、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

25、登记机构：指办理登记业务的机构。基金的登记机构为前海开源基金管理有限公司或接受前海开源基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构

26、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

27、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买卖基金的基金份额变动及结余情况的账户

28、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

29、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

30、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

31、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

32、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

- 33、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
- 34、T+n日：指自T日起第n个工作日(不包含T日)
- 35、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
- 36、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
- 37、《业务规则》：指《前海开源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
- 38、认购：指在基金募集期内，投资人申请购买基金份额的行为
- 39、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
- 40、赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为
- 41、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
- 42、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
- 43、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基金申购申请的一种投资方式
- 44、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%
- 45、元：指人民币元
- 46、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
- 47、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
- 48、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值
- 49、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
- 50、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

51、基金份额的类别：本基金根据销售服务费及赎回费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别：A类基金份额和C类基金份额。两类基金份额分设不同的基金代码，并分别公布基金份额净值

52、A类基金份额：指不从基金资产中计提销售服务费的基金份额

53、C类基金份额：指从基金资产中计提销售服务费的基金份额

54、销售服务费：指本基金用于持续销售和服务基金份额持有人的费用，该笔费用从基金财产中计提，属于基金的营运费用

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、不可抗力：指本合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

57、发起资金：指基金管理人的公司股东资金、公司固有资金、公司高级管理人员或基金经理等人员的资金。发起资金认购本基金的金额不低于1000万元，且发起资金认购的基金份额持有期限不低于三年

58、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

59、基金产品资料概要：指《前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金基金产品资料概要》及其更新（基金合同关于基金产品资料概要的编制、披露及更新等内容，将不晚于2020年9月1日起执行）

### 三、基金管理人

#### （一）基金管理人概况

- 1、名称：前海开源基金管理有限公司
- 2、住所：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）
- 3、设立日期：2013年1月23日
- 4、法定代表人：王兆华
- 5、批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监许可[2012]1751号
- 6、组织形式：有限责任公司
- 7、办公地址：深圳市福田区深南大道7006号万科富春东方大厦22楼
- 8、电话：0755-88601888 传真：0755-83181169
- 9、联系人：傅成斌
- 10、注册资本：人民币2亿元
- 11、存续期限：持续经营
- 12、股权结构：开源证券股份有限公司出资25%，北京市中盛金期投资管理有限公司出资25%，北京长和世纪资产管理有限公司出资25%，深圳市和合投信资产管理合伙企业（有限合伙）出资25%。

#### （二）主要人员情况

##### 1、基金管理人董事会成员

王兆华先生，董事长，本科学历，国籍：中国。历任中国人民银行西安市分行职员，中国工商银行西安市开发区支行副行长、分行信贷处处长，华夏证券西安营业部总经理、华夏证券济南管理总部党委书记兼总经理、华夏证券总裁助理兼重庆分公司党委书记、总经理，华夏证券总裁助理，开源证券董事长兼总经理，现任前海开源基金管理有限公司董事长。

龚方雄先生，荣誉董事长，宾夕法尼亚大学沃顿商学院金融经济学博士。国籍：中国香港。历任美国联邦储备银行经济学家，美国银行首席策略师、全球货币及利率市场策略部联席主管，摩根大通中国区研究部主管、首席策略师、首席大中华区经济学家、中国综合公司（企业）投融资主席，现任前海开源基金管理有限公司荣誉董事长。

王宏远先生，联席董事长，西安交通大学经济学硕士，美国哥伦比亚大学公共管理硕士，国籍：中国。历任深圳特区证券有限公司研究员，南方基金管理有限公司基金经理、投资总监、副总经理，中信证券股份有限公司首席投资官、执行总经理（ED）、交易与衍生产品业务部行政负责人。现任前海开源基金管理有限公司联席董事长。

蔡颖女士，副董事长，硕士研究生，国籍：中国。历任南方证券广州分公司营业部电脑部主管、经纪业务部主管、电子商务部副经理，南方基金管理有限公司广州代表处首席代表、南方区域总部高级经理，鹏华基金管理有限公司华南营销中心（广州）副总经理、广州分公司总经理，曾任前海开源基金管理有限公司总经理、前海开源资产管理有限公司董事长。现任前海开源基金管理有限公司副董事长。

周芊先生，董事，北京大学 DBA，国籍：中国。历任中信证券股份有限公司董事总经理、中信证券产品委员会委员、中信金石不动产基金管理有限公司经理，信保股权投资基金董事、全国工商联商业地产专家委员会委员、中房协养老地产专委会副主任委员。现任北京中联合国新投资基金管理有限公司董事长。

范镭先生，董事，本科学历，国籍：中国。历任中国建设银行武汉分行、华安保险北京分公司、交通银行天津分行、北京长和世纪资产管理有限公司投资总监。

秦亚峰先生，董事、执委会委员、分管投资研究交易及公募 REITs 业务的高级管理人员、固定收益投资决策委员会主席。清华大学硕士，中国社科院博士，国籍：中国。历任中国银行湖南分行信托咨询公司技术员，中国东方信托湖南证券营业部部门经理，银河证券湖南证券营业部部门经理，亚洲证券湖南证券营业部部门经理，华安财产保险股份有限公司资产管理中心副总经理、总经理，华安财产保险股份有限公司副总经理，华安财保资产管理有限责任公司总经理，华安汇富资本投资管理有限公司董事长，现任前海开源基金管理有限公司董事、固定收益投资决策委员会主席。

贾红波先生，董事、总经理、执委会委员。硕士研究生，国籍：中国。曾任职中国银行营业部、人力资源部、中国银行办公室高级经理、办公室董事长秘书；中国证监会办公厅秘书处处长；中国证券投资基金业协会秘书长、党委委员；同时兼任中国天使投资联席会荣誉秘书长；中国光大银行资产管理部副总经理；北京龙萨资本投资管理中心（有限合伙）总经理。现任前海开源基金管理有限公司总经理。

周新生先生，独立董事，中国工业经济学会副会长，管理学博士学位，经济学教授。国籍：中国。历任陕西财经学院助教、讲师、副教授、教授、工业经济系副主任、研究生部主任、MBA 中心主任、院长助理；曾任陕西省审计厅副厅长、长安银行监事长、民建陕西省委员会副主委；曾任第十二届全国政协委员。

樊臻宏先生，独立董事，国籍：中国。纽约大学 STERN 商学院商业管理博士学位。历任 ARGONAUT 资本管理公司（对冲基金）分析员、美林证券全球科技策略师、中国人寿资产管理公司国际业务部副总经理及项目部副总经理、北京春湖投资顾问有限公司总经理，天津汇通太和投资管理有限公司总经理。

Terence Culver 先生，独立董事，硕士学历。国籍：美国。历任哈佛大学国际发展研究所项目经理，联合国 GeSCI 组织全球新兴市场政府顾问及开发专家，哥伦比亚大学国际

和公共事务学院副院长等职务，现任美国数字金融集团—DFG Fund 首席执行官、普通合伙人。

Samuel T. Lundquist 先生，独立董事，本科学历。国籍：美国。在美国宾夕法尼亚大学沃顿商学院先后工作 25 年，现任宾夕法尼亚大学沃顿商学院对外事务副院长。

## 2、基金管理人监事会成员

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

陆琦先生，监事，理学学士和工学硕士学位。国籍：中国。历任穆迪信息咨询有限公司研发工程师，项目研发组组长，南方基金风险管理部，2015 年 10 月加入前海开源基金，担任金融工程部总监。

傅智先生，监事，本科学历，注册会计师。国籍：中国。历任天健信德会计师事务所审计员、南方基金管理有限公司运作保障部总监助理、副总监、执行总监，现任前海开源基金管理有限公司基金核算部总监。

曾媛媛女士，经济学硕士。国籍：中国。曾任博时基金管理有限公司交易员。2014 年 4 月加入前海开源基金管理有限公司，现任交易部总监。

汤力女士，硕士研究生。国籍：中国。历任中青国际出版集团法务部主任，汤森路透法律集团产品培训师，英大基金管理有限公司监察稽核部高级经理。2013 年 11 月起加入前海开源基金管理有限公司，现担任监察稽核部副总监。

## 3、高级管理人员情况

王兆华先生，董事长，本科学历，国籍：中国。历任中国人民银行西安市分行职员，中国工商银行西安市开发区支行副行长、分行信贷处处长，华夏证券西安营业部总经理、华夏证券济南管理总部党委书记兼总经理、华夏证券总裁助理兼重庆分公司党委书记、总经理，华夏证券总裁助理，开源证券董事长兼总经理，现任前海开源基金管理有限公司董事长。

贾红波先生，董事、总经理、执委会委员。硕士研究生，国籍：中国。历任中国银行营业部、人力资源部、中国银行办公室高级经理、办公室董事长秘书；中国证监会办公厅秘书处处长；中国证券投资基金业协会秘书长、党委委员；同时兼任中国天使投资联合会荣誉秘书长；中国光大银行资产管理部副总经理；北京龙萨资本投资管理中心（有限合伙）总经理。现任前海开源基金管理有限公司总经理。

何隽先生，执委会委员、首席信息官、首席运营官、轮值首席执行官。硕士研究生。国籍：中国。历任国信证券信息技术部经理，汉唐证券红岭中路营业部副总经理、深圳、东莞银证通负责人，华泰联合证券部门总经理，华林证券总裁助理。2016 年 6 月加入前海开

源基金管理有限公司，现担任前海开源基金管理有限公司首席信息官、首席运营官、执委会轮值首席执行官。

傅成斌先生，督察长、执委会委员。硕士研究生，国籍：中国。历任中国建设银行深圳分行科技部软件开发工程师，南方基金管理有限公司信息技术部总监助理、监察稽核部副总监、执行总监。现任前海开源基金管理有限公司督察长、前海开源资产管理有限公司董事。

秦亚峰先生，董事、执委会委员、分管投资研究交易及公募 REITs 业务的高级管理人员、固定收益投资决策委员会主席。清华大学硕士，中国社科院博士，国籍：中国。历任中国银行湖南分行信托咨询公司技术员，中国东方信托湖南证券营业部部门经理，银河证券湖南证券营业部部门经理，亚洲证券湖南证券营业部部门经理，华安财产保险股份有限公司资产管理中心副总经理、总经理，华安财产保险股份有限公司副总经理，华安财保资产管理有限责任公司总经理，华安汇富资本投资管理有限公司董事长，现任前海开源基金管理有限公司董事、固定收益投资决策委员会主席。

#### 4、本基金基金经理

本基金历任基金经理为：唐文杰先生，管理时间为 2013 年 12 月 19 日至 2015 年 1 月 15 日、王霞女士，管理时间为 2014 年 12 月 25 日至今。

王霞女士，中国国籍，北京交通大学经济学硕士，中国注册会计师(CPA)。历任南方基金管理有限公司商业、旅游、贸易行业研究员、房地产行业首席研究员、金融地产组组长。现任前海开源基金管理有限公司执行投资总监。2014 年 6 月 17 日至 2017 年 8 月 30 日，任前海开源沪深 300 指数型证券投资基金基金经理、2014 年 12 月 25 日至今，任前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理、2017 年 3 月 21 日至 201 年 5 月 15 日，任前海开源盈鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理、2017 年 3 月 23 日至今，任前海开源沪港深裕鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理、2018 年 3 月 6 日至 2021 年 2 月 23 日，任前海开源中国成长灵活配置混合型证券投资基金基金经理、2020 年 7 月 20 日至今，任前海开源沪港深非周期性行业股票型证券投资基金基金经理、2020 年 7 月 23 日至今，任前海开源港股通股息率 50 强股票型证券投资基金基金经理。王霞女士具备基金从业资格。

#### 5、投资决策委员会成员情况

投资决策委员会名单如下：曲扬、邱杰、吴国清、王霞、谢屹、杨德龙、肖立强。曲扬为投资决策委员会主席，邱杰为投资决策委员会联席主席，肖立强为投资决策委员会秘书。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

### （三）基金管理人的职责

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

#### **（四）基金管理人的承诺**

1、基金管理人承诺不从事违反《证券法》、《基金法》、《销售办法》、《运作办法》、《信息披露办法》等法律法规的行为，并承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违法行为的发生。

2、基金管理人的禁止行为：

- （1）将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
- （2）不公平地对待公司管理的不同基金财产；
- （3）利用基金财产或职务之便为基金份额持有人以外的人牟取利益；
- （4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- （5）侵占、挪用基金财产；
- （6）泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
- （7）玩忽职守，不按照规定履行职责；
- （8）法律法规以及中国证监会禁止的其他行为。

3、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）违反法律法规、基金合同或托管协议；
- （3）故意损害基金份额持有人或基金合同其他当事人的合法权益；
- （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) 泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
- (8) 违反证券交易所业务规则，利用对敲、倒仓等非法手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；
- (9) 贬损同行，以提高自己；
- (10) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
- (11) 以不正当手段谋求业务发展；
- (12) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；
- (13) 其他法律、行政法规禁止的行为。

#### 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) 不得利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者谋取利益；
- (3) 不泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
- (4) 不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

为保证公司规范化运作，有效地防范和化解经营风险，促进公司诚信、合法、有效经营，保障基金份额持有人利益，维护公司及公司股东的合法权益，本基金管理人建立了科学、严密、高效的内部控制体系。

##### 1、内部控制的总体目标

- (1) 保证公司经营运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念。
- (2) 防范和化解经营风险，提高经营管理效益，确保经营业务的稳健运行和受托资产的安全完整，实现公司的持续、稳定、健康发展。
- (3) 确保基金、公司财务和其他信息真实、准确、完整、及时。
- (4) 促进公司全体员工恪守职业操守，正直诚信，廉洁自律，勤勉尽责。

##### 2、制订内部控制制度应当遵循以下原则：

- (1) 健全性原则。内部控制应当包括公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员，并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个环节。

(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。公司各机构、部门和岗位职责应当保持相对独立，公司基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离。

(4) 相互制约原则。公司内部部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡。

(5) 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。

(6) 适时性原则。内部控制应具有前瞻性，并且必须随着公司经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律法规、政策制度等外部环境的改变及时进行相应的修改和完善。

### 3、内部控制体系

#### (1) 内部控制制度体系

公司制定了合理、完备、有效并易于执行的制度体系。公司制度体系由不同层面的制度构成。按照其效力大小分为四个层面：第一个层面是公司内部控制大纲，它是公司制定各项规章制度的纲要和总揽；第二个层面是公司基本管理制度，包括风险控制制度、投资管理制度、基金会计制度、信息披露制度、监察稽核制度、信息技术管理制度、公司财务制度、资料档案制度、业绩评估考核制度和紧急应变制度；第三个层面是部门业务规章，是在基本管理制度的基础上，对各部门的主要职责、岗位设置、岗位职责、操作守则等的具体说明；第四个层面是业务操作手册，是各项具体业务和管理工作的运行办法，是对业务各个细节、流程进行的描述和约束。它们的制订、修改、实施、废止应该遵循相应的程序，每一层面的内容不得与其以上层面的内容相违背。公司重视对制度的持续检验，结合业务的发展、法规及监管环境的变化以及公司风险控制的要求，不断检讨和增强公司制度的完备性、有效性。

#### (2) 内部控制组织架构

##### 1) 董事会

负责制定公司的风险管理政策，对风险管理负完全的和最终的责任。

##### 2) 监察及风险控制委员会

作为董事会下的专业委员会之一，监察及风险控制委员会负责批准公司风险管理系统文件，即负责确保每一个部门都有合适的系统来识别、评定和监控该部门的风险，负责批准每一个部门的风险级别。负责解决重大的突发的风险。

##### 3) 督察长

独立行使督察权利，直接对董事会负责；按季向监察及风险控制委员会提交风险管理报告和风险管理建议。

##### 4) 监察稽核部

监察稽核部负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理系统的发展提供协助，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标，负责建立和完善公司投资风险管理制度与流程。

#### 5) 风险合规本部风险管理团队

风险合规本部风险管理团队负责公司投资管理风险、信用风险、市场风险等日常风险管理工作，组织实施公司投资风险管理与绩效分析工作，确保公司各类投资风险得到良好监督与控制。

#### 6) 业务部门

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

### 4、内部控制措施

#### （1）授权制度

公司的授权制度贯穿于整个公司活动。股东会、董事会、监事会和管理层必须充分履行各自的职权，健全公司逐级授权制度，确保公司各项规章制度的贯彻执行；各项经营业务和管理程序必须遵从管理层制定的操作规程，经办人员的每一项工作必须是在业务授权范围内进行。公司重大业务的授权必须采取书面形式，授权书应当明确授权内容和时效。公司授权要适当，对已获授权的部门和人员应建立有效的评价和反馈机制，对已不适用的授权应及时修改或取消授权。

