

# 嘉实基础产业优选股票型证券投资基金更 新招募说明书

(2021年04月13日更新)

**基金管理人：嘉实基金管理有限公司**

**基金托管人：中国建设银行股份有限公司**

## 重要提示

嘉实基础产业优选股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会 2019 年 9 月 30 日证监许可[2019] 1825 号《关于准予嘉实基础产业优选股票型证券投资基金注册的批复》注册募集。本基金的基金合同于 2020 年 4 月 15 日正式生效，自该日起本基金管理人开始管理本基金。

本招募说明书是对原《嘉实基础产业优选股票型证券投资基金招募说明书》的更新，原招募说明书与本招募说明书不一致的，以本招募说明书为准。基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值和市场前景作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

证券投资基金（以下简称“基金”）是一种长期投资工具，其主要功能是分散投资，降低投资单一证券所带来的个别风险。基金不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具，投资者购买基金，既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益，也可能承担基金投资所带来的损失。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险、本基金的特有风险等等。

本基金为股票型证券投资基金，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金将投资港股通标的股票，将承担汇率风险以及因投资环境、投资标的、市场制度、交易规则差异等带来的境外市场的风险。

本基金投资相关股票市场交易互联互通机制试点允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）的，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险（港股市场实行 T+0 回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股估价可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对基金的投资收益造成损失）、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险（在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险）等。

本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与中国存托凭证发行机制相关的风险。

本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股，基金资产并非必然投资港股。

投资者在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的招募说明书、基金合同和基金产品资料概要，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策。

投资者应当通过本基金管理人或代销机构购买和赎回基金。本基金在募集期内按 1 元面值发售并不改变基金的风险收益特征。投资者按 1 元面值购买基金份额以后，有可能面临基金份额净值跌破 1 元、从而遭受损失的风险。

本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。

本基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。

本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为 2021 年 3 月 16 日，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），特别事项注明除外。

## 目录

一、绪言.....	4
二、释义.....	5
三、基金管理人.....	9
四、基金托管人.....	19
五、相关服务机构.....	21
六、基金的募集.....	38
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.....	57
十、基金的业绩.....	69
十一、基金的财产.....	71
十二、基金资产的估值.....	72
十三、基金的收益与分配.....	77
十四、基金的费用与税收.....	78
十五、基金的会计与审计.....	80
十六、基金的信息披露.....	81
十七、风险揭示.....	87
十八、基金合同的变更、终止和基金财产的清算.....	94
十九、基金合同的内容摘要.....	96
二十、基金托管协议的内容摘要.....	109
二十一、对基金份额持有人的服务.....	125
二十二、其他应披露事项.....	127
二十三、招募说明书存放及查阅方式.....	129
二十四、备查文件.....	130

## 一、绪言

《嘉实基础产业优选股票型证券投资基金更新招募说明书》（以下简称“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》”）、《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运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）、《证券投资基金信息披露编报规则第5号〈招募说明书的内容与格式〉》等有关法律法规以及《嘉实基础产业优选股票型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

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

本招募说明书根据本基金的基金合同编写，并经中国证监会注册。基金合同是约定基金合同当事人之间基本权利义务的法律文件，其他与本基金相关的涉及基金合同当事人之间权利义务关系的任何文件或表述，均以基金合同为准。基金合同的当事人包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人。基金投资者自依基金合同取得本基金基金份额，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。基金份额持有人作为基金合同当事人并不以在基金合同上书面签章为必要条件。基金合同当事人按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

## 二、释义

本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

- 1、基金/本基金：指嘉实基础产业优选股票型证券投资基金
- 2、基金管理人：指嘉实基金管理有限公司
- 3、基金托管人：指中国建设银行股份有限公司
- 4、基金合同/基金合同/《基金合同》：指《嘉实基础产业优选股票型证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充
- 5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《嘉实基础产业优选股票型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
- 6、招募说明书：指《嘉实基础产业优选股票型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《嘉实基础产业优选股票型证券投资基金基金份额发售公告》
- 8、基金产品资料概要：指《嘉实基础产业优选股票型证券投资基金基金产品资料概要》及其更新
- 9、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等以及颁布机关对其不时做出的修订
- 10、《基金法》：指2003年10月28日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，经2012年12月28日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自2013年6月1日起实施，并经2015年4月24日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修正的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 11、《销售办法》：指中国证监会2013年3月15日颁布、同年6月1日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 12、《信息披露办法》：指中国证监会2019年7月26日颁布、同年9月1日实施的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 13、《运作办法》：指中国证监会2014年7月7日颁布、同年8月8日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 14、《流动性风险管理规定》：指中国证监会2017年8月31日颁布、同年10月1日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订
- 15、港股通：指内地投资者经由内地证券交易所设立的证券交易服务公司，向香港联合交易所进行申报，买卖规定范围内的香港联合交易所上市的股票的交易机制，或有权机构对该交易机制的修改或调整

- 16、中国证监会：指中国证券监督管理委员会
- 17、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行保险监督管理委员会
- 18、基金合同当事人：指受基金合同约束，根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人
- 19、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人
- 20、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
- 21、合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》及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
- 22、人民币合格境外机构投资者：指按照《人民币合格境外机构投资者境内证券投资试点办法》及相关法律法规规定，运用来自境外的人民币资金进行境内证券投资的境外法人
- 23、投资人/投资者：指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称
- 24、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
- 25、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务
- 26、销售机构：指嘉实基金管理有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务协议，办理基金销售业务的机构
- 27、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
- 28、登记机构：指办理登记业务的机构。本基金的登记机构为嘉实基金管理有限公司或接受嘉实基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构
- 29、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
- 30、基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构办理认购、申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务而引起基金份额变动及结余情况的账户
- 31、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
- 32、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

33、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

34、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

35、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

36、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

37、T+n日：指自T日起第n个工作日（不包含T日）

38、交易日：在内地、香港两地均为交易日且能够满足结算安排、开通港股通交易的交易日。具体交易日安排，由两地证券交易所、证券交易服务公司对市场公布

39、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（若该工作日为非港股通交易日，则本基金不开放基金份额申购、赎回或其他业务）

40、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

41、《业务规则》：指《嘉实基金管理有限公司开放式基金业务规则》，是由基金管理人制定并不时修订，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

42、认购：指在基金募集期内，投资人根据基金合同、招募说明书及相关公告的规定申请购买基金份额的行为

43、申购：指基金合同生效后，投资人根据基金合同、招募说明书及相关公告的规定申请购买基金份额的行为

44、赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同、招募说明书及相关公告规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为

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

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

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

48、巨额赎回：指本基金单个开放日，基金净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一工作日基金总份额的10%

49、元：指人民币元

50、基金收益：指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约

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

52、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

53、基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

54、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

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

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

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

58、不可抗力：指基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

59、基金份额类别：本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同类别。各类基金份额分别设置基金代码，合并投资运作，分别计算和公布基金份额净值和基金份额累计净值

A类基金份额：在投资人认购/申购基金份额时收取认购/申购费用，并不再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

C类基金份额：从本类别基金资产中计提销售服务费，且不收取认购/申购费用的基金份额，称为C类基金份额

60、销售服务费：指从相应类别基金份额的基金资产中计提的，用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务的费用



### 三、基金管理人

#### （一）基金管理人基本情况

##### 1、基本信息

名称	嘉实基金管理有限公司
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心二期27楼09-14单元
办公地址	北京市朝阳区建国门外大街21号北京国际俱乐部C座写字楼12A层
法定代表人	经雷
成立日期	1999年3月25日
注册资本	1.5亿元
股权结构	中诚信托有限责任公司40%，DWS Investments Singapore Limited 30%，立信投资有限责任公司30%。
存续期间	持续经营
电话	(010) 65215588
传真	(010) 65185678
联系人	胡勇钦

嘉实基金管理有限公司经中国证监会证监基字[1999]5号文批准，于1999年3月25日成立，是中国第一批基金管理公司之一，是中外合资基金管理公司。公司注册地上海，总部设在北京并设北京、深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州、北京怀柔、武汉分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人、QDII资格和特定资产管理业务资格。

##### 2、管理基金情况

截止2020年12月31日，基金管理人共管理205只开放式证券投资基金，具体包括嘉实成长收益混合、嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券、嘉实服务增值行业混合、嘉实优质企业混合、嘉实货币、嘉实沪深300ETF联接（LOF）、嘉实超短债债券、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实海外中国股票混合（QDII）、嘉实研究精选混合、嘉实多元债券、嘉实量化阿尔法混合、嘉实回报混合、嘉实基本面50指数（LOF）、嘉实稳固收益债券、嘉实价值优势混合、嘉实H股指数（QDII-LOF）、嘉实主题新动力混合、嘉实领先成长混合、

嘉实深证基本面 120ETF、嘉实深证基本面 120ETF 联接、嘉实黄金（QDII-FOF-LOF）、嘉实信用债券、嘉实周期优选混合、嘉实安心货币、嘉实中创 400ETF、嘉实中创 400ETF 联接、嘉实沪深 300ETF、嘉实优化红利混合、嘉实全球房地产（QDII）、嘉实理财宝 7 天债券、嘉实纯债债券、嘉实中证 500ETF、嘉实增强信用定期债券、嘉实中证 500ETF 联接、嘉实中证中期国债 ETF、嘉实中证金边中期国债 ETF 联接、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实研究阿尔法股票、嘉实如意宝定期债券、嘉实美国成长股票（QDII）、嘉实丰益策略定期债券、嘉实新兴市场债券、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实宝 A/B、嘉实活期宝货币、嘉实活钱包货币、嘉实泰和混合、嘉实薪金宝货币、嘉实对冲套利定期混合、嘉实中证主要消费 ETF、嘉实中证医药卫生 ETF、嘉实中证金融地产 ETF、嘉实 3 个月理财债券 A/E、嘉实医疗保健股票、嘉实新兴产业股票、嘉实新收益混合、嘉实沪深 300 指数研究增强、嘉实逆向策略股票、嘉实企业变革股票、嘉实新消费股票、嘉实全球互联网股票、嘉实先进制造股票、嘉实事件驱动股票、嘉实快线货币、嘉实低价策略股票、嘉实中证金融地产 ETF 联接、嘉实新起点混合、嘉实腾讯自选股大数据策略股票、嘉实环保低碳股票、嘉实创新成长混合、嘉实智能汽车股票、嘉实新起航混合、嘉实新财富混合、嘉实稳祥纯债债券、嘉实稳瑞纯债债券、嘉实新优选混合、嘉实新趋势混合、嘉实新思路混合、嘉实沪港深精选股票、嘉实稳盛债券、嘉实稳鑫纯债债券、嘉实安益混合、嘉实文体娱乐股票、嘉实稳泽纯债债券、嘉实惠泽混合（LOF）、嘉实成长增强混合、嘉实策略优选混合、嘉实研究增强混合、嘉实优势成长混合、嘉实稳荣债券、嘉实农业产业股票、嘉实现金宝货币、嘉实增益宝货币、嘉实物流产业股票、嘉实丰安 6 个月定期债券、嘉实稳元纯债债券、嘉实新能源新材料股票、嘉实稳熙纯债债券、嘉实丰和灵活配置混合、嘉实新添华定期混合、嘉实现金添利货币、嘉实沪港深回报混合、嘉实原油（QDII-LOF）、嘉实前沿科技沪港深股票、嘉实稳宏债券、嘉实中关村 A 股 ETF、嘉实稳华纯债债券、嘉实 6 个月理财债券、嘉实稳怡债券、嘉实富时中国 A50ETF 联接、嘉实富时中国 A50ETF、嘉实中小企业量化活力灵活配置混合、嘉实创业板 ETF、嘉实新添泽定期混合、嘉实新添丰定期混合、嘉实新添辉定期混合、嘉实领航资产配置混合（FOF）、嘉实价值精选股票、嘉实医药健康股票、嘉实润泽量化定期混合、嘉实核心优势股票、嘉实润和量化定期混合、嘉实金融精选股票、嘉实新添荣定期混合、嘉实致兴定期纯债债券、嘉实战略配售混合、嘉实瑞享定期混合、嘉实新添康定期混合、嘉实资源精选股票、嘉实致盈债券、嘉实恒生港股通新经济指数（LOF）、嘉实中短债债券、嘉实致享纯债债券、嘉实互通精选股票、嘉实互融精选股票、嘉实养老 2040 混合（FOF）、嘉实消费精选股票、嘉实新添元定期混合、嘉实中债 1-3 政金债指数、嘉实养老 2050 混合（FOF）、嘉实长青竞争优势股票、嘉实科技创新混合、嘉实基本面 50ETF、嘉实稳联纯债债券、嘉实汇达中短债债券、嘉实养老 2030 混合（FOF）、嘉实致元 42 个月定期债券、嘉实沪深 300 红利低波动 ETF、嘉实新添益定期混合、嘉实融享货币、嘉实瑞虹三年定期混合、嘉实价值成长混合、嘉实央企创新驱动 ETF、嘉实新兴科技 100ETF、嘉实致安 3 个月

定期债券、嘉实汇鑫中短债债券、嘉实新兴科技 100ETF 联接、嘉实致华纯债债券、嘉实商业银行精选债券、嘉实央企创新驱动 ETF 联接、嘉实致禄 3 个月定期纯债债券、嘉实民企精选一年定期债券、嘉实先进制造 100 ETF、嘉实沪深 300 红利低波动 ETF 联接、嘉实安元 39 个月定期纯债债券、嘉实中债 3-5 年国开债指数、嘉实鑫和一年持有期混合、嘉实致融一年定期债券、嘉实瑞熙三年封闭运作混合、嘉实中证 500 指数增强、嘉实回报精选股票、嘉实致宁 3 个月定开纯债债券、嘉实中证 500 成长估值 ETF、嘉实瑞和两年持有期混合、嘉实基础产业优选股票、嘉实中证主要消费 ETF 联接 A/C、嘉实医药健康 100ETF、嘉实稳福混合、嘉实瑞成两年持有期混合、嘉实致益纯债债券、嘉实精选平衡混合、嘉实致信一年定期纯债债券、嘉实致嘉纯债债券、嘉实产业先锋混合、嘉实远见精选两年持有期混合、嘉实致业一年定期纯债债券、嘉实安泽一年定期纯债债券、嘉实前沿创新混合、嘉实远见企业精选两年持有期混合、嘉实价值发现三个月定期混合、嘉实 H 股 50ETF(QDII)、嘉实浦惠 6 个月持有期混合、嘉实创新先锋混合、嘉实核心成长混合、嘉实彭博国开债 1-5 年指数、嘉实动力先锋混合、嘉实多利收益债券、嘉实稳惠 6 个月持有期混合、嘉实优质精选混合、嘉实稳骏纯债基金、嘉实价值长青混合。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合和嘉实债券属于嘉实理财通系列基金。同时，基金管理人还管理多个全国社保基金、企业年金、特定客户资产投资组合。

## （二） 主要人员情况

### 1、基金管理人董事、监事、总经理及其他高级管理人员基本情况

牛成立先生，联席董事长，经济学硕士，中共党员。曾任中国人民银行非银行金融机构监管司副处长、处长；中国银行厦门分行党委委员、副行长（挂职）；中国银行业监督管理委员会（下称银监会）非银行金融机构监管部处长；银监会新疆监管局党委委员、副局长；银监会银行监管四部副主任；银监会黑龙江监管局党委书记、局长；银监会融资性担保业务工作部（融资性担保业务监管部际联席会议办公室）主任；中诚信托有限责任公司党委委员、总裁。现任中诚信托有限责任公司党委书记、董事长，兼任中国信托业保障基金有限责任公司董事。

赵学军先生，董事长，党委书记，经济学博士。曾就职于天津通信广播公司电视设计所、外经贸部中国仪器进出口总公司、北京商品交易所、天津纺织原材料交易所、商鼎期货经纪有限公司、北京证券有限公司、大成基金管理有限公司。2000 年 10 月至 2017 年 12 月任嘉实基金管理有限公司董事、总经理，2017 年 12 月起任公司董事长。

朱蕾女士，董事，硕士研究生，中共党员。曾任保监会财会部资金运用处主任科员；国都证券有限责任公司研究部高级经理；中欧基金管理有限公司董秘兼发展战略官。现任

中诚信托有限责任公司业务总监兼国际业务部总经理，兼任中诚国际资本有限公司总经理、中诚宝捷思货币经纪有限公司董事长及法人代表。

Mark H. Cullen 先生，董事，澳大利亚籍，澳大利亚莫纳什大学经济政治专业学士。曾任达灵顿商品(Darlington Commodities)商品交易主管，贝恩(Bain&Company)期货与商品部负责人，德意志银行（纽约）全球股票投资部首席运营官、MD，德意志资产管理（纽约）全球首席运营官、MD，德意志银行（伦敦）首席运营官，德意志银行全球审计主管。现任 DWS Management GmbH 执行董事、全球首席运营官。

Holger Wilhelm Naumann 先生，董事，德国籍。曾任 DWS Investment GmbH 子公司管理、业务发展、业务区域控制欧洲负责人，DWS 资产管理（德国）管委会成员、COO，DWS 资产管理（欧洲）COO，RREEF Management GmbH RREEF 德国负责人，DWS 全球 COO，德意志资产管理全球 COO，DWS 管理委员会成员、亚太区负责人，现任 DWS Investments Hong Kong Limited 董事会主席、亚太区负责人。

韩家乐先生，董事，1990年毕业于清华大学经济管理学院，硕士研究生。1990年2月至2000年5月任海问证券投资咨询有限公司总经理；1994年至今，任北京德恒有限责任公司总经理；2001年11月至今，任立信投资有限责任公司董事长。

王巍先生，独立董事，美国福特姆大学文理学院国际金融专业博士。曾任职于中国建设银行辽宁分行。曾任中国银行总行国际金融研究所助理研究员，美国化学银行分析师，美国世界银行顾问，中国南方证券有限公司副总裁，万盟投资管理有限公司董事长。2004年至今任万盟并购集团董事长。

汤欣先生，独立董事，中共党员，法学博士，清华大学法学院教授、清华大学商法研究中心副主任、《清华法学》副主编，汤姆森路透集团“中国商法”丛书编辑咨询委员会成员。曾兼任中国证券监督管理委员会第一、二届并购重组审核委员会委员，现兼任上海证券交易所上市委员会委员、中国上市公司协会独立董事委员会首任主任。

王瑞华先生，独立董事，管理学博士，会计学教授，注册会计师，中共党员。曾任中央财经大学财务会计教研室主任、研究生部副主任、商学院院长兼 MBA 教育中心主任。现任中央财经大学商学院教授。

经雷先生，董事、总经理，金融学、会计学专业本科学历，工商管理学学士学位，特许金融分析师（CFA）。1998年到2008年在美国国际集团（AIG）国际投资公司美国纽约总部担任研究投资工作。2008年到2013年历任友邦保险中国区资产管理中心副总监，首席投资总监及资产管理中心负责人。2013年10月至今就职于嘉实基金管理有限公司，历任董事总经理（MD）、机构投资和固定收益业务首席投资官；2018年3月起任公司总经理。

