

易方达 3 年封闭运作战略配售灵活配置  
混合型证券投资基金（LOF）更新的招募说明  
书

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

二〇二一年五月

## 重要提示

1、本基金根据 2018 年 6 月 6 日中国证券监督管理委员会《关于准予易方达 3 年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）注册的批复》（证监许可[2018]926 号），进行募集。本基金基金合同于 2018 年 7 月 5 日正式生效。

2、基金管理人保证《招募说明书》的内容真实、准确、完整。本基金经中国证监会注册，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、市场前景和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

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

3、本基金基金合同生效后进入三年的封闭运作期，封闭运作期间投资者不能赎回基金份额。本基金在封闭运作期间，基金份额可上市交易，投资者可在二级市场买卖基金份额。受市场供需关系等各种因素的影响，投资者买卖基金份额有可能面临相应的折溢价风险。

4、本基金封闭运作期内主要参与战略配售股票的投资，战略配售股票有可能出现股价波动较大的情况，投资者有可能面临战略配售股票价格大幅波动的风险。

5、本基金以投资战略配售股票为主要投资策略，需参与并接受发行人的战略配售股票，由此产生的投资风险与价格波动由投资者自行承担。

6、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。投资有风险，投资者在投资本基金前，请认真阅读本基金的招募说明书和基金合同等信息披露文件，全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，自主判断基金的投资价值，对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，承担基金投资中出现的各类风险。投资本基金可能遇到的特有风险包括：

（1）资产配置风险；（2）封闭运作期内主要参与战略配售股票投资的风险；（3）封闭运作期不能赎回且二级市场交易折价的风险；（4）基金份额无法上市或终止上市的风险；（5）基金份额二级市场交易价格折溢价的风险；（6）封闭运作期届满转为上市开放式基金（LOF）后，本基金投资范围包括股指期货、国债期货、股票期权等金融衍生品等特殊品种而面临的其他额外风险；（7）封闭运作期届满转为上市开放式基金（LOF）后，本基金投资范围包括中小企业私募债而面临的其他额外风险；（8）封闭运作期届满转为上市开放式基金（LOF）后，本基金投资范围包括资产支持证券而面临的额外风险；（9）封闭运作期届满转为上市开放式基金（LOF）后，本基金投资范围包括内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买

卖的香港证券市场股票而面临的香港股票市场及港股通机制带来的风险；（10）投资于存托凭证的风险；此外本基金还将面临市场风险、流动性风险、本基金法律文件中涉及基金风险特征的表述与销售机构对基金的风险评级可能不一致的风险、管理风险等其他一般风险。

本基金的具体运作特点详见基金合同和招募说明书的约定。本基金的一般风险及特有风险详见本招募说明书的“风险揭示”部分。

7、本基金为混合型基金，理论上其预期风险收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

8、基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。此外，本基金以 1 元初始面值进行募集，在市场波动等因素的影响下，存在单位份额净值跌破 1 元初始面值的风险。

9、基金不同于银行储蓄，基金投资人有可能获得较高的收益，也有可能损失本金。投资有风险，投资人在进行投资决策前，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等信息披露文件。

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

本基金有关财务数据截止日为 2021 年 3 月 31 日，净值表现截止日为 2020 年 12 月 31 日，主要人员情况截止日为 2021 年 5 月 27 日，除非另有说明，本招募说明书其他所载内容截止日为 2021 年 4 月 16 日。（本报告中财务数据未经审计）

## 目录

|                                |     |
|--------------------------------|-----|
| 一、绪言 .....                     | 1   |
| 二、释义 .....                     | 2   |
| 三、基金管理人 .....                  | 7   |
| 四、基金托管人 .....                  | 20  |
| 五、相关服务机构 .....                 | 23  |
| 六、基金的募集 .....                  | 71  |
| 七、基金合同的生效 .....                | 72  |
| 八、基金份额的上市交易 .....              | 73  |
| 九、基金份额的申购、赎回 .....             | 75  |
| 十、基金转换和定期定额投资计划 .....          | 86  |
| 十一、基金的转托管、质押、非交易过户、冻结与解冻 ..... | 87  |
| 十二、基金的投资 .....                 | 89  |
| 十三、基金的业绩 .....                 | 107 |
| 十四、基金的财产 .....                 | 108 |
| 十五、基金资产的估值 .....               | 109 |
| 十六、基金的收益分配 .....               | 114 |
| 十七、基金的费用与税收 .....              | 116 |
| 十八、基金的会计与审计 .....              | 119 |
| 十九、基金的信息披露 .....               | 120 |
| 二十、风险揭示 .....                  | 127 |
| 二十一、基金合同的变更、终止与基金财产的清算 .....   | 136 |
| 二十二、基金合同的内容摘要 .....            | 138 |
| 二十三、基金托管协议的内容摘要 .....          | 153 |
| 二十四、对基金份额持有人的服务 .....          | 171 |
| 二十五、其他应披露事项 .....              | 173 |
| 二十六、招募说明书的存放及查阅方式 .....        | 174 |
| 二十七、备查文件 .....                 | 175 |

## 一、绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第5号〈招募说明书的内容与格式〉》、《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《管理规定》）、《易方达3年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同》（以下简称基金合同）及其它有关规定等编写。

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当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

## 二、释义

本招募说明书中除非文意另有所指，下列词语有如下含义：

- 1、基金或本基金：指易方达 3 年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）
- 2、基金管理人：指易方达基金管理有限公司
- 3、基金托管人：指中国建设银行股份有限公司
- 4、基金合同：指《易方达 3 年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）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《易方达 3 年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）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、本招募说明书：指《易方达 3 年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）招募说明书》及其更新
- 7、基金产品资料概要：指《易方达 3 年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金产品资料概要》及其更新
- 8、基金份额发售公告：指《易方达 3 年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金份额发售公告》
- 9、上市交易公告书：指《易方达 3 年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）上市交易公告书》
- 10、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
- 11、《基金法》：指 2012 年 12 月 28 日经第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议通过，自 2013 年 6 月 1 日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 12、《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
- 13、《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
- 14、《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

15、《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

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、特定机构投资者：指全国社会保障基金、基本养老保险基金、企业年金基金和职业年金基金等机构投资者

22、合格境外机构投资者：指符合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

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

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：指易方达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，以及可通过深圳证券交易所交易系统办理基金销售业务的会员单位。其中，可通过深圳证券交易所交易系统办理本基金销售业务的机构必须具有基金销售业务资格、并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的、可通过深圳证券交易所交易系统办理本基金销售业务的深圳证券交易所会员单位

27、登记业务：指中国证券登记结算有限责任公司相关业务规则定义的基金份额的登记、存管、结算及相关业务，及其不时修订和补充

28、登记结算机构：指办理登记结算业务的机构。本基金的登记结算机构为中国证券登记结算有限责任公司（以下简称：中国结算公司），基金管理人也可以自行或委托其他机构担任登记结算机构

29、开放式基金账户：指投资人通过场外销售机构在中国证券登记结算有限责任公司注册的、用于记录其持有的、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、深圳证券账户：指在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开设的深圳证券交易所人民币普通股票账户（即 A 股账户）或证券投资基金账户

31、基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构买卖基金的基金份额变动及结余情况的账户

32、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

33、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

34、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，最长不得超过三个月

35、存续期：指基金合同生效日至终止日之间的不定期期限

36、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的交易日

37、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

38、T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日（不包含 T 日），n 为自然数

39、封闭运作期：本基金合同生效后的前三年为封闭运作期，封闭运作期内本基金不开放赎回。封闭运作期届满后，本基金转为上市开放式基金（LOF）

40、受限开放期：本基金封闭运作期内，自基金合同生效日起每 6 个月的月度对日（若不存在对应日期或对日为非工作日的，则顺延至下一个工作日），本基金进入受限开放期，即首个受限开放期的起始日为本基金的基金合同生效日起 6 个月的月度对日，第二个受限开放期的起始日为本基金的基金合同生效日起 12 个月的月度对日，依此类推。本基金的每个受限开放期不少于 5 个工作日、不超过 10 个工作日，具体期间由基金管理人在上一个封闭期结束前公告说明。受限开放期内，本基金只开放申购业务，不开放赎回业务

41、开放日：指本基金转为上市开放式基金（LOF）并进入开放期后为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日（若该工作日非港股通交易日，则本基金不开放）