#### （2）公司研究业务

研究工作应保持独立、客观，不受任何部门及个人的不正当影响；建立严密的研究工作业务流程，形成科学、有效的研究方法；建立投资产品备选库制度，研究部门根据投资产品的特征，在充分研究的基础上建立和维护备选库。建立研究与投资的业务交流制度，保持畅通的交流渠道；建立研究报告质量评价体系，不断提高研究水平。

#### （3）基金投资业务

基金投资应确立科学的投资理念，根据决策的风险防范原则和效率性原则制定合理的决策程序；在进行投资时应有明确的投资授权制度，并应建立与所授权限相应的约束制度和考核制度。建立严格的投资禁止和投资限制制度，保证基金投资的合法合规性。建立投资风险评估与管理制度，将重点投资限制在规定的风险权限额度内；对于投资结果建立科学的投资管理业绩评价体系。

#### （4）交易业务

建立集中交易制度，投资指令通过交易部完成；建立交易监测系统、预警系统和交易反馈系统，完善相关的安全设施；交易部应对交易指令进行审核，建立公平的交易分配制

度，确保各基金利益的公平；交易记录应完善，并及时进行反馈、核对和存档保管；同时建立科学的投资交易绩效评价体系。

#### （5）基金会计核算

公司根据法律法规及业务的要求建立会计制度，并根据风险控制点建立严密的会计系统，对于不同基金、不同客户独立建账，独立核算；公司通过复核制度、凭证制度、合理的估值方法和估值程序等会计措施真实、完整、及时地记载每一笔业务并正确进行会计核算和业务核算。同时还建立会计档案保管制度，确保档案真实完整。

#### （6）信息披露

公司建立了完善的信息披露制度，保证公开披露的信息真实、准确、完整。公司设立了信息披露负责人，并建立了相应的程序进行信息的收集、组织、审核和发布工作，以此加强对信息的审查核对，使所公布的信息符合法律法规的规定，同时加强对信息披露的检查和评价，对存在的问题及时提出改进办法。

#### （7）监察稽核

公司设立督察长，经董事会聘任，报中国证监会核准。根据公司监察稽核工作的需要和董事会授权，督察长可以列席公司相关会议，调阅公司相关档案，就内部控制制度的执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能。督察长定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况，董事会对督察长的报告进行审议。

公司设立监察稽核部开展监察稽核工作，并保证监察稽核部的独立性和权威性。公司明确了监察稽核部及内部各岗位的具体职责，严格制订了专业任职条件、操作程序和组织纪律。

监察稽核部强化内部检查制度，通过定期或不定期检查内部控制制度的执行情况，促使公司各项经营管理活动的规范运行。

公司董事会和管理层充分重视和支持监察稽核工作，对违反法律法规和公司内部控制制度的，追究有关部门和人员的责任。

### 5、基金管理人关于内部合规控制书的声明

（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）基金管理人承诺以上关于内部控制的披露真实、准确；

（3）基金管理人承诺根据市场变化和公司发展不断完善内部控制体系和内部控制制度。

## 四、基金托管人

### （一）基金托管人情况

#### 1、基本情况

名称：上海银行股份有限公司（以下简称“上海银行”）

住所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 168 号

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 168 号

法定代表人：金煜

成立时间：1995 年 12 月 29 日

组织形式：股份有限公司（中外合资、上市）

注册资本：人民币 142.065287 亿元

存续期间：持续经营

基金托管业务批准文号：中国证监会 证监许可[2009]814 号

托管部门联系人：周直毅

电话：021-68475608

传真：021-68476936

上海银行成立于 1995 年 12 月 29 日，是一家由国有股份、中资法人股份、外资股份及个人股份共同组成的股份制商业银行，总行位于上海，是上海证券交易所主板上市公司，股票代码 601229。

上海银行以“精品银行”为战略愿景，以“精诚至上，信义立行”为核心价值观，近年来通过推进专业化经营和精细化管理，着力为企业客户提供集普惠金融、供应链金融、科创金融、民生金融、跨境金融、投资银行、金融市场交易等全方位的综合金融服务，为个人客户提供消费金融、财富管理、养老金融、信用卡等线上线下融合的金融服务。近年来，本公司把握金融科技趋势，推动科技赋能客户体验优化、产品服务升级、服务渠道拓展、风控能力提升等，不断满足企业和个人客户日趋多样化的金融服务需求。

上海银行目前在上海、北京、深圳、天津、成都、宁波、南京、杭州、苏州、无锡、绍兴、南通、常州、盐城等城市设立分支机构，形成长三角、环渤海、珠三角和中西部重点城市的布局框架；发起设立四家村镇银行、上银基金管理有限公司、上海尚诚消费金融股份有限公司，设立上海银行（香港）有限公司和上银国际有限公司，并与全球 120 多个国家和地区近 1500 多家境内外银行及其分支机构建立了代理行关系。

上海银行自成立以来市场影响力不断提升。被中国银行业协会授予城商行工作“卓越贡献奖”。被中国企业联合会、中国企业家协会评为 2019 年中国企业 500 强第 219 名、2019 年中国服务业企业 500 强第 85 名。被证券时报授予 2019 中国城商行资产管理品牌“君鼎奖”。在英国《银行家》杂志 2019 年度发布的“全球银行 1000 强”榜单中，按照

一级资本排名，上海银行位居第 68 位，较上一年度上升 8 位。近年来，上海银行在该榜单中排名连年提升。国际评级机构穆迪投资者服务公司授予上海银行的长期发行人和长期存款评级从“Baa3”上调至“Baa2”，短期发行人和短期存款评级从“Prime-3”上调至“Prime-2”，评级展望稳定。反映出上海银行资本实力不断增强，盈利能力稳步提高，资产质量同业领先。

截至 2020 年 6 月末，上海银行资产总额 23,882.29 亿元，较上年末增长 6.76%，存款总额（不含应计利息）为 12,841.08 亿元，较上年末增长 8.27%；客户贷款和垫款总额为 10,288.65 亿元，较上年末增长 5.80%；拨备覆盖率 330.61%，较上年末下降 6.54 个百分点。

## 2、主要人员情况

上海银行总行下设资产托管部，是从事资产托管业务的职能部门，内设托管产品部、托管运作部、行管运作部、稽核监督部、系统管理部，平均年龄 30 岁左右，100%员工拥有大学本科以上学历，业务岗位人员均具有基金从业资格。

## 3、基金托管业务经营情况

上海银行于 2009 年 8 月 18 日获得中国证监会、中国银监会核准开办证券投资基金托管业务，批准文号：中国证监会证监许可[2009]814 号。

截至 2020 年 9 月末，上海银行已托管 62 只证券投资基金，分别为天治新消费灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛稳健增利债券型证券投资基金（LOF）、中证财通中国可持续发展 100（ECPI ESG）指数增强型证券投资基金、鹏华双债增利债券型证券投资基金、浦银安盛季季添利定期开放债券型证券投资基金、鹏华双债保利债券型证券投资基金、前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金、万家现金宝货币市场证券投资基金、中银安心回报半年定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛月月盈定期支付债券型证券投资基金、华安添颐混合型发起式证券投资基金、万家瑞丰灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞兴灵活配置混合型证券投资基金基金、博时裕荣纯债债券型证券投资基金、浙商惠盈纯债债券型证券投资基金、兴业福益债券型证券投资基金、大成慧成货币市场证券投资基金、嘉实稳瑞纯债债券型证券投资基金、嘉实稳祥纯债债券型证券投资基金、博时裕弘纯债债券型证券投资基金、万家瑞富灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞尧灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞舜灵活配置混合型证券投资基金、永赢荣益债券型证券投资基金、长江可转债债券型证券投资基金、建信中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金、国融融信消费严选混合型证券投资基金、博时悦楚纯债债券型证券投资基金、平安惠聚纯债债券型证券投资基金、大成中债 1-3 年国开行债券指数增强型证券投资基金、蜂巢添幂中短债债券型证券投资基金、博时富进纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、广发景富纯债债券型证券投资基金、富国汇远纯债三年定期开放债券型证券投资基金、兴业中证银行 50 金融债指数证券投资基金、融通增润三个月定期开放债券型发起

式证券投资基金、中欧同益一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰盛合三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、博时富洋纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、长城泰利纯债债券型证券投资基金、国金惠安利率债债券型证券投资基金、银华中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城泰申回报混合型证券投资基金、南方宁利一年定期开放债券型发起式证券投资基金、博时稳悦 63 个月定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛盛晖一年定期开放债券型发起式证券投资基金、汇添富鑫福债券型证券投资基金、国泰聚瑞纯债债券型证券投资基金、东方臻慧纯债债券型证券投资基金、平安合庆 1 年定期开放债券型发起式证券投资基金、广发中债 3-5 年政策性金融债指数证券投资基金、长信中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、博时鑫荣稳健混合型证券投资基金、惠升和悦债券型证券投资基金、新疆前海联合泓旭纯债 1 年定期开放债券型发起式证券投资基金、易方达恒智 63 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国投瑞银顺荣 39 个月定期开放债券型证券投资基金、国泰上证综合交易型开放式指数证券投资基金、诺德安瑞 39 个月定期开放债券型证券投资基金、国联安增盛一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、建信食品饮料行业股票型证券投资基金和浙商惠隆 39 个月定期开放债券型证券投资基金，资产净值合计 1477.58 亿元。

## （二）基金托管人的内部控制制度

### 1、内部控制目标

严格遵守国家有关法律法规、行业监管规章和本行有关规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金资产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

### 2、内部控制组织结构

上海银行基金托管业务内部风险控制组织结构是由总行风险管理部门和资产托管部共同组成。托管业务风险控制纳入全行的风险管理体系；资产托管部配备专职人员负责托管业务内控稽核工作，各业务部室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

### 3、内部控制的原则

（1）全面性原则：监督制约必须渗透到托管业务的全过程和各个操作环节，覆盖到资产托管部所有的部室、岗位和人员。

（2）独立性原则：资产托管部内设独立的稽核监督团队，保持高度的独立性和权威性，负责对托管业务风险控制工作进行指导和监督。

（3）相互制约原则：各业务部室在内部组织结构上形成相互制约，建立不同岗位之间的制衡体系。

（4）审慎性原则：内控与风险管理必须以防范风险、审慎经营为前提，保证托管资产的安全与完整；托管业务经营管理必须按照“内控优先”的原则，在新设机构或新增业务时，做到先期完成相关制度建设。

(5) 有效性原则：内部控制体系应与所处的环境相适应，以合理的成本实现内控目标，内部制度的制订应当具有前瞻性，并应当根据国家政策、法律及经营管理的需要，适时进行相应修改和完善；内部控制应当具有高度的权威性，任何人不得拥有不受内部控制约束的权力，内部控制存在的问题应当能够得到及时反馈和纠正。

#### 4、内部控制制度及措施

(1) 建立明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度。

(2) 建立托管业务前后台分离，不同岗位相互牵制的管理结构。

(3) 专门的稽核监督人员组织各业务部室进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施。

(4) 托管业务操作间实施门禁管理和音像监控。

(5) 定期开展业务与职业道德培训，使员工树立风险防范与控制理念，并签订承诺书。

(6) 制定完备的应急预案，并组织员工定期演练；建立异地灾备，保证业务连续不中断。

#### (三) 基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

基金托管人负有对基金管理人的投资运作行使监督权的职责。根据《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定，托管人对基金的投资对象和范围、投资组合比例、投资限制、费用的计提和支付方式、基金会计核算、基金资产估值和基金净值的计算、收益分配、申购赎回以及其他有关基金投资和运作的事项，对基金管理人进行业务监督、核查。

基金托管人发现基金管理人违反法律法规和基金合同的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金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，基金托管人应报告中国证监会。

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

基金托管人发现基金管理人的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。

基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。

## 五、相关服务机构

### （一）基金份额销售机构

#### 1、直销机构

##### （1）前海开源基金管理有限公司直销柜台

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市福田区深南大道7006号万科富春东方大厦10层

法定代表人：王兆华

联系人：何凌

电话：（0755）83181190

传真：（0755）83180622

##### （2）前海开源基金管理有限公司电子直销交易

客服电话：4001-666-998

网址：www.qhkyfund.com

微信公众号：qhkyfund

#### 2、代销机构：

序号	代销机构	销售机构信息
1	深圳市前海排排网基金销售有限责任公司	深圳市前海排排网基金销售有限责任公司 注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司） 办公地址：深圳市福田区福强路4001号深圳市世纪工艺品文化市场313栋E-403 法定代表人：李春瑜 客服电话：400-680-3928 网址：www.simuwang.com
2	万家财富基金销售（天津）有限公司	万家财富基金销售（天津）有限公司 注册地址：天津自贸区（中心商务区）迎宾大道1988号滨海浙商大厦公寓2-2413室 法定代表人：李修辞 客服电话：010-59013825 网址：www.wanjiawealth.com
3	喜鹊财富基金销售有限公司	喜鹊财富基金销售有限公司 注册地址：西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦1513室 法定代表人：陈皓 客服电话：0891-6177483 网址：www.xiquefund.com
4	南京苏宁基金销售有限公司	南京苏宁基金销售有限公司 注册地址：南京市玄武区苏宁大道1-5号 办公地址：江苏省南京市玄武区苏宁大道1-5号 法定代表人：王锋

		<p>客服电话：95177 网址：www.snjijin.com</p>
5	大河财富基金销售有限公司	<p>大河财富基金销售有限公司 注册地址：贵州省贵阳市南明区新华路110-134号富中国际广场1栋20层1.2号 法定代表人：王荻 客服电话：0851-88235678 网址：www.urainf.com</p>
6	嘉实财富管理有限公司	<p>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53层5312-15单元 法定代表人：赵学军 客服电话：400-021-8850 网址：www.harvestwm.cn</p>
7	北京唐鼎耀华基金销售有限公司	<p>北京唐鼎耀华基金销售有限公司 注册地址：北京市延庆区延庆经济开发区百泉街10号2栋236室 法定代表人：张冠宇 传真：9,01059200800 客服电话：400-819-9868 网址：www.tdyhfund.com</p>
8	海银基金销售有限公司	<p>海银基金销售有限公司 注册地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路8号402室 法定代表人：惠晓川 联系人：毛林 客服电话：400-808-1016 网址：www.fundhaiyin.com</p>
9	北京坤元基金销售有限公司	<p>北京坤元基金销售有限公司 注册地址：北京市东城区建国门内大街8号B座501 法定代表人：李雪松 联系人：王玲玲 客服电话：400-818-5585 网址：www.kunyuanfund.com</p>
10	和耕传承基金销售有限公司	<p>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)东风南路东康宁街北6号楼5楼503 法定代表人：王璇 客服电话：4000-555-671 网址：www.hgccpb.com</p>
11	北京富国大通基金销售有限公司	<p>北京富国大通基金销售有限公司 注册地址：北京市朝阳区安定路5号院3号楼中建财富国际中心25层 法定代表人：许家宝 客服电话：400-088-0088 网址：www.fuguowealth.com</p>
12	民商基金销售（上海）有限公司	<p>民商基金销售（上海）有限公司 注册地址：上海市黄浦区北京东路666号H区(东座)6楼A31室</p>

		<p>法定代表人：贾惠琴          客服电话：021-50206003          网址：www.msftec.com</p>
13	江苏汇林保大基金销售有限公司	<p>江苏汇林保大基金销售有限公司          注册地址：南京市高淳区经济开发区古檀大道 47 号          办公地址：江苏省南京市鼓楼区中山北路 105 号中环国际 1413 室          法定代表人：吴言林          联系人：黄子珈          客服电话：025-66046166          网址：www.huilinbd.com</p>
14	腾安基金销售（深圳）有限公司	<p>腾安基金销售（深圳）有限公司          注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）          办公地址：深圳市南山区海天二路 33 号腾讯滨海大厦 15 楼          法定代表人：刘明军          联系人：马梓轩          传真：9,86013399          客服电话：95017（拨通后转 1 再转 8）          网址：www.tenganxinxi.com；www.txfund.com.</p>
15	阳光人寿保险股份有限公司	<p>阳光人寿保险股份有限公司          注册地址：海南省三亚市迎宾路 360-1 号三亚阳光金融广场 16 层          办公地址：北京市朝阳区朝阳门外大街乙 12 号院 1 号昆泰国际大厦 12 层          法定代表人：李科          传真：9,01059053700          客服电话：95510          网址：www.sinosig.com</p>
16	上海凯石财富基金销售有限公司	<p>上海凯石财富基金销售有限公司          办公地址：上海市黄浦区延安东路 1 号凯石大厦 4 楼          法定代表人：陈继武          联系人：高皓辉          客服电话：4006-433-389          网址：www.vstonewealth.com</p>
17	北京格上富信基金销售有限公司	<p>北京格上富信基金销售有限公司          注册地址：北京市朝阳区东三环北路 19 号楼 701 内 09 室          法定代表人：叶精一          客服电话：400-066-8586          网址：www.igesafe.com</p>
18	上海挖财基金销售有限公司	<p>上海挖财基金销售有限公司          注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 楼 01、02、03 室          法定代表人：冷飞          客服电话：021-50810673          网址：www.wacaijin.com</p>
19	中衍期货有限公司	中衍期货有限公司