袁管华先生，监事长，博士研究生，中共党员。曾任中国人民银行外资金融机构管理司副处长、银行监管一司处长；中国银监会财务会计部处长，江西监管局副局长、党委委

员；中国银监会财务会计部正局级巡视员；中诚信托有限责任公司第四届监事会副监事长。现任中诚信托有限责任公司副监事长。

穆群先生，监事，经济师，硕士研究生。曾任西安电子科技大学助教，长安信息产业（集团）股份有限公司董事会秘书，北京德恒有限责任公司财务主管。2001年11月至今任立信投资有限公司财务总监。

曾宪政先生，监事，法学硕士。1999年7月至2003年10月就职于首钢集团，2003年10月至2008年6月，为国浩律师集团（北京）事务所证券部律师。2008年7月至今，就职于嘉实基金管理有限公司法律稽核部、法律部，现任基金法务组总监。

罗丽丽女士，监事，经济学硕士。2000年7月至2004年8月任北京兆维科技股份有限公司证券事务代表，2004年9月至2006年1月任平泰人寿保险股份有限公司（筹）法律事务主管，2006年2月至2007年10月任上海浦东发展银行北京分行法务经理，2007年10月至2010年12月任工银瑞信基金管理有限公司法律合规经理。2010年12月加入嘉实基金管理有限公司，曾任稽核部执行总监，现任基金运营总监。

郭松先生，督察长，硕士研究生。曾任职于国家外汇管理局、中汇储投资有限责任公司、国新国际投资有限公司。2019年12月加入嘉实基金管理有限公司，现任公司督察长。

郭杰先生，机构首席投资官，硕士研究生。曾任职于富国基金管理有限公司、汇添富基金管理股份有限公司、海富通基金管理有限公司。2012年5月加入嘉实基金管理有限公司，历任部门总监、策略组组长，现任公司机构首席投资官。

## 2、基金经理

### （1）现任基金经理

肖觅先生，管理学硕士，11年证券从业经历，具有基金从业资格。2009年7月加入嘉实基金管理有限公司任职于研究部，先后任钢铁行业、交通运输行业研究员等职位，现任研究部副总监。2018年3月9日至2019年12月24日任嘉实惠泽灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金经理、2016年12月29日至今任嘉实物流产业股票型证券投资基金基金经理、2020年4月15日至今任嘉实基础产业优选股票型证券投资基金基金经理、2020年6月5日至今任嘉实周期优选混合型证券投资基金基金经理、2020年7月21日至今任嘉实资源精选股票型发起式证券投资基金基金经理。

### （2）历任基金经理

本基金无历任基金经理。

## 3、股票投资决策委员会

股票投资决策委员会的成员包括：公司董事长赵学军先生，公司总经理经雷先生，主基金经理邵健先生，机构业务 CIO 郭杰先生，主基金经理归凯先生、胡涛先生、谭丽女士、张金涛先生、洪流先生，主基金经理兼研究部总监张丹华先生。

4、上述人员之间均不存在近亲属关系。

### （三）基金管理人的职责

- 1、依法募集基金，办理或者委托经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、转换和登记事宜；
- 2、办理基金备案手续；
- 3、对所管理的不同基金资产分别管理、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和基金份额累计净值，确定基金份额申购、赎回价格；
- 8、办理与基金资产管理业务活动有关的信息披露事项；
- 9、召集基金份额持有人大会；
- 10、保存基金资产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- 11、以基金管理人名义，代表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、有关法律法规和中国证监会规定的其他职责。

### （四）基金管理人的承诺

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

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

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

3、本基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不得将基金资产用于以下投资或活动：

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

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先的原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上（含三分之二）的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

#### 4、基金经理承诺

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

#### 1、内部控制制度概述

为加强内部控制，防范和化解风险，促进公司诚信、合法、有效经营，保障基金份额持有人利益，根据《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》并结合公司具体情况，公司已建立健全内部控制体系和内部控制制度。

公司内部控制制度由内部控制大纲、基本管理制度、部门业务规章等部分组成。公司内部控制大纲是对公司章程规定的内控原则的细化和展开，是各项基本管理制度的纲要和总揽。基本管理制度包括投资管理、信息披露、信息技术管理、公司财务管理、基金会计、人力资源管理、资料档案管理、业绩评估考核、合规管理和风险控制、紧急应变等制度。部门业务规章是对各部门的主要职责、岗位设置、岗位职责、操作守则等具体说明。

#### 2、内部控制的原则

（1）健全性原则：内部控制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、部门和岗位在职能上必须保持相对独立；

（4）相互制约原则：组织结构体现职责明确、相互制约的原则，各部门有明确的授权分工，操作相互独立；

（5）成本效益原则：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。

### 3、内部控制组织体系

（1）公司董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任。董事会下设审计与合规委员会，负责检查公司内部管理制度的合法合规性及内控制度的执行情况，充分发挥独立董事监督职能，保护投资者利益和公司合法权益。

（2）股票投资决策委员会为公司投资管理的最高决策机构，由总经理、总监及资深基金经理组成，负责指导基金资产的运作、确定基本的投资策略和投资组合的原则。

（3）风险控制委员会为公司风险管理的最高决策机构，由公司总经理、督察长及相关总监组成，负责全面评估公司经营管理过程中的各项风险，并提出防范化解措施。

（4）督察长积极对公司各项制度、业务的合法合规性及公司内部控制制度的执行情况进行监察、稽核，定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况。

（5）合规管理部门：公司管理层重视和支持合规风控工作，并保证合规管理部门的独立性和权威性，配备了充足合格的合规风控人员，明确合规管理部门及其各岗位的职责和 workflows、组织纪律。合规管理部门具体负责公司各项制度、业务的合法合规性及公司内部控制制度的执行情况的监控检查工作。

（6）业务部门：部门负责人为所在部门的风险控制第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控及时报告的义务。

（7）岗位员工：公司努力树立内控优先和风险管理理念，培养全体员工的风险防范意识，营造一个浓厚的内控文化氛围，保证全体员工及时了解国家法律法规和公司规章制度，使风险意识贯穿到公司各个部门、各个岗位和各个环节。员工在其岗位职责范围内承担相应的内控责任，并负有对岗位工作中发现的风险隐患或风险问题及时报告、反馈的义务。

### 4、内部控制措施

公司确立“制度上控制风险、技术上量化风险”，积极吸收或采用先进的风险控制技术和手段，进行内部控制和风险管理。

（1）公司逐步健全法人治理结构，充分发挥独立董事和监事会的监督职能，严禁不正当关联交易、利益输送和内部人控制现象的发生，保护投资者利益和公司合法权益。



(2) 公司设置的组织结构，充分体现职责明确、相互制约的原则，各部门均有明确的授权分工，操作相互独立。公司逐步建立决策科学、运营规范、管理高效的运行机制，包括民主、透明的决策程序和管理议事规则，高效、严谨的业务执行系统，以及健全、有效的内部监督和反馈系统。

(3) 公司设立了顺序递进、权责统一、严密有效的内控防线：

①各岗位职责明确，有详细的岗位说明书和业务流程，各岗位人员在上岗前均应知悉并以书面方式承诺遵守，在授权范围内承担责任；

②建立重要业务处理凭据传递和信息沟通制度，相关部门和岗位之间相互监督制衡。

(4) 公司建立有效的人力资源管理制度，健全激励约束机制，确保公司人员具备与岗位要求相适应的职业操守和专业胜任能力。

(5) 公司建立科学严密的风险评估体系，对公司内外部风险进行识别、评估和分析，及时防范和化解风险。

(6) 授权控制应当贯穿于公司经营活动的始终，授权控制的主要内容包括：

①股东会、董事会、监事会和管理层充分了解和履行各自的职权，建立健全公司授权标准和程序，确保授权制度的贯彻执行；

②公司各部门、分公司及员工在规定授权范围内行使相应的职责；

③重大业务授权采取书面形式，授权书应当明确授权内容和时效；

④对已获授权的部门和人员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。

(7) 建立完善的基金财务核算与基金资产估值系统和资产分离制度，基金资产与公司自有资产、其他委托资产以及不同基金的资产之间实行独立运作，分别核算，及时、准确和完整地反映基金资产的状况。

(8) 建立科学、严格的岗位分离制度，明确划分各岗位职责，投资和交易、交易和清算、基金会计和公司会计等重要岗位不得有人员重叠。投资、研究、交易、IT 等重要业务部门和岗位进行物理隔离。

(9) 建立和维护信息管理系统，严格信息管理，保证客户资料等信息安全、真实和完整。积极维护信息沟通渠道的畅通，建立清晰的报告系统，各级领导、部门及员工均有明确的报告途径。

(10) 建立和完善客户服务标准，加强基金销售管理，规范基金宣传推介，不得有不正当销售行为和不正当竞争行为。

(11) 制订切实有效的应急应变措施，建立危机处理机制和程序，对发生严重影响基金份额持有人利益、可能引起系统性风险、严重影响社会稳定的突发事件，按照预案妥善处理。

(12)公司建立健全内控制度，督察长、合规管理部门对公司内部控制制度的执行情况进行持续的监督，保证内部控制制度落实；定期评价内部控制的有效性并适时改进。

①对公司各项制度、业务的合法合规性进行监控核查，确保公司各项制度、业务符合有关法律、行政法规、部门规章及行业监管规则；

②对内部风险控制制度的持续监督。合规管理部门持续完善“风险责任授权体系”机制，组织相关业务部门、岗位共同识别风险点，界定风险责任人，确保所有识别出的关键风险点均有对应控制措施，及时防范和化解风险；

③督察长按照公司规定，向董事会、经营管理主要负责人报告公司经营管理的合法合规情况和合规管理工作开展情况。

#### 5、基金管理人关于内部控制的声明

(1)基金管理人承诺以上关于内部控制的披露真实、准确；

(2)基金管理人承诺根据市场变化和基金管理人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

#### （一）基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：田国立

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

联系人：李莉

联系电话：(021)6063 7111

#### （二）主要人员情况

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、全球托管处、养老金托管处、新兴业务处、运营管理处、跨境托管运营处、社保及大客户处、托管应用系统支持处、合规监督处等 12 个职能处室，在安徽合肥设有托管运营中心，在上海设有托管运营中心上海分中心，共有员工 300 余人。自 2007 年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常态化的内控工作手段。

#### （三）基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、(R)QFII、(R)QDII、企业年金、存托业务等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至 2020 年二季度末，中国建设银行已托管 1000 只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行先后 9 次获得《全球托管人》“中国最佳托管银行”、4 次获得《财资》“中国最佳次托管银行”、连续多年荣获中央国债登记结算有限责任公司（中债）“优秀资产托管机构”、银行间市场清算所股份有限公司（上清所）“优秀托管银行”奖项，并在 2016 年被《环球金融》评为中国市场唯一一家“最佳托

管银行”、在2017年及2019年分别荣获《亚洲银行家》“最佳托管系统实施奖”、“中国年度托管业务科技实施奖”。

## 二、基金托管人的内部控制制度

### （一）内部控制目标

作为基金托管人，中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和本行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格检查，确保业务的稳健运行，保证基金财产的安全完整，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。

### （二）内部控制组织结构

中国建设银行设有风险与内控管理委员会，负责全行风险管理与内部控制工作，对托管业务风险控制工作进行检查指导。资产托管业务部配备了专职内控合规人员负责托管业务的内控合规工作，具有独立行使内控合规工作职权和能力。

### （三）内部控制制度及措施

资产托管业务部具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理严格实行复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

## 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

### （一）监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的“新一代托管应用监督子系统”，严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

### （二）监督流程

1. 每工作日按时通过新一代托管应用监督子系统，对各基金投资运作比例控制等情况进行监控，如发现投资异常情况，向基金管理人进行风险提示，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，如有重大异常事项及时报告中国证监会。

2. 收到基金管理人的划款指令后，对指令要素等内容进行核查。

3. 通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求基金管理人进行解释或举证，如有必要将及时报告中国证监会。

## 五、相关服务机构

### （一）基金份额发售机构

#### 1、直销机构

##### （1）嘉实基金管理有限公司直销中心

办公地址	北京市东城区建国门南大街7号北京万豪中心D座12层		
电话	(010) 65215588	传真	(010) 65215577
联系人	黄娜		

##### （2）嘉实基金管理有限公司上海直销中心

办公地址	上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期27楼09-14单元		
电话	(021) 38789658	传真	(021) 68880023
联系人	邵琦		

##### （3）嘉实基金管理有限公司成都分公司

办公地址	成都市高新区交子大道177号中海国际中心A座2单元21层04-05单元		
电话	(028) 86202100	传真	(028) 86202100
联系人	王启明		

##### （4）嘉实基金管理有限公司深圳分公司

办公地址	深圳市福田区益田路6001号太平金融大厦16层		
电话	(0755) 84362222	传真	(0755) 84362284
联系人	陈寒梦		

##### （5）嘉实基金管理有限公司青岛分公司

办公地址	青岛市市南区山东路6号华润大厦B座3101室		
电话	(0532) 66777997	传真	(0532) 66777676
联系人	胡洪峰		

##### （6）嘉实基金管理有限公司杭州分公司

办公地址	杭州市江干区四季青街道钱江路1366号万象城华润大厦B座2幢1001A室		
------	--------------------------------------	--	--

电话	(0571) 88061392	传真	(0571) 88021391
联系人	邵琦		

## (7) 嘉实基金管理有限公司福州分公司

办公地址	福州市鼓楼区五四路 137 号信合广场 801A		
电话	(0591) 88013676	传真	(0591) 88013670
联系人	陈寒梦		

## (8) 嘉实基金管理有限公司南京分公司

办公地址	南京市新街口汉中路 2 号亚太商务楼 23 层 B 区		
电话	(025) 66671118		
联系人	潘曙晖		

## (9) 嘉实基金管理有限公司广州分公司

办公地址	广东省广州市天河区洗村路 5 号凯华国际金融中心 36 层 05-06 单元		
电话	(020) 29141918	传真	(020) 29141914
联系人	陈寒梦		

## 2、代销机构

序号	代销机构名称	代销机构信息
1	上海浦东发展银行股份有限公司 注:只代销 A 份额。	办公地址: 上海市中山东一路 12 号 法定代表人: 高国富 联系人: 江逸舟、赵守良 电话: (021)61618888 传真: (021)63604199 客服电话: 95528 网址: <a href="http://www.spdb.com.cn">http://www.spdb.com.cn</a>
2	中国银行股份有限公司	办公地址: 中国北京市复兴门内大街 1 号 法定代表人: 刘连舸 电话: (010)66596688 传真: (010)66594946 客服电话: 95566 网址: <a href="http://www.boc.cn">http://www.boc.cn</a>
3	中国建设银行股份有限公司	办公地址: 北京市西城区金融大街 25 号 法定代表人: 田国立 客服电话: 95533

		网址： <a href="http://www.ccb.com">http://www.ccb.com</a>
4	平安银行股份有限公司	办公地址：深圳市深南东路 5047 号 法定代表人：谢永林 联系人：张青 电话：0755-22166118 传真：0755-82080406 客服电话：95511-3 或 95501 网址： <a href="http://www.bank.pingan.com">http://www.bank.pingan.com</a>
5	上海农村商业银行股份有限公司	办公地址：上海市浦东新区银城中路 8 号 16 层 法定代表人：冀光恒 联系人：施传荣 电话：021-38523692 传真：021-50105124 客服电话：(021)962999 网址： <a href="http://www.srcb.com">http://www.srcb.com</a>
6	北京农村商业银行股份有限公司	办公地址：北京市朝阳区朝阳门北大街 16 号 法定代表人：王金山 联系人：王薇娜 电话：(010)85605006 传真：(010)85605345 客服电话：96198 网址： <a href="http://www.bjrcb.com">http://www.bjrcb.com</a>
7	东莞银行股份有限公司	办公地址：东莞市莞城区体育路 21 号 法定代表人：廖玉林 联系人：朱杰霞 电话：0769-22111802 传真：0769-23156406 客服电话：956033 网址： <a href="http://www.dongguanbank.cn/">http://www.dongguanbank.cn/</a>
8	乌鲁木齐银行股份有限公司	办公地址：新疆乌鲁木齐市天山区新华北路 8 号 法定代表人：杨黎 联系人：何佳 电话：(0991)8824667 传真：(0991)8824667 客服电话：(0991)96518 网址： <a href="http://www.uccb.com.cn">http://www.uccb.com.cn</a>
9	烟台银行股份有限公司	办公地址：烟台市芝罘区海港路 25 号 法定代表人：叶文君 联系人：王淑华 电话：0535-6699660 传真：0535-6699884 客服电话：4008-311-777 网址： <a href="http://www.yantaibank.net">http://www.yantaibank.net</a>
10	东莞农村商业银行股份有限公司	办公地址：广东省东莞市东城区鸿福东路 2 号

	司	<p>法定代表人：王耀球  联系人：洪晓琳  电话：0769-22866143  传真：0769-22866282  客服电话：(0769)961122  网址：<a href="http://www.drcbank.com/">http://www.drcbank.com/</a></p>
11	西安银行股份有限公司	<p>办公地址：陕西省西安市高新路 60 号  法定代表人：郭军  联系人：白智  电话：029-88992881  传真：029-88992475  客服电话：40086-96779  网址：<a href="http://www.xacbank.com">http://www.xacbank.com</a></p>
12	日照银行股份有限公司	<p>办公地址：山东省日照市烟台路 197 号  法定代表人：王森  联系人：孔颖  电话：0633-8081590  传真：0633-8081276  客服电话：4006896588  网址：<a href="http://www.bankofrizhao.com.cn">www.bankofrizhao.com.cn</a></p>
13	福建海峡银行股份有限公司	<p>办公地址：福建省福州市台江区江滨中大道 358 号海峡银行大厦  法定代表人：俞敏  联系人：吴白玫  电话：0591-87838759  传真：0591-87388016  客服电话：4008939999  网址：<a href="http://www.fjhxbank.com">http://www.fjhxbank.com</a></p>
14	华融湘江银行股份有限公司	<p>办公地址：湖南省长沙市天心区芙蓉南路一段 828 号鑫远杰座大厦  法定代表人：张永宏  联系人：杨舟  电话：0731-89828900  客服电话：0731-96599  网址：<a href="http://www.hrxjbank.com.cn">http://www.hrxjbank.com.cn</a></p>
15	云南红塔银行股份有限公司	<p>办公地址：云南省昆明市盘龙区世博路低碳中心 A 座  法定代表人：李光林  联系人：马杰  电话：0871-65236624  传真：0871-65236614  客服电话：0877-96522  网址：<a href="http://www.ynhtbank.com">www.ynhtbank.com</a></p>
16	江苏汇林保大基金销售有限公	<p>办公地址：南京市鼓楼区中山北路 2 号绿地紫峰</p>