42、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

43、《业务规则》：指深圳证券交易所、登记结算机构、基金管理人及基金销售机构的相关业务规则及其不时做出的修订



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

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

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

47、上市交易：指基金合同生效后，投资者通过证券交易所会员单位以集中竞价的方式买卖基金份额的行为

48、场外：指通过深圳证券交易所系统外的销售机构办理基金份额认购、申购和赎回的场所。通过该等场所办理基金份额的认购、申购、赎回也称为场外认购、场外申购、场外赎回

49、场内：指通过深圳证券交易所内具有相应业务资格的会员单位利用交易所交易系统办理基金份额申购、赎回和上市交易的场所。通过该等场所办理基金份额的申购、赎回也称为场内申购、场内赎回

50、登记结算系统：指中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统。投资人通过场外基金销售机构认购、申购所得的基金份额登记在本系统下

51、证券登记系统：指中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记系统。投资人通过场内会员单位申购或买入所得的基金份额登记在本系统下

52、场外份额：指登记在登记结算系统下的基金份额

53、场内份额：指登记在证券登记系统下的基金份额

54、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

55、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

56、系统内转托管：指基金份额持有人将其持有的基金份额在登记结算系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记系统内不同会员单位（交易单元）之间进行转托管的行为

57、跨系统转托管：指持有人将其持有的基金份额在登记结算系统和证券登记系统之间进行转托管的行为

58、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

59、巨额赎回：指本基金进入开放期后，单个开放日基金净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过上一日基金总份额的 10%

60、元：指人民币元

61、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

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

63、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

64、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

65、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

66、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

67、基金份额折算：指基金管理人根据基金运作的需要，在基金资产净值不变的前提下，按照一定比例调整基金份额总额及基金份额净值

68、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

69、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

70、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

### 三、基金管理人

#### （一）基金管理人基本情况

1、基金管理人：易方达基金管理有限公司

注册地址：广东省珠海市横琴新区宝华路6号105室-42891（集中办公区）

办公地址：广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40-43楼

设立日期：2001年4月17日

法定代表人：刘晓艳

联系电话：4008818088

联系人：李红枫

注册资本：13,244.2万元人民币

批准设立机关及文号：中国证券监督管理委员会，证监基金字[2001]4号

经营范围：公开募集证券投资基金管理、基金销售、特定客户资产管理

#### 2、股权结构：

| 股东名称                | 出资比例     |
|---------------------|----------|
| 广东粤财信托有限公司          | 22.6514% |
| 广发证券股份有限公司          | 22.6514% |
| 盈峰控股集团有限公司          | 22.6514% |
| 广东省广晟控股集团有限公司       | 15.1010% |
| 广州市广永国有资产经营有限公司     | 7.5505%  |
| 珠海祺荣宝股权投资合伙企业（有限合伙） | 1.5087%  |
| 珠海祺泰宝股权投资合伙企业（有限合伙） | 1.6205%  |
| 珠海祺丰宝股权投资合伙企业（有限合伙） | 1.5309%  |
| 珠海聚莱康股权投资合伙企业（有限合伙） | 1.7558%  |
| 珠海聚宁康股权投资合伙企业（有限合伙） | 1.4396%  |
| 珠海聚弘康股权投资合伙企业（有限合伙） | 1.5388%  |
| 总 计                 | 100%     |

#### （二）主要人员情况

##### 1、董事、监事及高级管理人员

詹余引先生，工商管理博士，董事长。曾任中国平安保险公司证券部研究咨询室总经理助理，平安证券有限责任公司研究咨询部副总经理（主持工作）、国债部副总经理（主持工作）、资产管理部副总经理、资产管理部总经理，中国平安保险股份有限公司投资管理部副总经理（主持工作），全国社会保障基金理事会投资部资产配置处处长、投资部副主任、境

外投资部主任、投资部主任、证券投资部主任。现任易方达基金管理有限公司董事长，易方达国际控股有限公司董事长。

刘晓艳女士，经济学博士，副董事长、总裁。曾任广发证券有限责任公司投资理财部副经理、基金经理、基金投资理财部副总经理，易方达基金管理有限公司督察员、监察部总经理、市场部总经理、总裁助理、副总裁、常务副总裁，易方达资产管理有限公司董事，易方达资产管理（香港）有限公司董事长。现任易方达基金管理有限公司副董事长、总裁，易方达国际控股有限公司董事。

周泽群先生，高级管理人员工商管理硕士（EMBA），董事。曾任珠海粤财实业有限公司董事长，粤财控股（北京）有限公司总经理、董事长，广东粤财投资控股有限公司总经理助理、办公室主任，广东粤财投资控股有限公司副总经理。现任易方达基金管理有限公司董事，广东粤财投资控股有限公司董事、总经理，中航通用飞机有限责任公司副董事长。

秦力先生，经济学博士，董事。曾任广发证券投资银行部常务副总经理、投资理财部总经理、资金营运部总经理、规划管理部总经理、投资部总经理、公司总经理助理、副总经理、常务副总经理，广东金融高新区股权交易中心有限公司董事长，广发证券资产管理（广东）有限公司董事长。现任易方达基金管理有限公司董事，广发证券股份有限公司执行董事、公司总监，广发控股（香港）有限公司董事长。

苏斌先生，管理学硕士，董事。曾任中富证券有限责任公司投行部经理，鸿商产业控股集团有限公司产业投资部执行董事，名力中国成长基金合伙人，复星能源环境与智能装备集团总裁。现任易方达基金管理有限公司董事，盈峰控股集团有限公司董事、副总裁，盈合（深圳）机器人与自动化科技有限公司董事长，广东民营投资股份有限公司董事，南京柯勒复合材料有限责任公司总经理，北京华录百纳影视股份有限公司董事。

潘文皓先生，经济学硕士，董事。曾任劲牌有限公司资金管理部综合分析员，云南锡业股份有限公司证券部业务主管、证券事务代表、证券部主任、董事会秘书、副总经理、董事，云南华联锌铟股份有限公司董事会办公室主任、董事会秘书、财务总监，云锡（深圳）融资租赁公司董事长，西藏巨龙铜业有限公司董事会秘书、董事，广晟有色金属股份有限公司董事会秘书。现任易方达基金管理有限公司董事，广东省广晟控股集团有限公司资本运营部副部长（主持工作），广东南粤银行股份有限公司董事。

忻榕女士，工商管理博士，独立董事。曾任中科院研究生院讲师，美国加州高温橡胶公司市场部经理，美国加州大学讲师，美国南加州大学助理教授，香港科技大学副教授，

中欧国际工商学院教授，瑞士洛桑管理学院教授。现任易方达基金管理有限公司独立董事，中欧国际工商学院教授，复星旅游文化集团（开曼）有限公司独立董事，上海汇招信息技术有限公司董事，上海卡恩文化传播股份有限公司独立董事，上海智篆文化传播有限公司董事。

谭劲松先生，管理学博士（会计学），独立董事。曾任邵阳市财会学校教师，中山大学管理学院助教、讲师、副教授。现任易方达基金管理有限公司独立董事，中山大学管理学院教授，中远海运特种运输股份有限公司独立董事，上海莱士血液制品股份有限公司独立董事，珠海华发实业股份有限公司独立董事，广州恒运企业集团股份有限公司独立董事，中国南方航空股份有限公司独立董事，广州环保投资集团有限公司外部董事，玉山银行（中国）有限公司独立董事，广东粤财金融租赁股份有限公司独立董事，中新广州知识城投资开发有限公司监事，美的置业控股有限公司独立非执行董事，中信证券华南股份有限公司独立董事，数字广东网络建设有限公司独立董事。

庄伟燕女士，法学博士，独立董事。曾任广东省妇女联合会干部，广东鸿鼎律师事务所主任，广东广悦鸿鼎律师事务所管委会主任。现任易方达基金管理有限公司独立董事，广东广信君达律师事务所高级合伙人，广东省建筑科学研究院集团股份有限公司独立董事，华农财产保险股份有限公司独立董事。

刘发宏先生，工商管理硕士，监事会主席。曾任天津商学院团总支书记兼政治辅导员、人事处干部，海南省三亚国际奥林匹克射击娱乐中心会计主管，三英（珠海）纺织有限公司财务主管，珠海市饼业食品有限公司财务部长、审计部长，珠海市国弘财务顾问有限公司项目经理，珠海市迪威有限公司会计师，珠海市卡都九洲食品有限公司财务总监，珠海格力集团（派驻下属企业）财务总监，珠海市国资委（派驻国有企业）财务总监，珠海港置业开发有限公司总经理，酒鬼酒股份有限公司副总经理，广东粤财投资控股有限公司审计部总经理、党委办主任、人力资源部总经理，广东粤财信托有限公司党委委员、副书记。现任易方达基金管理有限公司监事会主席，广东粤财信托有限公司董事，广东省融资再担保有限公司监事长。