		注册地址：北京市朝阳区东四环中路 82 号金长安大厦 B 座 7 层 法定代表人：马宏波 客服电话：4006881117 网址：www.cdfco.com.cn
20	济安财富（北京）基金销售有限公司	济安财富（北京）基金销售有限公司 注册地址：北京市朝阳区东三环中路 7 号北京财富中心 A 座 46 层 法定代表人：杨健 客服电话：400-673-7010 网址：www.jianfortune.com
21	联储证券有限责任公司	联储证券有限责任公司 注册地址：深圳市福田区福田街道岗厦社区深南大道南侧金地中心大厦 9 楼 法定代表人：吕春卫 客服电话：400-620-6868 网址：www.lczq.com
22	乾道盈泰基金销售（北京）有限公司	乾道盈泰基金销售（北京）有限公司 注册地址：北京市西城区德胜门外大街合生财富广场 1302 室 法定代表人：董云巍 客服电话：400-088-8080 网址：www.qiandaojr.com
23	上海万得基金销售有限公司	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：王廷富 客服电话：400-821-0203 网址：www.520fund.com.cn
24	凤凰金信（银川）基金销售有限公司	凤凰金信（银川）基金销售有限公司 注册地址：宁夏银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路 142 号 14 层 1402 办公用房 办公地址：北京市朝阳区紫月路 18 号院 朝来高科技产业园 18 号楼 法定代表人：张旭 客服电话：400-8105-919 网址：www.fengfd.com
25	北京植信基金销售有限公司	北京植信基金销售有限公司 注册地址：北京市密云区兴盛南路 8 号院 2 号楼 106 室-67 法定代表人：于龙 客服电话：4006-802-123 网址：www.zhixin-inv.com
26	上海有鱼基金销售有限公司	上海有鱼基金销售有限公司 注册地址：上海自由贸易试验区浦东大道 2123 号 3 层 3E-2655 室 法定代表人：林琼

		<p>客服电话：4007676298 网址：www.youyufund.com</p>
27	北京懒猫基金销售有限公司	<p>北京懒猫基金销售有限公司 注册地址：北京市石景山区金府路32号院3号楼9层940室 办公地址：北京市石景山区金府路32号院3号楼9层940室 法定代表人：赵劲松 客服电话：85965586 网址：www.lanmao.com</p>
28	大连网金基金销售有限公司	<p>大连网金基金销售有限公司 注册地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路22号诺德大厦2层202室 法定代表人：樊怀东 客服电话：4000-899-100 网址：www.yibaijin.com</p>
29	上海大智慧基金销售有限公司	<p>上海大智慧基金销售有限公司 注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102单元 法定代表人：申健 客服电话：021-20292031 网址：www.gw.com.cn</p>
30	北京恒天明泽基金销售有限公司	<p>北京恒天明泽基金销售有限公司 注册地址：北京市延庆区延庆经济开发区百泉街10号2栋883室 办公地址：北京市朝阳区东三环中路20号乐成中心A座23层 法定代表人：梁越 客服电话：400-188-8848 网址：www.chtfund.com</p>
31	深圳富济基金销售有限公司	<p>深圳富济基金销售有限公司 注册地址：深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路3088号中洲大厦3203A单元 办公地址：深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路3088号中洲大厦3203A单元 法定代表人：刘鹏宇 客服电话：0755-83999907 网址：www.jinqianwo.cn</p>
32	上海陆金所基金销售有限公司	<p>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 客服电话：4008219031 网址：www.lufunds.com</p>
33	北京虹点基金销售有限公司	<p>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</p>

		层 222 单元 法定代表人：郑毓栋 客服电话：400-068-1176 网址：www.jimufund.com
34	厦门市鑫鼎盛控股有限公司	厦门市鑫鼎盛控股有限公司 注册地址：福建省厦门市思明区鹭江道 2 号厦门第一广场西座 1501-1504 室 法定代表人：陈洪生 客服电话：400-918-0808 网址：www.xds.com.cn
35	北京蛋卷基金销售有限公司	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 222507 法定代表人：钟斐斐 客服电话：400-0618-518 网址：www.danjuanapp.com
36	奕丰基金销售有限公司	奕丰基金销售有限公司 注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入住深圳市前海商务秘书有限公司） 办公地址：深圳市南山区海德三道航天科技广场 A 座 17 楼 1704 室 法定代表人：TEO WEE HOWE 联系人：叶健 客服电话：400-684-0500 网址：www.ifastps.com.cn
37	宜信普泽（北京）基金销售有限公司	宜信普泽（北京）基金销售有限公司 注册地址：北京市朝阳区建国路 88 号楼 soho 现代城 C 座 18 层 1809 法定代表人：戎兵 客服电话：400-609-9200 网址：www.yixinfund.com
38	蚂蚁（杭州）基金销售有限公司	蚂蚁（杭州）基金销售有限公司 注册地址：浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路 969 号 3 幢 5 层 599 室 法定代表人：祖国明 客服电话：4000-766-123 网址：www.fund123.cn
39	国海证券股份有限公司	国海证券股份有限公司 注册地址：广西壮族自治区桂林市辅星路 13 号 法定代表人：何春梅 客服电话：95563 网址：www.ghzq.com.cn
40	北京中期时代基金销售有限公司	北京中期时代基金销售有限公司 注册地址：北京市朝阳区建国门外光华路 14 号 1 幢 11 层 1103 号 法定代表人：田宏莉 客服电话：010-65807609 网址：www.cifcofund.com
41	华安证券股份有限公司	华安证券股份有限公司

	公司	注册地址：合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号 办公地址：合肥市蜀山区南二环路 959 号财智中心华安证券 B1 座 0327 室 法定代表人：章宏韬 客服电话：95318 网址：www.hazq.com
42	渤海证券股份有限公司	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 法定代表人：王春峰 客服电话：400-651-5988 网址：www.ewww.com.cn
43	华龙证券股份有限公司	华龙证券股份有限公司 注册地址：兰州市城关区东岗西路 638 号财富大厦 法定代表人：陈牧原 客服电话：400-689-8888 网址：www.hlzq.com
44	长城证券股份有限公司	长城证券股份有限公司 注册地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 16、17 层 法定代表人：黄耀华 客服电话：400-666-6888 网址：www.cgws.com
45	东方财富证券股份有限公司	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 客服电话：95357 网址：www.18.cn
46	大通证券股份有限公司	大通证券股份有限公司 注册地址：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：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 客服电话：4008-169-169 网址：www.daton.com.cn
47	西南证券股份有限公司	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 法定代表人：吴坚 客服电话：95355；4008096096 网址：www.swsc.com.cn
48	天风证券股份有限公司	天风证券股份有限公司 注册地址：湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路 2 号高科大厦 4 楼 法定代表人：余磊 客服电话：400-800-5000

		网址: <a href="http://www.tfzq.com">www.tfzq.com</a>
49	中信证券华南股份有限公司	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 客服电话: 95396 网址: <a href="http://www.gzs.com.cn">www.gzs.com.cn</a>
50	东海证券股份有限公司	东海证券股份有限公司 注册地址: 江苏省常州延陵西路23号投资广场18层 办公地址: 上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦 法定代表人: 钱俊文 客服电话: 95531; 400-8888-588 网址: <a href="http://www.longone.com.cn">www.longone.com.cn</a>
51	英大证券有限责任公司	英大证券有限责任公司 注册地址: 深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层 法定代表人: 吴骏 客服电话: 400-018-8688 网址: <a href="http://www.ydsc.com.cn">www.ydsc.com.cn</a>
52	深圳腾元基金销售有限公司	深圳腾元基金销售有限公司 注册地址: 深圳市福田区福田街道岗厦社区彩田路2009号瀚森大厦10层6A 办公地址: 深圳市福田区金田路2028号卓越世纪中心1号楼1806-1808单元 法定代表人: 杨启香 客服电话: 400-990-8600 网址: <a href="http://www.tenyuanfund.com">www.tenyuanfund.com</a>
53	上海联泰基金销售有限公司	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号楼3层 法定代表人: 尹彬彬 客服电话: 4000-466-788 网址: <a href="http://www.66zichan.com">www.66zichan.com</a>
54	北京增财基金销售有限公司	北京增财基金销售有限公司 注册地址: 北京市西城区南礼士路66号1号楼12层1208号 法定代表人: 罗细安 客服电话: 400-001-8811 网址: <a href="http://www.zcvc.com.cn">www.zcvc.com.cn</a>
55	中信期货有限公司	中信期货有限公司 注册地址: 深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座13层1301-1305室、14层 法定代表人: 张皓 客服电话: 400-990-8826 网址: <a href="http://www.citicsf.com">www.citicsf.com</a>

56	北京微动利基金销售有限公司	北京微动利基金销售有限公司 注册地址：北京市石景山区古城西路 113 号景山财富中心 341 办公地址：北京市石景山区古城西路 113 号景山财富中心 341 法定代表人：梁洪军 客服电话：4008-196-665 网址：www.buyforyou.com.cn
57	深圳市华融金融服务有限公司	深圳市华融金融服务有限公司 注册地址：深圳市福田区滨河路 5022 号联合广场 A 座裙楼 A302 法定代表人：喻天柱 客服电话：400-600-0583 网址：www.hrjijin.com
58	上海基煜基金销售有限公司	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潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室(上海泰和经济发展区) 法定代表人：王翔 客服电话：021-65370077 网址：www.fofund.com.cn
59	信达证券股份有限公司	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 法定代表人：张志刚 客服电话：95321 网址：www.cindasc.com
60	华鑫证券有限责任公司	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 法定代表人：俞洋 客服电话：95323；4001-099-918 网址：www.cfsc.com.cn
61	中山证券有限责任公司	中山证券有限责任公司 注册地址：深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼 7 层、8 层 办公地址：深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼 7 层、8 层 法定代表人：林炳城 客服电话：95329 网址：www.zszq.com
62	方正证券股份有限公司	方正证券股份有限公司 注册地址：长沙市天心区湘江中路二段 36 号华远华中心 4、5 号楼 3701-3717 法定代表人：施华 客服电话：95571 网址：www.foundersc.com
63	北京展恒基金销售股份有限公司	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 法定代表人：闫振杰 客服电话：400-818-8000

		网址: <a href="http://www.myfund.com">www.myfund.com</a>
64	中邮证券有限责任公司	中邮证券有限责任公司 注册地址: 陕西省西安市唐延路 5 号(陕西邮政信息大厦 9-11 层) 办公地址: 西安市高新区唐延路 5 号陕西邮政大厦 9-11 层 法定代表人: 丁奇文 客服电话: 4008-888-005 网址: <a href="http://www.cnpsec.com.cn">www.cnpsec.com.cn</a>
65	上海汇付基金销售有限公司	上海汇付基金销售有限公司 注册地址: 办公上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼 法定代表人: 张晶 客服电话: 400-820-2819 网址: <a href="http://www.chinapnr.com">www.chinapnr.com</a>
66	深圳市新兰德证券投资咨询有限公司	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 法定代表人: 洪弘 客服电话: 400-166-1188 网址: <a href="http://www.jrj.com.cn">www.jrj.com.cn</a>
67	北京钱景基金销售有限公司	北京钱景基金销售有限公司 注册地址: 北京市海淀区中关村东路 18 号 1 号楼 11 层 B-1108 办公地址: 北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012 法定代表人: 赵荣春 客服电话: 400-893-6885 网址: <a href="http://www.qianjing.com">www.qianjing.com</a>
68	珠海盈米基金销售有限公司	珠海盈米基金销售有限公司 注册地址: 珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491 法定代表人: 肖雯 客服电话: 020-89629066 网址: <a href="http://www.yingmi.cn">www.yingmi.cn</a>
69	中国邮政储蓄银行股份有限公司	中国邮政储蓄银行股份有限公司 注册地址: 北京市西城区宣武门西大街 131 号 法定代表人: 张金良 客服电话: 95580 网址: <a href="http://www.psbc.com">www.psbc.com</a>
70	上海利得基金销售有限公司	上海利得基金销售有限公司 注册地址: 上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室 法定代表人: 李兴春 客服电话: 400-921-7755 网址: <a href="http://www.leadbank.com.cn">www.leadbank.com.cn</a>
71	平安银行股份有限公司	平安银行股份有限公司 注册地址: 广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号 法定代表人: 谢永林 客服电话: 95511-3 网址: <a href="http://bank.pingan.com">bank.pingan.com</a>

72	北京广源达信基金销售有限公司	北京广源达信基金销售有限公司 注册地址：北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座六层 605 室 法定代表人：齐剑辉 客服电话：400-623-6060 网址：www.niuniufund.com
73	申万宏源证券有限公司	申万宏源证券有限公司 注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 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（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室 法定代表人：杨玉成 客服电话：95523；4008-895-523 网址：www.swhysc.com
74	安信证券股份有限公司	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 楼、28 层 A02 单元 法定代表人：黄炎勋 客服电话：4008-001-001 网址：www.essence.com.cn
75	山西证券股份有限公司	山西证券股份有限公司 注册地址：山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼 法定代表人：侯巍 客服电话：400-666-1618；95573 网址：www.i618.com.cn
76	浦领基金销售有限公司	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：北京市朝阳区望京中航资本大厦 10 层 法定代表人：聂婉君 客服电话：400-876-9988 网址：www.zscffund.com
77	招商证券股份有限公司	招商证券股份有限公司 注册地址：深圳市福田区福田街道福华一路 111 号 办公地址：广东省深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层 法定代表人：霍达 客服电话：95565 网址：www.newone.com.cn
78	长江证券股份有限公司	长江证券股份有限公司 注册地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦 法定代表人：李新华 客服电话：95579 网址：www.95579.com
79	国金证券股份有限公司	国金证券股份有限公司 注册地址：四川省成都市东城根上街 95 号 法定代表人：冉云 客服电话：95310

		网址: <a href="http://www.gjzq.com.cn">www.gjzq.com.cn</a>
80	北京新浪仓石基金销售有限公司	北京新浪仓石基金销售有限公司 注册地址: 北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2 地块新浪总部科研楼 5 层 518 室 法定代表人: 赵芯蕊 客服电话: 010-62675369 网址: <a href="http://www.xincai.com">www.xincai.com</a>
81	北京加和基金销售有限公司	北京加和基金销售有限公司 注册地址: 北京市西城区金融大街 11 号 7 层 703 室 法定代表人: 曲阳 客服电话: 400-803-1188 网址: <a href="http://www.bzfunds.com">www.bzfunds.com</a>
82	武汉市伯嘉基金销售有限公司	武汉市伯嘉基金销售有限公司 注册地址: 湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际 SOHO 城(一期)第 7 栋 23 层 1 号、4 号 法定代表人: 陶捷 客服电话: 027-87006003 网址: <a href="http://www.buyfunds.cn">www.buyfunds.cn</a>
83	深圳市金斧子基金销售有限公司	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 客服电话: 400-930-0660 网址: <a href="http://www.jfzinv.com">www.jfzinv.com</a>
84	北京汇成基金销售有限公司	北京汇成基金销售有限公司 注册地址: 北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108 室 办公地址: 北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108 室 法定代表人: 王伟刚 客服电话: 400-619-9059 网址: <a href="http://www.hcjin.com">www.hcjin.com</a>
85	广发证券股份有限公司	广发证券股份有限公司 注册地址: 广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街 2 号 618 室 办公地址: 广州市天河北路 183 号大都会广场 5、18、19、36、38、39、41-43 楼 法定代表人: 孙树明 客服电话: 95575 网址: <a href="http://www.gf.com.cn">www.gf.com.cn</a>
86	华融证券股份有限公司	华融证券股份有限公司 注册地址: 北京市西城区金融大街 8 号 法定代表人: 祝献忠 客服电话: 400-898-9999 网址: <a href="http://www.hrsec.com.cn">www.hrsec.com.cn</a>
87	中泰证券股份有限公司	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