	司	大厦 2005 室 法定代表人：吴言林 联系人：林伊灵 电话：025-66046166-810 传真：025-56663409 客服电话：025-66046166 网址： <a href="http://www.huilinbd.com/">http://www.huilinbd.com/</a>
17	诺亚正行基金销售有限公司	办公地址：上海市杨浦区秦皇岛路 32 号 C 栋 法定代表人：汪静波 联系人：张裕 电话：021-38509735 传真：021-38509777 客服电话：400-821-5399 网址： <a href="http://www.noah-fund.com">http://www.noah-fund.com</a>
18	深圳众禄基金销售股份有限公司	办公地址：深圳市罗湖区笋岗街道梨园路物资控股置地大厦 8 楼 801 法定代表人：薛峰 联系人：童彩平 电话：0755-33227950 传真：0755-33227951 客服电话：4006-788-887 网址： <a href="http://www.jjmmw.com">http://www.jjmmw.com</a> ; <a href="https://www.zlfund.cn">https://www.zlfund.cn</a>
19	上海好买基金销售有限公司	办公地址：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 法定代表人：杨文斌 联系人：张茹 电话：021-20613999 传真：021-68596916 客服电话：4007009665 网址： <a href="https://www.howbuy.com/">https://www.howbuy.com/</a>
20	上海长量基金销售投资顾问有限公司	办公地址：上海市浦东新区东方路 1267 号陆家嘴金融服务广场二期 11 层 法定代表人：张跃伟 联系人：单丙焯 电话：021-20691869 传真：021-20691861 客服电话：400-089-1289 网址： <a href="http://www.erichfund.com">http://www.erichfund.com</a>
21	上海利得基金销售有限公司	办公地址：上海宝山区蕴川路 5475 号 1033 室 法定代表人：李兴春 联系人：曹怡晨 电话：021-50583533 传真：021-50583633 客服电话：400-921-7755

		网址： <a href="http://www.leadfund.com.cn">http://www.leadfund.com.cn</a>
22	嘉实财富管理有限公司	办公地址：北京市朝阳区建国路91号金地中心A座5-6层 法定代表人：赵学军 联系人：景琪 电话：021-20289890 传真：021-20280110 客服电话：400-021-8850 网址： <a href="http://www.harvestwm.cn">http://www.harvestwm.cn</a>
23	宜信普泽(北京)基金销售有限公司	办公地址：北京市朝阳区建国路88号楼15层1809 法定代表人：戎兵 联系人：魏晨 电话：010-52413385 传真：010-85894285 客服电话：400-6099-200 网址： <a href="http://www.yixinfund.com">http://www.yixinfund.com</a>
24	通华财富(上海)基金销售有限公司	办公地址：上海市浦东新区新金桥路28号新金桥大厦5楼 法定代表人：马刚 联系人：褚志朋 电话：021-60818730 传真：021-60818187 客服电话：40066-95156 网址： <a href="http://www.tonghuafund.com">http://www.tonghuafund.com</a>
25	北京恒天明泽基金销售有限公司	办公地址：北京市朝阳区东三环北路甲19号嘉盛中心30层 法定代表人：周斌 联系人：侯艳红 电话：010-53572363 传真：010-59313586 客服电话：400-8980-618 网址： <a href="http://www.chtfund.com/">http://www.chtfund.com/</a>
26	北京唐鼎耀华基金销售有限公司	办公地址：北京市朝阳区建外大街19号国际大厦A座1503 法定代表人：张冠宇 联系人：王丽敏 电话：010-85932810 传真：010-59200800 网址： <a href="http://www.tdyhfund.com">http://www.tdyhfund.com</a>
27	北京植信基金销售有限公司	办公地址：北京市密云县兴盛南路8号院2号楼106室-67 法定代表人：于龙 联系人：吴鹏

		电话：010-56075718 传真：010-67767615 客服电话：400-680-2123 网址： <a href="http://www.zhixin-inv.com">http://www.zhixin-inv.com</a>
28	海银基金销售有限公司	办公地址：上海市浦东新区银城中路8号4楼402室 法定代表人：巩巧丽 联系人：秦琼 电话：021-80134149 传真：021-80133413 客服电话：4008081016 网址： <a href="http://www.fundhaiyin.com">http://www.fundhaiyin.com</a>
29	上海汇付基金销售有限公司	办公地址：上海市中山南路100号金外滩国际广场19楼 法定代表人：金佶 联系人：陈云卉 电话：021-33323998 传真：021-33323837 客服电话：400-820-2819
30	上海基煜基金销售有限公司	办公地址：上海昆明路518号北美广场A1002 法定代表人：王翔 联系人：蓝杰 电话：021-65370077 传真：021-55085991 客服电话：4008-205-369 网址： <a href="http://www.jiyufund.com.cn">http://www.jiyufund.com.cn</a>
31	上海中正达广基金销售有限公司	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 联系人：戴珉微 电话：021-33768132 传真：021-33768132*802 客服电话：400-6767-523 网址： <a href="http://www.zzwealth.cn">http://www.zzwealth.cn</a>
32	大泰金石基金销售有限公司	办公地址：南京市建邺区江东中路222号南京奥体中心现代五项馆2105室 法定代表人：袁顾明 联系人：朱海涛 电话：15921264785 传真：021-20324199 客服电话：400-928-2266 网址： <a href="http://www.dtfortune.com/">http://www.dtfortune.com/</a>
33	奕丰基金销售有限公司	办公地址：深圳市南山区蛇口街道后海滨路与海德三道交汇处航天科技广场A座17楼1704室 法定代表人：TEO WEE HOWE

		<p>联系人：叶健  电话：0755-89460500  传真：0755-21674453  网址：<a href="https://www.ifastps.com.cn/">https://www.ifastps.com.cn/</a></p>
34	中证金牛(北京)投资咨询有限公司	<p>办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲1号环球财讯中心A座5层  法定代表人：钱昊旻  联系人：仲甜甜  电话：010-59336492  传真：010-59336510  客服电话：010-59336512  网址：<a href="http://www.jnlc.com">http://www.jnlc.com</a></p>
35	大连网金基金销售有限公司	<p>办公地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路22号2F  法定代表人：樊怀东  联系人：于舒  电话：0411-39027828  传真：0411-39027835  客服电话：4000-899-100  网址：<a href="http://www.yibaijin.com/">http://www.yibaijin.com/</a></p>
36	阳光人寿保险股份有限公司	<p>办公地址：北京市朝阳区朝外大街乙12号1号楼昆泰国际大厦  法定代表人：李科  联系人：王超  电话：010-59053660  传真：010-59053700  客服电话：95510  网址：<a href="http://life.sinosig.com/">http://life.sinosig.com/</a></p>
37	中信建投证券股份有限公司	<p>办公地址：北京市东城区朝内大街188号  法定代表人：王常青  联系人：权唐  电话：(010) 65183880  传真：(010) 65182261  客服电话：400-8888-108  网址：<a href="http://www.csc108.com">http://www.csc108.com</a></p>
38	广发证券股份有限公司	<p>办公地址：广州市天河区马场路26号广发证券大厦  法定代表人：孙树明  联系人：陈姗姗  电话：(020) 66338888  传真：(020) 87555305  客服电话：95575 或致电各地营业网点  网址：<a href="http://www.gf.com.cn">http://www.gf.com.cn</a></p>
39	中信证券股份有限公司	<p>办公地址：深圳市福田区中心三路8号中信证券</p>

		大厦;北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦 法定代表人: 张佑君 联系人: 郑慧 电话: 010-60838888 客服电话: 95558 网址: <a href="http://www.cs.ecitic.com">http://www.cs.ecitic.com</a>
40	海通证券股份有限公司	办公地址: 上海市广东路689号 法定代表人: 周杰 联系人: 金芸、李笑鸣 电话: (021)23219000 传真: (021)23219100 客服电话: 95553 或拨打各城市营业网点咨询电话 网址: <a href="http://www.htsec.com">http://www.htsec.com</a>
41	安信证券股份有限公司	办公地址: 深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元 法定代表人: 黄炎勋 联系人: 陈剑虹 电话: (0755) 82825551 传真: (0755) 82558355 客服电话: 4008001001 网址: <a href="http://www.essence.com.cn">http://www.essence.com.cn</a>
42	中信证券(山东)有限责任公司	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 联系人: 焦刚 电话: (0531) 89606166 传真: (0532) 85022605 客服电话: 95548 网址: <a href="http://sd.citics.com/">http://sd.citics.com/</a>
43	中国中金财富证券有限公司	办公地址: 深圳福田区益田路6003号荣超商务中心A座4层、18-21层 法定代表人: 高涛 联系人: 胡芷境 电话: 0755-88320851 传真: 0755-82026539 客服电话: 400 600 8008 网址: <a href="http://www.china-invs.cn">http://www.china-invs.cn</a>
44	东兴证券股份有限公司	办公地址: 北京市西城区金融大街5号(新盛大厦)6、10、12、15、16层 法定代表人: 魏庆华 联系人: 汤漫川 电话: (010) 66555316 传真: (010) 66555246

		<p>客服电话：400-8888-993</p> <p>网址：<a href="http://www.dxzq.net">http://www.dxzq.net</a></p>
45	光大证券股份有限公司	<p>办公地址：上海市静安区新闻路1508号</p> <p>法定代表人：周健男</p> <p>联系人：刘晨、李芳芳</p> <p>电话：(021) 22169999</p> <p>传真：(021) 22169134</p> <p>客服电话：4008888788、10108998</p> <p>网址：<a href="http://www.ebscn.com">http://www.ebscn.com</a></p>
46	中信证券华南股份有限公司	<p>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</p> <p>法定代表人：胡伏云</p> <p>联系人：梁微</p> <p>电话：020-88836999</p> <p>传真：020-88836984</p> <p>客服电话：95396</p> <p>网址：<a href="http://www.gzs.com.cn">http://www.gzs.com.cn</a></p>
47	中泰证券股份有限公司	<p>办公地址：济南市市中区经七路86号</p> <p>法定代表人：李玮</p> <p>联系人：许曼华</p> <p>电话：021-20315290</p> <p>客服电话：95538</p> <p>网址：<a href="http://www.zts.com.cn/">http://www.zts.com.cn/</a></p>
48	第一创业证券股份有限公司	<p>办公地址：深圳市福田区福华一路115号投行大厦9、16-20楼</p> <p>法定代表人：刘学民</p> <p>联系人：毛诗莉</p> <p>电话：(0755)23838750</p> <p>传真：(0755)25838701</p> <p>客服电话：95358</p> <p>网址：<a href="http://www.firstcapital.com.cn">http://www.firstcapital.com.cn</a></p>
49	华福证券有限责任公司	<p>办公地址：福州市鼓楼区温泉街道五四路157号7-8层</p> <p>法定代表人：黄金琳</p> <p>联系人：张腾</p> <p>电话：(0591) 87383623</p> <p>传真：(0591) 87383610</p> <p>客服电话：(0591) 96326</p> <p>网址：<a href="http://www.hfzq.com.cn/">http://www.hfzq.com.cn/</a></p>
50	粤开证券股份有限公司	<p>办公地址：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</p> <p>法定代表人：严亦斌</p> <p>联系人：彭莲</p> <p>电话：0755-83331195</p>

		<p>客服电话：95564 网址：<a href="http://www.lxsec.com">http://www.lxsec.com</a></p>
51	国金证券股份有限公司	<p>办公地址：四川省成都市青羊区东城根上街95号成证大厦16楼 法定代表人：冉云 联系人：刘婧漪、贾鹏 电话：028-86690057、028-86690058 传真：028-86690126 客服电话：95310 网址：<a href="http://www.gjq.com.cn">http://www.gjq.com.cn</a></p>
52	中信期货有限公司	<p>办公地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1303-1305室、14层 法定代表人：张皓 联系人：刘宏莹 电话：010-60833754 传真：021-60819988 客服电话：400-990-8826 网址：<a href="http://www.citicsf.com">http://www.citicsf.com</a></p>
53	万联证券股份有限公司	<p>办公地址：广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F座18、19楼 法定代表人：罗钦城 联系人：甘蕾 电话：020-38286026 客服电话：95322 网址：<a href="http://www.wlzq.cn">http://www.wlzq.cn</a></p>
54	渤海证券股份有限公司	<p>办公地址：天津市南开区滨水西道8号 法定代表人：王春峰 联系人：蔡霆 电话：(022)28451991 传真：(022)28451892 客服电话：4006515988 网址：<a href="http://www.bhzq.com">http://www.bhzq.com</a></p>
55	东吴证券股份有限公司	<p>办公地址：江苏省苏州工业园区星阳街5号 法定代表人：范力 联系人：方晓丹 电话：(0512)65581136 传真：(0512)65588021 客服电话：95330 网址：<a href="http://www.dwzq.com.cn">http://www.dwzq.com.cn</a></p>
56	南京证券股份有限公司	<p>办公地址：江苏省南京市江东中路389号 法定代表人：步国旬 联系人：王万君 电话：(025)58519523 传真：(025)83369725</p>

		<p>客服电话：95386 网址：<a href="http://www.njzq.com.cn">http://www.njzq.com.cn</a></p>
57	上海证券有限责任公司	<p>办公地址：上海市西藏中路336号华旭国际大厦6楼 法定代表人：李俊杰 联系人：邵珍珍 电话：(021)53686888 传真：(021)53686100-7008 客服电话：(021)962518、4008918918 网址：<a href="http://www.shzq.com">http://www.shzq.com</a></p>
58	国联证券股份有限公司	<p>办公地址：无锡市金融一街8号 法定代表人：姚志勇 联系人：祁昊 电话：0510-82831662 传真：0510-82830162 客服电话：95570 网址：<a href="http://www.glsc.com.cn">http://www.glsc.com.cn</a></p>
59	平安证券股份有限公司	<p>办公地址：深圳市福田区益田路5033号平安金融中心61层-64层 法定代表人：何之江 联系人：周一涵 电话：021-38637436 传真：021-58991896 客服电话：95511—8 网址：<a href="http://stock.pingan.com">stock.pingan.com</a></p>
60	华安证券股份有限公司	<p>办公地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号 法定代表人：章宏韬 联系人：范超 电话：0551-65161821 传真：0551-65161672 客服电话：95318 网址：<a href="http://www.hazq.com">http://www.hazq.com</a></p>
61	国都证券股份有限公司	<p>办公地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层 法定代表人：王少华 联系人：黄静 电话：(010)84183389 传真：(010)84183311 客服电话：400-818-8118 网址：<a href="http://www.guodu.com">http://www.guodu.com</a></p>
62	东海证券股份有限公司	<p>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：陈耀庭</p>



		<p>联系人：王一彦  电话：(021)20333333  传真：(021)50498825  客服电话：95531;400-8888-588  网址：<a href="http://www.longone.com.cn">http://www.longone.com.cn</a></p>
63	金元证券股份有限公司	<p>办公地址：海口市南宝路36号证券大厦4楼  法定代表人：王作义  联系人：马贤清  电话：(0755)83025022  传真：(0755)83025625  客服电话：400-8888-228  网址：<a href="http://www.jyzq.cn">http://www.jyzq.cn</a></p>
64	西部证券股份有限公司	<p>办公地址：陕西省西安市新城东大街319号8幢10000室  法定代表人：徐朝晖  联系人：梁承华  电话：(029)87416168  传真：(029)87406710  客服电话：95582  网址：<a href="http://www.west95582.com">http://www.west95582.com</a></p>
65	华龙证券股份有限公司	<p>办公地址：甘肃省兰州市城关区东岗西路638号兰州财富中心21楼  法定代表人：李晓安  联系人：范坤  电话：(0931)4890208  传真：(0931)4890628  客服电话：95368  网址：<a href="http://www.hlzq.com">http://www.hlzq.com</a></p>
66	华鑫证券有限责任公司	<p>办公地址：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  联系人：杨莉娟  电话：021-54967552  传真：021-54967032  客服电话：021-32109999;029-68918888;4001099918  网址：<a href="http://www.cfsc.com.cn">http://www.cfsc.com.cn</a></p>
67	华宝证券有限责任公司	<p>办公地址：上海市浦东新区世纪大道100号57层  法定代表人：陈林  联系人：夏元  电话：(021)68777222  传真：(021)68777822  客服电话：4008209898  网址：<a href="http://www.cnhbstock.com">http://www.cnhbstock.com</a></p>

68	深圳市新兰德证券投资咨询有限公司	办公地址：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 联系人：文雯 电话：010-83363101 传真：010-83363072 客服电话：400-166-1188 网址：8.jrj.com.cn
69	和讯信息科技有限公司	办公地址：北京市朝阳区朝阳门外泛利大厦10层 法定代表人：王莉 联系人：刘洋 传真：8610-65884788 客服电话：4009200022 网址： <a href="http://www.hexun.com/">http://www.hexun.com/</a>
70	腾安基金销售(深圳)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：谭广锋 电话：0755-86013388-80618 传真：- 客服电话：95017 网址： <a href="http://www.tenganxinxi.com">http://www.tenganxinxi.com</a> 或 <a href="http://www.txfund.com">http://www.txfund.com</a>
71	北京百度百盈基金销售有限公司	办公地址：北京市海淀区上地十街10号1幢1层101 法定代表人：葛新 联系人：杨琳 电话：010-61952702 传真：010-61951007 客服电话：95055 网址： <a href="http://www.baiyingfund.com">http://www.baiyingfund.com</a>
72	上海天天基金销售有限公司	办公地址：上海市徐汇区宛平南路88号金座 法定代表人：其实 联系人：屠彦洋 电话：95021 传真：(021) 64385308 客服电话：400-1818-188 网址： <a href="http://www.1234567.com.cn">http://www.1234567.com.cn</a>
73	蚂蚁(杭州)基金销售有限公司	办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路18号黄龙时代广场B座 法定代表人：祖国明 联系人：韩爱彬 电话：021-60897840