董志钢先生，法学学士，监事。曾任中国建设银行广东省分行法律事务部科员、脱钩办法律事务室副经理、中农信托管办任经理，中国信达资产管理公司广州办事处处置办处置业务部经理，广东卓信律师事务所律师，广东合邦律师事务所律师，广东省粤科资产管理股份有限公司总经理，广州市广永国有资产经营有限公司董事长，广州广永股权投资基金管理有限公司董事长，广州广永投资管理有限公司董事长、总经理，广州赛马娱乐总公司副董事长。

现任易方达基金管理有限公司监事。

廖智先生，经济学硕士，监事。曾任广东证券股份有限公司基金部主管，易方达基金管理有限公司综合管理部副总经理、人力资源部副总经理、市场部总经理、互联网金融部总经理、综合管理部总经理。现任易方达基金管理有限公司监事、总裁助理、行政管理部总经理，广东粤财互联网金融股份有限公司董事。

邓志盛先生，经济学研究生，监事。曾任广东证监会信息部部长，中国证监会广州证管办机构二处处长，金鹰基金管理有限公司副总经理，易方达基金管理有限公司综合管理部总经理、董事会秘书。现任易方达基金管理有限公司监事、行政总监、党群工作部总经理。

刘炜先生，工商管理硕士（EMBA）、法学硕士，监事。曾任易方达基金管理有限公司监察部监察员、上海分公司销售经理、市场部总经理助理、人力资源部副总经理、综合管理部总经理。现任易方达基金管理有限公司监事、人力资源部总经理。

马骏先生，工商管理硕士（EMBA），常务副总裁。曾任君安证券有限公司营业部职员，深圳众大投资有限公司投资部副总经理，广发证券有限责任公司研究员，易方达基金管理有限公司基金经理、固定收益部总经理、现金管理部总经理、固定收益总部总经理、总裁助理、固定收益投资总监、固定收益首席投资官，易方达资产管理有限公司董事。现任易方达基金管理有限公司常务副总裁、固定收益投资决策委员会委员，易方达资产管理（香港）有限公司董事长、人民币合格境外投资者（RQFII）业务负责人、证券交易负责人员（RO）、就证券提供意见负责人员（RO）、提供资产管理负责人员（RO）、产品审批委员会委员。

吴欣荣先生，工学硕士，常务副总裁。曾任易方达基金管理有限公司研究员、投资管理部经理、基金经理、基金投资部副总经理、研究部副总经理、研究部总经理、基金投资部总经理、公募基金投资部总经理、权益投资总部总经理、总裁助理、权益投资总监，易方达国际控股有限公司董事。现任易方达基金管理有限公司常务副总裁、权益投资决策委员会委员，易方达资产管理（香港）有限公司董事。

陈彤先生，经济学博士，副总经理级高级管理人员。曾任中国经济开发信托投资公司成都营业部研发部副经理、交易部经理、研发部经理、证券总部研究部行业研究员，易方达基金管理有限公司市场拓展部主管、基金经理、市场部华东区大区销售经理、市场部总经理助理、南京分公司总经理、成都分公司总经理、上海分公司总经理、总裁助理、市场总监。现任易方达基金管理有限公司副总经理级高级管理人员，易方达国际控股有限公司董事。

张南女士，经济学博士，督察长。曾任广东省经济贸易委员会主任科员、副处长，易方

达基金管理有限公司市场拓展部副总经理、监察部总经理。现任易方达基金管理有限公司督察长。

范岳先生，工商管理硕士，副总经理级高级管理人员。曾任中国工商银行深圳分行国际业务部科员，深圳证券登记结算公司办公室经理、国际部经理，深圳证券交易所北京中心助理主任、上市部副总监、基金债券部副总监、基金管理部总监，易方达资产管理（香港）有限公司董事。现任易方达基金管理有限公司副总经理级高级管理人员。

高松凡先生，工商管理硕士（EMBA），副总经理级高级管理人员。曾任招商银行总行人事部高级经理、企业年金中心副主任，浦东发展银行总行企业年金部总经理，长江养老保险公司首席市场总监，易方达基金管理有限公司养老金业务总监。现任易方达基金管理有限公司副总经理级高级管理人员。

关秀霞女士，工商管理硕士、金融学硕士，副总经理级高级管理人员。曾任中国银行（香港）有限公司分析员，Daniel Dennis 高级审计师，美国道富银行公司内部审计部高级审计师、美国共同基金业务风险经理、亚洲区（除日本外）机构服务主管、亚洲区（除日本外）副总裁、大中华地区董事总经理、大中华地区高级副总裁、中国区行长。现任易方达基金管理有限公司副总经理级高级管理人员。

陈荣女士，经济学博士，副总经理级高级管理人员。曾任中国人民银行广州分行统计研究处科员，易方达基金管理有限公司运作支持部经理、核算部总经理助理、核算部副总经理、核算部总经理、投资风险管理部总经理、总裁助理、董事会秘书、公司财务中心主任。现任易方达基金管理有限公司副总经理级高级管理人员，易方达国际控股有限公司董事，易方达资产管理（香港）有限公司董事，易方达资产管理有限公司监事，易方达海外投资（深圳）有限公司监事。

张坤先生，理学硕士，副总经理级高级管理人员。曾任易方达基金管理有限公司行业研究员、基金经理助理、研究部总经理助理。现任易方达基金管理有限公司副总经理级高级管理人员、权益投资决策委员会委员、基金经理。

陈丽园女士，管理学硕士、法律硕士，副总经理级高级管理人员。曾任易方达基金管理有限公司监察部监察员、监察部总经理助理、监察部副总经理、监察部总经理、监察与合规管理总部总经理兼合规内审部总经理，易方达资产管理有限公司董事。现任易方达基金管理有限公司副总经理级高级管理人员，易方达资产管理（香港）有限公司董事。

胡剑先生，经济学硕士，副总经理级高级管理人员。曾任易方达基金管理有限公司债券

研究员、基金经理助理、固定收益研究部负责人、固定收益总部总经理助理、固定收益研究部总经理、固定收益投资部总经理。现任易方达基金管理有限公司副总经理级高级管理人员、固定收益投资业务总部总经理、固定收益投资决策委员会委员、基金经理。

张清华先生，物理学硕士，副总经理级高级管理人员。曾任晨星资讯（深圳）有限公司数量分析师，中信证券股份有限公司研究员，易方达基金管理有限公司投资经理、固定收益基金投资部总经理、混合资产投资部总经理。现任易方达基金管理有限公司副总经理级高级管理人员、多资产投资业务总部总经理、固定收益投资决策委员会委员、基金经理。

冯波先生，经济学硕士，副总经理级高级管理人员。曾任广东发展银行行员，易方达基金管理有限公司市场拓展部研究员、市场拓展部副经理、市场部大区销售经理、北京分公司副总经理、行业研究员、基金经理助理、研究部总经理助理、研究部副总经理。现任易方达基金管理有限公司副总经理级高级管理人员、研究部总经理、权益投资决策委员会委员、基金经理。

陈皓先生，管理学硕士，副总经理级高级管理人员。曾任易方达基金管理有限公司行业研究员、基金经理助理、投资一部总经理助理、投资一部副总经理、投资经理。现任易方达基金管理有限公司副总经理级高级管理人员、投资一部总经理、权益投资决策委员会委员、基金经理。

娄利舟女士，工商管理硕士（EMBA）、经济学硕士，副总经理级高级管理人员。曾任联合证券有限责任公司证券营业部分析师、研究所策略研究员、经纪业务部高级经理，易方达基金管理有限公司销售支持中心经理、市场部总经理助理、市场部副总经理、广州分公司总经理、北京分公司总经理、总裁助理，易方达资产管理有限公司总经理。现任易方达基金管理有限公司副总经理级高级管理人员、FOF 投资决策委员会委员，易方达资产管理有限公司董事长，易方达资产管理（香港）有限公司董事。

## 2、基金经理

胡剑先生，经济学硕士，本基金的基金经理。曾任易方达基金管理有限公司债券研究员、基金经理助理、固定收益研究部负责人、固定收益总部总经理助理、固定收益研究部总经理、固定收益投资部总经理、易方达中债新综合债券指数发起式证券投资基金（LOF）基金经理（自 2012 年 11 月 8 日至 2014 年 3 月 28 日）、易方达纯债债券型证券投资基金基金经理（自 2013 年 4 月 22 日至 2015 年 3 月 13 日）、易方达永旭添利定期开放债券型证券投资基金基金经理（自 2013 年 4 月 22 日至 2015 年 3 月 13 日）、易方达纯债 1 年定期开放债券型证券