		<p>法定代表人：李玮          客服电话：95538          网址：www.zts.com.cn</p>
88	东方证券股份有限公司	<p>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22层、23层、25层-29层          法定代表人：潘鑫军          客服电话：95503          网址：www.dfzq.com.cn</p>
89	中国民族证券有限责任公司	<p>中国民族证券有限责任公司          注册地址：北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼          法定代表人：姜志军          客服电话：4008-895-618          网址：www.e5618.com</p>
90	开源证券股份有限公司	<p>开源证券股份有限公司          注册地址：西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层          法定代表人：李刚          客服电话：400-860-8866          网址：www.kysec.cn</p>
91	光大证券股份有限公司	<p>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          法定代表人：薛峰          客服电话：95525          网址：www.ebscn.com</p>
92	交通银行股份有限公司	<p>交通银行股份有限公司          注册地址：中国(上海)自由贸易试验区银城中路188号          办公地址：上海市浦东新区银城中路188号          法定代表人：任德奇          客服电话：95559          网址：www.bankcomm.com</p>
93	中国银河证券股份有限公司	<p>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          法定代表人：陈共炎          客服电话：4008-888-888          网址：www.chinastock.com.cn</p>
94	上海银行股份有限公司	<p>上海银行股份有限公司          注册地址：上海市银城中路168号          法定代表人：金煜          客服电话：95594          网址：www.bosc.cn</p>
95	中信建投证券股份有限公司	<p>中信建投证券股份有限公司          注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼          法定代表人：王常青          客服电话：4008-888-108          网址：www.csc108.com</p>
96	中国中金财富证券有限公司	<p>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6003号荣超商务中心A栋第04、18层至21层</p>

		<p>法定代表人：高涛          客服电话：95532；4006-008-008          网址：www.china-invs.cn</p>
97	中信证券股份有限公司	<p>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：北京朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦          法定代表人：张佑君          客服电话：95548          网址：www.cs.ecitic.com</p>
98	申万宏源西部证券有限公司	<p>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358号大成国际大厦20楼2005室          法定代表人：许建平          客服电话：400-800-0562          网址：www.hysec.com</p>
99	海通证券股份有限公司	<p>海通证券股份有限公司          注册地址：上海市广东路689号          办公地址：上海市广东路689号          法定代表人：周杰          客服电话：95553          网址：www.htsec.com</p>
100	中信证券（山东）有限责任公司	<p>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1号楼2001          办公地址：青岛市市南区东海西路28号龙翔广场东座5层          法定代表人：姜晓林          客服电话：95548          网址：www.zxwt.com.cn</p>
101	中国国际金融股份有限公司	<p>中国国际金融股份有限公司          注册地址：北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27、28层          法定代表人：丁学东          客服电话：400-910-1166          网址：www.cicc.com.cn</p>
102	中国农业银行股份有限公司	<p>中国农业银行股份有限公司          注册地址：北京市东城区建国门内大街69号          法定代表人：周慕冰          客服电话：95599          网址：www.abchina.com</p>
103	中国国际期货有限公司	<p>中国国际期货有限公司          注册地址：北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢6层609号、610号          办公地址：北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢1层、2层、9层、11层、12层          法定代表人：王兵          客服电话：95162          网址：www.cifco.net</p>
104	东莞证券股份有限公司	<p>东莞证券股份有限公司</p>

	公司	注册地址：广东省东莞市莞城区可园南路一号金源中心 法定代表人：陈照星 客服电话：0769-961130 网址：www.dgzq.com.cn
105	浙江同花顺基金销售有限公司	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1号903室 法定代表人：凌顺平 客服电话：4008-773-772 网址：www.5ifund.com
106	华泰证券股份有限公司	华泰证券股份有限公司 注册地址：南京市江东中路228号 法定代表人：张伟 客服电话：95597 网址：www.htsc.com.cn
107	平安证券股份有限公司	平安证券股份有限公司 注册地址：深圳市福田区益田路5033号平安金融中心61-64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 法定代表人：何之江 客服电话：95511-8 网址：www.stock.pingan.com
108	第一创业证券股份有限公司	第一创业证券股份有限公司 办公地址：深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼 法定代表人：刘学民 客服电话：95358 网址：www.firstcapital.com.cn
109	华西证券股份有限公司	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 法定代表人：杨炯洋 客服电话：95584 网址：www.hx168.com.cn
110	粤开证券股份有限公司	粤开证券股份有限公司 注册地址：广州经济技术开发区科学大道60号开发区金控中心21、22、23层 办公地址：深圳市福田区深南中路2002号中广核大厦北楼10层 法定代表人：严亦斌 客服电话：95564 网址：www.ykzq.com
111	诺亚正行基金销售有限公司	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：上海市杨浦区长阳路1687号2号楼 法定代表人：汪静波 客服电话：400-821-5399 网址：www.noah-fund.com
112	一路财富（北京）	一路财富（北京）基金销售有限公司

	基金销售有限公司	注册地址：北京市海淀区宝盛南路1号院20号楼9层101-14 法定代表人：吴雪秀 客服电话：400-001-1566 网址：www.yilucaifu.com
113	深圳市锦安基金销售有限公司	深圳市锦安基金销售有限公司 注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路鲤鱼门街1号前海深港合作区管理局综合办公楼A栋201室 法定代表人：李学东 客服电话：400-071-9888 网址：www.ananj.com.cn
114	上海好买基金销售有限公司	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：上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号 法定代表人：杨文斌 客服电话：400-700-9665 网址：www.ehowbuy.com
115	上海天天基金销售有限公司	上海天天基金销售有限公司 注册地址：上海市徐汇区龙田路190号2号楼二层 办公地址：上海市徐汇区龙田路190号2号楼二层 法定代表人：其实 客服电话：95021 网址：www.1234567.com.cn
116	深圳众禄基金销售股份有限公司	深圳众禄基金销售股份有限公司 注册地址：深圳市罗湖区笋岗街道笋西社区梨园路8号HALO广场一期四层12-13室 办公地址：深圳市罗湖区笋岗街道笋西社区梨园路8号HALO广场一期四层12-13室 法定代表人：薛峰 客服电话：400-678-8887 网址：www.zlfund.cn；www.jmmw.com
117	东兴证券股份有限公司	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 法定代表人：魏庆华 客服电话：95309 网址：www.dxzq.net
118	上海长量基金销售有限公司	上海长量基金销售有限公司 注册地址：浦东新区高翔路526号2幢220室 法定代表人：张跃伟 客服电话：400-820-2899 网址：www.erichfund.com
119	和讯信息科技有限公司	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1002室 法定代表人：章知方 客服电话：400-9200-022 网址：www.hexun.com

120	大同证券有限责任公司	大同证券有限责任公司 注册地址：大同市城区迎宾街 15 号桐城中央 21 层 法定代表人：董祥 客服电话：400-7121-212 网址：www.dtsbc.com.cn
121	万联证券股份有限公司	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 18、19 楼 法定代表人：罗钦城 客服电话：95322 网址：www.wlzq.cn
122	国信证券股份有限公司	国信证券股份有限公司 注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 16-26 层 法定代表人：何如 客服电话：95536 网址：www.guosen.com.cn
123	国泰君安证券股份有限公司	国泰君安证券股份有限公司 注册地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼 办公地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号 法定代表人：贺青 客服电话：95521 网址：www.gtja.com
124	深圳前海凯恩斯基金销售有限公司	深圳前海凯恩斯基金销售有限公司 注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入驻前海商务秘书有限公司） 法定代表人：高锋 客服电话：4008-048-688 网址：www.keynesasset.com
125	深圳安见基金销售有限公司	深圳安见基金销售有限公司 注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司） 办公地址：深圳市罗湖区和平路鸿隆世纪广场 B 座 211 法定代表人：吴永宏 联系人：张媛媛 客服电话：400-800-8668 网址：www.ph6.com
126	京东肯特瑞基金销售有限公司	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 客服电话：95118；400-088-8816 网址：kenterui.jd.com
127	北京创金启富基金销售有限公司	北京创金启富基金销售有限公司 注册地址：北京市西城区白纸坊东街 2 号院 6 号楼 712 室 法定代表人：梁蓉

		<p>客服电话：400-6262-818 网址：www.5irich.com</p>
128	中民财富基金销售（上海）有限公司	<p>中民财富基金销售（上海）有限公司 注册地址：上海市黄浦区中山南路100号07层 法定代表人：弭洪军 联系人：黄鹏 传真：021-63353736 客服电话：400-876-5716 网址：www.cmiwm.com</p>
129	北京度小满基金销售有限公司	<p>北京度小满基金销售有限公司 注册地址：北京市海淀区西北旺东路10号院西区4号楼1层103室 办公地址：北京市海淀区西北旺东路10号院西区4号楼1层103室 法定代表人：葛新 传真：9,01061951009 客服电话：95055-4 网址：www.baiyingfund.com</p>
130	深圳市小牛基金销售有限公司	<p>深圳市小牛基金销售有限公司 注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司） 法定代表人：李俊 客服电话：400-669-5666 网址：www.xiaoniuxcf.com</p>
131	玄元保险代理有限公司	<p>玄元保险代理有限公司 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：马永谔 传真：9,02150701053 客服电话：021-50701053 网址：www.xyinsure.com</p>
132	中证金牛（北京）投资咨询有限公司	<p>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：北京市宣武门外大街甲1号新华社第三工作区5F 法定代表人：钱昊旻 传真：9,01059336586 客服电话：4008-909-998 网址：www.jnlc.com</p>
133	深圳新华信通基金销售有限公司	<p>深圳新华信通基金销售有限公司 注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司） 办公地址：深圳市福田区深南大道2003号华嵘大厦1806 法定代表人：韩森 客服电话：400-000-5767 网址：www.xintongfund.com</p>
134	鼎信汇金（北京）投资管理有限公司	<p>鼎信汇金（北京）投资管理有限公司 注册地址：北京市海淀区太月园3号楼5层521室</p>

		<p>办公地址：北京市海淀区太月园3号楼5层521室          法定代表人：齐凌峰          传真：9,01082031470          客服电话：400-158-5050          网址：www.9ifund.com</p>
135	上海中正达广基金销售有限公司	<p>上海中正达广基金销售有限公司          注册地址：上海市徐汇区龙腾大道2815号302室          办公地址：上海市徐汇区龙腾大道2815号302室          法定代表人：黄欣          客服电话：400-6767-523          网址：www.zhongzhengfund.com</p>
136	华瑞保险销售有限公司	<p>华瑞保险销售有限公司          注册地址：上海市嘉定区南翔镇众仁路399号运通星财富广场1号楼B座13、14层          法定代表人：路昊          传真：9,02168595766          客服电话：952303          网址：www.huaruisales.com</p>
137	中国人寿保险股份有限公司	<p>中国人寿保险股份有限公司          注册地址：北京市西城区金融大街16号          办公地址：北京市西城区金融大街16号中国人寿广场A座          法定代表人：王滨          传真：9,01066222276          客服电话：95519          网址：www.e-chinalife.com</p>
138	深圳市金海九州基金销售有限公司	<p>深圳市金海九州基金销售有限公司          办公地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室          法定代表人：彭维熙          客服电话：4000993333          网址：www.jhjzfund.com</p>
139	华福证券股份有限公司	<p>华福证券股份有限公司          注册地址：福建省福州市鼓楼区鼓屏路27号1#楼3层、4层、5层          办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1088号招商银行大厦18楼          法定代表人：黄金琳          客服电话：95547          网址：www.gfhfzq.com.cn</p>
140	泛华普益基金销售有限公司	<p>泛华普益基金销售有限公司          办公地址：成都市成华区建设路9号高地中心1101室          法定代表人：于海锋          客服电话：4000803388          网址：www.puyifund.com</p>
141	沈阳麟龙投资顾问有限公司	<p>沈阳麟龙投资顾问有限公司          注册地址：辽宁省沈阳市浑南区白塔二南街18-2号B座601          办公地址：辽宁省沈阳市浑南区白塔二南街18-2号B</p>

		座 601 法定代表人：朱荣晖 客服电话：4000035811 网址：www.jinjiwo.com
142	上海陆亨基金销售有限公司	上海陆亨基金销售有限公司 注册地址：上海市浦东新区南汇新城镇环湖西二路 888 号 1 幢 1 区 14032 室 办公地址：上海市浦东新区世纪大道 1196 号世纪汇广场 2 座 16 楼 法定代表人：陈志英 客服电话：021-53398816 网址：www.luxxfund.com

**（二）注册登记机构**

名称：前海开源基金管理有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市福田区深南大道 7006 号万科富春东方大厦 22 楼

法定代表人：王兆华

联系人：罗炜

电话：（0755）83181579

传真：（0755）83181121

**（三）律师事务所和经办律师**

律师事务所：北京市君合（深圳）律师事务所

住所：深圳市罗湖区深南东路 5047 号深圳发展银行大厦 20C

办公地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号深圳发展银行大厦 20C

负责人：姚文平

电话：（0755）25870765

传真：（0755）25870780

经办律师：张建伟、胡义锦

联系人：胡义锦

**（四）会计师事务所和经办注册会计师**

会计师事务所：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：中国(上海)黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座 11 楼

首席合伙人：李丹

联系人：施翊洲

经办会计师：施翊洲、陈熹

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》和其他有关法律法规，以及基金合同的规定，经中国证监会 2013 年 11 月 04 日证监许可[2013]1399 号文准予注册募集。募集期自 2013 年 11 月 15 日至 2013 年 12 月 16 日，共募集有效认购份额 128,484,379.36 份，利息结转份额 39,083.39 份，合计 128,523,462.75 份，募集户数为 1,029 户。

本基金为契约型开放式混合型基金，基金存续期限为不定期。本基金为发起式基金，发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

## 七、基金合同的生效

### （一）基金合同的生效

本基金合同于 2013 年 12 月 19 日正式生效。自基金合同生效日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

### （二）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，基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元的，基金管理人应当及时报告中国证监会；连续 20 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会说明原因并报送解决方案；基金合同生效之日起三年后的对应日，若基金资产规模低于 2 亿元，基金合同自动终止。

法律法规另有规定时，从其规定。

## 八、基金份额的申购与赎回

### （一）申购和赎回场所

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。具体的销售网点将由基金管理人在招募说明书或其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并在管理人网站公示。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。

若基金管理人或其指定的销售机构开通电话、传真或电子等交易方式，投资人可以通过上述方式进行申购与赎回，具体办法由基金管理人或其指定的销售机构另行公告。

### （二）申购和赎回的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

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。

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

#### 2、申购、赎回开始日及业务办理时间

基金管理人自基金合同生效之日起不超过三个月开始办理申购，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。

基金管理人自基金合同生效之日起不超过三个月开始办理赎回，具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。

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

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

本基金已于2014年2月10日开放日常申购赎回业务。

### （三）申购与赎回的原则

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

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；

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

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

#### （四）申购与赎回的程序

##### 1、申购和赎回的申请方式

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

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

##### 2、申购和赎回的款项支付

投资人申购基金份额时，必须全额交付申购款项，投资人交付款项，申购申请即为有效。

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

##### 3、申购和赎回申请的确认

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

基金销售机构对申购申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购的确认以登记机构或基金管理人的确认结果为准。投资人应及时查询并妥善行使合法权利。否则，由此产生的投资人任何损失由投资人自行承担。

#### （五）申购和赎回的限制

1、本基金对单个投资人不设累计持有的基金份额上限，但法律法规、中国证监会和《基金合同》另有规定的除外。

2、投资人通过基金管理人的直销柜台首次申购本基金的单笔最低限额为人民币 10 万元（含申购费）。投资人通过基金管理人的电子直销交易系统和其他销售机构首次申购本基金的单笔最低限额为人民币 10 元（含申购费）。投资人通过基金管理人的直销柜台追加申购本基金的最低金额为人民币 10 万元（含申购费）。投资人通过基金管理人的电子直销交易系统和其他销售机构追加申购本基金的最低金额为人民币 10 元（含申购费）。各销售机构对最低申购限额及交易级差有其他规定的，以各销售机构的业务规定为准。

3、投资人赎回本基金份额时，可申请将其持有的部分或全部基金份额赎回，但每笔最低赎回份额不得低于 10 份；账户最低余额为 10 份基金份额，若某笔赎回将导致投资人