		传真：0571-26697013 客服电话：400-0766-123 网址： <a href="http://www.fund123.cn">http://www.fund123.cn</a>
74	浙江同花顺基金销售有限公司	办公地址：浙江省杭州市余杭区同顺街18号同花顺大厦 法定代表人：吴强 联系人：林海明 传真：0571-86800423 客服电话：4008-773-772 网址： <a href="http://www.5ifund.com">http://www.5ifund.com</a>
75	南京苏宁基金销售有限公司	办公地址：南京市玄武区苏宁大道1-5号 法定代表人：刘汉青 联系人：喻明明 电话：025-66996699-884131 传真：025-66008800-884131 客服电话：95177 网址： <a href="http://www.snjjjin.com/">http://www.snjjjin.com/</a>
76	北京汇成基金销售有限公司	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 联系人：丁向坤 电话：010-56282140 传真：010-62680827 客服电话：400-619-9059 网址： <a href="http://www.hcjijin.com/">http://www.hcjijin.com/</a>
77	上海大智慧基金销售有限公司	办公地址：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 联系人：宋楠 电话：021-20219988-37492 传真：021-20219923 客服电话：021-20292031 网址： <a href="https://www.wg.com.cn/">https://www.wg.com.cn/</a>
78	凤凰金信(银川)基金销售有限公司	办公地址：宁夏银川市金凤区阅海湾中心商务区万寿路142号14层办公房 法定代表人：张旭 联系人：汪莹 电话：010-58160168 传真：010-58160173 客服电话：400-810-5919 网址： <a href="http://www.fengfd.com/">http://www.fengfd.com/</a>
79	珠海盈米基金销售有限公司	办公地址：珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491 法定代表人：肖雯

		联系人：黄敏嫦 电话：020-89629019 传真：020-89629011 客服电话：020-89629066 网址： <a href="http://www.yingmi.cn">http://www.yingmi.cn</a>
80	北京肯特瑞基金销售有限公司	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15层 法定代表人：王苏宁 联系人：陈龙鑫 电话：4000988511 传真：010-89188000 客服电话：95118 网址： <a href="http://kenterui.jd.com">kenterui.jd.com</a>
81	北京蛋卷基金销售有限公司	办公地址：北京市朝阳区创远路34号院融新科技中心C座17层 法定代表人：钟斐斐 联系人：侯芳芳 电话：010-61840688 传真：010-61840699 客服电话：400-159-9288 网址： <a href="https://danjuanapp.com/">https://danjuanapp.com/</a>

## （二） 登记机构

名称	嘉实基金管理有限公司
住所	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心二期27楼09-14单元
办公地址	北京市朝阳区建国门外大街21号北京国际俱乐部C座写字楼12A层
法定代表人	经雷
联系人	彭鑫
电话	(010) 65215588
传真	(010) 65185678

## （三） 出具法律意见书的律师事务所

名称	上海市通力律师事务所		
住所、办公地址	上海市银城中路68号时代金融中心19和16楼		
负责人	韩炯	联系人	陈颖华
电话	(021) 31358666	传真	(021) 31358600
经办律师	黎明、陈颖华		

## (四) 审计基金财产的会计师事务所

名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）		
住所及办公地址	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层 01-12室		
法定代表人	毛鞍宁	联系人	王珊珊
电话	(010) 58152145	传真	(010) 85188298
经办注册会计师	王珊珊、贺耀		

## 六、基金的募集

### （一）基金募集的依据

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定募集。本基金募集申请已经中国证监会2019年9月30日证监许可【2019】1825号文注册。

### （二）基金类型和存续期间

- 1、基金的类别：股票型证券投资基金。
- 2、基金的运作方式：契约型开放式。
- 3、基金存续期间：不定期。

### （三）基金份额的类别

本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。其中A类基金份额类别为在投资人认购/申购时收取认购/申购费用，且不从本类别基金资产净值中计提销售服务费的基金份额；C类基金份额为从本类别基金资产中计提销售服务费，且不收取认购/申购费用的基金份额。相关费率及费率水平在招募说明书和相关公告中列示。

本基金两类基金份额分别设置代码，分别公布基金份额净值和基金份额累计净值。投资者可自行选择认购/申购的基金份额类别。本基金不同基金份额类别之间不得相互转换。

本基金份额类别的具体设置、费率水平等由基金管理人确定，并在招募说明书中列明。在不违反法律法规、基金合同规定的情况下，基金管理人在履行适当程序后可以增加新的基金份额类别、停止现有基金份额类别的销售或调整基金份额分类办法及规则等，不需召开基金份额持有人大会审议，但调整实施前基金管理人需及时公告，并报中国证监会备案。

### （四）基金份额的募集期限、募集方式及场所、募集对象、募集目标

- 1、募集期间：2020年3月25日至2020年4月10日。
- 2、募集方式及场所

本基金将通过各销售机构的基金销售网点公开发售，各销售机构的具体名单见基金份额发售公告以及基金管理人网站。

#### 3、募集对象

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

其他投资人。

#### 4、募集目标

本基金不设募集目标。基金管理人可以对募集期间的本基金募集规模设置上限。募集期内超过募集规模上限时，基金管理人可以采用比例确认或其他方式进行确认，具体办法参见基金份额发售公告。

### （五）基金的认购

1、认购程序：投资者认购时间安排、认购时应提交的文件和办理的手续，详见本基金的份额发售公告。

2、本基金 A 类基金份额收取认购费用，C 类基金份额不收取认购费用。本基金 A 类份额认购费率按照认购金额递减，即认购金额越大，所适用的认购费率越低。投资者在一天之内如果有多笔认购，适用费率按单笔分别计算。本基金 A 类基金份额具体认购费率如下：

投资者在认购 A 类基金份额时需交纳前端认购费，费率按认购金额递减，具体如下：

认购金额（含认购费）	认购费率
M < 100 万元	1.20%
100 万元 ≤ M < 200 万元	0.80%
200 万元 ≤ M < 500 万元	0.50%
M ≥ 500 万元	按笔收取，1000 元/笔

本基金 A 类基金份额的认购费用由认购 A 类基金份额的投资者承担，不列入基金资产，认购费用用于本基金的市场推广、销售、注册登记等募集期间发生的各项费用。

本基金 C 类基金份额认购费率为 0。

#### 3、募集期利息的处理方式

有效认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有，其中利息转份额的数量以登记机构的记录为准。有效认购款项利息折算的份额计算按截位方法，保留到小数点后两位，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

#### 4、认购份额的计算

本基金 A 类、C 类基金份额的初始面值均为人民币 1 元。

（1）当投资者选择认购 A 类基金份额时，认购份数的计算方法如下：

① 认购费用适用比例费率时，认购份额的计算方法如下：

净认购金额 = 认购金额 / (1 + 认购费率)

认购费用 = 认购金额 - 净认购金额

认购份额 = (净认购金额 + 认购资金利息) / 1 元

② 认购费用为固定金额时，认购份额的计算方法如下：

认购费用 = 固定金额

净认购金额 = 认购金额 - 认购费用

认购份额 = (净认购金额 + 认购资金利息) / 1 元

其中：认购份额的计算保留到小数点后两位，小数点两位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

例一：某投资者投资 10,000 元认购本基金 A 类基金份额，如果其认购资金的利息为 10 元，则其可得到的基金份额数计算如下：

净认购金额 =  $10,000 / (1 + 1.2\%) = 9,881.42$  元

认购费用 =  $10,000 - 9,881.42 = 118.58$  元

认购份额 =  $(9,881.42 + 10) / 1 = 9,891.42$  份

即投资者投资 10,000 元认购本基金 A 类基金份额，可得到 9,891.42 份 A 类基金份额。

(2) 当投资者选择认购 C 类基金份额时，认购份数的计算方法如下：

认购份额 = (认购金额 + 认购资金利息) / 1 元

例二：某投资者投资 10,000.00 元认购本基金 C 类基金份额，假设这 10,000.00 元在募集期间产生的利息为 5.00 元，则其可得到的基金份额数计算如下：

认购份额 =  $(10,000.00 + 5.00) / 1 = 10,005.00$  份

即投资者投资 10,000.00 元认购本基金 C 类基金份额，加上募集期间利息后一共可以得到 10,005.00 份 C 类基金份额。

## 5、募集资金

基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。



## 七、基金合同的生效

### （一）基金合同的生效

本基金的基金合同于 2020 年 4 月 15 日正式生效，自该日起本基金管理人开始管理本基金。

### （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，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当在 10 个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并于 6 个月内召集基金份额持有人大会。

法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

## 八、基金份额的申购与赎回

### （一）申购和赎回的场所

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。具体的销售机构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针对某类基金份额变更或增减销售机构。基金投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。

### （二）申购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，若该工作日为非港股通交易日，则本基金不开放申购与赎回，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/期货市场、证券/期货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

本基金自2020年6月15日开始办理基金份额的申购、赎回业务。本基金在开放日办理基金份额的申购、赎回，若该工作日为非港股通交易日，则本基金不开放申购、赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回业务时除外。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请，登记机构有权拒绝，如登记机构确认接收的，视为投资人下一开放日提出的申购、赎回或转换申请，并按照下一个开放日的申请处理。

### （三）申购与赎回的原则

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

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；

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

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

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

#### （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。

投资人办理申购、赎回等业务时应提交的文件和办理手续、办理时间、处理规则等在遵守基金合同和招募说明书规定的前提下，以各销售机构的具体规定为准。

##### 2、申购和赎回的款项支付

投资人申购基金份额时，必须在规定时间内全额交付申购款项，投资人交付申购款项，申购成立。

基金份额持有人的赎回申请被确认后，基金管理人将在 T+7 日(包括该日)内支付赎回款项。遇证券/期货交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障等非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程时，赎回款项的支付相应顺延。在发生巨额赎回或基金合同载明的其他暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。

##### 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。投资人向销售机构交付申购款项，申购成立，投资人向销售机构递交赎回申请，赎回成立；本基金登记机构确认申购或赎回的，申购或赎回生效。T日提交的有效申请，投资人应在 T+2 日后(包括该日)及时到办理申购、赎回或其他基金业务的销售营业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(无利息)退还给投资人。

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

##### 4、如未来法律法规或监管机构对上述内容另有规定，从其规定。

在法律法规允许的范围内，本基金登记机构可根据相关业务规则，对上述业务办理时间进行调整，本基金管理人将于开始实施前按照有关规定予以公告。

#### （五）申购和赎回的数量限制

##### 1. 申请申购基金的金额

投资者通过代销机构或嘉实基金管理有限公司网上直销首次申购单笔最低限额为人民币 1 元(含申购费)，追加申购单笔最低限额为人民币 1 元(含申购费)；投资者通过直销

中心柜台首次申购单笔最低限额为人民币 20,000 元（含申购费），追加申购单笔最低限额为人民币 1 元（含申购费）。

投资者可多次申购，对单个投资者累计持有份额不设上限限制，但单一投资者累计持有份额不得达到或者超过本基金总份额的 50%，且不得变相规避 50%集中度要求。法律法规、中国证监会或基金合同另有规定的除外。

## 2. 申请赎回基金的份额

投资者通过销售机构赎回本基金份额时，可申请将其持有的部分或全部基金份额赎回；单笔赎回不得少于 1 份，每个基金交易账户最低持有基金份额余额为 1 份，若某笔赎回导致某一销售机构的某一基金交易账户的基金份额余额少于 1 份时，基金管理人有权将投资者在该销售机构的某一基金交易账户剩余基金份额一次性全部赎回。投资者通过代销机构赎回本基金的具体单笔赎回最低份额以各销售机构规定为准。

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

4. 当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。具体见基金管理人相关公告。

## （六）申购、赎回的费率

1、本基金A类基金份额收取申购费用，C类基金份额不收取申购费用。A类基金份额采用前端收费模式收取基金申购费用。投资者在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。具体如下：

申购金额（含申购费）	申购费率
M<100 万元	1.50%
100 万元≤M<200 万元	1.00%
200 万元≤M<500 万元	0.60%
M≥500 万元	按笔收取，单笔 1000 元

本基金A类基金份额的申购费用由申购该类基金份额的投资人承担，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用，不列入基金财产。

本基金C类基金份额申购费率为0。

个人投资者通过本基金管理人直销网上交易系统申购本基金业务实行申购费率优惠，其申购费率不按申购金额分档，统一优惠为申购金额的 0.6%，但中国银行长城借记卡持卡人，申购本基金的申购费率优惠按照相关公告规定的费率执行；机构投资者通过本基金

管理人直销网上交易系统申购本基金，其申购费率不按申购金额分档，统一优惠为申购金额的0.6%。优惠后费率如果低于0.6%，则按0.6%执行。基金招募说明书及相关公告规定的相应申购费率低于0.6%时，按实际费率收取申购费。个人投资者于本公司网上直销系统通过汇款方式申购本基金的，前端申购费率按照相关公告规定的优惠费率执行。

注：2014年9月2日，本基金管理人发布了《嘉实基金管理有限公司关于增加开通后端收费基金产品的公告》，自2020年6月15日起，增加开通本基金在本公司基金网上直销系统的后端收费模式（包括申购、定期定额投资、基金转换等业务）、并对通过本公司基金网上直销系统交易的后端收费进行费率优惠，本基金优惠后的费率见下表：

持有期限 (T)	基金网上直销 后端申购优惠费率
0<T<1年	0.20%
1年≤T<3年	0.10%
T≥3年	0.00%

本公司直销中心柜台和代销机构暂不开通后端收费模式。具体请参见嘉实基金网站刊载的公告。

2、本基金对A、C类基金份额收取赎回费，在投资者赎回基金份额时收取。基金份额的赎回费率按照持有时间递减，即相关基金份额持有时间越长，所适用的赎回费率越低。

本基金的赎回费用由基金份额持有人承担。本基金A类基金份额，对持续持有期少于30日的投资人，赎回费全额计入基金财产；对持续持有期大于等于30天少于90天的投资人，赎回费总额的75%计入基金财产；对持续持有期大于等于90天少于180天的投资人，赎回费总额的50%计入基金财产。本基金C类基金份额，对持续持有期少于30日的投资人收取的赎回费全额计入基金财产。

本基金A类基金份额的赎回费率具体如下：

持有期限 (T)	赎回费率
0≤T<7天	1.50%
7天≤T<30天	0.75%
30天≤T<180天	0.50%
T≥180天	0%

本基金C类基金份额的赎回费率具体如下：

持有期限 (T)	赎回费率
0≤T<7天	1.5%

7天 $\leq$ T<30天	0.5%
T $\geq$ 30天	0%

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

4、基金销售机构可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，根据市场情况制定基金促销计划，定期或不定期地开展基金促销活动。

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

### （七）申购份额、赎回金额的计算方式

#### 1、申购份额的计算

（1）当投资者选择申购A类基金份额时，申购份额的计算方法如下：

①申购费用适用比例费率时，申购份额的计算方法如下：

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

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

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

②申购费用为固定金额时，申购份额的计算方法如下：

$$\text{申购费用} = \text{固定金额}$$

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

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

例一：某投资者投资5万元申购本基金A类基金份额，假设申购当日A类基金份额净值为1.0500元，则可得到的申购份额为：

$$\text{净申购金额} = 50,000 / (1 + 1.50\%) = 49,261.08 \text{元}$$

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

$$\text{申购份额} = 49,261.08 / 1.0500 = 46,915.31 \text{份}$$

即：投资者投资5万元申购本基金A类基金份额，假设申购当日A类基金份额净值为1.0500元，则其可得到46,915.31份A类基金份额。

（2）当投资者选择申购C类基金份额时，申购份额的计算方法如下：

申购份额 = 申购金额 / T日C类基金份额净值

例二：某投资者投资5万元申购本基金C类基金份额，假设申购当日C类基金份额净值为1.0500元，则可得到的申购份额为：

申购份额 = 50,000 / 1.0500 = 47,619.05份

即：投资人投资50,000元申购本基金C类基金份额，假设申购当日本基金C类基金份额的基金份额净值为1.0500元，则其可得到本基金C类基金份额47,619.05份。

(3) 申购份额按四舍五入方法，保留到小数点后2位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

## 2、基金赎回金额的计算

本基金的赎回采用“份额赎回”方式，赎回价格以T日的该类基金份额净值为基准进行计算，本基金的赎回金额为赎回总额扣减赎回费用。

(1) 当投资者赎回A类基金份额时，赎回金额的计算方法如下：

赎回总额 = 赎回份额 × T日A类基金份额净值

赎回费用 = 赎回总额 × 赎回费率

赎回金额 = 赎回总额 - 赎回费用

(2) 当投资者赎回C类基金份额时，赎回金额的计算方法如下：

赎回金额 = 赎回份额 × T日C类基金份额净值

赎回费用 = 赎回金额 × 赎回费率

净赎回金额 = 赎回金额 - 赎回费用

(3) 赎回金额按四舍五入方法，保留到小数点后2位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

例三：假定三笔赎回申请的赎回A类基金份额均为10,000份，但持有时间长短不同，其中A类基金份额的基金份额净值为假设数，那么各笔赎回负担的赎回费用和获得的赎回金额计算如下：

	赎回1	赎回2	赎回3
赎回份额（份，a）	10,000	10,000	10,000
基金份额净值（元，b）	1.1000	1.2000	1.3000
持有时间N	0 ≤ T < 7 天	30天 ≤ T < 180天	T ≥ 180天

适用赎回费率（c）	1.5%	0.5%	0
赎回总额（元，d=a×b）	11,000.00	12,000.00	13,000.00
赎回费（e=c×d）	165.00	60.00	0.00
赎回金额（f=d-e）	10,835.00	11,940.00	13,000.00

3、本基金各类基金份额净值的计算，均保留到小数点后4位，小数点后第5位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T日的各类基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日内公告。遇特殊情况，经履行适当程序，可以适当延迟计算或公告。

#### （八）拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

1、因不可抗力导致基金无法正常运转。

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

3、证券、期货交易所或外汇市场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或者无法办理申购业务。

4、接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。

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

6、基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术故障等异常情况导致基金销售系统或基金注册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项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受基金投资者的申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的，被拒绝的申购款项（无利息）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。

#### （九）暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。



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

3、证券、期货交易所或外汇市场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或者无法办理赎回业务。

4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

5、发生继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时，基金管理人可暂停接受基金份额持有人的赎回申请。

6、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

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

#### （十）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）超过前一工作日的基金总份额的 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全部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工作日基金总份额 10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类

推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

若基金发生巨额赎回且基金管理人决定部分延期赎回并在当日接受赎回比例不低于上一工作日基金总份额 10%的前提下，如出现单个基金份额持有人超过前一工作日基金总份额 20%的赎回申请（“大额赎回申请人”）的，基金管理人有权按照优先确认其他赎回申请人（“小额赎回申请人”）赎回申请的原则，对当日的赎回申请按照以下原则办理：如小额赎回申请人的赎回申请在当日被全部确认，则在仍可接受赎回申请的范围内对大额赎回申请人的赎回申请按比例（单个大额赎回申请人的赎回申请量/当日大额赎回申请总量）确认，对大额赎回申请人未予确认的赎回申请延期办理；如小额赎回申请人的赎回申请在当日不能被全部确认，则按照单个小额赎回申请人的赎回申请量占当日小额赎回申请总量的比例，确认其当日受理的赎回申请量，对当日全部未确认的赎回申请（含小额赎回申请人的其余赎回申请与大额赎回申请人的全部赎回申请）延期办理。延期办理的具体程序，按照本条规定的延期赎回或取消赎回的方式办理，即对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销；同时，基金管理人应当对延期办理的事宜在指定媒介上刊登公告。