投资基金基金经理（自 2013 年 7 月 30 日至 2015 年 3 月 13 日）、易方达裕惠回报债券型证券投资基金基金经理（自 2013 年 12 月 17 日至 2014 年 8 月 17 日）、易方达裕景添利 6 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理（自 2016 年 4 月 12 日至 2018 年 2 月 9 日）、易方达瑞智灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自 2017 年 6 月 21 日至 2019 年 7 月 2 日）、易方达瑞兴灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自 2017 年 6 月 23 日至 2019 年 7 月 2 日）、易方达瑞祥灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自 2018 年 1 月 19 日至 2019 年 7 月 2 日）、易方达高等级信用债债券型证券投资基金基金经理（自 2017 年 3 月 7 日至 2019 年 9 月 17 日）、易方达瑞祺灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自 2018 年 1 月 29 日至 2019 年 10 月 16 日）、易方达瑞财灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自 2016 年 2 月 4 日至 2019 年 11 月 7 日）、易方达丰惠混合型证券投资基金基金经理（自 2017 年 3 月 24 日至 2020 年 6 月 8 日）。现任易方达基金管理有限公司副总经理级高级管理人员、固定收益投资业务总部总经理、固定收益投资决策委员会委员、易方达稳健收益债券型证券投资基金基金经理（自 2012 年 2 月 29 日起任职）、易方达信用债债券型证券投资基金基金经理（自 2013 年 4 月 24 日起任职）、易方达裕惠回报定期开放式混合型发起式证券投资基金基金经理（自 2014 年 8 月 18 日起任职）、易方达瑞富灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自 2017 年 5 月 12 日起任职）、易方达 3 年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金经理（自 2018 年 7 月 5 日起任职）、易方达岁丰添利债券型证券投资基金基金经理（自 2019 年 1 月 4 日起任职）、易方达恒利 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理（自 2019 年 4 月 4 日起任职）、易方达恒益定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理（自 2019 年 7 月 12 日起任职）、易方达恒盛 3 个月定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理（自 2019 年 9 月 6 日起任职）、易方达富惠纯债债券型证券投资基金基金经理（自 2019 年 11 月 2 日起任职）、易方达中债 3-5 年期国债指数证券投资基金基金经理（自 2020 年 3 月 10 日起任职）、易方达中债 7-10 年期国开行债券指数证券投资基金基金经理（自 2020 年 3 月 10 日起任职）、易方达恒惠定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理（自 2020 年 7 月 9 日起任职）。

纪玲云女士，经济学硕士，本基金的基金经理。曾任易方达基金管理有限公司固定收益研究员、投资经理助理、固定收益研究部总经理助理、投资经理、易方达丰惠混合型证券投资基金基金经理助理。现任易方达基金管理有限公司固定收益分类资产研究管理部负责人、易方达信用债债券型证券投资基金基金经理（自 2013 年 9 月 14 日起任职）、易方达 3 年封

闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金经理(自2018年7月5日起任职)、易方达瑞财灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2019年1月11日起任职)、易方达恒利3个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理(自2019年4月4日起任职)、易方达恒盛3个月定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理(自2019年9月6日起任职)、易方达恒裕一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理(自2020年3月12日起任职)、易方达稳健收益债券型证券投资基金基金经理助理。

付浩先生,经济学硕士,本基金的基金经理。曾任广东粤财信托投资有限公司国际金融部职员,深圳和君创业研究咨询有限公司管理咨询项目经理,湖南证券投资银行总部项目经理,融通基金管理有限公司研究策划部研究员,易方达基金管理有限公司权益投资总部副总经理、养老金与专户权益投资部副总经理、公募基金投资部总经理、基金经理助理、投资经理、易方达策略成长证券投资基金基金经理(自2004年2月14日至2005年12月31日)、科瑞证券投资基金基金经理(自2006年1月1日至2012年9月27日)、易方达科翔股票型证券投资基金基金经理(自2011年1月1日至2014年5月9日)、易方达科汇灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2018年8月4日至2019年11月27日)。现任易方达基金管理有限公司权益投资管理部总经理、权益投资决策委员会委员、易方达3年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金经理(自2018年7月5日起任职)。

本基金历任基金经理情况:肖林,管理时间为2018年7月5日至2019年9月9日。

### 3、固定收益投资决策委员会成员

本公司固定收益投资决策委员会成员包括:马骏先生、胡剑先生、张清华先生、王晓晨女士、袁方女士、刘朝阳女士、祁广东先生。

马骏先生,同上。

胡剑先生,同上。

张清华先生,同上。

王晓晨女士,易方达基金管理有限公司固定收益全策略投资部总经理、基金经理,易方达资产管理(香港)有限公司基金经理、就证券提供意见负责人员(R0)、提供资产管理负责人员(R0)。

袁方女士,易方达基金管理有限公司多资产养老金投资部总经理、投资经理。

刘朝阳女士,易方达基金管理有限公司现金管理部总经理、基金经理。

祁广东先生,易方达基金管理有限公司国际投资部总经理、基金经理、投资经理,易方

达资产管理（香港）有限公司首席投资官（国际固定收益）、就证券提供意见负责人员（RO）、提供资产管理负责人员（RO）、投资决策委员会委员。

#### 4、权益投资决策委员会成员

本公司权益投资决策委员会成员包括：吴欣荣先生、冯波先生、陈皓先生、张坤先生、孙松先生、付浩先生。

吴欣荣先生，同上。

冯波先生，同上。

陈皓先生，同上。

张坤先生，同上。

孙松先生，易方达基金管理有限公司投资二部总经理、基金经理。

付浩先生，同上。

#### 5、上述人员之间均不存在近亲属关系。

#### （三）基金管理人的职责

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

#### （四）基金管理人的承诺

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

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

- (1) 将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
- (2) 不公平地对待其管理的不同基金财产；
- (3) 利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人谋取利益；
- (4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- (5) 侵占、挪用基金财产；
- (6) 泄漏因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
- (7) 玩忽职守，不按照规定履行职责；
- (8) 法律、行政法规和中国证监会禁止的其他行为。

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

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

#### 4、基金经理承诺

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

(2) 不利用职务之便为自己及其代理人、受雇人或任何第三人谋取利益；

(3) 不违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，泄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) 不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

#### (五) 基金管理人的内部控制制度

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

#### 1、公司内部控制的总体目标

(1) 保证公司经营管理活动的合法合规性；

(2) 保证各类基金份额持有人及委托人的合法权益不受侵犯；

(3) 防范和化解经营风险，提高经营管理效率，确保业务稳健经营运行和受托资产安全完整，实现公司的持续、健康发展，促进公司实现发展战略；

(4) 督促公司全体员工恪守职业操守，正直诚信，廉洁自律，勤勉尽责；

(5) 维护公司的声誉，保持公司的良好形象。

#### 2、公司内部控制遵循的原则

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

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

(3) 独立性原则。公司机构、部门和岗位职责应当保持相对独立，除非法律法规另有规定，公司基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离。

(4) 相互制约原则。公司内部部门和岗位的设置应当体现权责分明、相互制衡。

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

### 3、内部控制的制度体系

公司制定了合理、完备、有效并易于执行的制度体系。公司制度体系由不同层面的制度构成。按照其效力大小分为四个层面：第一个层面是公司章程；第二个层面是公司内部控制大纲，它是公司制定各项规章制度的基础和依据；第三个层面是公司基本管理制度；第四个层面是部门和业务管理制度。它们的制订、修改、实施、废止应该遵循相应的程序，每一层面的内容不得与其以上层面的内容相违背。公司重视对制度的持续检验，结合业务的发展、法规及监管环境的变化以及公司风险控制的要求，不断检讨和增强公司制度的完备性、有效性。

### 4、关于授权、研究、投资、交易等方面的控制点

#### （1）授权制度

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

#### （2）公司研究业务

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

#### （3）基金投资业务

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

#### （4）交易业务

建立集中交易部门和集中交易制度，投资指令通过集中交易部门完成；建立交易监测系

统、预警系统和交易反馈系统,完善相关的安全设施;集中交易部门应对交易指令进行审核,建立公平的交易分配制度,确保公平对待不同基金;完善交易记录,并及时进行反馈、核对和存档保管;建立科学的投资交易绩效评价体系。