在销售机构托管的单只基金份额余额不足 10 份时，该笔赎回业务应包括账户内全部基金份额，否则，基金管理人有权将剩余部分的基金份额强制赎回。

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

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前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。

#### （六）申购和赎回的价格、费用及其用途

1、本基金根据销售服务费及赎回费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。

不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额。A 类基金份额与 C 类基金份额合并运作。

本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码，分别计算和公告两类基金份额净值和两类基金份额累计净值。本基金份额净值的计算，保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

#### 2、申购费率

（1）投资人通过代销机构申购本基金 A/C 类基金份额的申购费率见下表：

申购金额 M（万元） （含申购费）	申购费率
$M < 50$	1.50%
$50 \leq M < 250$	1.20%
$250 \leq M < 500$	0.80%
$M \geq 500$	每笔 1,000 元

（2）本基金对通过基金管理人直销柜台和电子直销交易系统申购的投资人实施差别的申购费率，详见基金管理人官网或相关公告。

部分销售机构如实行优惠费率，请投资人参见销售机构公告。

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取。投资人在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。

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

#### 3、申购份额的计算及余额的处理方式

基金的申购金额包括申购费用和净申购金额。其中：

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

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

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

申购的有效份额单位为份，上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

例如：某投资人在某代销机构网点投资 8 万元申购本基金 A 类基金份额，对应费率为 1.5%，假设申购当日 A 类基金份额净值为 1.080 元，则可得到的申购份额为：

$$\text{净申购金额} = 80,000 / (1 + 1.5\%) = 78,817.73 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 80,000 - 78,817.73 = 1,182.27 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 78,817.73 / 1.080 = 72,979.38 \text{ 份}$$

即：投资人投资 8 万元申购本基金 A 类基金份额，假设申购当日 A 类基金份额净值为 1.080 元，则其可得到 72,979.38 份 A 类基金份额。

#### 4、赎回费率

(1) 本基金 A 类基金份额的赎回费率如下表所示：

持有期限 D (天)	赎回费率
D < 7	1.50%
7 ≤ D < 30	0.75%
30 ≤ D < 366	0.50%
366 ≤ D < 731	0.25%
D ≥ 731	0

投资者可将其持有的全部或部分 A 类基金份额赎回。赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。对于持有期少于 30 日的基金份额所收取的赎回费，赎回费用全额归入基金财产；对于持有期少于 3 个月的基金份额所收取的赎回费，赎回费用 75% 归入基金财产；对于持有期长于 3 个月但小于 6 个月的基金份额所收取的赎回费，赎回费用 50% 归入基金财产；对于持有期长于 6 个月的基金份额所收取的赎回费，赎回费用 25% 归入基金财产。

(2) 本基金 C 类基金份额的赎回费率如下表所示：

持有时间 D (天)	赎回费率
D < 7	1.50%
7 ≤ D < 30	0.50%
D ≥ 30	0%

投资者可将其持有的全部或部分 C 类基金份额赎回。对 C 类基金份额持有人收取的赎回费全额计入基金财产。

#### 5、赎回金额的计算及处理方式

本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额的赎回金额的计算方式相同，按照各自对应的 T 日该类基金份额净值和赎回费率计算，净赎回金额为赎回总金额扣减赎回费用。其中，

赎回总金额=赎回份额×赎回当日该类基金份额净值

赎回费用=赎回总金额×赎回费率

净赎回金额=赎回总金额-赎回费用

赎回金额单位为元，计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

例如：某投资人赎回本基金 1 万份 A 类基金份额，持有时间为 300 天，对应的赎回费率为 0.5%，假设赎回当日 A 类基金份额净值是 1.088 元，则其可得到的赎回金额为：

赎回金额=10,000×1.088=10,880 元

赎回费用=10,880×0.5%=54.4 元

净赎回金额=10,880-54.4=10,825.6 元

即：投资人赎回本基金 1 万份 A 类基金份额，持有期限为 300 天，假设赎回当日本基金 A 类基金份额净值是 1.088 元，则其可得到的净赎回金额为 10,825.6 元。

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

7、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，针对以特定交易方式（如电子直销交易、电话交易等）等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

#### （七）拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资者的申购申请：

1、因不可抗力导致基金无法正常运作。

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

3、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

4、基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。

5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人利益的情形。

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

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

8、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

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

#### **（八）暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形**

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。

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

3、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

5、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付，并以后续开放日的基金份额净值为依据计算赎回金额。若出现上述第 4 项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

#### **（九）巨额赎回的情形及处理方式**

1、巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过前一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。若进行上述延期办理，对于单个基金份额持有人当日赎回申请超过上一开放日基金总份额 10%以上的部分，基金管理人可以对其进行延期办理。对于当日未延期办理的赎回申请，应当按单个账户未延期办理的赎回申请量占未延期办理的赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额。对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

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

### 3、巨额赎回的公告

当发生上述延期赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个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) 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，基金管理人应在规定期限内指定媒介上刊登暂停公告。

2、如发生暂停的时间为 1 日，基金管理人应于重新开放日，在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近 1 个开放日两类基金份额的基金份额净值。

3、如发生暂停的时间超过 1 日但少于 2 周（含 2 周），暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人依照有关法律法规的规定在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近 1 个开放日两类基金份额的基金份额净值。

4、如发生暂停的时间超过 2 周，暂停期间，基金管理人应每 2 周至少刊登暂停公告 1 次。当连续暂停时间超过 2 个月的，基金管理人可以调整刊登公告的频率。暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人依照有关法律法规的规定在指定媒介上连续刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近 1 个开放日两类基金份额的基金份额净值。

#### (十一) 基金转换

基金管理人已于 2014 年 9 月 10 日起开通本基金与基金管理人旗下其他基金之间的转换业务，具体内容详见 2014 年 9 月 5 日在指定报刊和公司网站上发布的《前海开源基金管理有限公司关于旗下基金开通转换业务并在直销机构实行申购补差费率优惠的公告》。

#### **（十二）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。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。

#### **（十三）基金的转托管**

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

#### **（十四）定期定额投资计划**

基金管理人已于 2014 年 2 月 27 日起开通本基金的定期定额投资业务，具体内容详见 2014 年 2 月 25 日在指定报刊和公司网站上发布的《前海开源基金管理有限公司关于前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金代销机构开通定投业务及参与部分代销机构基金费率优惠活动的公告》。

#### **（十五）基金的冻结和解冻**

基金登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻，以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。

## 九、基金的投资

### （一）投资目标

本基金基于对宏观经济、资本市场的深入分析和理解，在积极把握市场发展趋势和市场参与者行为逻辑的基础上，精选具有估值优势和成长潜力的公司进行投资，力争获取超越业绩比较基准的收益，追求基金资产的长期稳定增值。

### （二）投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、中期票据、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规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。

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

基金的投资组合比例为：本基金将基金资产的0%-95%投资于股票，将不低于5%的基金资产投资于债券等固定收益类品种，其中，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。股指期货的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

### （三）投资策略

本基金的投资策略主要有以下五方面内容：

#### 1、大类资产配置

在大类资产配置中，本基金综合运用定性和定量的分析手段，在对宏观经济因素进行充分研究的基础上，判断宏观经济周期所处阶段。本基金将依据经济周期理论，结合对证券市场的系统性风险以及未来一段时期内各大类资产风险和预期收益率的评估，制定本基金在股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例。

本基金通过对股票等权益类、债券等固定收益类和现金资产分布的监控，根据经济运行周期变动、市场利率变化、市场估值、证券市场变化等因素以及基金的风险评估进行灵活调整。在各类资产中，根据其参与市场基本要素的变动，调整各类资产在基金投资组合中的比例。

#### 2、股票投资策略

本基金在积极把握宏观经济变迁、证券市场变化以及证券市场参与各方行为逻辑的基础上，将影响行业和公司投资价值的事件性因素作为投资的主线，以事件驱动为核心的投资策略。

本基金通过选取一年内发布过基金合同约定事件的相关公告的上市公司，在其事件发生或相关公告出具后，从中挑选部分公司进入股票池；或者在事前通过公开信息的定量研究，批量选择有可能发生基金合同约定事件的公司进入股票池，管理人通过优选股票池中的股票或者批量买入构建组合。

本基金的股票投资策略分为以下两个层次：

(1) 不同类型事件驱动下的投资组合配置

本基金将影响个股价值的事件驱动因素归纳为如下几个方面：

1) 发行制度改革

新股发行体制是指首次公开发行股票时的新股定价、承销和发售的一系列制度及相关安排。新股发行体制的核心是定价机制，有两方面基本内容，一是确定新股发行价格，即价格发现；二是采用一定的方式将新股出售给投资者。这两个方面相互制约和依赖，构成价格形成机制的核心内容。新股发行体制改革将使得存量的股票和未来新发行的股票的价格形成机制发生改变，也会因此带来相应的新股申购机会和投资机会。

2) 股份增持和股份回购

股份增持包括股东增持和高管增持，其中股东增持是指上市公司股东及其一致行动人增持股份行为；高管增持是指上市公司高管及其一致行动人增持股份的行为；股份回购是指公司按一定的程序购回发行或流通在外的本公司股份的行为。这两个行为通常被认为是公司股东及其一致行动人看好公司未来发展前景的积极举措。本基金将通过筛选、分析和评估股份增持和股份回购的样本股，结合预期盈利水平和成长潜力，择优选取安全边际较高、成长性较好的公司进行投资。

3) 业绩预告和超预期

业绩预告是指上市公司根据交易所规定所作出的关于净利润为负值、净利润增减幅度超过 50%以上、或实现扭亏为盈等事项的公告；业绩超预期是指公司业绩披露后，实际业绩显著超越过去 3 个月券商等研究机构的预测平均数的情况。这两种情形都代表着上市公司经营上出现了一些值得关注的变化因素，其股票市场表现也有一定的统计特征；本基金将通过筛选和分析业绩预增和超预期的样本股，自下而上进行评估，结合预期盈利水平和成长潜力，择优选取安全边际较高、成长性较好的公司进行投资。

4) 高分红和高转送

分红是指上市公司以现金分红方式将盈余公积和当期应付利润的部分或全部发放给股东。高分红是指公司分红比例较高的股票。高转送是实施较高比例的送股或转股的股票。高分红、高转送的公司，从侧面反应了公司投资价值和成长潜力。有高分红历史的上市公

司一般会延续高分红的政策，而高转送的上市公司往往有一些类似的行为特征可供研究。本基金将以高分红、高转送的公司作为样本库，自下而上进行评估，结合预期盈利水平和成长潜力，择优选取安全边际较高、成长性较好的公司进行投资。

#### 5) 再融资类

再融资是指上市公司通过配股、增发和发行可转换债券等方式在证券市场上进行的直接融资。再融资对上市公司的发展起到了较大的推动作用，我国证券市场的再融资功能越来越受到有关方面的重视。计划进行再融资的上市公司往往有一些类似的行为特征可供研究，本基金将通过筛选、分析和评估再融资的样本股，结合预期盈利水平和成长潜力，择优选取安全边际较高、成长性较好的公司进行投资。

#### 6) 股权激励

随着公司股权的日益分散和管理技术的日益复杂化，世界各国的大公司为了合理激励公司管理人员，创新激励方式，纷纷推行了股权、期权等形式的股权激励机制。股权激励是一种通过经营者获得公司股权形式给予企业经营者一定的经济权利，使他们能够以股东的身份参与企业决策、分享利润、承担风险，从而勤勉尽责地为公司的长期发展服务的一种激励方法。实施股权激励的公司，企业所有者和员工的利益是一致的，本基金将通过筛选、分析和评估股权激励的样本股，结合预期盈利水平和成长潜力，择优选取安全边际较高、成长性较好的公司进行投资。

#### 7) 重大变动类

重大变动类的上市公司，包括公司遭遇重大危机、并购重组、管理层发生重大变更等，这些变动公告后，往往对公司的生产、运营产生深远影响，其估值水平也会相应的出现大幅度的波动，因此也往往蕴藏着一些中长期的投资机会。本基金将通过筛选、分析和评估发生重大变动样本股，结合预期盈利水平和成长潜力，择优选取安全边际较高、成长性较好的公司进行投资。

#### 8) 其他影响资本市场和相关公司的重大事件

影响资本市场和相关上市公司的事件层出不穷，不一而足。本基金将持续密切关注重大事件的发生、进展、演变及其对相关公司的影响，并从中挖掘出相应的投资机会，择优选取安全边际较高、成长性较好的公司进行投资。

本基金对上述不同类型事件所隐含的投资机会进行定性和定量的评估，其中定性分析是指在特定的市场阶段，根据上述不同类型的事件，分析其行为逻辑，并从整体考虑各类事件的内外部驱动因素、变化方向；不同类型事件的特定指标具有一定的统计特征，定量分析是指对这些不同类型事件的特定指标进行统计分析，特定指标包括但不限于总市值，流通市值，市盈率，市净率和市销率等。通过定性和定量分析，确定每类事件驱动下的投资组合在本基金的配置比重，管理人通过优选股票池中的股票或者批量买入构建组合。

### (2) 个股配置

根据上述不同类型事件的配置的分析 and 评估结果，管理人将采用 GARP 选股策略精选股票进行投资，综合评估事件对个股的影响、安全边际、成长空间和投资价值等，在各自的事件股票库中进行投资。GARP (Growth at a Reasonable Price) 是指在合理价格投资成长性股票，追求成长与价值的平衡。即将不同成长类型的股票进行成长性分析，提早发掘其成长潜力或者看到其被低估的价值。

在运用 GARP 选股策略时，重点关注（1）成长速度：重点选择营业收入和营业利润在行业中未来将保持相对领先增长速度的公司。（2）成长空间：通过分析公司所处的行业前景，行业集中度和在行业中的地位，选择服务和产品未来具备广阔成长空间的公司。（3）成长模式：通过对公司的竞争壁垒、内部管理能力、行业属性等进行定性分析，选择业绩增长具有合理基础、在未来能够持续的公司。（4）成长估值：重点关注 PEG 较低的公司。

本基金通过上述分析方法在股票库中精选出成长能力突出、估值相对合理的股票，以此为基础构建本基金的股票投资组合。

### 3、债券投资策略

本基金投资债券等固定收益类资产的主要目的是为了有效控制股票等权益类资产的投资风险，优化组合流动性管理，并显著提高债券投资组合债息收益。当股票市场风险显著增大时，本基金将降低股票等权益类资产投资的仓位，增加对债券等固定收益类资产的投资。

因此，在债券投资方面，通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势以及不同类属固定收益类投资品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素，以目标久期管理和品种选择策略为主，以收益率利差策略、债券置换策略为辅，构造能获取稳定收益的固定收益类投资品种组合。

### 4、权证投资策略

本基金将权证的作为提高基金投资组合收益的辅助手段。根据权证对应公司基本面研究成果确定权证的合理估值，发现市场对股票权证的非理性定价；利用权证衍生工具的特性，通过权证与证券的组合投资，来达到改善组合风险收益特征的目的。

### 5、股指期货投资策略

本基金以套期保值为目的，参与股指期货交易。

本基金参与股指期货投资时机和数量的决策建立在对证券市场总体行情的判断和组合风险收益分析的基础上。基金管理人将根据宏观经济因素、政策及法规因素和资本市场因素，结合定性和定量方法，确定投资时机。基金管理人将结合股票投资的总体规模，以及中国证监会的相关限定和要求，确定参与股指期货交易的投资比例。

基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

基金管理人在进行股指期货投资前将建立股指期货投资决策部门或小组，负责股指期货的投资管理的相关事项，同时针对股指期货投资管理制定投资决策流程和风险控制等制度，并经基金管理人董事会批准后执行。

若相关法律法规发生变化时，基金管理人期货投资管理从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。

#### （四）投资决策依据及程序

##### 1、决策依据

以《基金法》、基金合同、公司章程等有关法律法规为决策依据，并以维护基金份额持有人利益作为最高准则。

##### 2、决策程序

（1）投资决策委员会制定整体投资战略。

（2）研究部根据自身以及其他研究机构的研究成果，构建股票备选库、精选库，对拟投资对象进行持续跟踪调研，并提供个股、债券决策支持。

（3）基金经理根据投资决策委员会的投资战略，设计和调整投资组合。设计和调整投资组合需要考虑的基本因素包括：每日基金申购和赎回净现金流量；基金合同的投资限制和比例限制；研究员的投资建议；基金经理的独立判断；绩效与风险评估小组的建议等。