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

### 3、巨额赎回的公告

当发生上述巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当通过公告、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，并在两日内在指定媒介上刊登公告。

#### （十一）暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

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

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

3、若暂停时间超过 1 日，基金管理人可以根据《信息披露办法》自行确定公告的增加次数，但基金管理人须依照《信息披露办法》，最迟于重新开放日在指定媒介上刊登重新开放申购或赎回的公告，或根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间，届时可不再另行发布重新开放的公告。

#### （十二）基金转换

本基金自 2020 年 6 月 15 日开始办理基金份额的转换业务。本基金在开放日办理基金份额转换，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（若非港股通交易日，则本基金不开放基金份额申购、赎回或其他业务），但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回、转换时除外。

#### 1. 开通转换业务基金明细

本基金在代销机构与嘉实基金管理有限公司直销渠道上开放办理基金转换业务。与本基金开通转换业务的本基金管理人旗下的基金包括：嘉实中证 500ETF 联接 A、嘉实研究阿尔法股票、嘉实沪深 300 指数研究增强、嘉实泰和混合、嘉实薪金宝货币、嘉实医疗保健股票、嘉实新兴产业股票、嘉实新收益混合、嘉实快线货币 A、嘉实逆向策略股票、嘉实企业变革股票、嘉实先进制造股票、嘉实新消费股票、嘉实事件驱动股票、嘉实中证金融地产 ETF 联接 A、嘉实低价策略股票、嘉实环保低碳股票、嘉实腾讯自选股大数据策略股票、嘉实新起点混合 A、嘉实策略优选混合、嘉实研究增强混合、嘉实成长增强混合、嘉实创新成长混合、嘉实沪港深精选股票、嘉实智能汽车股票、嘉实新起点混合 C、嘉实新财富混合、嘉实新起航混合、嘉实新趋势混合、嘉实稳祥纯债债券 A、嘉实文体娱乐股票 A、嘉实文体娱乐股票 C、嘉实安益混合、嘉实优势成长混合、嘉实物流产业股票 A、嘉实物流产业股票 C、嘉实稳祥纯债债券 C、嘉实稳宏债券 A、嘉实稳宏债券 C、嘉实农业产业股票、嘉实稳骏纯债债券、嘉实新能源新材料股票 A、嘉实新能源新材料股票 C、嘉实增益宝货币、嘉实丰和灵活配置混合、嘉实前沿科技沪港深股票、嘉实沪港深回报混合、嘉实富时中国 A50ETF 联接 A、嘉实中小企业量化活力灵活配置混合、嘉实稳华纯债债券 A、嘉实富时中国 A50ETF 联接 C、嘉实价值精选股票、嘉实医药健康股票 A、嘉实医药健康股票 C、嘉实核心优势股票、嘉实资源精选股票 A、嘉实资源精选股票 C、嘉实金融精选股票 A、嘉实金融精选股票 C、嘉实中创 400ETF 联接 C、嘉实深证基本面 120ETF 联接 C、嘉实中证金融地产 ETF 联接 C、嘉实致盈债券、嘉实稳联纯债债券、嘉实互融精选股票、嘉实消费精选股票 A、嘉实消费精选股票 C、嘉实中短债债券 A、嘉实中短债债券 C、嘉实互通精选股票、嘉实致享纯债债券、嘉实稳华纯债债券 C、嘉实中债 1-3 政金债指数 A、嘉实中债 1-3 政金债指数 C、嘉实长青竞争优势股票 A、嘉实长青竞争优势股票 C、嘉实新添益定期混合 A、嘉实新添益定期混合 C、嘉实汇达中短债债券 A、嘉实汇达中短债债券 C、嘉实科技创新混合、嘉实沪深 300 红利低波动 ETF 联接 A、嘉实沪深 300 红利低波动 ETF 联接 C、嘉实央企创新驱动 ETF 联接 A、嘉实央企创新驱动 ETF 联接 C、嘉实新兴科技 100 ETF 联接 A、嘉实新兴科技 100 ETF 联接 C、嘉实价值成长混合、嘉实中债 3-5 年国开债指数 A、嘉实中债 3-5 年国开债指数 C、嘉实民企精选一年定期债券、嘉实远见企业精选两年持有期混合、嘉实致融一年定期债券、嘉实鑫和一年持有期混合 A、嘉实鑫和一年持有期混合 C、嘉实中证 500 指数增强 A、嘉实中证 500 指数增强 C、嘉实回报精选股票、嘉实稳固收益债券 A、嘉实瑞和两年持有期混合、嘉实瑞成两年持有期混合 A、嘉实瑞成两年持有期混合 C、嘉实中证主要消

费ETF联接A、嘉实中证主要消费ETF联接C、嘉实稳福混合A、嘉实稳福混合C、嘉实稳惠6个月持有期混合A、嘉实稳惠6个月持有期混合C、嘉实精选平衡混合A、嘉实精选平衡混合C、嘉实彭博国开债1-5年指数A、嘉实彭博国开债1-5年指数C、嘉实远见精选两年持有期混合、嘉实浦惠6个月持有期混合A、嘉实浦惠6个月持有期混合C、嘉实产业先锋混合A、嘉实产业先锋混合C、嘉实动力先锋混合A、嘉实动力先锋混合C、嘉实前沿创新混合、嘉实创新先锋混合A、嘉实创新先锋混合C、嘉实核心成长混合A、嘉实核心成长混合C、嘉实价值长青混合A、嘉实价值长青混合C、嘉实优质精选混合A、嘉实优质精选混合C、嘉实成长收益混合A、嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券、嘉实服务增值行业混合、嘉实货币A、嘉实超短债债券、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实研究精选混合A、嘉实多元债券A、嘉实多元债券B、嘉实量化阿尔法混合、嘉实回报混合、嘉实价值优势混合、嘉实稳固收益债券C、嘉实主题新动力混合、嘉实领先成长混合、嘉实深证基本面120ETF联接A、嘉实信用债券A、嘉实信用债券C、嘉实周期优选混合、嘉实安心货币A、嘉实安心货币B、嘉实中创400ETF联接A、嘉实优化红利混合、嘉实纯债债券A、嘉实纯债债券C、嘉实中证500ETF联接C、嘉实货币B、嘉实优质企业混合。

## 2. 基金转换费用

本基金转换费用由转出基金赎回费用及基金申购补差费用构成：

### (1) 通过代销机构办理基金转换业务（“前端转前端”的模式）

转出基金有赎回费用的，收取该基金的赎回费用。从低申购费用基金向高申购费用基金转换时，每次收取申购补差费用；从高申购费用基金向低申购费用基金转换时，不收取申购补差费用。申购补差费用按照转换金额对应的转出基金与转入基金的申购费用差额进行补差。

### (2) 通过直销（直销柜台及网上直销）办理基金转换业务（“前端转前端”的模式）

转出基金有赎回费用的，收取该基金的赎回费用。从0申购费用基金向非0申购费用基金转换时，每次按照非0申购费用基金申购费用收取申购补差费；非0申购费用基金互转时，不收取申购补差费用。

通过网上直销办理转换业务的，转入基金适用的申购费率比照该基金网上直销相应优惠费率执行。

### (3) 通过网上直销系统办理基金转换业务（“后端转后端”模式）

①若转出基金有赎回费，则仅收取转出基金的赎回费；

②若转出基金无赎回费，则不收取转换费用。

### (4) 基金转换份额的计算

基金转换采取未知价法，以申请当日基金份额净值为基础计算。计算公式如下：

转出基金金额=转出份额×转出基金当日基金份额净值

转出基金赎回费用=转出基金金额×转出基金赎回费率

转出基金申购费用=（转出基金金额-转出基金赎回费用）×转出基金申购费率÷（1+转出基金申购费率）

转入基金申购费用=（转出基金金额-转出基金赎回费用）×转入基金申购费率÷（1+转入基金申购费率）

申购补差费用 =MAX（0，转入基金申购费用-转出基金申购费用）

转换费用=转出基金赎回费用+申购补差费用

净转入金额=转出基金金额-转换费用

转入份额=净转入金额/转入基金当日基金份额净值

转出基金有赎回费用的,收取的赎回费归入基金财产的比例不得低于法律法规、中国证监会规定的比例下限以及该基金基金合同的相关约定。

注：嘉实泰和混合、嘉实薪金宝货币、嘉实新兴产业股票、嘉实快线货币 A、嘉实新消费股票、嘉实新起点混合 A、嘉实策略优选混合、嘉实成长增强混合、嘉实创新成长混合、嘉实新起点混合 C、嘉实新财富混合、嘉实新起航混合、嘉实新趋势混合、嘉实稳祥纯债债券 A、嘉实安益混合、嘉实优势成长混合、嘉实稳祥纯债债券 C、嘉实增益宝货币、嘉实稳华纯债债券 A、嘉实致盈债券、嘉实中短债债券 A、嘉实中短债债券 C、嘉实稳华纯债债券 C、嘉实汇达中短债债券 A、嘉实汇达中短债债券 C、嘉实稳福混合 A、嘉实稳福混合 C、嘉实精选平衡混合 A、嘉实精选平衡混合 C、嘉实彭博国开债 1-5 年指数 A、嘉实彭博国开债 1-5 年指数 C、嘉实债券、嘉实货币 A、嘉实超短债债券、嘉实价值优势混合、嘉实安心货币 A、嘉实安心货币 B、嘉实纯债债券 A、嘉实纯债债券 C、嘉实货币 B 有单日单个基金账户账户的累计申购（转入）限制，嘉实瑞和两年持有期混合、嘉实彭博国开债 1-5 年指数 A、嘉实彭博国开债 1-5 年指数 C、嘉实增长混合、嘉实服务增值行业混合暂停申购和转入业务，具体请见嘉实基金网站刊载的相关公告。定期开放类基金在封闭期内无法转换。

### 3. 其他与转换相关的事项

（1）基金转换的时间：投资者需在转出基金和转入基金均有交易的当日，方可办理基金转换业务。

（2）基金转换的原则：

①采用份额转换原则，即基金转换以份额申请；

②当日的转换申请可以在当日交易结束时间前撤销，在当日的交易时间结束后不得撤销；

③基金转换价格以申请转换当日基金份额净值为基础计算；

④投资者可在任一同时销售拟转出基金及转入基金的销售机构处办理基金转换。基金转换只能在同一销售机构进行。转换的两只基金必须都是该销售机构代理的同一基金管理人管理的、在同一基金注册登记机构处注册的基金；

⑤基金管理人可在不损害基金份额持有人权益的情况下更改上述原则，但应在新的原则实施前在至少一种中国证监会指定媒介公告。

### （3）基金转换的程序

#### ①基金转换的申请方式

基金投资者必须根据基金管理人和基金代销机构规定的手续，在开放日的业务办理时间提出转换的申请。

投资者提交基金转换申请时，账户中必须有足够可用的转出基金份额余额。

#### ②基金转换申请的确认

基金管理人应以在规定的基金业务办理时间段内收到基金转换申请的当天作为基金转换的申请日（T日），并在T+1日对该交易的有效性进行确认。投资者可在T+2日及之后查询成交情况。

### （4）基金转换的数额限制

基金转换时，投资者通过销售机构由本基金转换到基金管理人管理的其他开放式基金时，最低转出份额为1份基金份额。但若有代销机构特别约定单笔转换份额最低限额并已经发布临时公告，则以该等公告为准。

基金管理人可根据市场情况制定或调整上述基金转换的有关限制并及时公告。

### （5）基金转换的注册登记

投资者申请基金转换成功后，基金注册登记机构在T+1日为投资者办理减少转出基金份额、增加转入基金份额的权益登记手续。一般情况下，投资者自T+2日起有权赎回转入部分的基金份额。

基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，并于开始实施前在至少一种中国证监会指定媒介公告。

### （6）基金转换与巨额赎回

当发生巨额赎回时，本基金转出与基金赎回具有相同的优先级，基金管理人可根据基金资产组合情况，决定全额转出或部分转出，并且对于本基金转出和基金赎回，将采取相同的比例确认；但基金管理人在当日接受部分转出申请的情况下，对未确认的转换申请将不予顺延。

### （7）拒绝或暂停基金转换的情形及处理方式

#### ①发生下列情况之一时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的转入申请：

- （a）因不可抗力导致基金无法正常工作；
- （b）发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况；
- （c）证券、期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值或者无法办理转入业务；
- （d）接受某笔或某些转入申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时；

(e) 基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或发生其他损害现有基金份额持有人利益的情形；

(f) 基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术故障等异常情况导致基金销售系统或基金注册登记系统或基金会计系统等无法正常运行；

(g) 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转入申请；

(h) 基金管理人接受某笔或者某些转入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；

(i) 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

②发生下列情形之一时，基金管理人可暂停接受投资人的转出申请或者延缓支付转出款项：

(a) 因不可抗力导致基金管理人不能支付转出款项；

(b) 发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况；

(c) 证券、期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值或者无法办理转出业务；

(d) 连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回；

(e) 发生继续接受转出申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时，基金管理人可暂停接受基金份额持有人的转出申请；

(f) 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转出款项或暂停接受基金转出申请；

(g) 基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术故障等异常情况导致基金销售系统或基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行；

(h) 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

③基金转换业务的解释权归基金管理人，基金管理人可以根据市场情况在不违背有关法律、法规和《基金合同》的规定之前提下调整上述转换的收费方式、费率水平、业务规则及有关限制，但应在调整生效前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

投资者到本基金代销机构的销售网点办理本基金转换业务时，其相关具体办理规定以各代销机构的规定为准。

### （十三）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和协助执行通知书要求登记机构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。

#### （十四）基金的转托管

基金份额持有人可向其销售机构申请办理已持有基金份额在不同销售机构之间的转托管，基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。尽管有前述约定，基金销售机构仍有权决定是否办理基金份额转托管。

#### （十五）定期定额投资计划

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

#### （十六）基金份额的冻结和解冻

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

基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益一并冻结，被冻结部分份额仍然参与收益分配。法律法规或监管机构另有规定的除外。



## 九、基金的投资

### （一）投资目标

本基金主要在基础产业中优选质地优良并具有长期回报潜力的个股，力争在风险可控的前提下获取超越业绩比较基准的收益。

### （二）投资范围

本基金投资于国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板、存托凭证及其他依法发行上市的股票）、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许买卖的香港联合交易所上市股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换公司债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、股指期货、现金以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

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。

本基金的投资组合比例为：股票资产的比例不低于基金资产的80%，其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的0-50%，投资于本基金界定的基础产业范围内的股票不低于非现金基金资产的80%。每个交易日日终，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值的5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股指期货及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

如法律法规或中国证监会允许，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

#### 1、资产配置策略

本基金采取“自上而下”的方式进行大类资产配置，根据对宏观经济、市场面、政策面等因素进行定量与定性相结合的分析研究，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例。

#### 2、股票投资策略

本基金界定的基础产业指在国民经济发展中处于基础地位、可影响其他产业发展水平的产业群，主要集中在基础设施、基础工业和基础服务等领域，具体如下：

- 1) 与传统和新型基础设施的建设、运营和维护相关的产业，包括但不限于交通运输、建筑、水利、市政公用、通信等；
- 2) 基础工业主要是指能源工业和原材料工业，包括但不限于煤炭、石油石化、电力及电力设备、电子、化工、钢铁、建材、有色金属等；
- 3) 为国民经济和人民生活提供普遍基础性服务的相关产业，包括但不限于软件、互联网和相关服务业、教育、文化、卫生等；
- 4) 其他在国民经济中承担基础性职能的产业，包括但不限于农林牧渔、机械、环保等。

同时，本基金将对基础产业的发展进行密切跟踪，随着产业的不断发展，相关上市公司的范围也会相应改变。在履行适当必要的程序后，本基金将根据实际情况调整基础产业的界定标准。

本基金首先根据上述基础产业的范畴在国内 A 股和港股通标的中选出备选股票池，并在此基础上通过自上而下及自下而上相结合的方法优选出具有长期回报潜力的优质上市公司，构建股票投资组合。

自上而下，在考虑传统宏观经济指标（如：GDP、PPI、CPI、利率变化等）、资金面情况、投资者预期、其他资产的预期收益与风险等等因素的基础上，依次对产业链条上细分子行业的产业政策、商业模式、进入壁垒、市场空间、增长速度等进行深度研究和综合考量，并在充分考虑估值水平的原则下进行资产配置。重点配置行业景气度较高、发展前景良好、技术基本成熟、政策重点扶持的子行业。对于技术、生产模式或商业模式尚不成熟处于培育期的产业，但其在未来市场前景广阔，本基金也将根据其发展阶段做适度配置。

自下而上，本基金通过定量和定性相结合的方法进行个股自下而上的选择。

在定性方面，本基金通过以下标准对股票的基本面进行研究分析并筛选出基本面优异的上市公司：

第一，根据公司的核心业务竞争力、市场地位、经营管理者能力、人才资源等选择具备良好竞争优势的公司；

第二，根据上市公司股权结构、公司组织框架、信息透明度等角度定性分析，选择公司治理结构良好的公司；

第三，通过定性的方式分析公司在自身的发展过程中，受国家产业政策的扶持程度、公司发展方向、核心产品和服务的发展前景、公司规模扩张及经营效益的趋势。另外还将考察公司在同业中的地位、决策体系及开拓精神等等。

在定量方面，本基金通过对上市公司内在价值的深入分析，挖掘具备估值优势的上市公司。本基金将在宏观经济分析、行业分析的基础上，根据公司的基本面及财务报表信息灵活运用各类估值方法评估公司的价值，评估指标包括 PE、PEG、PB、PS、EV/EBITDA 等。

港股通标的股票投资策略方面，本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场，不使用合格境内机构投资者(QDII)境外投资额度进行境外投资。本基金将遵循上述投资策略，优先将基本面健康、业绩向上弹性较大、具有估值优势的港股纳入本基金的股票投资组合。

对于存托凭证投资，本基金将在深入研究的基础上，通过定性分析和定量分析相结合的方式，筛选具有比较优势的存托凭证作为投资标的。

### 3、债券投资策略

本基金在债券投资方面，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的收益率水平、流动性和信用风险等因素，以久期控制和结构分布策略为主，以收益率曲线策略、利差策略等为辅，构造能够提供稳定收益的债券和货币市场工具组合。

### 4、股指期货投资策略

本基金参与股指期货投资将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的。本基金将在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

基金管理人针对股指期货交易制订严格的授权管理制度和投资决策流程，确保研究分析、投资决策、交易执行及风险控制各环节的独立运作，并明确相关岗位职责。

### 5、资产支持证券投资策略

本基金将通过宏观经济、提前偿还率、资产池结构及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，预测资产池未来现金流变化；研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响，同时密切关注流动性对标的证券收益率的影响。综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后的收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