#### (5) 基金会计核算

公司根据法律法规及业务的要求建立会计制度,并根据风险控制点建立健全规范的系统 and 流程,以基金为会计核算主体,独立建账、独立核算。通过合理的估值方法和估值程序等会计措施,真实、完整、及时地记载每一笔业务并正确进行会计核算和业务核算。同时建立会计档案保管制度,确保档案真实完整。

#### (6) 信息披露

公司建立了完备的信息披露制度,指定了信息披露负责人,并建立了相应的制度流程规范相关信息的收集、组织、审核和发布,努力确保公开披露的信息真实、准确、完整、及时。

#### (7) 监察与合规管理

公司设立督察长,由董事会聘任,向董事会负责。根据公司监察与合规管理工作的需要和董事会授权,督察长可以列席公司相关会议,调阅公司相关档案资料,就内部控制制度的执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能。督察长定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况,董事会对督察长的报告进行审议。

公司设立监察合规管理部门,并保障其独立性。监察合规管理部门按照公司规定和督察长的安排履行监察与合规管理职责。

监察合规管理部门通过定期或不定期检查内部控制制度的执行情况,督促公司和旗下基金的管理运作规范进行。

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

### 5、基金管理人关于内部控制制度声明书

(1) 本公司承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确;

(2) 本公司承诺根据市场变化和公司业务发展不断完善内部控制制度。

## 四、基金托管人

### （一）基金托管人情况

#### 1、基本情况

名称：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

#### 2、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、社保及大客户服务处、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，并已经成为常规化的内控工作手段。

#### 3、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

### 1、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。

### 2、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。

### 3、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

### 1、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。

## 2、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）基金份额销售机构

#### 1、直销机构：易方达基金管理有限公司

注册地址：广东省珠海市横琴新区宝华路6号105室-42891（集中办公区）

办公地址：广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40-43楼

法定代表人：刘晓艳

电话：020-85102506

传真：4008818099

联系人：梁美

网址：[www.efunds.com.cn](http://www.efunds.com.cn)

直销机构网点信息：

#### （1）易方达基金管理有限公司广州直销中心

办公地址：广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40楼

电话：020-85102506

传真：4008818099

联系人：梁美

#### （2）易方达基金管理有限公司北京直销中心

办公地址：北京市西城区武定侯街2号泰康国际大厦18层

电话：010-63213377

传真：4008818099

联系人：刘蕾

#### （3）易方达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88号金茂大厦46楼

电话：021-50476668

传真：4008818099

联系人：王程

#### （4）易方达基金管理有限公司网上交易系统

网址: [www.efunds.com.cn](http://www.efunds.com.cn)

客户服务传真: 020-38798812

客户服务电话: 400-881-8088

## 2、非直销销售机构

### (1) 中国建设银行

注册地址: 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

联系人: 王未雨

客户服务电话: 95533

网址: [www.ccb.com](http://www.ccb.com)

### (2) 广发银行

注册地址: 广东省广州市越秀区东风东路 713 号

办公地址: 广东省广州市越秀区东风东路 713 号

法定代表人: 尹兆君

客户服务电话: 400-830-8003

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

### (3) 交通银行

注册地址: 中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号

办公地址: 中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号

法定代表人: 任德奇

联系人: 高天

联系电话: 021-58781234

客户服务电话: 95559

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

### (4) 平安银行

注册地址: 广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号

办公地址: 广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号

法定代表人: 谢永林

联系人:赵杨

联系电话:0755-22166574

客户服务电话:95511-3

传真:021-50979507

网址:bank.pingan.com

(5)浦发银行

注册地址:上海市中山东一路 12 号

办公地址:上海市中山东一路 12 号

法定代表人:郑杨

联系人:赵守良

联系电话:021-61618888

客户服务电话:95528

传真:021-63604196

网址:www.spdb.com.cn

(6)兴业银行

注册地址:福州市湖东路 154 号

办公地址:上海市银城路 167 号兴业银行大厦

法定代表人:陶以平(代为履行法定代表人职权)

联系人:孙琪虹

客户服务电话:95561

网址:www.cib.com.cn

(7)招商银行

注册地址:深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址:深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人:缪建民

联系人:季平伟

客户服务电话:95555

网址:www.cmbchina.com

(8)中国工商银行

注册地址:北京西城区复兴门内大街 55 号

办公地址:北京西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人:陈四清

联系人:杨菲

客户服务电话:95588

网址:www.icbc.com.cn

(9) 中国光大银行

注册地址:北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心

办公地址:北京市西城区太平桥大街 25 号金融街 F3 大厦 (中国光大中心)

法定代表人:李晓鹏

联系人:朱红

联系电话:010-63636153

客户服务电话:95595

传真:010-63639709

网址:www.cebbank.com

(10) 中国民生银行

注册地址:北京市西城区复兴门内大街 2 号

办公地址:北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人:高迎欣

联系人:徐野

客户服务电话:95568

网址:www.cmbc.com.cn

(11) 中国农业银行

注册地址:北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址:北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人:谷澍

联系人:李紫钰

客户服务电话:95599

传真:010-85109219

网址:www.abchina.com

(12) 中国银行

注册地址:北京市西城区复兴门内大街 1 号

办公地址:北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人:刘连舸

客户服务电话:95566

网址:www.boc.cn

(13) 中国邮政储蓄银行

注册地址:北京市西城区金融大街 3 号

办公地址:北京市西城区金融大街 3 号

法定代表人:张金良

联系人:王硕

客户服务电话:95580

传真:010-68858057

网址:www.psbc.com

(14) 中信银行

注册地址:北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层

办公地址:北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层

法定代表人:李庆萍

联系人:王晓琳

客户服务电话:95558

传真:010-85230049

网址:bank.ecitic.com

(15) 北京银行

注册地址:北京市西城区金融大街甲 17 号首层

办公地址:北京市西城区金融大街丙 17 号

法定代表人:张东宁

联系人:周黎

客户服务电话:95526

网址:www.bankofbeijing.com.cn

(16) 东莞银行

注册地址:东莞市莞城区体育路 21 号

办公地址:东莞市莞城区体育路 21 号东莞银行大厦

法定代表人:卢国锋

联系人:朱杰霞

联系电话:0769-27239605

客户服务电话:956033

网址:www.dongguanbank.cn

(17) 福建海峡银行

注册地址:福建省福州市台江区江滨中大道 358 号海峡银行大厦

办公地址:福建省福州市台江区江滨中大道 358 号福建海峡银行 8 楼

法定代表人:俞敏

联系人:黄晶

联系电话:0591-87385069

客户服务电话:400-893-9999

传真:0591-87330926

网址:www.fjhxbank.com

(18) 广州银行

注册地址:广州市天河区珠江东路 30 号

办公地址:广州市天河区珠江东路 30 号广州银行大厦

法定代表人:丘斌

联系人:唐荟

客户服务电话:96699 (广东) 400-83-96699 (全国)

网址:www.gzcb.com.cn

(19) 杭州银行

注册地址:浙江省杭州市下城区庆春路 46 号

办公地址:杭州市下城区庆春路 46 号杭州银行大厦

法定代表人:陈震山



联系人:蒋梦君

联系电话:0571-85120718

客户服务电话:95398

传真:0571-85106576

网址:www.hzbank.com.cn

(20)河北银行

注册地址:石家庄市平安北大街 28 号

办公地址:石家庄市平安北大街 28 号

法定代表人:梅爱斌

联系人:李博

联系电话:0311-88627587

客户服务电话:400-612-9999

传真:0311-67806407

网址:www.hebbank.com

(21)嘉兴银行

注册地址:浙江省嘉兴市昌盛南路 1001 号

办公地址:浙江省嘉兴市昌盛南路 1001 号

法定代表人:夏林生

联系人:朱李平

联系电话:0573-82080289

客户服务电话:0573-96528

网址:http://www.bojx.com

(22)江苏银行

注册地址:南京市中华路 26 号

办公地址:南京市中华路 26 号

法定代表人:夏平

联系人:展海军

联系电话:025-58587039

客户服务电话:95319

传真:025-58587820

网址:www.jsbchina.cn

(23) 南京银行

注册地址:南京市玄武区中山路 288 号

办公地址:南京市玄武区中山路 288 号

法定代表人:胡升荣

联系人:赵世光

客户服务电话:95302

网址:www.njcb.com.cn

(24) 宁波银行

注册地址:浙江省宁波市鄞州区宁东路 345 号

办公地址:浙江省宁波市鄞州区宁东路 345 号

法定代表人:陆华裕

联系人:陈佳瑜

客户服务电话:95574

网址:www.nbcb.com.cn

(25) 泉州银行

注册地址:泉州市丰泽区泉泰路 266 号

办公地址:泉州市丰泽区泉泰路 266 号

法定代表人:傅子能

联系人:董培姗

联系电话:0595-22551071

客户服务电话:400-88-96312

传真:0595-22578871

网址:http://www.qzccbank.com

(26) 上海银行

注册地址:中国(上海)自由贸易试验区银城中路 168 号

办公地址:上海市浦东新区银城中路 168 号

法定代表人:金煜

联系人:王笑

联系电话:021-68475732

客户服务电话:95594

网址:<http://www.bosc.cn/>

(27) 微众银行

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

办公地址:广东省深圳市南山区沙河西路1819号深圳湾科技生态园7栋A座

法定代表人:顾敏

客户服务电话:95384

网址:<http://www.webank.com>

(28) 乌鲁木齐银行

注册地址:新疆乌鲁木齐市水磨沟区会展大道599号新疆财富中心A座4层至31层

办公地址:新疆乌鲁木齐市水磨沟区会展大道599号新疆财富中心A座4层至31层

法定代表人:任思宇

联系人:王小培

联系电话:0991-4500319

客户服务电话:0991-96518

网址:[www.uccb.com.cn](http://www.uccb.com.cn)