（4）投资决策委员会对基金经理提交的方案进行论证分析，并形成决策纪要。

（5）根据决策纪要，基金经理小组构造具体的投资组合及操作方案，交由交易部执行。

（6）交易部按有关交易规则执行，并将有关信息反馈基金经理。

（7）基金绩效评估岗及风险管理岗定期进行基金绩效评估，并向投资决策委员会提交综合评估意见和改进方案。

（8）风险控制委员会对识别、防范、控制基金运作各个环节的风险全面负责，尤其重点关注基金投资组合的风险状况；基金绩效评估岗及风险管理岗重点控制基金投资组合的市场风险和流动性风险。

#### （五）业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×70%+中证全债指数收益率×30%。

业绩比较基准选择理由：

沪深 300 指数是由中证指数公司编制发布、表征 A 股市场走势的权威指数。该指数是由上海和深圳证券交易所中选取 300 只 A 股作为样本编制而成的成份股指数。其样本覆盖了沪深市场六成左右的市值，具有良好的市场代表性。本基金选择该指数来衡量股票投资部分的绩效。

中证全债指数是中证指数公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数。该指数的样本由银行间市场和沪深交易所市场的国债、金融债券及企业债券组成，中证指数公司每日计算并发布中证全债的收盘指数及相应的债券属性指标。该指数的一个重要特点在于对异常价格和无价情况下使用了模型价，能更为真实地反映债券的实际价值和收益率特征。本基金选择该指数来衡量债券投资部分的绩效。

根据本基金的投资范围和投资比例约束，设定本基金的基准为沪深 300 指数收益率  $\times 70\%$  + 中证全债指数收益率  $\times 30\%$ ，该基准能客观衡量本基金的投资绩效。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时，本基金管理人协商基金托管人后可以在报中国证监会备案以后变更业绩比较基准并及时公告，但不需要召集基金份额持有人大会。

#### （六）风险收益特征

本基金为混合型基金，属于中高风险收益的投资品种，其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金，低于股票型基金。

#### （七）投资限制

##### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金将基金资产的 0%–95% 投资于股票；将不低于 5% 的基金资产投资于债券等固定收益类品种；

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

（3）本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%；

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

（5）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

（6）本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

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

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

（9）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

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

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

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

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

(14) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

(15) 一只基金持有一家公司发行的流通受限证券，其市值不得超过基金资产净值的百分之三；一只基金持有的所有流通受限证券，其市值不得超过基金资产净值的百分之十五；经基金管理人和基金托管人协商，可对以上比例进行调整；

(16) 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%；

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

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

(19) 本基金投资单只中期票据的额度不得超过其发行总额度的 10%，并且不得超过基金净值的 10%；

(20) 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%；

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

(22) 本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；本基金管理人应当按照中国金融期货交易所要求的内容、格式与时限向交易所报告所交易和持有的卖出期货合约情况、交易目的及对应的证券资产情况等；

(23) 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）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；

（24）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%；

（25）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。

本基金在进行股指期货投资之前，应与基金托管人就股指期货清算、估值、交割等事宜另行具体协商。

除上述第（2）、（12）、（17）、（18）项外，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- （1）承销证券；
- （2）违反规定向他人贷款或者提供担保；
- （3）从事承担无限责任的投资；
- （4）买卖其他基金份额，但是国务院证券监督管理机构另有规定的除外；
- （5）向其基金管理人、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、行政法规和国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

## （八）基金管理人代表基金行使股东权利及债权人权利的处理原则及方法

- 1、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；
- 2、有利于基金资产的安全与增值；
- 3、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金份额持有人的利益；
- 4、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利，保护基金份额持有人的利益。

## （九）基金的融资融券

本基金可以根据有关法律法规和政策的规定进行融资、融券。

## （十）基金的投资组合报告

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

基金托管人上海银行股份有限公司根据本基金合同规定复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容, 保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至 2020 年 12 月 31 日（未经审计）。

### 1. 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	95,729,838.87	87.16
-	其中：股票	95,729,838.87	87.16
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	12,861,809.56	11.71
8	其他资产	1,243,496.26	1.13
9	合计	109,835,144.69	100.00

### 2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	21,739,360.00	20.16
C	制造业	10,366,025.96	9.61
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,716.24	0.02
J	金融业	63,430,088.89	58.82
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	175,647.78	0.16
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
-	合计	95,729,838.87	88.77

## 2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

## 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	300059	东方财富	337,700	10,468,700.00	9.71
2	601899	紫金矿业	1,111,200	10,323,048.00	9.57
3	603799	华友钴业	130,100	10,316,930.00	9.57
4	002797	第一创业	995,700	9,907,215.00	9.19
5	600988	赤峰黄金	512,900	9,186,039.00	8.52
6	601336	新华保险	157,900	9,153,463.00	8.49
7	600999	招商证券	324,732	7,579,244.88	7.03
8	601995	中金公司	84,543	6,199,873.05	5.75
9	600030	中信证券	159,400	4,686,360.00	4.35
10	601628	中国人寿	111,500	4,280,485.00	3.97

## 4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

## 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

无。

## 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

无。

## 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

无。

## 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

无。

## 9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

### 9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

## 10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 10.1 本期国债期货投资政策

无。

**10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

无。

**10.3 本期国债期货投资评价**

无。

**11. 投资组合报告附注**

11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

11.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

**11.3 其他资产构成**

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	256,291.25
2	应收证券清算款	967,132.95
3	应收股利	-
4	应收利息	2,918.19
5	应收申购款	17,153.87
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,243,496.26

**11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

无。

**11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况 说明
1	601995	中金公司	1,714,383.21	1.59	新股流通受限

**11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

**（十一）基金的业绩**

基金管理人依照恪尽职守、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，也不保证最低收益。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。

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)
2013.12.19-2013.12.31	0.10%	0.03%	-0.04%	0.92%	0.14%	-0.89%
2014.1.1-2014.12.31	1.60%	0.99%	38.56%	0.85%	-36.96%	0.14%
2015.1.1-2015.12.31	5.80%	0.74%	8.26%	1.74%	-2.46%	-1.00%
2016.1.1-2016.12.31	-1.12%	1.17%	-7.02%	0.98%	5.90%	0.19%
2017.1.1-2017.12.31	34.59%	0.91%	14.79%	0.45%	19.70%	0.46%
2018.1.1-2018.12.31	-20.39%	1.39%	-15.97%	0.93%	-4.42%	0.46%
2019.1.1-2019.12.31	45.35%	1.28%	26.39%	0.87%	18.96%	0.41%
2020.1.1-2020.12.31	24.92%	1.14%	20.09%	1.00%	4.83%	0.14%
2013.12.19-2020.12.31	107.00%	1.11%	104.11%	1.03%	2.89%	0.08%

前海开源事件驱动混合型发起式证券投资基金 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)
2015.10.26-2015.12.31	0.30%	0.04%	3.45%	1.14%	-3.15%	-1.10%
2016.1.1-2016.12.31	-2.99%	1.17%	-7.02%	0.98%	4.03%	0.19%
2017.1.1-2017.12.31	34.43%	0.91%	14.79%	0.45%	19.64%	0.46%
2018.1.1-2018.12.31	-20.41%	1.39%	-15.97%	0.93%	-4.44%	0.46%
2019.1.1-2019.12.31	45.15%	1.28%	26.39%	0.87%	18.76%	0.41%
2020.1.1-2020.12.31	24.82%	1.13%	20.09%	1.00%	4.73%	0.13%
2015.10.26-	88.60%	1.17%	40.82%	0.88%	47.78%	0.29%

---

2020.12.31						
------------	--	--	--	--	--	--

注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×70%+中证全债指数收益率×30%

## 十、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。

基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益归入基金财产。

## 十一、基金资产的估值

### （一）估值日

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

### （二）估值对象

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

### （三）估值方法

#### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

（1）交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化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）交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

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

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

#### 2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

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

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

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

4、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

5、股票指数期货合约估值方法

本基金投资股指期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，  
且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

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

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

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

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

#### **（四）估值程序**

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

每个工作日计算基金资产净值及两类基金份额净值，并按规定公告。

2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或基金合  
同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将基金份额净值结  
果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

#### **（五）估值错误的处理**

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确  
性、及时性。当基金份额净值小数点后 3 位以内(含第 3 位)发生估值错误时，视为基金份  
额净值错误。

基金合同的当事人应按照以下约定处理：

1、估值错误类型

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

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

## 2、估值错误处理原则

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

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

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

（4）估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

## 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

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

4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

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

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

(3) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

#### **(六) 暂停估值的情形**

- 1、基金投资所涉及的证券市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；
- 3、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商一致的；
- 4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

#### **(七) 基金净值的确认**

用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的基金资产净值和基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金净值予以公布。

## 十二、基金的收益分配

### （一）基金利润的构成

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

### （二）基金可供分配利润

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

### （三）基金收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为6次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的30%，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后任一类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的任一类基金份额净值减去该类每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、本基金两类基金份额在费用收取上不同，其对应的可分配收益可能有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

### （四）收益分配方案

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

### （五）收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

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

### （六）基金收益分配中发生的费用

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

## 十三、基金的费用与税收

### （一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、从C类基金份额的基金财产中计提的销售服务费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、证券账户开户费用、银行账户维护费用；
- 10、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

### （二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.9%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.9\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.05%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 3、从C类基金份额的基金财产中计提的销售服务费

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年费率为0.1%。

本基金销售服务费按前一日C类基金资产净值的0.1%年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

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

销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中一次性划出，由注册登记机构代收，注册登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述“（一）基金费用的种类”中第 4—10 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

### （三）不列入基金费用的项目

- 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）基金管理费、基金托管费和销售服务费的调整

基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况，履行适当程序后调整基金管理费率、基金托管费率和销售服务费率等相关费率。降低基金管理费率、基金托管费率和销售服务费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率实施日前在指定媒介上刊登公告。

### （五）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## 十四、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；
- 3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
- 4、会计制度执行国家有关会计制度；
- 5、本基金独立建账、独立核算；
- 6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；
- 7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

### （二）基金的审计

- 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、期货相关从业资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意。
- 3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所需按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

## 十五、基金的信息披露

（一）本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《基金合同》及其他有关规定。

### （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、行政法规和中国证监会规定的自然人、法人和非法人组织。

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

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

（三）本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

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

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

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

### （五）公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

- 1、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，基金管理人在基金份额发售的3日前，将基金招募说明书、《基金合同》摘要登载在指定媒介上；基金管理人、基金托管人应当将《基金合同》、基金托管协议登载在网站上。

## 2、基金份额发售公告

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

## 3、《基金合同》生效公告

基金管理人应当在收到中国证监会确认备案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公告一次基金资产净值和两类基金份额净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过指定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日的两类基金份额净值和两类基金份额累计净值。

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两类基金份额净值和两类基金份额累计净值。

## 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。基金年度报告中的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计。

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

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

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

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。

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

## 7、临时报告

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，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) 基金管理人高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；
- (10) 基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十，基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十；
- (11) 涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁；

(12) 基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；

(13) 基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易事项，但中国证监会另有规定的除外；

(14) 基金收益分配事项；

(15) 管理费、托管费、销售服务费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；

(16) 任一类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，应当依法报国务院证券监督管理机构核准或者备案，并予以公告。

#### 10、基金投资股指期货的信息披露

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交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示股指期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标等。

#### 11、中国证监会规定的其他信息。

### （六）信息披露事务管理

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

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

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

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

基金管理人、基金托管人除依法在指定媒介上披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒介披露信息，但是其他公共媒介不得早于指定媒介披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

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。

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

#### **（七）信息披露文件的存放与查阅**

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

**（八）** 本基金信息披露事项以法律法规规定及本章节约定的内容为准。

## 十六、风险揭示

本基金的风险主要包括：基金投资风险、基金运作风险、本法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险和其他风险。

### （一）基金投资风险

#### 1、市场风险

本基金投资于证券市场，证券价格受整体政治、经济、社会等环境因素的影响会产生波动，从而对本基金的投资产生潜在风险，导致本基金的收益水平发生波动。

##### （1）政策风险

政策风险是指国家货币政策、财政政策、产业政策等宏观经济政策发生重大变化而导致的本基金投资对象的价格波动，从而给投资带来的风险。

##### （2）经济周期风险

经济运行具有周期性的特点，市场的收益水平随经济运行的周期性变动而变动，本基金所投资于固定收益类品种和股权相关的投资工具的收益水平也会随之变化，从而产生风险。

##### （3）利率风险

金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着债券的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。基金投资于债券和股票，其收益水平可能会受到利率变化的影响。

##### （4）购买力风险

基金的一部分收益将通过现金形式来分配，而现金的购买力可能因为通货膨胀的影响而下降，从而给投资者带来实际收益水平下降的风险。

##### （5）再投资风险

市场利率下降将影响固定收益类证券利息收入的再投资收益率，这与利率上升所带来的价格风险互为消长。

##### （6）债券发行人提前兑付风险

当利率下降时，拥有提前兑付权的债券发行人往往会行使该类权利。在此情形下，债券基金经理不得不将兑付资金再投资到收益率更低的固定收益证券上，从而影响投资组合的整体回报率。

##### （7）公司经营风险

上市公司的经营状况受多种因素的影响，如管理能力、行业竞争、市场前景、技术更新、财务状况、新产品研究开发等都会导致公司盈利发生变化。如果基金所投资的上市公司经营不善，其股票价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，使基金投资收益下

降。上市公司还可能出现难以预见的变化。虽然基金可以通过投资多样化来分散这种非系统风险，但不能完全避免。

#### （8）信用风险

信用风险是指金融工具的一方到期无法履行约定义务致使本基金遭受损失的风险。基金在交易过程中可能发生交收违约或者所投资债券的发行人违约、拒绝支付到期本息等情况，从而导致基金资产损失。

#### （9）通货膨胀风险

由于通货膨胀率提高，基金的实际投资价值会因此降低。

#### （10）法律风险

由于法律法规方面的原因，某些市场行为受到限制或合同不能正常执行，导致了基金资产损失的风险。

## 2、流动性风险

（1）流动性风险是指在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险主要来源于开放式基金每日兑付赎回资金的流动性风险，以及因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险以及因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。

为了克服流动性风险，本基金将在坚持分散化投资和精选个股原则的基础上，通过一系列风险控制指标加强对流动性风险的跟踪、防范和控制，但基金管理人并不保证完全避免此类风险。

#### （2）本基金主要的流动性风险管理方法说明

1) 在申购、赎回安排方面，本基金将加强对开放式基金申购环节的管理，合理控制基金份额持有人集中度，审慎确认大额申购申请，在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，基金管理人将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对基金规模予以控制，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。

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

3) 在本基金出现巨额赎回情形下，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况或巨额赎回份额占比情况决定全额赎回或部分延期赎回。同时，如本基金单个基金份额持有人在单个开放日申请赎回基金份额超过基金总份额一定比例以上的，基金管理人可以实施延期办理赎回申请的措施。具体内容详见本招募说明书第八章。

4) 本基金可能实施备用的流动性风险管理工具，以更好地应对流动性风险。基金管理人经与基金托管人协商，在确保投资者得到公平对待的前提下，可依照法律法规及基金合同的约定，综合运用各类流动性风险管理工具，对赎回申请等进行适度调整，作为特定情形下基金管理人流动性风险管理的辅助措施，包括但不限于：①延期办理巨额赎回申请；②暂停接受赎回申请；③延缓支付赎回款项；④收取短期赎回费，本基金对持续持有期少于7日的投资者收取不低于1.5%的赎回费；⑤暂停基金估值，当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商一致，本基金将暂停基金估值。

当基金管理人实施流动性风险管理工具时，可能对投资者具有一定的潜在影响，包括但不限于不能申购本产品、赎回申请不能确认或者赎回款项延迟到账、如持有期限少于7日会产生较高的赎回费造成收益损失等。提示投资者了解自身的流动性偏好、合理做好投资安排。

### 3、本基金特定风险

本基金为混合型基金，资产配置策略对基金的投资业绩具有较大的影响。在类别资产配置中可能会由于市场环境、公司治理、制度建设等因素的不同影响，导致资产配置偏离优化水平，为组合绩效带来风险。

#### （二）基金运作风险

##### 1、管理风险

在本基金管理运作过程中基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的占有和对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响本基金收益水平。此外，基金管理人的职业操守和道德标准同样都有可能对本基金回报带来负面影响。因此，本基金可能因为基金管理人的因素而影响基金收益水平。

##### 2、操作或技术风险

相关当事人在业务各环节操作过程中，可能因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等导致本基金资产损失，例如，越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误等。