### 6、风险管理策略

本基金将借鉴国外风险管理的成功经验如 Barra 多因子模型、风险预算模型等，并结合公司现有的风险管理流程，在各个投资环节中来识别、度量和控制投资风险，并通过调整投资组合的风险结构，来优化基金的风险收益匹配。

具体而言，在大类资产配置策略的风险控制上，由投资决策委员会及宏观策略研究小组进行监控；在个股投资的风险控制上，本基金将严格遵守公司的内部规章制度，控制单一个股投资风险。

### 7、投资决策依据和决策程序

#### (1) 投资决策依据

- 法律法规和基金合同。本基金的投资将严格遵守国家有关法律、法规和基金的相关规定。

- 宏观经济和上市公司的基本面数据。
- 投资对象的预期收益和预期风险的匹配关系。本基金将在承受适度风险的范围内，选择预期收益大于预期风险的品种进行投资。

#### （2）投资决策程序

- 公司研究部通过内部独立研究，并借鉴其他研究机构的研究成果，形成宏观、政策、投资策略、行业和上市公司等分析报告，为投资决策委员会和基金经理提供决策依据。

- 投资决策委员会定期和不定期召开会议，根据本基金投资目标和对市场的判断决定本计划的总体投资策略，审核并批准基金经理提出的资产配置方案或重大投资决定。

- 在既定的投资目标与原则下，根据分析师基本面研究成果以及定量投资模型，由基金经理选择符合投资策略的品种进行投资。

- 独立的交易执行：本基金管理人通过严格的交易制度和实时的一线监控功能，保证基金经理的投资指令在合法、合规的前提下得到高效地执行。

- 动态的组合管理：基金经理将跟踪证券市场和上市公司的发展变化，结合本基金的现金流量情况，以及组合风险和流动性的评估结果，对投资组合进行动态的调整，使之不断得到优化。

基金管理人风险管理部根据市场变化对本基金投资组合进行风险评估与监控，并授权风险控制小组进行日常跟踪，出具风险分析报告。合规管理部分对本基金投资过程进行日常监督。

#### （四）投资限制

##### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）股票资产的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%，投资于本基金界定的基础产业范围内的股票不低于非现金基金资产的 80%；

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

（3）本基金持有一家公司发行的证券（同一家公司在内地和香港同时上市的 A+H 股合计计算），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（同一家公司在内地和香港同时上市的 A+H 股合计计算），不超过该证券的 10%；

(5) 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%；

(6) 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15%；

(7) 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%；

(8) 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%；

(9) 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；

(10) 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；

(11) 基金资产总值不得超过基金资产净值的140%；

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

(13) 本基金参与股指期货交易，应当符合下列投资限制：

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

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，应当保持不低于基金资产净值的5%的现金或到期日在一年以内的政府债券；

③ 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）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

④ 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；

⑤ 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规定；

⑥ 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%；

（14）本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，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%；

（15）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本款所规定比例限制的，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

（16）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；

（17）本基金投资存托凭证的比例限制依照国内依法发行上市的股票执行，与国内依法发行上市的股票合并计算；

（18）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资比例限制。

因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例（除第（2）、（9）、（15）、（16）项）的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

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

法律法规或监管部门取消上述限制，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，但是中国证监会另有规定的除外；
- （5）向其基金管理人、基金托管人出资；
- （6）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- （7）依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先的原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管

理人董事会审议，并经过三分之二以上（含三分之二）的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

3、法律法规或监管部门对基金合同所述投资比例、投资限制、组合限制、禁止行为等作出强制性调整的，本基金应当按照法律法规或监管部门的规定执行；如法律法规或监管部门修改或调整涉及本基金的投资比例、投资限制、组合限制、禁止行为等，且该等调整或修改属于非强制性的，则基金管理人与基金托管人协商一致后，可按照法律法规或监管部门调整或修改后的规定执行，而无需基金份额持有人大会审议决定，但基金管理人在执行法律法规或监管部门调整或修改后的规定前，应向投资者履行信息披露义务并向监管机构报告或备案或更新/变更注册。

#### （五）业绩比较基准

中证全指资本品指数收益率\*30%+中证全指运输指数收益率\*30%+中证全指原材料指数收益率\*20%+恒生指数收益率\*5%+中债综合财富指数收益率\*15%

本基金股票部分主要投资于基础产业相关股票，中证全指资本品指数、中证全指运输指数、中证全指原材料指数所跟踪的上市公司大多数属于本基金界定的基础产业范畴，较好地代表了我国基础产业发展状况。恒生指数是由恒生指数服务有限公司编制，以香港股票市场中的50家上市股票为成分股样本，以其发行量为权数的加权平均股价指数，是反映香港股市价幅趋势最有影响的一种股价指数。中债综合财富指数为中央国债登记结算有限责任公司编制并发布，该指数的样本券包括了商业银行债券、央行票据、证券公司债、证券公司短期融资券、政策性银行债券、地方企业债、中期票据、记账式国债、国际机构债券、非银行金融机构债、短期融资券、中央企业债等债券，综合反映了债券市场整体价格和回报情况，该指数以债券托管量市值作为样本券的权重因子，每日计算债券市场整体表现，是目前市场上较为权威的反映债券市场整体走势的基准指数之一，适合作为本基金债券部分的业绩比较基准。

如果相关法律法规发生变化，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，经基金管理人与基金托管人协商，本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告，而无须召开基金份额持有人大会。

#### （六）风险收益特征

本基金为股票型证券投资基金，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金将投资港股通标的股票，将承担汇率风险以及因投资环境、投资标的、市场制度、交易规则差异等带来的境外市场的风险。

### （七）基金管理人代表基金行使相关权利的处理原则及方法

- 1、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东或债权人权利，保护基金份额持有人的利益；
- 2、不谋求对上市公司的控股；
- 3、有利于基金财产的安全与增值；
- 4、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

### （八）基金的融资

本基金可以根据届时有效的有关法律法规和政策的规定进行融资。

### （九）基金投资组合报告

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。

本基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年1月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至2020年12月31日（“报告期末”），本报告所列财务数据未经审计。

#### 1. 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	224,447,293.34	92.28
	其中：股票	224,447,293.34	92.28
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	9,762,023.70	4.01
	其中：债券	9,762,023.70	4.01
	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	5,913,818.96	2.43



8	其他资产	3,100,099.18	1.27
9	合计	243,223,235.18	100.00

注：通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 81,907,041.35 元，占基金资产净值的比例为 34.23%。

## 2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

### (1) 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	10,943,044.00	4.57
B	采矿业	-	-
C	制造业	37,454,677.22	15.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,612,015.04	3.60
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	16,322.72	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	58,971,656.33	24.65
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,036,119.58	3.36
J	金融业	7,721,900.00	3.23
K	房地产业	10,769,436.00	4.50
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	15,081.10	0.01
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	142,540,251.99	59.57

### (2) 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
通信服务	22,310,193.12	9.32
非必需消费品	25,433,519.16	10.63
必需消费品	2,576,731.36	1.08
能源	2,517,648.23	1.05
金融	-	-
医疗保健	-	-

工业	4,592,105.67	1.92
信息技术	-	-
原材料	11,997,746.53	5.01
房地产	-	-
公用事业	12,479,097.28	5.22
合计	81,907,041.35	34.23

### 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	3690 HK	美团-W	95,000	23,554,978.68	9.84
2	700 HK	腾讯控股	47,000	22,310,193.12	9.32
3	603885	吉祥航空	1,952,900	22,204,473.00	9.28
4	002120	韵达股份	1,263,107	19,830,779.90	8.29
5	601021	春秋航空	305,185	16,916,404.55	7.07
6	384 HK	中国燃气	481,400	12,479,097.28	5.22
7	581 HK	中国东方集团	6,920,000	11,997,746.53	5.01
8	000998	隆平高科	552,400	10,943,044.00	4.57
9	601155	新城控股	309,200	10,769,436.00	4.50
10	002557	洽洽食品	162,112	8,729,731.20	3.65

### 4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	9,762,023.70	4.08
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	9,762,023.70	4.08

### 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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	019627	20 国债 01	97,630	9,762,023.70	4.08

注：报告期末，本基金仅持有上述 1 支债券。

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

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**

**(1) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

无。

**(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**

**(1) 本期国债期货投资政策**

无。

**(2) 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

无。

**(3) 本期国债期货投资评价**

无。

**11. 投资组合报告附注**

**(1) 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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**

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

**(2) 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库**

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

### (3) 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	388,244.93
2	应收证券清算款	2,360,696.36
3	应收股利	-
4	应收利息	216,081.58
5	应收申购款	135,076.31
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,100,099.18

### (4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

### (5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

### (6) 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## 十、基金的业绩

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。

### （一）本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

#### 嘉实基础产业优选股票 A

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2020年04月15日 （基金合同生效日）至 2020年12月31日	23.80%	0.97%	26.56%	1.02%	-2.76%	-0.05%

#### 嘉实基础产业优选股票 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
2020年04月15日 （基金合同生效日）至 2020年12月31日	23.37%	0.97%	26.56%	1.02%	-3.19%	-0.05%

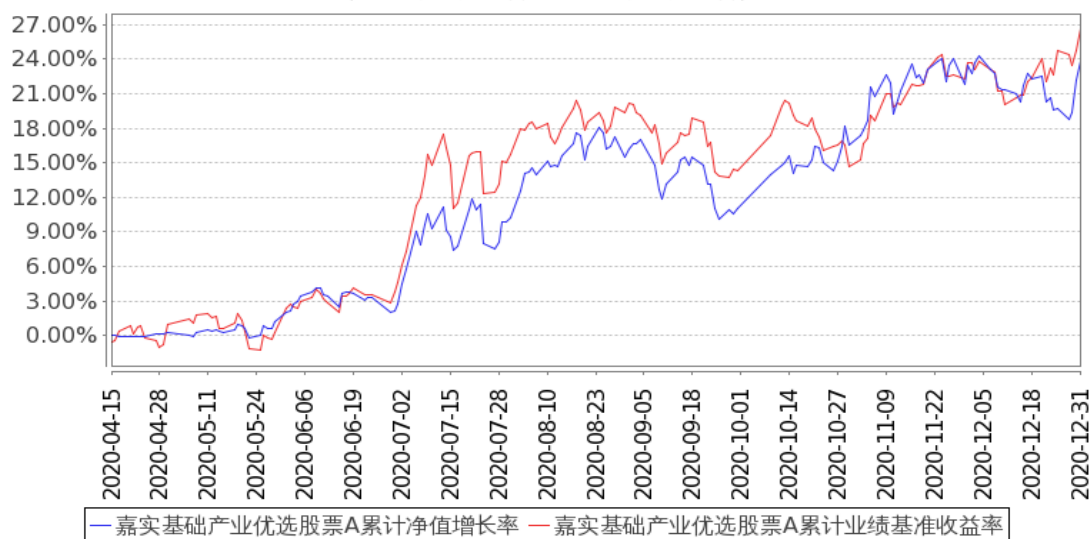
该时间区间历任基金经理

本基金在该时间区间内无历任基金经理。

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

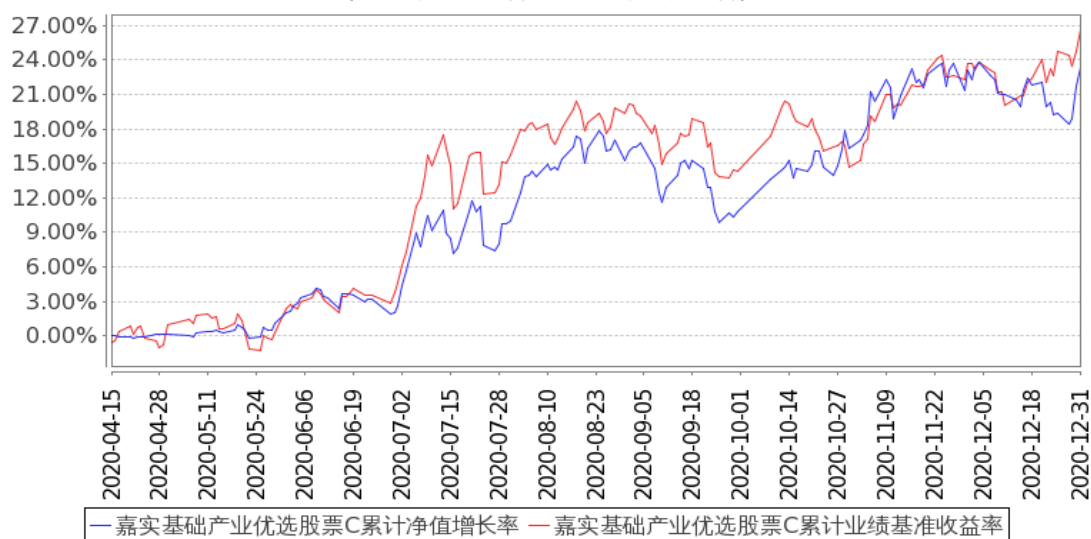
### 嘉实基础产业优选股票A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2020年04月15日至2020年12月31日)



### 嘉实基础产业优选股票C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2020年04月15日至2020年12月31日)



注：（1）本基金合同生效日2020年04月15日至报告期末未满1年。

（2）按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起6个月为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

## 十一、基金的财产

### （一）基金资产总值

基金资产总值是指购买的各类证券及票据价值、银行存款本息和基金应收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、基金服务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、基金托管人和基金服务机构的财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人、基金服务机构和基金销售机构以其自有的财产承担其自身的法律责任，其债权人不得对本基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。除依法律法规和《基金合同》的规定处分外，基金财产不得被处分。

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

## 十二、基金资产的估值

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

### （三）估值原则

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

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

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

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

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

### （四）估值方法

本基金所持有的投资品种，按如下原则进行估值：

#### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

（1）交易所上市的有价证券（包括股票等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经



济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

(2) 交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（基金合同另有规定的除外），选取估值日第三方估值机构提供的相应品种对应的估值净价估值。

(3) 对在交易所市场上市交易的可转换债券，按照每日收盘价作为估值全价。

(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，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) 流通受限股票（指在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分、首次公开发行股票公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中质押券等。）按监管机构或行业协会发布的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、同一证券同时在两个或两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。

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

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

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

8、估值计算中涉及港币对人民币汇率的，将依据下列信息提供机构所提供的汇率为基准：当日中国人民银行公布的人民币与港币的中间价。

9、本基金投资存托凭证的估值核算，依照国内依法发行上市的股票执行。

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

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

基金管理人负责基金资产净值计算和基金会计核算，并担任本基金的会计责任方。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見，基金管理人向基金托管人出具盖章的书面说明后，按照基金管理人對基金净值信息的计算结果对外予以公布。

#### （五）估值程序

1、某一类别基金份额净值是按照每个工作日闭市后，该类别基金资产净值除以当日该类别基金份额的余额数量计算，精确到0.0001元，小数点后第五位四舍五入。基金管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的，从其规定。本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值。

基金管理人每个工作日计算基金资产净值及各类基金份额的基金份额净值，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，将各类基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

#### （六）估值错误的处理

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

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，则该有协助义务的当事人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) 基金份额净值出现错误时，基金管理人、基金托管人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；

(2) 错误偏差达到该类别基金份额净值的 0.25%时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到该类别基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告，通知基金托管人，并同时报中国证监会备案；

(3) 当发生净值计算错误时，由基金管理人负责处理，由此给基金份额持有人和基金造成损失的，应由基金管理人先行赔付，基金管理人按差错情形，有权向其他当事人追偿。

### 5、特殊情况的处理

(1) 基金管理人或基金托管人按基金合同约定的估值方法第(6)项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

(2) 由于不可抗力原因，或由于证券交易所、期货交易所、第三方估值机构及登记结算机构发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金

资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

（七）暂停估值的情形

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

2、因不可抗力致使基金管理人、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基金管理人应当暂停基金估值；

4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

（八）基金净值的确认

用于基金信息披露的基金资产净值和各类别基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金资产净值和各类别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。

## 十三、基金的收益与分配

### （一）基金利润的构成

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

### （二）基金可供分配利润

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

### （三）基金收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金可以进行收益分配，本基金每年收益分配次数最多为12次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的20%，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按除息日的该类基金份额净值自动转为同一类别的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、基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、由于本基金A类基金份额不收取销售服务费，而C类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同。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。

在不违反法律法规规定及基金合同约定，且不损害基金份额持有人实际利益的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则和支付方式进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

### （四）收益分配方案

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

### （五）收益分配方案的确定、公告与实施

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

### （六）基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为同一类别的基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。

## 十四、基金的费用与税收

### （一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金的销售服务费；
- 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、律师费和诉讼费或仲裁费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券、期货交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、因投资港股通标的股票而产生的各项费用；
- 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1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日或不可抗力等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

#### 2、基金托管人的托管费

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

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

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日或不可抗力等，支付日期

顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

### 3、基金的销售服务费

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0.50%，销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值的0.50%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

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

基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日或不可抗力等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

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）基金税收

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

## 十五、基金的会计与审计

### （一）基金会计政策

- 1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；
- 2、基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日；
- 3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
- 4、会计制度执行国家有关会计制度；
- 5、本基金独立建账、独立核算；
- 6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；
- 7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

### （二）基金的年度审计

- 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意。
- 3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所需依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。



## 十六、基金的信息披露

（一）本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《流动性风险管理规定》、《基金合同》及其他有关规定。相关法律法规关于信息披露的规定发生变化时，本基金从其最新规定。

### （二）信息披露义务人

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

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

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

（三）本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

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

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

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

### （五）公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

#### 1、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，将基金份额发售公告、基金招募说明书提示性公告和《基金合同》提示性公告登载在指定报刊上，将基金份额发售公告、基金招募说明书、基金产品资料概要、《基金合同》和基金托管协议登载在指定网站上，并将基金产品资料概要登载在基金销售机构网站或营业网点；基金托管人应当同时将《基金合同》、基金托管协议登载在网站上。

## 2、基金份额发售公告

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

## 3、《基金合同》生效公告

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

## 4、基金净值信息

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

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

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

## 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有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

## 7、临时报告

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

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

- （1）基金份额持有人大会的召开及决定的事项；
- （2）《基金合同》终止、基金清算；
- （3）转换基金运作方式、基金合并；
- （4）更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；
- （5）基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；
- （6）基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- （7）基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人的实际控制人变更；
- （8）基金募集期延长或提前结束募集；
- （9）基金管理人的高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；
- （10）基金管理人的董事在最近12个月内变更超过百分之五十，基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近12个月内变动超过百分之三十；

- (11) 涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁；
- (12) 基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；
- (13) 基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易事项，但中国证监会另有规定的除外；
- (14) 基金收益分配事项；
- (15) 管理费、托管费、申购费、赎回费、基金销售服务费等费用计提标准、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该类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) 调整本基金份额类别设置；
- (22) 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；
- (23) 基金管理人采用摆动定价机制进行估值；
- (24) 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或基金合同规定的其他事项。