(29) 厦门银行

注册地址:厦门市思明区湖滨北路101号商业银行大厦

办公地址:厦门市思明区湖滨北路101号商业银行大厦

法定代表人:吴世群

联系人:孙瑜

联系电话:0592-5310251

客户服务电话:400-858-8888

传真:0592-5373973

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

(30) 东莞农村商业银行

注册地址:广东省东莞市东城区鸿福东路 2 号

办公地址:广东省东莞市东城区鸿福东路 2 号东莞农商银行大厦

法定代表人:王耀球

联系人:钟燕珊

客户服务电话:0769-961122

网址:www.drcbank.com

(31)江南农村商业银行

注册地址:常州市武进区延政中路 9 号

办公地址:常州市武进区延政中路 9 号

法定代表人:陆向阳

联系人:李仙

联系电话:0519-80585939

客户服务电话:0519-96005

传真:0519-89995170

网址:http://www.jnbank.com.cn

(32)上海农村商业银行

注册地址:上海市黄浦区中山东二路 70 号

办公地址:上海市黄浦区中山东二路 70 号上海农商银行大厦

法定代表人:徐力

联系人:施传荣

联系电话:021-61899999

客户服务电话:021-962999、 4006962999

网址:www.srcb.com

(33)南洋商业银行

注册地址:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 800 号三层、六层至九层(不含六层 A 座)

办公地址:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 800 号三层、六层至九层(不含六层 A 座)

法定代表人:孙建东

联系人:施艳

联系电话:021-38566625

客户服务电话:8008207898 (内地固话用户)、4008207898 (内地手机用户)、(86551)  
64360499 (港澳台及境外)

传真:021-38566400

网址:<http://www.ncbchina.cn/cn/index.html>

(34) 安信证券

注册地址:深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

办公地址:深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元 深圳市福  
田区深南大道 2008 号中国凤凰大厦 1 栋 9 层

法定代表人:黄炎勋

联系人:陈剑虹

联系电话:0755-82825551

客户服务电话:95517

传真:0755-82558355

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

(35) 渤海证券

注册地址:天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

办公地址:天津市南开区滨水西道 8 号

法定代表人:安志勇

联系人:王星

联系电话:022-28451922

客户服务电话:400-651-5988

传真:022-28451892

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

(36) 财达证券

注册地址:河北省石家庄市桥西区自强路 35 号

办公地址:河北省石家庄市桥西区自强路 35 号庄家金融大厦 23-26 层

法定代表人:翟建强

联系人:李卓颖

联系电话:0311-66008561

客户服务电话:95363 (河北省内); 0311-95363 (河北省外)

传真:0311-66006414

网址:www.sl0000.com

(37)财通证券

注册地址:浙江省杭州市西湖区天目山路 198 号财通双冠大厦西楼

办公地址:浙江省杭州市西湖区天目山路 198 号财通双冠大厦西楼

法定代表人:陆建强

联系人:蔡驰宙

联系电话:0571-87821867

客户服务电话:95336

网址:www.ctsec.com

(38)财信证券

注册地址:湖南省长沙市岳麓区茶子山东路 112 号滨江金融中心 T3、T4 及裙房 718

办公地址:长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26-28 层

法定代表人:刘宛晨

联系人:郭静

联系电话:0731-84403347

客户服务电话:95317

传真:0731-84403439

网址:www.cfzq.com

(39)长城国瑞证券

注册地址:厦门市思明区莲前西路 2 号莲富大厦 17 楼

办公地址:厦门市思明区深田路 46 号深田国际大厦 20 楼

法定代表人:王勇

联系人:布前

联系电话:010-68085771

客户服务电话:400-0099-886

传真:0592-2079602

网址:www.gwgsc.com

(40) 长城证券

注册地址:深圳市福田区福田街道金田路 2026 号能源大厦南塔楼 10-19 层

办公地址:深圳市福田区福田街道金田路 2026 号能源大厦南塔楼 10-19 层长城证券

法定代表人:张巍

联系人:梁浩

联系电话:0755-83530715

客户服务电话:400-6666-888 或 95514

传真:0755-83515567

网址:www.cgws.com

(41) 长江证券

注册地址:湖北省武汉市新华路特 8 号

办公地址:湖北省武汉市新华路特 8 号

法定代表人:李新华

联系人:奚博宇

联系电话:027-65799999

客户服务电话:95579 或 4008-888-999

传真:027-85481900

网址:www.95579.com

(42) 川财证券

注册地址:中国(四川)自由贸易试验区成都高新区交子大道 177 号中海国际中心 B 座  
17 楼

办公地址:四川省成都高新区交子大道 177 号中海国际中心 B 座 17 楼

法定代表人:金树成

联系人:匡婷

联系电话:028-86583053

客户服务电话:028-962708

网址:www.cczq.com

(43) 大通证券

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

38、39 层

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

38、39 层

法定代表人:赵玺

联系人:谢立军

联系电话:0411-39991807

客户服务电话:4008-169-169

传真:0411-39673214

网址:www.daton.com.cn

(44) 大同证券

注册地址:山西省大同市城区迎宾街 15 号桐城中央 21 层

办公地址:山西省太原市小店区长治路 111 号山西世贸中心 A 座 F12、F13

法定代表人:董祥

联系人:薛津

联系电话:0351-4130322

客户服务电话:4007121212

传真:0351-7219891

网址:www.dtsbc.com.cn

(45) 德邦证券

注册地址:上海市普陀区曹杨路 510 号南半幢 9 楼

办公地址:上海市福山路 500 号城建国际中心 29 楼

法定代表人:武晓春

联系人:李林

联系电话:021-68761616

客户服务电话:400-8888-128

传真:021-68767880

网址:http://www.tebon.com.cn



(46) 第一创业证券

注册地址:深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼

办公地址:深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼

法定代表人:刘学民

联系人:单晶

联系电话:0755-23838750

客户服务电话:95358

网址:www.firstcapital.com.cn

(47) 东北证券

注册地址:长春市生态大街 6666 号

办公地址:长春市生态大街 6666 号

法定代表人:李福春

联系人:安岩岩

联系电话:0431-85096517

客户服务电话:95360

传真:0431-85096795

网址:www.nesc.cn

(48) 东海证券

注册地址:江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18 层

办公地址:上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦

法定代表人:钱俊文

联系人:王一彦

联系电话:021-20333333

客户服务电话:95531、400-8888-588

传真:021-50498825

网址:www.longone.com.cn

(49) 东吴证券

注册地址:苏州工业园区星阳街 5 号

办公地址:苏州工业园区星阳街 5 号

法定代表人:范力

联系人:陆晓

联系电话:0512-62938521

客户服务电话:95330

传真:0512-65588021

网址:www.dwzq.com.cn

(50)东兴证券

注册地址:北京市西城区金融大街5号(新盛大厦)12、15层

办公地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座10层、12层、15层

法定代表人:魏庆华

联系人:郑旷怡

联系电话:010-66559039

客户服务电话:95309

传真:010-66555133

网址:www.dxzq.net

(51)东莞证券

注册地址:东莞市莞城区可园南路一号

办公地址:东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼

法定代表人:陈照星

联系人:陈士锐

联系电话:0769-22112151

客户服务电话:95328

传真:0769-22115712

网址:www.dgzq.com.cn

(52)方正证券

注册地址:湖南省长沙市天心区湘江中路二段36号华远华中心4、5号楼3701-3717

办公地址:北京市朝阳区朝阳门南大街10号兆泰国际中心A座16-19层

法定代表人:施华

联系人:丁敏

联系电话:010-59355997

客户服务电话:95571

传真:010-56437030

网址:www.foundersc.com

(53)光大证券

注册地址:上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址:上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人:刘秋明