在开放式基金的各种交易行为或者后台运作中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致投资者的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理公司、注册登记机构、销售机构、银行间债券市场、证券交易所、证券登记结算机构、中央国债登记结算中心等等。

##### 3、大额赎回风险

本基金是开放式基金，基金规模将随着投资者对本基金份额的申购与赎回而不断变化，若是由于投资者的连续大量赎回而导致本基金管理人被迫抛售持有投资品种以应付本基金

赎回的现金需要,则可能使本基金资产变现困难,本基金面临流动性风险或承担额外的冲击成本。

#### 4、顺延或暂停赎回风险

因为市场剧烈波动或其他原因而连续出现巨额赎回,并导致基金管理人的现金支付出现困难,基金投资者在赎回基金份额时,可能会遇到部分顺延赎回或暂停赎回等风险。

### （三）其他风险

#### 1、技术风险

计算机、通讯系统、交易网络等技术保障系统或信息网络支持出现异常情况,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显示产生净值、基金的投资交易指令无法及时传输等风险。

2、金融市场危机、行业竞争、代理机构违约、托管行违约等超出本基金管理人自身直接控制能力之外的风险,可能导致本基金或者基金份额持有人的利益受损;

3、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;

4、因人为因素而产生的风险、如内幕交易、欺诈行为等产生的风险;

5、对主要业务人员如基金经理的依赖而可能产生的风险;

6、其他意外导致的风险。

### （四）本法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险

本法律文件投资章节有关风险收益特征的表述是基于投资范围、投资比例、证券市场普遍规律等做出的概述性描述,代表了一般市场情况下本基金的长期风险收益特征。销售机构(包括基金管理人直销机构和代销机构)根据相关法律法规对本基金进行风险评价,不同的销售机构采用的评价方法也不同,因此销售机构的风险等级评价与法律文件中风险收益特征的表述可能存在不同,投资人在购买本基金时需按照销售机构的要求完成风险承受能力与产品风险之间的匹配检验。

## 十七、基金的终止与清算

### （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经中国证监会备案生效后方可执行，自决议生效后两日内在指定媒介公告。

### （二）基金合同的终止

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- 3、发起式基金基金合同生效三年后，若基金资产规模低于 2 亿元的，基金合同自动终止；
- 4、《基金合同》约定的其他情形；
- 5、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### （三）基金财产的清算

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

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

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

4、基金财产清算程序：

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

5、基金财产清算的期限为6个月。

**（四）清算费用**

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

**（五）基金财产清算剩余资产的分配**

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

**（六）基金财产清算的公告**

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

**（七）基金财产清算账册及文件的保存**

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。

## 十八、基金合同的内容摘要

### 一、基金合同当事人的权利、义务

#### （一）基金份额持有人的权利与义务

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

- （1）分享基金财产收益；
- （2）参与分配清算后的剩余基金财产；
- （3）依法申请赎回其持有的基金份额；
- （4）按照规定要求召开基金份额持有人大会；
- （5）出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- （6）查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- （7）监督基金管理人的投资运作；
- （8）对基金管理人、基金托管人、基金销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；
- （9）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

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

#### （二）基金管理人的权利与义务

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

- （1）依法募集基金；

(2) 自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；

(3) 依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；

(4) 销售基金份额；

(5) 召集基金份额持有人大会；

(6) 依据《基金合同》及有关法律法规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

(7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

(8) 选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；

(9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；

(10) 依据《基金合同》及有关法律法规规定决定基金收益的分配方案；

(11) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；

(12) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

(13) 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、转托管等业务的规则；

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

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

(2) 办理基金备案手续；

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

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

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

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

(7) 依法接受基金托管人的监督；

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

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(10) 编制季度报告、中期报告和年度报告；

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

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

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

(14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(26) 建立并保存基金份额持有人名册；

(27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(三) 基金托管人的权利与义务

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

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

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

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

(4) 根据相关市场规则，为基金开设证券账户、为基金办理证券交易资金清算；

(5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

(6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

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

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

- (4) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；
- (5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
- (6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户，按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
- (7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；
- (8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值、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) 建立并保存基金份额持有人名册；
- (13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
- (14) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；
- (15) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
- (16) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；
- (17) 参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- (18) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人；
- (19) 因违反《基金合同》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- (20) 按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿；
- (21) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；
- (22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## 二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

（一）召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

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

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

- （1）调低基金管理费、基金托管费、销售服务费和其他应由基金财产承担的费用；
- （2）法律法规要求增加的基金费用的收取；
- （3）在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式；
- （4）因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；
- （5）对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生变化；
- （6）按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

（二）会议召集人及召集方式

- 1、除法律法规规定或《基金合同》另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集；
- 2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集；
- 3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集。
- 4、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开。
- 5、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。
- 6、基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

（三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

- 1、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 30 日，在指定媒介公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：
  - （1）会议召开的时间、地点和会议形式；
  - （2）会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；
  - （3）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
  - （4）授权委托证明的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；
  - （5）会务常设联系人姓名及联系电话；
  - （6）出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
  - （7）召集人需要通知的其他事项。

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

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

#### （四）基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式或通讯开会方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

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

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

（2）经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的 50%（含 50%）。

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式在表决截至日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

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

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

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

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

（5）会议通知公布前报中国证监会备案。

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

（五）议事内容与程序

1、议事内容及提案权

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

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

2、议事程序

（1）现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

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

（2）通讯开会

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

（六）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

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

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

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

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

#### （七）计票

##### 1、现场开会

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

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

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

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

##### 2、通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证

机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

#### （八）生效与公告

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

基金份额持有人大会的决议自中国证监会依法核准或者出具无异议意见或备案（视届时有效适用的法律法规的要求而定）之日起生效。

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

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

（九）本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规的部分，如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的或法律法规增加新的持有人大会机制的，基金管理人提前公告后，可直接对本部分内容进行修改、调整或补充，无需召开基金份额持有人大会审议。

### 三、基金收益分配原则、执行方式

#### （一）基金利润的构成

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

#### （二）基金可供分配利润

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

#### （三）基金收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 30%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后任一类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的任一类基金份额净值减去该类每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

4、本基金两类基金份额在费用收取上不同，其对应的可分配收益可能有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### （四）收益分配方案

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

#### （五）收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

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

#### （六）基金收益分配中发生的费用

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

### 四、基金费用与税收

#### （一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、从C类基金份额的基金财产中计提的销售服务费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、证券账户开户费用、银行账户维护费用；
- 10、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

#### （二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

##### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.9%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.9\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

## 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.05%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

## 3、从C类基金份额的基金财产中计提的销售服务费

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年费率为0.1%。

本基金销售服务费按前一日C类基金资产净值的0.1%年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

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

销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金资产中一次性划出，由注册登记机构代收，注册登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述“（一）基金费用的种类”中第4—10项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

### （三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、《基金合同》生效前的相关费用；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

（四）基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况，履行适当程序后调整基金管理费率、基金托管费率和销售服务费等相关费率。降低基金管理费率、基金托管费率和销售

服务费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率实施日前在指定媒介上刊登公告。

#### （五）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

### 五、基金财产的投资范围和投资限制

#### （一）投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、中期票据、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规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。

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

基金的投资组合比例为：本基金将基金资产的0%-95%投资于股票，将不低于5%的基金资产投资于债券等固定收益类品种，其中，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。股指期货的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

#### （二）投资限制

##### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金将基金资产的0%-95%投资于股票；将不低于5%的基金资产投资于债券等固定收益类品种；

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

（3）本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的10%；

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

（5）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的3%；

（6）本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的10%；

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

- (8) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；
- (9) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；
- (10) 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；
- (11) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；
- (12) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；
- (13) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；
- (14) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；
- (15) 一只基金持有一家公司发行的流通受限证券，其市值不得超过基金资产净值的百分之三；一只基金持有的所有流通受限证券，其市值不得超过基金资产净值的百分之十五；经基金管理人和基金托管人协商，可对以上比例进行调整；
- (16) 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%；
- (17) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合该比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；
- (18) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；
- (19) 本基金投资单只中期票据的额度不得超过其发行总额度的 10%，并且不得超过基金净值的 10%；
- (20) 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%；
- (21) 本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

(22) 本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；本基金管理人应当按照中国金融期货交易所要求的内容、格式与时限向交易所报告所交易和持有的卖出期货合约情况、交易目的及对应的证券资产情况等；

(23) 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）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；

(24) 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%；

(25) 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。

本基金在开始进行股指期货投资之前，应与基金托管人就股指期货清算、估值、交割等事宜另行具体协商。

除上述第（2）、（12）、（17）、（18）项外，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但是国务院证券监督管理机构另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、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、行政法规和国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

## 六、基金资产估值

### （一）估值日

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

### （二）估值对象

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

### （三）估值方法

### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

(1) 交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化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) 交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

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

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

### 2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

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

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

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

4、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

### 5、股票指数期货合约估值方法

本基金投资股指期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

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

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

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

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

#### （四）估值程序

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

每个工作日计算基金资产净值及两类基金份额净值，并按规定公告。

2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或本基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

#### （五）估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后3位以内（含第3位）发生估值错误时，视为基金份额净值错误。

本基金合同的当事人应按照以下约定处理：

##### 1、估值错误类型

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

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

##### 2、估值错误处理原则

（1）估值错误已发生，但尚未给当事人造成损失时，估值错误责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正估值错误发生的费用由估值错误责任方承担；由于估值错误责任方未及时更正已产生的估值错误，给当事人造成损失的，由估值错误责任方对直接损失承担赔偿责任；若估值错误责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间

进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责任。估值错误责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保估值错误已得到更正。

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

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

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

### 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

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

### 4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

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

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

(3) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

### (六) 暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

3、当前一估值日基金资产净值 50% 以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商一致的；

4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

### （七）基金净值的确认

用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的基金资产净值和基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金净值予以公布。

## 七、基金合同变更、终止与基金财产的清算

### （一）《基金合同》的变更

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

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议经中国证监会备案生效后方可执行，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，《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、发起式基金基金合同生效三年后，若基金资产规模低于 2 亿元的，基金合同自动终止；
- 4、《基金合同》约定的其他情形；
- 5、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### （三）基金财产的清算

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

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

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

#### 4、基金财产清算程序：

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

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

(6) 将清算报告报中国证监会备案并公告。

(7) 对基金财产进行分配；

5、基金财产清算的期限为 6 个月。

(四) 清算费用

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

(五) 基金财产清算剩余资产的分配

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

(六) 基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

(七) 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 八、争议的处理和适用的法律

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，任何一方均有权将争议提交上海国际经济贸易仲裁委员会（上海国际仲裁中心）并根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为上海。仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，仲裁费由败诉方承担。

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

《基金合同》受中国法律管辖。

## 九、基金合同存放地和投资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；投资者也可按工本费购买《基金合同》复制件或复印件，但内容应以《基金合同》正本为准。

## 十九、基金托管协议的内容摘要

### 一、基金托管协议当事人

#### （一）基金管理人

名称：前海开源基金管理有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市福田区深南大道7006号万科富春东方大厦22楼

邮政编码：518040

法定代表人：王兆华

成立日期：2013年1月23日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监许可[2012]1751号

组织形式：有限责任公司

注册资本：人民币2亿元

存续期间：持续经营

经营范围：基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务。

#### （二）基金托管人

名称：上海银行股份有限公司

注册地址：中国(上海)自由贸易试验区银城中路168号

办公地址：中国(上海)自由贸易试验区银城中路168号

邮政编码：200120

法定代表人：金煜

成立日期：1995年12月29日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监许可[2009]814号

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币78.05785亿元

存续期间：持续经营

经营范围：人民币存贷款等

### 二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

（一）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。《基金合同》明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种池，以便基金托管人运用相关技术系统，

对基金实际投资是否符合《基金合同》关于证券选择标准的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。

本基金的投资范围为：具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、中期票据、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规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。

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

本基金的配置比例为：本基金将基金资产的0%-95%投资于股票，将不低于5%的基金资产投资于债券等固定收益类品种，其中，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。股指期货的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

（二）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督：

（1）本基金将基金资产的0%-95%投资于股票；将不低于5%的基金资产投资于债券等固定收益类品种；

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

（3）本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的10%；

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

（5）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的3%；

（6）本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的10%；

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

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

（9）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的20%；

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

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

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

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

(14) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

(15) 一只基金持有一家公司发行的流通受限证券，其市值不得超过基金资产净值的百分之三；一只基金持有的所有流通受限证券，其市值不得超过基金资产净值的百分之十五；经基金管理人和基金托管人协商，可对以上比例进行调整；

(16) 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%；

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

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

(19) 本基金投资单只中期票据的额度不得超过其发行总额度的 10%，并且不得超过基金净值的 10%；

(20) 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%；

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

(22) 本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；本基金管理人应当按照中国金融期货交易所要求的内容、格式与时限向交易所报告所交易和持有的卖出期货合约情况、交易目的及对应的证券资产情况等；

(23) 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）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；

(24) 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%；

(25) 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。

本基金在开始进行股指期货投资之前，应与基金托管人就股指期货清算、估值、交割等事宜另行具体协商。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

如果法律法规对上述投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

除上述第（2）、（12）、（17）、（18）项外，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

（三）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对本托管协议第十五条第九款基金投资禁止行为进行监督。

（四）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的、经慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手名单，并约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金管理人应严格按照交易对手名单的范围在银行间债券市场选择交易对手。基金托管人监督基金管理人是否按事前提提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易。基金管理人可以每半年对银行间债券市场交易对手名单及结算方式进行更新，新名单确定前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。如基金管理人根据市场情况需要临时调整银行间债券市场交易对手名单及结算方式的，应向基金托管人说明理由，并在与交易对手发生交易前 3 个工作日内与基金托管人协商解决。

基金管理人负责对交易对手的资信控制，按银行间债券市场的交易规则进行交易，并负责解决因交易对手不履行合同而造成的纠纷及损失，基金托管人不承担由此造成的任何法律责任及损失。基金托管人根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督。如基金托管人事后发现基金管理人没有按照事先约定的交易对手或交易方式进行交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人，基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任。

（五）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金管理人投资流通受限证券进行监督。

基金管理人投资流通受限证券，应事先根据中国证监会相关规定，明确基金投资流通受限证券的比例，制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险

和操作风险等各种风险。基金托管人对基金管理人是否遵守相关制度、流动性风险处置预案以及相关投资额度和比例等的情况进行监督。

1. 本基金投资的受限证券须为经中国证监会批准的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。本基金不投资有锁定期但锁定期不明确的证券。

本基金投资的受限证券限于可由中国证券登记结算有限责任公司或中央国债登记结算有限责任公司负责登记和存管，并可在证券交易所或全国银行间债券市场交易的证券。

本基金投资的受限证券应保证登记存管在本基金名下，基金管理人负责相关工作的落实和协调，并确保基金托管人能够正常查询。因基金管理人原因产生的受限证券登记存管问题，造成基金托管人无法安全保管本基金资产的责任与损失，及因受限证券存管直接影响本基金安全的责任及损失，由基金管理人承担。

本基金投资受限证券，不得预付任何形式的保证金。

2. 基金管理人投资非公开发行股票，应制订流动性风险处置预案并经其董事会批准。风险处置预案应包括但不限于因投资受限证券需要解决的基金投资比例限制失调、基金流动性困难以及相关损失的应对解决措施，以及有关异常情况的处置。基金管理人应在首次投资流通受限证券前向基金托管人提供基金投资非公开发行股票相关流动性风险处置预案。

基金管理人对本基金投资受限证券的流动性风险负责，确保对相关风险采取积极有效的措施，在合理的时间内有效解决基金运作的流动性问题。如因基金巨额赎回或市场发生剧烈变动等原因而导致基金现金周转困难时，基金管理人应保证提供足额现金确保基金的支付结算，并承担所有损失。对本基金因投资受限证券导致的流动性风险，基金托管人不承担任何责任。如因基金管理人原因导致本基金出现损失致使基金托管人承担连带赔偿责任的，基金管理人应赔偿基金托管人由此遭受的损失。

3. 本基金投资非公开发行股票，基金管理人应至少于投资前三个工作日向基金托管人提交有关书面资料，并保证向基金托管人提供的有关资料真实、准确、完整。有关资料如有调整，基金管理人应及时提供调整后的资料。上述书面资料包括但不限于：

(1) 中国证监会批准发行非公开发行股票的批准文件。

(2) 非公开发行股票有关发行数量、发行价格、锁定期等发行资料。

(3) 非公开发行股票发行人与中国证券登记结算有限责任公司或中央国债登记结算有限责任公司签订的证券登记及服务协议。

(4) 基金拟认购的数量、价格、总成本、账面价值。

4. 基金管理人应在本基金投资非公开发行股票后两个交易日内，在中国证监会指定媒介披露所投资非公开发行股票的名称、数量、总成本、账面价值，以及总成本和账面价值占基金资产净值的比例、锁定期等信息。