#### 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议，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

#### 10、清算报告

基金合同终止的，基金管理人应当依法组织清算组对基金财产进行清算并作出清算报告。清算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，并由律师事务所出具法律意见书。清算组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

#### 11、中国证监会规定的其他信息

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。

基金管理人应在基金年报及中期中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细。

基金管理人应在基金季度报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期末按市值占基金净资产比例大小排序的前10名资产支持证券明细。

基金应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露参与港股通标的股票交易的相关情况。

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

#### （六）信息披露事务管理

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

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

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、各类基金份额的基金份额净值、各类基金份额的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的信息。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。

#### （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）暂停或延迟信息披露的情形

当出现下述情况时，基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金信息：

- 1、基金投资所涉及的证券、期货交易所或外汇市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；
- 3、法律法规规定、中国证监会或《基金合同》认定的其他情形。

## 十七、风险揭示

### （一）市场风险

证券市场价格因受各种因素的影响而引起的波动，将对本基金资产产生潜在风险，主要包括：

#### 1、政策风险

货币政策、财政政策、产业政策等国家政策的变化对证券市场产生一定的影响，导致市场价格波动，影响基金收益而产生风险。

#### 2、经济周期风险

证券市场是国民经济的晴雨表，而经济运行具有周期性的特点。宏观经济运行状况将对证券市场的收益水平产生影响，从而产生风险。

#### 3、利率风险

金融市场利率波动会导致股票市场及债券市场的价格和收益率的变动，同时直接影响企业的融资成本和利润水平。基金投资于货币市场工具，收益水平会受到利率变化的影响。

#### 4、购买力风险

本基金投资的目的是使基金资产保值增值，如果发生通货膨胀，基金投资于证券所获得的收益可能会被通货膨胀抵消，从而影响基金资产的保值增值。

#### 5、上市公司经营风险

上市公司的经营状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务等都会导致公司盈利发生变化，从而导致基金投资收益变化。

### （二）信用风险

信用风险主要指债券、资产支持证券等信用证券发行主体信用状况恶化，导致信用评级下降甚至到期不能履行合约进行兑付的风险，另外，信用风险也包括证券交易对手因违约而产生的证券交割风险。

### （三）流动性风险

指基金资产不能迅速转变成现金，或者不能应付可能出现的投资者大额赎回的风险。在开放式基金交易过程中，可能会发生巨额赎回的情形。巨额赎回可能会产生基金仓位调整的困难，导致流动性风险，甚至影响基金份额净值。

#### 1、本基金的申购、赎回安排

投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，若该工作日为非港股通交易日，则本基金不开放申购与赎回，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/期货交易市场、证券/期货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、拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

### （1）投资市场的流动性风险

本基金投资于国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他依法发行上市的股票）、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许买卖的香港联合交易所上市股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换公司债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、股指期货等。上述资产均存在规范的交易场所，运作时间长，市场透明度较高，运作方式规范，历史流动性状况良好，正常情况下能够及时满足基金变现需求，保证基金按时应对赎回要求。极端市场情况下，上述资产可能出现流动性不足，导致基金资产无法变现，从而影响投资者按时收到赎回款项。根据过往经验统计，绝大部分时间上述资产流动性充裕，流动性风险可控，当遇到极端市场情况时，基金管理人会按照基金合同及相关法律法规要求，及时启动流动性风险应对措施，保护基金投资者的合法权益。

### （2）投资行业的流动性风险

本基金主要投资于基础产业范围内股票，基金资产投资于本基金界定的基础产业范围内的股票不低于非现金基金资产的 80%。

本基金界定的基础产业指在国民经济发展中处于基础地位、可影响其他产业发展水平的产业群，主要集中在基础设施、基础工业和基础服务等领域，具体如下：

- 1) 与传统和新型基础设施的建设、运营和维护相关的产业，包括但不限于交通运输、建筑、水利、市政公用、通信等；
- 2) 基础工业主要是指能源工业和原材料工业，包括但不限于煤炭、石油石化、电力及电力设备、电子、化工、钢铁、建材、有色金属等；
- 3) 为国民经济和人民生活提供普遍基础性服务的相关产业，包括但不限于软件、互联网和相关服务业、教育、文化、卫生等；
- 4) 其他在国民经济中承担基础性职能的产业，包括但不限于农林牧渔、机械、环保等。

同时，本基金将对基础产业的发展进行密切跟踪，随着产业的不断发展，相关上市公司的范围也会相应改变。在履行适当必要的程序后，本基金将根据实际情况调整基础产业的界定标准。

本基金投资行业集中度高，在正常市场环境下投资标的流动性充足能够及时满足投资者的赎回需求，但在极端市场情况下可能出现基金资产净值 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，届时基金管理人会按



照基金合同及相关法律法规要求，及时启动流动性风险应对措施，保护基金投资者的合法权益。

### （3）投资资产的流动性风险

本基金针对流动性较低资产的投资进行了严格的限制，以降低基金的流动性风险：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%。

本基金绝大部分基金资产投资于7个工作日内可变现资产，包括可在交易所、银行间市场正常交易的股票、债券、非金融企业债务融资工具及同业存单，7个工作日内到期或可支取的逆回购、银行存款，7个工作日内能够确认收到的各类应收款项等，上述资产流动性情况良好。

### 3、巨额赎回措施

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）超过前一工作日的基金总份额的10%，即认为是发生了巨额赎回。

当本基金发生巨额赎回情形时，基金管理人可能采用以下流动性风险管理措施，以控制因巨额赎回可能产生的流动性风险：

（1）延缓支付赎回款项，并对当日申请赎回的份额超过前一工作日基金总份额20%的单个赎回申请人部分延期办理；

（2）采用摆动定价机制；

（3）中国证监会认定的其他措施。

### 4、实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响：

（1）当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金申购赎回申请的措施。基金份额持有人存在不能及时赎回基金份额的风险。

（2）本基金对持续持有期少于7日的投资人，收取1.5%的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产。赎回费在投资人赎回基金份额时收取。

（3）当本基金发生大额申购或赎回情形时，本基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。当日参与申购和赎回交易的投资者存在承担申购或者赎回产生的交易及其他成本的风险。

### （四）管理风险

在基金管理运作过程中，可能因基金管理人经济形势和证券市场等判断有误、获取的信息不全等影响基金的收益水平。基金管理人的管理水平、管理手段和管理技术等对基金收益水平存在影响。

### （五）操作或技术风险

指相关当事人在业务各环节操作过程中，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引致的风险，例如，越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误、IT系统故障等风险。

在开放式基金的各种交易行为或者后台运作中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致投资者的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理人、登记机构、代销机构、证券、期货交易所、证券登记结算机构等等。

#### （六）合规性风险

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

#### （七）本基金特有的风险

##### 1、市场下跌风险

本基金是股票型基金，基金资产主要投资于股票市场，因此股市的变化将影响到基金业绩表现。本基金虽然按照风险收益配比原则，实行动态的资产配置，但并不能完全抵御市场整体下跌风险，基金净值表现因此会可能受到影响。本基金管理人将发挥专业研究优势，加强对市场、上市公司基本面和固定收益类产品的深入研究，持续优化组合配置，以控制特定风险。

##### 2、资产支持证券投资风险

本基金投资资产支持证券，可能面临利率风险、流动性风险、现金流预测风险。利率风险是指市场利率将随宏观经济环境的变化而波动，利率波动可能会影响资产支持证券收益。流动性风险是指在交易对手有限的情况下，资产支持证券持有人将面临无法在合理的时间内以公允价格出售资产支持证券而遭受损失的风险。资产支持证券的还款来源为基础资产未来现金流，现金流预测风险是指由于对基础资产的现金流预测发生偏差导致的资产支持证券本息无法按期或足额偿还的风险。

##### 3、港股交易失败风险

港股通业务试点期间存在每日额度限制。在香港联合交易所有限公司开市前阶段，当日额度使用完毕的，新增的买单申报将面临失败的风险；在联交所持续交易时段，当日额度使用完毕的，当日本基金将面临不能通过港股通进行买入交易的风险。

##### 4、汇率风险

本基金将投资港股通标的股票，在交易时间内提交订单依据的港币买入参考汇率和卖出参考汇率，并不等于最终结算汇率。港股通交易日日终，中国证券登记结算有限责任公司进行净额换汇，将换汇成本按成交金额分摊至每笔交易，确定交易实际适用的结算汇率。故本基金投资面临汇率风险，汇率波动可能对基金的投资收益造成损失。

##### 5、境外市场的风险

（1）本基金的将通过“内地与香港股票市场交易互联互通机制”投资于香港市场，在市场进入、投资额度、可投资对象、税务政策等方面都有一定的限制，而且此类限制可能会不断调整，这些限制因素的变化可能对本基金进入或退出当地市场造成障碍，从而对投资收益以及正常的申购赎回产生直接或间接的影响。

（2）香港市场交易规则有别于内地A股市场规则，此外，在“内地与香港股票市场交易互联互通机制”下参与香港股票投资还将面临包括但不限于如下特殊风险：

1）港股市场实行T+0回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股估价可能表现出比A股更为剧烈的股价波动；

2）只有境内、香港两地均为交易日且能够满足结算安排、开通港股通交易的交易日才为港股通交易日，在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险；

3）香港出现台风、黑色暴雨或者联交所规定的其他情形时，联交所将可能停市，投资者将面临在停市期间无法进行港股通交易的风险；出现内地证券交易服务公司认定的交易异常情况时，内地证券交易服务公司将可能暂停提供部分或者全部港股通服务，投资者将面临在暂停服务期间无法进行港股通交易的风险；

4）投资者因港股通股票权益分派、转换、上市公司被收购等情形或者异常情况，所取得的港股通股票以外的联交所上市证券，只能通过港股通卖出，但不得买入，内地证券交易服务公司另有规定的除外；因港股通股票权益分派或者转换等情形取得的联交所上市股票的认购权利在联交所上市的，可以通过港股通卖出，但不得行权；因港股通股票权益分派、转换或者上市公司被收购等所取得的非联交所上市证券，可以享有相关权益，但不得通过港股通买入或卖出；

5）代理投票。由于中国结算是汇总投资者意愿后再向香港结算提交投票意愿，中国结算对投资者设定的意愿征集期比香港结算的征集期稍早结束；投票没有权益登记日的，以投票截止日的持有作为计算基准；投票数量超出持有数量的，按照比例分配持有基数。以上所述因素可能会给本基金投资带来特殊交易风险。

## 6、其他投资风险

本基金还投资于股指期货等金融工具，而股指期货属于高风险投资工具，相应市场的波动也可能给基金财产带来较高风险。

本基金的投资工具股指期货还有可能引发如下风险：

### （1）卖空风险

本基金可能会采用股指期货来剥离基金的系统性风险，将来会优选做空个股、做空其他衍生工具的方式来实现投资目标。同时持有多头和空头头寸的方式导致本基金存在在特定市场情况下跑不赢普通偏股型基金的风险，同时有可能导致持有本基金在特殊情况下比持有普通偏股型基金蒙受更大损失。

## （2）基差风险

在使用股指期货对冲市场风险的过程中，基金财产可能因为股指期货合约与标的指数价格波动不一致而遭受基差风险。形成基差风险的潜在原因包括：

1) 需要对冲的风险资产与股指期货标的指数风险收益特征存在明显差异；

2) 因未知因素导致股指期货合约到期时基差严重偏离正常水平；

3) 因存在基差风险，在进行股指期货合约展期的过程中，基金财产可能会承担股指期货合约之间的价差向不利方向变动而导致的展期风险。

## （3）杠杆风险

因股指期货采用保证金交易而存在杠杆，基金财产可能因此产生更大的收益波动。

## （4）到期日风险

股指期货合约到期时，基金财产如持有未平仓合约，中金所将按照交割结算价将基金财产持有的合约进行现金交割，基金财产将无法继续持有到期合约，具有到期日风险。

## （5）对手方风险

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

## （6）盯市结算风险

股指期货采取保证金交易，保证金账户实行当日无负债结算制度，对资金管理要求较高。假如市场走势对本基金财产不利，期货经纪公司会按照期货经纪合同约定的时间和方式通知基金管理人追加保证金，以使基金财产能继续持有未平仓合约。如出现极端行情，市场持续向不利方向波动导致期货保证金不足，又未能在规定时间内补足，按规定保证金账户将被强制平仓，甚至已缴付的所有保证金都不能弥补损失，从而导致超出预期的损失。

## （7）平仓风险

在某些市场情况下，基金财产可能会难以或无法将持有的未平仓合约平仓，例如，这种情况可能市场达到涨跌停板时出现。出现这类情况，基金财产缴付的所有保证金有可能无法弥补全部损失，委托人还必须承担由此导致的全部损失。

期货经纪公司或其客户保证金不足，又未能在规定的时间内补足，或因其他原因导致中金所以对期货经纪公司的经纪账户强行平仓，基金财产可能因被连带强行平仓而遭受损失。

## （8）连带风险

为基金财产进行结算的结算会员或该结算会员下的其他投资者出现保证金不足、又未能在规定的时间内补足，或因其他原因导致中金所对该结算会员下的经纪账户强行平仓时，基金财产的资产可能因被连带强行平仓而遭受损失。

## （9）基金资产投资特定投资对象的其他风险

如期货经纪公司违反法律法规或中金所交易、结算等规则，可能会导致基金财产受到损失。

由于国家法律、法规、政策的变化、中金所交易规则的修改、紧急措施的出台等原因，基金财产持有的未平仓合约可能无法继续持有，基金财产必须承担由此导致的损失。

#### 7、存托凭证的投资风险

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

#### （八）其他风险

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

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

## 十八、基金合同的变更、终止和基金财产的清算

### （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。对于法律法规规定和基金合同约定可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，自决议生效后按照《信息披露办法》的规定在指定媒介公告。

### （二）《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：

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

### （三）基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起30个工作日内成立清算小组，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。在基金财产清算小组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

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、期货相关业务资格的注册会计师、律师组成。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）基金财产清算小组成立后，由基金财产清算小组统一接管基金；
- （2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- （3）对基金财产进行估值和变现；
- （4）制作清算报告；
- （5）聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- （6）将清算报告报中国证监会备案并公告；

（7）对基金剩余财产进行分配。

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

（四）清算费用

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

（五）基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按各类基金份额资产净值的比例确定剩余财产在各类基金份额中的分配比例，并在各类基金份额可分配的剩余财产范围内按各类别基金份额的基金份额持有人持有的该类基金份额比例进行分配。同一类别的基金份额持有人对本类别基金份额的剩余资产具有同等的分配权。

（六）基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算小组进行公告，基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

（七）基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。

## 十九、基金合同的内容摘要

### （一）基金合同当事人及权利义务

#### A. 基金份额持有人的权利和义务

基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受，基金投资者自依据《基金合同》取得基金份额，即成为本基金份额持有人和《基金合同》的当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为《基金合同》当事人并不以在《基金合同》上书面签章或签字为必要条件。

同一类别每份基金份额具有同等的合法权益。

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

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

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



(9) 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。B. 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) 依法募集资金；
- (2) 自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
- (3) 依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- (4) 销售基金份额；
- (5) 按照规定召集基金份额持有人大会；
- (6) 依据《基金合同》及有关法律、法规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律、法规规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- (7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- (8) 选择、更换为本基金提供销售、销售支付、份额登记、估值、投资顾问、法律、会计等服务的基金服务机构并确定相关费率，对基金服务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、期货经纪商或其他为基金提供服务的外部机构，并确定有关的费率；
- (16) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换和非交易过户等业务的《业务规则》；
- (17) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

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

- (3) 自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；
- (4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；
- (5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；
- (6) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；
- (7) 依法接受基金托管人的监督；
- (8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回的价格；
- (9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- (10) 编制季度报告、中期报告和年度报告；
- (11) 严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
- (12) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定或有权机关另有要求外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露，因向审计、法律等外部专业顾问提供的情况除外；
- (13) 按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；
- (14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
- (15) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
- (16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上；
- (17) 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间内发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件；
- (18) 组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- (19) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；
- (20) 因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

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

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

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

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

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(26) 建立并保存基金份额持有人名册；

(27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

### C. 基金托管人的权利和义务

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，为基金开设或注销证券账户、资金账户等投资所需账户，为基金办理证券、期货交易资金清算；

(5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

(6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

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

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

（4）除依据《基金法》、《基金合同》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）按规定开设或注销基金财产的资金账户和证券账户等投资所需的其他账户，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或有权机关另有要求外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露，因向审计、法律等外部专业顾问提供的情况除外；

（8）复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值；

（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管理人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

（16）按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；

（17）参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

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

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

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

（21）执行生效的基金份额持有人大会的决议；

（22）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## （二）基金份额持有人大会

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。就持有人大会事宜，同一类别的基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的权利。

### A. 召开事由

1、除法律法规，或基金合同，或中国证监会另有规定外，当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

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

2、在不违反法律法规及基金合同的有关规定的前提下，以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

- （1）法律法规要求增加的基金费用的收取；
- （2）在法律法规和《基金合同》规定的范围内且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，调整本基金的申购费率、调低赎回费率、销售服务费率或变更收费方式、调整本基金的基金份额类别的设置；
- （3）因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；
- （4）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；
- （5）按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

B. 会议召集人及召集方式

1、本基金基金份额持有人大会不设日常机构。除法律法规规定或《基金合同》另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。

2、基金管理人未按规定召集或不能召开时，由基金托管人召集。

3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。

基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集，并自出具书面决定之日起六十日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

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

5、代表基金份额 10%以上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、基金份额持有人大会的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

C. 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至少 30 日，在指定媒介发布召开基金份额持有人大会的通知。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、书面表决意见送达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。

#### D. 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或法律法规及监管机关允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

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

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

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

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

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

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

（3）本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的 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，并与基金登记机构记录相符；

3、在不与法律法规冲突的前提下，基金份额持有人大会可通过网络、电话或其他方式召开，基金份额持有人可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式进行表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

4、基金份额持有人授权他人代为出席会议并表决的，授权方式可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式，具体方式在会议通知中列明。

5、若到会者在权益登记日所持有的有效基金份额低于本条第1款第（2）项、第2款第（3）项规定比例的，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以后、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，到会者所持有的基金份额不少于在权益登记日基金份额总数的三分之一（含三分之一）。E. 议事内容与程序

#### 1、议事内容及提案权

议事内容为本部分“一、召开事由”中所述应由基金份额持有人大会审议决定的事项。

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计票人，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，首先由召集人在收取会议审议事项书面表决意见截止日期前至少提前30日公布提案，在所通知的收取表决意见截止日期后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。

#### F. 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。除基金合同另有约定外，转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》、本基金与其他基金合并以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的投资者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。

#### G. 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人士共同担任计票人；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计票人。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）计票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。

（3）如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有异议，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。计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人士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。

#### H. 生效与公告

基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。该表决通过之日为基金份额持有人大会计票完成且计票结果符合法律法规和基金合同规定的决议通过条件之日。