联系人:郁疆

联系电话:021-22169999

客户服务电话:95525

网址:www.ebscn.com

(54)广发证券

注册地址:广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街 2 号 618 室

办公地址:广州市天河区马场路 26 号广发证券大厦

法定代表人:孙树明

联系人:黄岚

客户服务电话:95575 或 02095575

网址:www.gf.com.cn

(55)国都证券

注册地址:北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

办公地址:北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

法定代表人:翁振杰

联系人:黄静

联系电话:010-84183333

客户服务电话:400-818-8118

传真:010-84183311-3122

网址:www.guodu.com

(56)国海证券

注册地址:广西壮族自治区桂林市七星区辅星路 13 号

办公地址:广西壮族自治区南宁市青秀区滨湖路 46 号国海大厦

法定代表人:何春梅

联系人:李健

联系电话:0755-88313842

客户服务电话:95563 或 0771-95563

网址:www.ghzq.com.cn

(57) 国金证券

注册地址:成都市青羊区东城根上街 95 号

办公地址:成都市青羊区东城根上街 95 号成证大厦

法定代表人:冉云

联系人:杜晶、黎建平

联系电话:028-86690057

客户服务电话:95310

传真:028-86690126

网址:www.gjzq.com.cn

(58) 国联证券

注册地址:江苏省无锡市太湖新城金融一街 8 号

办公地址:江苏省无锡市太湖新城金融一街 8 号国联金融大厦

法定代表人:姚志勇

联系人:祁昊

联系电话:0510-82831662

客户服务电话:95570

传真:0510-82830162

网址:www.glsc.com.cn

(59) 国融证券

注册地址:内蒙古自治区呼和浩特市武川县腾飞大道 1 号 4 楼

办公地址:北京市西城区宣武门西大街甲 129 号金隅大厦 16 层

法定代表人:张智河

联系人:刘云龙、张泽浩

联系电话:010-83991889、010-83991862

客户服务电话:95385

传真:010-66412537

网址:www.grzq.com

(60)国盛证券

注册地址:江西省南昌市新建区子实路 1589 号

办公地址:江西省南昌市红谷滩新区凤凰中大道 1115 号北京银行大厦

法定代表人:周军

联系人:占文驰

联系电话:0791-88250812

客户服务电话:956080

传真:0791-86281305

网址:www.gszq.com

(61)国泰君安证券

注册地址:中国(上海)自由贸易试验区商城路 618 号

办公地址:上海市静安区南京西路 768 号国泰君安大厦

法定代表人:贺青

联系人:芮敏祺

客户服务电话:95521

传真:021-38670666

网址:www.gtja.com

(62)国信证券

注册地址:深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址:深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人:张纳沙

联系人:李颖

联系电话:0755-82130833

客户服务电话:95536

传真:0755-82133952

网址:www.guosen.com.cn

(63) 国元证券

注册地址:安徽省合肥市梅山路 18 号

办公地址:安徽省合肥市梅山路 18 号安徽国际金融中心 A 座国元证券

法定代表人:俞仕新

联系人:汪先哲

联系电话:0551-62207400

客户服务电话:95578

传真:0551-2272100

网址:www.gyzq.com.cn

(64) 海通证券

注册地址:上海市广东路 689 号

办公地址:上海市广东路 689 号

法定代表人:周杰

联系人:金芸、李笑鸣

联系电话:021-23219000

客户服务电话:95553

传真:021-23219100

网址:www.htsec.com

(65) 恒泰证券

注册地址:内蒙古自治区呼和浩特市新城区海拉尔东街满世尚都办公商业综合楼

办公地址:内蒙古自治区呼和浩特市新城区海拉尔东街满世尚都办公商业综合楼

法定代表人:庞介民

联系人:熊丽

联系电话:0471-4972675

客户服务电话:956088

网址:www.cnht.com.cn

(66) 华安证券

注册地址:安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

办公地址:安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

法定代表人:章宏韬

联系人:范超

联系电话:0551-65161821

客户服务电话:95318

传真:0551-65161825

网址:www.hazq.com

(67)华宝证券

注册地址:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 100 号 57 层

办公地址:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 100 号 57 层

法定代表人:刘加海

联系人:刘闻川

联系电话:021-20515385

客户服务电话:400-820-9898

传真:021-20515593

网址:www.cnhbstock.com

(68)华福证券

注册地址:福建省福州市鼓楼区鼓屏路 27 号 1#楼 3 层、4 层、5 层

办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路 1088 号招行上海大厦 18 层、19 层、29 层

法定代表人:黄金琳

联系人:王虹

联系电话:021-20655183

客户服务电话:95547

传真:021-20655196

网址:www.hfzq.com.cn

(69)华林证券

注册地址:西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城 3 幢 1 单元 5-5

办公地址:深圳市南山区深南大道 9668 号华润置地大厦 C 座 31-33 层

法定代表人:林立

联系人:郑琢

联系电话:0755-82707766

客户服务电话:400-188-3888

传真:0755-82707993

网址:www.chinalin.com

(70) 华龙证券

注册地址:兰州市城关区东岗西路 638 号兰州财富中心 21 楼

办公地址:兰州市城关区东岗西路 638 号兰州财富中心

法定代表人:陈牧原

联系人:范坤

联系电话:0931-4890208

客户服务电话:95368、400-689-8888

传真:0931-4890628

网址:www.hlzq.com

(71) 华融证券

注册地址:北京市西城区金融大街 8 号

办公地址:北京市朝阳区朝阳门北大街 18 号中国人保寿险大厦 12 至 18 层

法定代表人:张海文

联系人:孙燕波

联系电话:010-85556048

客户服务电话:95390

传真:010-85556088

网址:www.hrsec.com.cn

(72) 华泰证券

注册地址:南京市江东中路 228 号

办公地址:南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场

法定代表人:张伟

联系人:庞晓芸



联系电话:0755-82492193

客户服务电话:95597

传真:025-83387523

网址:www.htsc.com.cn

(73) 华西证券

注册地址:四川省成都市高新区天府二街 198 号

办公地址:四川省成都市高新区天府二街 198 号华西证券大厦

法定代表人:杨炯洋

联系人:张彬

联系电话:010-58124967

客户服务电话:95584

传真:028-86150040

网址:www.hx168.com.cn

(74) 华鑫证券

注册地址:深圳市福田区莲花街道福中社区深南大道 2008 号中国凤凰大厦 1 栋 20C-1

房

办公地址:上海市徐汇区宛平南路 8 号

法定代表人:俞洋

联系人:刘熠

联系电话:021-54967387

客户服务电话:95323 (全国)、400-109-9918 (全国)、029-68918888 (西安)

传真:021- 54967293

网址:www.cfsc.com.cn

(75) 江海证券

注册地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

办公地址:黑龙江省哈尔滨市松北区创新三路 833 号

法定代表人:赵洪波

联系人:王金娇

联系电话:0451-87765732

客户服务电话:956007

传真:0451-82337279

网址:www.jhzq.com.cn

(76) 金元证券

注册地址:海口市南宝路 36 号证券大厦 4 楼

办公地址:深圳市深南大道 4001 号时代金融中心大厦 17 楼

法定代表人:王作义

联系人:刘萍

联系电话:0755-83025693

客户服务电话:95372

传真:0755-83025625

网址:www.jyzq.cn

(77) 开源证券

注册地址:陕西省西安市高新区锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层

办公地址:陕西省西安市高新区锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层

法定代表人:李刚

联系人:张蕊

联系电话:029-88365809

客户服务电话:95325

网址:www.kysec.cn

(78) 联储证券

注册地址:广东省深圳市福田区福田街道岗厦社区深南大道南侧金地中心大厦 9 楼

办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路 1366 号富士康大厦 9、10 层

法定代表人:吕春卫

联系人:祝博文

联系电话:010-86499794

客户服务电话:400-620-6868

网址:www.lczq.com

(79) 民生证券

注册地址:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 1168 号 B 座 2101、2104A 室