本基金有关投资受限证券比例如违反有关限制规定，在合理期限内未能进行及时调整，基金管理人应在两个工作日内编制临时报告书，予以公告。

5. 基金托管人根据有关规定有权对基金管理人进行以下事项监督：

(1) 本基金投资受限证券时的法律法规遵守情况。

(2) 在基金投资受限证券管理工作方面有关制度、流动性风险处置预案的建立与完善情况。

(3) 有关比例限制的执行情况。

(4) 信息披露情况。

6. 相关法律法规对基金投资受限证券有新规定的，从其规定。

(六) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查。

(七) 基金托管人发现基金管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作违反法律法规、《基金合同》和本托管协议的规定，应及时以电话提醒或书面提示等方式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到书面通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函，就基金托管人的疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金托管人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

(八) 基金管理人应积极配合和协助基金托管人依照法律法规、《基金合同》和本托管协议对基金业务执行核查。对基金托管人发出的书面提示，基金管理人应在规定时间内答复并改正，或就基金托管人的疑义进行解释或举证；对基金托管人按照法律法规、《基金合同》和本托管协议的要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

(九) 若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、行政法规和其他有关规定，或者违反《基金合同》约定的，应当立即通知基金管理人，由此造成的损失由基金管理人承担。

(十) 基金托管人发现基金管理人重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。基金管理人无正当理由，拒绝、

阻挠对方根据本托管协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的，基金托管人应报告中国证监会。

### 三、基金管理人对基金托管人的业务核查

（一）基金管理人对基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

（二）基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、《基金合同》、本协议及其他有关规定时，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给基金管理人发出回函，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，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。

（三）基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金托管人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。基金托管人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经基金管理人提出警告仍不改正的，基金管理人应报告中国证监会。

### 四、基金财产的保管

#### （一）基金财产保管的原则

1. 基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。
2. 基金托管人应安全保管基金财产。
3. 基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户。
4. 基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立。
5. 基金托管人按照《基金合同》和本协议的约定保管基金财产，如有特殊情况双方可另行协商解决。基金托管人未经基金管理人的指令，不得自行运用、处分、分配本基金的任何资产（不包含基金托管人依据中国结算公司结算数据完成场内交易交收、托管资产开户银行扣收结算费和账户维护费等费用）。
6. 对于因为基金投资产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金账户的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金财产造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金财产的损失，基金托管人对此不承担任何责任。

7. 除依据法律法规和《基金合同》的规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

#### （二）基金募集期间及募集资金的验资

1. 基金募集期间募集的资金应存于基金管理人在基金托管人的营业机构开立的“基金募集专户”。该账户由基金管理人开立并管理。

2. 基金募集期满或基金停止募集时，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》等有关规定后，基金管理人应将属于基金财产的全部资金划入基金托管人开立的基金银行账户，同时在规定时间内，聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的 2 名或 2 名以上中国注册会计师签字方为有效。

3. 若基金募集期限届满，未能达到《基金合同》生效的条件，由基金管理人按规定办理退款等事宜，基金托管人应提供充分协助。

#### （三）基金银行账户的开立和管理

1. 基金托管人应负责本基金的资金账户的开设和管理。

2. 基金托管人在其营业机构开立基金的银行账户，并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。

3. 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任何其他银行账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

4. 基金银行账户的开立和管理应符合相关法律法规的有关规定。

5. 在符合法律法规规定的条件下，基金托管人可以通过基金托管人专用账户办理基金资产的支付。

#### （四）基金证券账户和结算备付金账户的开立和管理

1. 基金托管人在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司为基金开立基金托管人与基金联名的证券账户。

2. 基金证券账户的开立和使用，仅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未经对方同意擅自转让基金的任何证券账户，亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

3. 基金证券账户的开立和证券账户卡的保管由基金托管人负责，账户资产的管理和运用由基金管理人负责。

4. 基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户，并代表所托管的基金完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级法人清算工作，基金管理人应予以积极协助。结算备付金、结算互保基金、交收价差资金等的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

5. 若中国证监会或其他监管机构在本托管协议订立日之后允许基金从事其他投资品种的投资业务，涉及相关账户的开立、使用的，按有关规定开设、使用并管理；若无相关规定，则基金托管人比照上述关于账户开立、使用的规定执行。

（五）债券托管专户的开设和管理

《基金合同》生效后，基金托管人根据中国人民银行、银行间市场登记结算机构的有关规定，以基金的名义在银行间市场登记结算机构开立债券托管账户，持有人账户和资金结算账户，并代表基金进行银行间市场债券的结算。基金管理人和基金托管人共同代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议。

（六）其他账户的开立和管理

1. 因业务发展需要而开立的其他账户，可以根据法律法规和《基金合同》的规定，由基金托管人负责开立。新账户按有关规定使用并管理。

2. 法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

（七）基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的有关实物证券、银行存款开户证实书等有价凭证由基金托管人存放于基金托管人的保管库，也可存入中央国债登记结算有限责任公司、中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司或票据营业中心的代保管库，保管凭证由基金托管人持有。有价凭证的购买和转让，由基金管理人和基金托管人共同办理。属于基金托管人实际有效控制下的实物证券在基金托管人保管期间的损坏、灭失，由此产生的责任应由基金托管人承担。基金托管人对由基金托管人以外机构实际有效控制的资产不承担保管责任。

（八）与基金财产有关的重大合同的保管

与基金财产有关的重大合同的签署，由基金管理人负责。由基金管理人代表基金签署的、与基金财产有关的重大合同的原件分别由基金管理人、基金托管人保管。除本协议另有规定外，基金管理人代表基金签署的与基金财产有关的重大合同包括但不限于基金年度审计合同、基金信息披露协议及基金投资业务中产生的重大合同，基金管理人应保证基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。重大合同的保管期限为《基金合同》终止后 15 年。

## 五、基金资产净值计算和会计核算

（一）基金资产净值的计算、复核与完成的时间及程序

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

每个工作日计算基金资产净值及两类基金份额净值，并按规定公告。

2. 基金管理人应每个工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或本基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

## （二）基金资产估值方法和特殊情形的处理

### 1. 估值对象

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

### 2. 估值方法

#### （1）证券交易所上市的有价证券的估值

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

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

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

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

#### （2）处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

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

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

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

（4）同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

（5）股票指数期货合约估值方法

本基金投资股指期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

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

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

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

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

（三）基金份额净值错误的处理方式

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后3位以内（含第3位）发生估值错误时，视为基金份额净值错误。

本基金合同的当事人应按照以下约定处理：

1. 估值错误类型

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

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

2. 估值错误处理原则

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

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

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

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

### 3. 估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

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

### 4. 基金份额净值估值错误处理的方法如下：

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

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

(3) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

#### (四) 暂停估值与公告基金份额净值的情形

1. 基金投资所涉及的证券市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2. 因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

3. 当前一估值日基金资产净值 50% 以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商一致的；

4. 中国证监会和基金合同认定的其它情形。

#### (五) 基金会计制度

按国家有关部门规定的会计制度执行。

#### （六）基金账册的建立

基金管理人进行基金会计核算并编制基金财务会计报告。基金管理人独立地设置、记录和保管本基金的全套账册。若基金管理人和基金托管人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。若当日核对不符，暂时无法查找到错账的原因而影响到基金资产净值的计算和公告的，以基金管理人的账册为准。

#### （七）基金财务报表与报告的编制和复核

##### 1. 财务报表的编制

基金财务报表由基金管理人编制，基金托管人复核。

##### 2. 报表复核

基金托管人在收到基金管理人编制的基金财务报表后，进行独立的复核。核对不符时，应及时通知基金管理人共同查出原因，进行调整，直至双方数据完全一致。

##### 3. 财务报表的编制与复核时间安排

###### （1）报表的编制

基金管理人应当在每月结束后 5 个工作日内完成月度报表的编制；在每个季度结束之日起 15 个工作日内完成基金季度报告的编制；在上半年结束之日起 60 日内完成基金半年度报告的编制；在每年结束之日起 90 日内完成基金年度报告的编制。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。《基金合同》生效不足两个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。

###### （2）报表的复核

基金管理人应及时完成报表编制，将有关报表提供基金托管人复核；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，调整以国家有关规定为准。

基金管理人应留足充分的时间，便于基金托管人复核相关报表及报告。

（八）基金管理人应在编制季度报告、半年度报告或者年度报告之前及时向基金托管人提供基金业绩比较基准的基础数据和编制结果。

### 六、基金份额持有人名册的登记与保管

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注册登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，基金管理人和基金托管人应分别保管基金份额持有人名册，保存期不少于 15 年。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半年报和年报前，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、争议解决方式

因本协议产生或与之相关的争议，双方当事人应通过协商、调解解决，协商、调解不能解决的，任何一方均有权将争议提交上海国际经济贸易仲裁委员会（上海国际仲裁中心）并根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为上海。仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，仲裁费由败诉方承担。

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

本协议受中国法律管辖。

## 八、托管协议的变更、终止与基金财产的清算

### （一）托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行修改。修改后的新协议，其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突。基金托管协议的变更报中国证监会核准或备案后生效。

### （二）基金托管协议终止出现的情形

1. 《基金合同》终止；
2. 基金托管人解散、依法被撤销、破产或由其他基金托管人接管基金资产；
3. 基金管理人解散、依法被撤销、破产或由其他基金管理人接管基金管理权；
4. 发生法律法规、中国证监会或《基金合同》规定的终止事项。

### （三）基金财产的清算

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

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

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

#### 4. 基金财产清算程序：

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

5. 基金财产清算的期限为 6 个月。

6. 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。

7. 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。

8. 基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计、并由律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

9. 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 二十、对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金投资人提供一系列的客户服务。基金管理人将根据基金投资人的需要和市场的变化，增加或变更服务项目。主要服务内容如下：

### （一）短信、邮件信息发送服务

基金管理人为基金投资人提供手机短信和电子邮件的信息定制服务，基金投资人可根据需要，通过基金管理人客服热线或官方网站订制、修改或取消该服务。

1、手机短信服务可提供的定制内容包括基金净值、基金交易确认、分红确认、月末账户余额等信息。

2、电子邮件服务可提供的定制内容包括基金净值、基金交易确认、分红确认、月末账户余额等信息。

3、除发送基金投资人定制的上述信息外，基金管理人会不定期向留有手机号码和电子邮箱地址的基金投资人发送节日及生日问候、产品推广等信息。若基金投资人不需要接收到该类信息，可通过基金管理人客服热线取消该项服务。

4、手机短信依托于外部通讯服务商发送，电子邮件通过互联网进行信息传送，基金管理人根据服务规则发送相关信息，但不对信息的送达做出承诺和保证。

### （二）客户服务中心（CALL-CENTER）电话服务

呼叫中心人工座席每个交易日（8：30-17：00）为基金投资人提供服务，客服热线服务内容包括业务咨询、信息查询、服务投诉、信息定制、资料修改等专项服务。

客服热线：4001-666-998

### （三）电子查询服务

基金投资人可通过基金管理人电子查询系统（网上查询系统、微信查询系统和APP查询系统）完成基金账户的查询业务。

官方网站：[www.qhkyfund.com](http://www.qhkyfund.com)

官方微信号：qhkyfund

### （四）投诉受理服务

基金投资人可以拨打基金管理人客服热线或以书信、电子邮件等方式，对基金管理人和销售网点所提供的服务进行投诉。

对于工作日期间受理的投诉，以“及时回复”为处理原则，对于不能及时回复的投诉，基金管理人承诺在3个工作日之内对基金投资人的投诉做出回复。对于非工作日提出的投诉，基金管理人将在顺延到下1个工作日进行回复。

客服邮箱：service@qhkyfund.com

#### （五）电子直销交易系统开户与交易服务

基金投资人可以登录基金管理人电子直销交易系统（网上交易系统、微信交易系统和APP交易系统）进行开户与交易。适用业务范围包括：基金账户开户、认购、申购、赎回、账户资料变更、分红方式变更、信息查询等业务。电子直销交易业务规则以公告为准。

#### （六）定期投资计划

基金管理人将利用直销网点或其他销售网点为基金投资人提供定期投资的服务。通过定期投资计划，基金投资人可以通过相关渠道，定期申购基金份额。定期投资计划业务规则以公告为准。

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

## 二十一、其他应披露事项

（一）前海开源基金管理有限公司（以下简称“本公司”）的从业人员在前海开源资产管理股份有限公司（以下简称“前海开源资管公司”或“子公司”）兼任董事、监事及领薪情况如下：

本公司谢劲松先生兼任前海开源资管公司董事长；

本公司督察长傅成斌先生兼任前海开源资管公司董事；

本公司汤力女士兼任前海开源资管公司监事；

上述人员均不在前海开源资管公司领薪。本公司除上述人员以外未有从业人员在前海开源资管公司兼任职务的情况。

（二）2020年01月21日至2021年01月22日披露的公告：

2021-01-22 前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金 2020 年第 4 季度报告
2021-01-22 前海开源基金管理有限公司旗下部分基金 2020 年第四季度报告提示性公告
2021-01-15 前海开源基金管理有限公司关于暂停北京晟视天下基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告
2021-01-15 前海开源基金管理有限公司关于暂停北京恒宇天泽基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告
2020-12-31 前海开源基金管理有限公司关于终止与部分代销机构合作关系的公告
2020-12-09 前海开源基金管理有限公司关于终止北京电盈基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告
2020-11-05 前海开源基金管理有限公司关于终止大泰金石基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告
2020-10-28 前海开源基金管理有限公司旗下部分基金 2020 年第三季度报告提示性公告
2020-10-28 前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金 2020 年第 3 季度报告
2020-08-27 前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新
2020-09-05 前海开源基金管理有限公司关于终止深圳信诚基金销售有限公司代理旗下基金相关销售业务的公告
2020-08-31 前海开源基金管理有限公司旗下部分基金 2020 年中期报告提示性公告
2020-08-31 前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金 2020 年中期报告
2020-07-21 前海开源基金管理有限公司旗下部分基金 2020 年第二季度报告提示性公告
2020-07-21 前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金 2020 年第 2 季度报告
2020-05-28 前海开源基金管理有限公司关于暂停扬州国信嘉利基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告

2020-05-06 前海开源基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加万联证券费率优惠的公告
2020-04-25 前海开源基金管理有限公司旗下部分基金 2019 年年度报告提示性公告
2020-04-25 前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金 2019 年年度报告
2020-04-22 前海开源基金管理有限公司旗下部分基金 2020 年第一季度报告提示性公告
2020-04-22 前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金 2020 年第 1 季度报告
2020-03-30 前海开源基金管理有限公司关于终止泰诚财富基金销售（大连）有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告
2020-03-24 关于调整前海开源旗下部分证券投资基金通过安信证券办理定投业务起点金额的公告
2020-03-24 前海开源基金管理有限公司关于推迟披露旗下基金 2019 年年度报告的公告
2020-03-20 前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书摘要（20200320 更新）
2020-03-17 前海开源基金管理有限公司关于调整旗下部分证券投资基金通过奕丰基金办理业务最低限额的公告
2020-03-04 前海开源基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加海通证券费率优惠的公告
2020-03-03 关于调整前海开源旗下部分证券投资基金通过珠海盈米基金销售有限公司办理定投业务起点金额的公告
2020-01-21 前海开源基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加一路财富费率优惠的公告

## 二十二、招募说明书的存放及查阅方式

本招募说明书按相关法律法规，存放在基金管理人、基金销售机构等的办公场所，投资人可在办公时间免费查阅；也可在支付工本费后在合理时间内获取本招募说明书复制件或复印件，但应以招募说明书正本为准。投资人也可以直接登录基金管理人的网站进行查阅。

基金管理人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

## 二十三、备查文件

### （一）备查文件包括：

1、中国证监会准予注册前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金募集的文件

2、《前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》

3、《前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议》

4、法律意见书

5、基金管理人业务资格批件、营业执照

6、基金托管人业务资格批件、营业执照

### （二）备查文件的存放地点和投资人查阅方式：

1、存放地点：《基金合同》、《托管协议》存放在基金管理人和基金托管人处；其余备查文件存放在基金管理人处。

2、查阅方式：投资人可在营业时间免费到存放地点查阅，也可按工本费购买复印件。

前海开源基金管理有限公司

2021年03月12日