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

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

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

### （三）基金合同的变更、终止与基金财产的清算

#### A. 《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。对于法律法规规定和基金合同约定可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，自决议生效后按照《信息披露办法》的规定在指定媒介公告。

#### B. 《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：

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

#### C. 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。在基金财产清算小组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

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、期货相关业务资格的注册会计师、律师组成。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) 基金财产清算小组成立后，由基金财产清算小组统一接管基金；
- (2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- (3) 对基金财产进行估值和变现；
- (4) 制作清算报告；
- (5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- (6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；
- (7) 对基金剩余财产进行分配。

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

D. 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。

E. 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，按各类基金份额资产净值的比例确定剩余财产在各类基金份额中的分配比例，并在各类基金份额可分配的剩余财产范围内按各类别基金份额的基金份额持有人持有的该类基金份额比例进行分配。同一类别的基金份额持有人对本类别基金份额的剩余资产具有同等的分配权。

F. 基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算小组进行公告，基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

G. 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。

(四) 争议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，各方当事人应尽量通过协商、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中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。仲裁费用由败诉方承担，除非仲裁裁决另有决定。

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

《基金合同》受中国法律（为本合同之目的，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区法律）管辖。

#### （五）基金合同的效力

《基金合同》是约定基金合同当事人之间权利义务关系的法律文件。

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

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

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

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

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

## 二十、基金托管协议的内容摘要

### （一）托管协议当事人

#### A. 基金管理人

名称：嘉实基金管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心二期27层09-14单元

办公地址：北京市朝阳区建国门外大街21号北京国际俱乐部C座写字楼12A层

邮政编码：100005

法定代表人：经雷

成立日期：1999年3月25日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字[1999]5号

组织形式：有限责任公司（中外合资）

注册资本：1.5亿元

存续期间：持续经营

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务

#### B. 基金托管人

名称：中国建设银行股份有限公司（简称：中国建设银行）

住所：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

邮政编码：100033

法定代表人：田国立

成立日期：2004年09月17日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]12号

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；经中国银行业监督管理委员会等监管部门批准的其他业务。

### （二）基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

A. 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。

本基金投资于国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板、存托凭证及其他依法发行上市的股票）、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许买卖的香港联合交易所上市股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换公司债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、股指期货、现金以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

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。

本基金的投资组合比例为：股票资产的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%，投资于本基金界定的基础产业范围内的股票不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值的 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股指期货及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。如法律法规或中国证监会允许，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。

B. 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）股票资产的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%，投资于本基金界定的基础产业范围内的股票不低于非现金基金资产的 80%；

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

（3）本基金持有一家公司发行的证券（同一家公司在内地和香港同时上市的 A+H 股合计计算），其市值不超过基金资产净值的 10%；

（4）本基金管理人管理的且在本基金托管人处托管的全部基金持有一家公司发行的证券（同一家公司在内地和香港同时上市的 A+H 股合计计算），不超过该证券的 10%；

（5）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%；

（6）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 15%；

(7) 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%；

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

(9) 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；

(10) 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；

(11) 本基金基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

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

(13) 本基金参与股指期货交易，应当符合下列投资限制：

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

② 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）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

③ 本基金在任何交易日日终，持有的卖出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；

④ 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合《基金合同》关于股票投资比例的有关规定；

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

⑥ 本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金在开始进行期货投资之前，应与基金托管人、期货公司三方一同就期货开户、清算、估值、交收等事宜另行签署《期货投资托管操作三方备忘录》（协议名称以实际签署为准）。

(14) 本基金管理人管理且在本基金托管人处托管的全部开放式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%；本基金管理人管理且在本基金托管人处托管的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；

(15) 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本款所规定比例限制的，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(16) 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；

(17) 本基金投资存托凭证的比例限制依照国内依法发行上市的股票执行，与国内依法发行上市的股票合并计算。

(18) 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。

因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例（除第（2）、（9）、（15）、（16）项）的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

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

法律法规或监管部门对基金合同所述投资比例、投资限制、组合限制、禁止行为等作出强制性调整的，本基金应当按照法律法规或监管部门的规定执行；如法律法规或监管部门修改或调整涉及本基金的投资比例、投资限制、组合限制、禁止行为等，且该等调整或修改属于非强制性的，则基金管理人与基金托管人协商一致后，可按照法律法规或监管部门调整或修改后的规定执行，而无需基金份额持有人大会审议决定，但基金管理人在执行法律法规或监管部门调整或修改后的规定前，应向投资者履行信息披露义务并向监管机关报告或备案或更新/变更注册。

C. 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通过事后监督方式进行监督。

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



人董事会审议，并经过三分之二以上（含三分之二）的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

D. 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。因交易对手违约给基金资产造成损失的，由基金管理人负责向违约方进行追偿；违约方在基金托管人与基金管理人确定的时间内未进行赔偿或赔偿不足以弥补基金资产损失的，由基金管理人承担相应损失。基金托管人则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改正，基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任。

E. 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、本基金投资的流通受限证券与上文所述的流动性受限资产并不完全一致，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。

本基金投资的流通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。

本基金投资的流通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流通受限证券

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，及因基金管理人原因导致的流通受限证券存管问题而直接影响本基金安全的责任及损失，由基金管理人承担。

本基金投资流通受限证券，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流通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流通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，基金管理人应按照国家法律法规和基金合同的规定处理并承担相应责任。对本基金因投资流通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。

本基金有关投资流通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）本基金投资流通受限证券时的法律法规遵守情况。
- （2）在基金投资流通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流通受限证券有新规定的，从其规定。

F. 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、各类基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、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。

G. 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。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

H. 基金管理人负有义务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。

I. 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。

J. 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）基金管理人对于基金托管人的业务核查

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

B. 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。

C. 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

##### A. 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、证券账户等投资所需账户。
- 4、基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，独立核算，分账管理，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证券登记结算有限责任公司结算数据完成场内交易交收、开户银行或交易/登记结算机构扣收的交易费、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，但应予以必要配合。
- 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。

##### B. 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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《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、期货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》备案的条件，由基金管理人按规定办理退款等事宜。

C. 基金银行账户的开立和管理

1、基金托管人可以基金的名义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。

2、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。

3、基金银行账户的开立和管理应符合银行业监督管理机构的有关规定。

4、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。

D. 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。

证券账户开户费由基金管理人先行垫付，待托管产品启始运营后，基金管理人可向基金托管人发送划款指令，将代垫开户费从本基金托管资金账户中扣还基金管理人。

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、结算保证金、交收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以及基金管理人与基金托管人签署的《托管银行证券资金结算协议》执行。

5、账户注销时，在遵守中国证券登记结算公司的相关规定下，由管理人和托管人协商确认主要办理人。账户注销期间，主要办理人如需另一方提供配合的，另一方应予以配合。

6、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，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。

E. 债券托管专户的开设和管理

《基金合同》生效后，基金管理人负责以基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表基金进行交易；基金托管人根据中国人民银行、银行间市场登

记结算机构的有关规定，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。

#### F. 其他账户的开立和管理

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

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。

#### G. 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/北京分公司、银行间市场清算所股份有限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。实物证券、银行定期存款证实书等有价凭证的购买和转让，按基金管理人和基金托管人双方约定办理。基金托管人对由基金托管人以外机构实际有效控制或保管的资产不承担保管责任。

#### H. 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。基金管理人应在重大合同签署后及时以加密方式将重大合同传真给基金托管人，并在三十个工作日内将正本送达基金托管人处。重大合同的保管期限为《基金合同》终止后15年，法律法规或监管部门另有规定的除外。

对于无法取得二份以上的正本的，基金管理人应向基金托管人提供加盖公章的合同复印件或传真件，未经双方协商一致，合同原件不得转移。

### （五）基金资产净值计算和会计核算

#### A. 基金资产净值的计算、复核与完成的时间及程序

1、基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。某一类别基金份额净值是按照每个工作日闭市后，该类别基金资产净值除以当日该类别基金份额的余额数量计算，精确到0.0001元，小数点后第五位四舍五入。基金管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的，从其规定。本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值。

基金管理人每个工作日计算基金资产净值及各类基金份额净值，并按规定公告。

2、基金管理人应每个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，将各类基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

#### B. 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、债券和银行存款本息、应收款项、股指期货合约、其它投资等资产及负债。

##### 2、估值方法

本基金所持有的投资品种，按如下原则进行估值：

###### （1）证券交易所上市的有价证券的估值

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

②交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（基金合同另有规定的除外），选取估值日第三方估值机构提供的相应品种对应的估值净价估值。

③对在交易所市场上市交易的可转换债券，按照每日收盘价作为估值全价。

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，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流通受限股票（指在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分、首次公开发行股票公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中质押券等。）按监管机构或行业协会发布的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）同一证券同时在两个或两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。

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

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

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

(8) 估值计算中涉及港币对人民币汇率的，将依据下列信息提供机构所提供的汇率为基准：当日中国人民银行公布的人民币与港币的中间价。

(9) 本基金投资存托凭证的估值核算，依照国内依法发行上市的股票执行。

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

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

基金管理人负责基金资产净值计算和基金会计核算，并担任本基金的会计责任方。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，基金管理人向基金托管人出具盖章的书面说明后，按照基金管理人对于基金资产净值的计算结果对外予以公布。

### 3、特殊情形的处理

(1) 基金管理人或基金托管人按基金合同约定的估值方法第(6)项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

(2) 由于不可抗力原因，或由于证券交易所、期货交易所、第三方估值机构及登记结算公司发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

#### C. 基金份额净值错误的处理方式

1、当任一类别基金份额净值小数点后4位以内(含第4位)发生差错时，视为该类基金份额净值错误；基金份额净值出现错误时，基金管理人、基金托管人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；错误偏差达到该类别基金份额净值的0.25%时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到该类别基金份额净值的0.5%时，基金管理人应当公告，通知基金托管人，并同时报中国证监会备案；当发生净值计算错误时，由基金管理人负责处理，由此给基金份额持有人和基金造成损失的，应由基金管理人先行赔付，基金管理人按差错情形，有权向其他当事人追偿。



2、当基金份额净值计算差错给基金和基金份额持有人造成损失需要进行赔偿时，基金管理人和基金托管人应根据实际情况界定双方承担的责任，经确认后按以下条款进行赔偿：

(1) 本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，与本基金有关的会计问题，如经双方在平等基础上充分讨论后，尚不能达成一致时，按基金管理人的建议执行，由此给基金份额持有人和基金财产造成的损失，由基金管理人负责赔付。

(2) 若基金管理人计算的基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告，而且基金托管人未对计算过程提出疑义或要求基金管理人书面说明，基金份额净值出错且造成基金份额持有人损失的，应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金，就实际向投资者或基金支付的赔偿金额，基金管理人与基金托管人按照管理费和托管费的比例各自承担相应的责任。

(3) 如基金管理人和基金托管人对基金份额净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对，尚不能达成一致时，为避免不能按时公布基金份额净值的情形，以基金管理人的计算结果对外公布，由此给基金份额持有人和基金造成的损失，由基金管理人负责赔付。

(4) 由于基金管理人提供的信息错误（包括但不限于基金申购或赎回金额等），进而导致基金份额净值计算错误而引起的基金份额持有人和基金财产的损失，由基金管理人负责赔付。

3、基金管理人和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差，以基金管理人计算结果为准。

4、前述内容如法律法规或者监管部门另有规定的，从其规定。如果行业另有通行做法，双方当事人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商。

#### D. 暂停估值与公告基金份额净值的情形

发生以下情形之一的，暂停估值和公告基金份额净值：

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

2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

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

4、中国证监会和《基金合同》认定的其他情形。

#### E. 基金会计制度

按国家有关部门规定的会计制度执行。

#### F. 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。基金管理人与基金托管人分别独立地设置、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。

#### G. 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两个月内完成基金中期报告的编制；在每年结束之日起三个月内完成基金年度报告的编制。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。《基金合同》生效不足两个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。

###### (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。

H. 基金管理人应在编制季度报告、中期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保管

基金份额持有人名册至少应包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。基金份额持有人名册由基金登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，基金管理人和基金托管人应分别保管基金份额持有人名册，保存期不少于 15 年，法律法规或监管部门另有规定的除外。如不能妥善保管，则按相关法规承担责任。

在基金托管人要求或编制中期报告和年度报告前，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）争议解决方式和适用法律

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中国国际经济贸易仲裁委员会，仲裁地点为北京市，

按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担，除非仲裁裁决另有决定。

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

本协议受中国法律（为本协议之目的，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区法律）管辖。

#### （八）托管协议的变更、终止与基金财产的清算

##### A. 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备案。

##### B. 托管协议终止的情形

发生以下情形之一的，托管协议终止：

- 1、《基金合同》终止；
- 2、基金托管人解散、依法被撤销、破产或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、发生法律法规或《基金合同》规定的终止事项。

##### C. 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。在基金财产清算小组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

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、期货相关业务资格的注册会计师、律师组成。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) 基金财产清算小组成立后，由基金财产清算小组统一接管基金；
- (2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- (3) 对基金财产进行估值和变现；
- (4) 制作清算报告；
- (5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- (6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；

(7)对基金剩余财产进行分配。

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

#### 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，按各类基金份额资产净值的比例确定剩余财产在各类基金份额中的分配比例，并在各类基金份额可分配的剩余财产范围内按各类别基金份额的基金份额持有人持有的该类基金份额比例进行分配。同一类别的基金份额持有人对本类别基金份额的剩余资产具有同等的分配权。

#### 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具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计、并由律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算小组进行公告，基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

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。

## 二十一、对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务，并将根据基金份额持有人的需要和市场的变化，增加或变更服务项目。主要服务内容如下：

### （一）资料寄送/发送

#### 1、开户确认书和交易对账单

首次基金交易（除基金开户外其他交易类型）后的15个工作日内向基金份额持有人寄送或邮件发送开户确认书和交易对账单

#### 2、基金份额持有人对账单

基金管理人在每年第1-3季度结束后向定制纸质对账单且在季度内有交易的投资者寄送季度对账单，在每年第4季度结束后向定制纸质对账单且季度内有交易或最后一个交易日仍持有份额的投资者寄送年度对账单；每月向定制电子对账单服务的份额持有人发送电子对账单。

3、由于投资者提供的邮寄地址、手机号码、电子邮箱不详、错误、未及时变更或邮局投递差错、通讯故障、延误等原因有可能造成对账单无法按时或准确送达。因上述原因无法正常收取对账单的投资者，敬请及时通过本公司网站，或拨打本公司客服热线查询、核对、变更您的预留联系方式。

### （二）定期定额投资计划

基金管理人可通过销售机构为投资者提供定期定额投资服务。通过定期定额投资计划，投资者可以通过销售渠道定期定额申购基金份额。定期定额投资计划的有关规则另行公告。

### （三）在线服务

通过本公司网站 [www.jsfund.cn](http://www.jsfund.cn)，基金份额持有人还可获得如下服务：

#### 1、查询服务

基金份额持有人均可通过基金管理人网站实现基金交易查询、账户信息查询和基金信息查询。

#### 2、信息资讯服务

投资者可以利用基金管理人网站获取基金和基金管理人的各类信息，包括基金的法律文件、业绩报告及基金管理人最新动态等资料。

#### 3、网上交易

本基金管理人已开通个人和机构投资者的网上直销交易业务。个人和机构投资者通过基金管理人网站 [www.jsfund.cn](http://www.jsfund.cn) 可以办理基金认购、申购、赎回、账户资料修改、交易密码修改、交易申请查询和账户资料查询等各类业务。

### （四）咨询服务

1、投资者或基金份额持有人如果了解申购与赎回的交易情况、基金账户余额、基金产品与服务等信息，可拨打基金管理人全国统一客服电话：400-600-8800（免长途话费）、(010)85712266，传真：（010）65182266。

2、网站和电子信箱

公司网址：<http://www.jsfund.cn>

电子信箱：[service@jsfund.cn](mailto:service@jsfund.cn)

## 二十二、其他应披露事项

自2020年4月15日至2021年3月16日,本基金的临时报告刊登于《证券时报》。

序号	临时报告名称	披露时间
1	嘉实基础产业优选股票型证券投资基金基金合同生效公告	2020年4月16日
2	嘉实基金管理有限公司机构首席投资官任职公告	2020年5月6日
3	关于嘉实基础产业优选股票型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定投业务的公告	2020年6月11日
4	嘉实基础产业优选股票2020年6月23日至6月28日暂停申购、赎回、转换及定投业务的公告	2020年6月19日
5	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	2020年6月19日
6	嘉实基金管理有限公司及子公司办公地址变更公告	2020年6月22日
7	关于嘉实基础产业优选股票2020年7月1日暂停申购、赎回、转换及定投业务的公告	2020年6月29日
8	嘉实基金管理有限公司关于旗下基金投资中科创达非公开发行股票的公告	2020年8月8日
9	关于嘉实基础产业优选股票2020年9月29日至10月8日暂停申购、赎回、转换及定投业务的公告	2020年9月25日
10	关于继续在网上直销开展基金认购、申购、转换费率优惠活动的公告	2020年9月28日
11	关于嘉实基础产业优选股票2020年10月13日暂停申购、赎回、转换及定投业务的公告	2020年10月14日
12	嘉实基金管理有限公司关于修订旗下部分基金基金合同及托管协议的公告	2020年10月17日
13	关于嘉实基础产业优选股票2020年10月26日暂停申购、赎回、转换及定投业务的公告	2020年10月22日
14	关于嘉实基础产业优选股票2020年12月24日至12月27日暂停申购、赎回、转换及定投业务的公告	2020年12月22日
15	嘉实基金管理有限公司关于提醒投资者持续完善客户身份信息的公告	2020年12月25日
16	关于嘉实基础产业优选股票2020年12月31日暂停申购、赎回、转换及定投业务的公告	2020年12月29日
17	嘉实基金管理有限公司关闭跨TA转换业务的公告	2021年1月21日

18	关于嘉实基础产业优选股票 2021 年 2 月 9 日、2 月 10 日 暂停申购、赎回、转换及定投业务的公告	2021 年 2 月 5 日
19	嘉实基金管理有限公司关于旗下基金投资新奥股份非公开 发行股票的公告	2021 年 2 月 5 日



## 二十三、招募说明书存放及查阅方式

本基金招募说明书公布后，分别置备于基金管理人、基金托管人和基金代销机构的住所，投资者可免费查阅。投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件。

## 二十四、备查文件

### （一）备查文件目录

- 1、中国证监会准予嘉实基础产业优选股票型证券投资基金注册的批复文件。
- 2、《嘉实基础产业优选股票型证券投资基金基金合同》。
- 3、《嘉实基础产业优选股票型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）存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人处。

### （三）查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅备查文件。在支付工本费后，可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

嘉实基金管理有限公司  
2021年04月13日