办公地址:北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16-20 层

法定代表人:冯鹤年

联系人:胡梦雅

联系电话:010-85127627

客户服务电话:95376

网址:www.msza.com

(80)南京证券

注册地址:南京市江东中路 389 号

办公地址:南京市江东中路 389 号

法定代表人:李剑锋

联系人:王万君

联系电话:025-58519523

客户服务电话:95386

传真:025-83369725

网址:www.njzq.com.cn

(81)平安证券

注册地址:深圳市福田区福田街道益田路 5023 号平安金融中心 B 座第 22-25 层

办公地址:深圳市福田区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

法定代表人:何之江

联系人:周驰

联系电话:021-38643230

客户服务电话:95511-8

传真:021-58991896

网址:stock.pingan.com

(82)山西证券

注册地址:太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

办公地址:太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

法定代表人:王怡里

联系人:谢武兵

联系电话:0351-8686721

客户服务电话:95573 或 400-666-1618

传真:0351-8686619

网址:www.i618.com.cn

(83)上海证券

注册地址:上海市黄浦区四川中路 213 号 7 楼

办公地址:上海市四川中路 213 号久事商务大厦 7 楼

法定代表人:何伟

联系人:邵珍珍

联系电话:021-53686888

客户服务电话:4008-918-918

传真:021-53686100-7008, 021-53686200-7008

网址:https://www.shzq.com/

(84)申万宏源西部证券

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

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

法定代表人:王献军

联系人:王怀春

联系电话:0991-2307105

客户服务电话:95523、4008895523

传真:010-88085195

网址:www.swhysc.com

(85)申万宏源证券

注册地址:上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址:上海市徐汇区长乐路 989 号世纪商贸广场 45 层

法定代表人:杨玉成

联系人:陈宇

联系电话:021-33388252

客户服务电话:95523、4008895523

传真:021-33388224

网址:www.swhysc.com

(86)世纪证券

注册地址:深圳市前海深港合作区南山街道桂湾五路 128 号前海深港基金小镇对冲基金中心 406

办公地址:广东省深圳市福田区福田街道金田路 2026 号能源大厦北塔 23-25 楼

法定代表人:李强

联系人:徐玲娟

联系电话:0755-83199599-9135

客户服务电话:4008323000

网址:www.cscoc.com.cn

(87)天风证券

注册地址:湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路 2 号高科大厦四楼

办公地址:湖北省武汉市武昌区中南路 99 号保利广场 A 座 37 楼

法定代表人:余磊

联系人:王雅薇

联系电话:027-87617017

客户服务电话:95391/400-800-5000

传真:027-87618863

网址:http://www.tfzq.com/

(88)万联证券

注册地址:广州市天河区珠江东路 11 号 18、19 楼全层

办公地址:广州市天河区珠江东路 13 号高德置地广场 E 栋 12 层

法定代表人:罗钦城

联系人:甘蕾

联系电话:020-38286026

客户服务电话:95322

传真:020-38286588

网址:www.wlzq.cn

(89)西部证券

注册地址:陕西省西安市新城区东大街 319 号 8 幢 10000 室

办公地址:陕西省西安市新城区东大街 319 号 8 幢 10000 室

法定代表人:徐朝晖

联系人:张吉安

联系电话:029-87211668

客户服务电话:95582

传真:029-87211478

网址:www.westsecu.com

(90)西南证券

注册地址:重庆市江北区桥北苑 8 号

办公地址:重庆市江北区桥北苑 8 号西南证券大厦

法定代表人:廖庆轩

联系人:魏馨怡

联系电话:023-67663104

客户服务电话:4008096096 或 95355

传真:023-63786212

网址:www.swsc.com.cn

(91)湘财证券

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

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

法定代表人:高振营

联系人:江恩前

联系电话:021-38784580-8920

客户服务电话:95351

传真:021-68865680

网址:www.xcsc.com

(92) 新时代证券

注册地址:北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501

办公地址:北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501

法定代表人:林雯

联系人:廖晓

联系电话:010-83561321

客户服务电话:95399

网址:www.xsdzq.cn

(93) 信达证券

注册地址:北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

办公地址:北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人:祝瑞敏

联系人:王薇安

联系电话:010-83252170

客户服务电话:95321

传真:010-63080978

网址:www.cindasc.com

(94) 兴业证券

注册地址:福州市湖东路 268 号

办公地址:上海浦东新区长柳路 36 号兴业证券大厦 20 楼

法定代表人:杨华辉

联系人:乔琳雪

联系电话:021-38565547

客户服务电话:95562

网址:www.xyzq.com.cn

(95) 银河证券

注册地址:北京市西城区金融大街 35 号 2-6 层

办公地址:北京市丰台区西营街 8 号院 1 号楼青海金融大厦

法定代表人:陈共炎

联系人:辛国政

联系电话:010-80928123

客户服务电话:4008-888-888 或 95551

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

(96)粤开证券

注册地址:广州经济技术开发区科学大道 60 号开发区控股中心 21、22、23 层

办公地址:广州经济技术开发区科学大道 60 号开发区控股中心 21、22、23 层

法定代表人:严亦斌

联系人:彭莲

联系电话:0755-83331195

客户服务电话:95564

网址:<http://www.ykzq.com>

(97)招商证券

注册地址:深圳市福田区福田街道福华一路 111 号

办公地址:深圳市福田区福田街道福华一路 111 号

法定代表人:霍达

联系人:黄婵君

联系电话:0755-82943666

客户服务电话:95565、400-8888-111

传真:0755-82943636

网址:[www.newone.com.cn](http://www.newone.com.cn)

(98)浙商证券

注册地址:浙江省杭州市江干区五星路 201 号

办公地址:浙江省杭州市江干区五星路 201 号浙商证券大楼 8 楼

法定代表人:吴承根

联系人:高扬

联系电话:0571-87902974

客户服务电话:95345



传真:0571-87901913

网址:www.stocke.com.cn

(99)中航证券

注册地址:江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号南昌国际金融大厦 A 栋 41 层

办公地址:江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号南昌国际金融大厦 A 栋 41 层

法定代表人:丛中

联系人:王紫雯

联系电话:010-59562468

客户服务电话:95335 或 400-88-95335

传真:010-59562637

网址:www.avicsec.com

(100)中金财富

注册地址:深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18-21 层及第 04 层 01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23 单元

办公地址:深圳福田区益田路 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:万玉琳

联系电话:0755-82026907

客户服务电话:95532

网址:https://www.ciccwm.com

(101)中金公司

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

办公地址:北京市朝阳区建国门外大街甲 6 号 SK 大厦 38 层

法定代表人:沈如军

联系人:杨涵宇

联系电话:010-65051166

客户服务电话:4009101166

网址:www.cicc.com.cn

(102)中山证券

注册地址:深圳市南山区粤海街道蔚蓝海岸社区创业路 1777 号海信南方大厦 21、22 层

办公地址:深圳市南山区创业路 1777 号海信南方大厦 21、22 层

法定代表人:吴小静

联系人:罗艺琳

联系电话:0755-82943755

客户服务电话:95329

传真:0755-82960582

网址:www.zszq.com

(103)中泰证券

注册地址:济南市市中区经七路 86 号

办公地址:山东省济南市经七路 86 号

法定代表人:李峰

联系人:许曼华

联系电话:021-20315290

客户服务电话:95538

传真:0531-68889095

网址:www.zts.com.cn

(104)中天证券

注册地址:辽宁省沈阳市和平区光荣街 23 甲

办公地址:辽宁省沈阳市和平区光荣街 23 甲

法定代表人:马功勋

联系人:李泓灏

联系电话:024-23255256

客户服务电话:024-95346

传真:024-23255606

网址:www.iztzq.com

(105)中信建投证券

注册地址:北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址:北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人:王常青

联系人:刘芸

联系电话:010—85130554

客户服务电话:95587 或 4008-888-108

网址:<http://www.csc108.com/>

(106) 中信证券

注册地址:广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座

办公地址:北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人:张佑君

联系人:王一通

联系电话:010-60838888

客户服务电话:95548

传真:010-60836029

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

(107) 中信证券（山东）

注册地址:青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001

办公地址:青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座 5 层

法定代表人:冯恩新

联系人:焦刚

联系电话:0531-89606166

客户服务电话:95548

传真:0532-85022605

网址:<http://sd.citics.com/>

(108) 中信证券华南

注册地址:广州市天河区临江大道 395 号 901 室(部位:自编 01), 1001 室

办公地址:广州市天河区临江大道 395 号合利天德广场 T1 楼 10 层

法定代表人:胡伏云

联系人:陈靖

联系电话:020-88836999

客户服务电话:95548

传真:020-88836984

网址:www.gzs.com.cn

(109) 中银证券

注册地址:上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层

办公地址:上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39-40 层

法定代表人:宁敏

联系人:王伟哲

客户服务电话:400-620-8888

传真:021-50372474

网址:www.bocichina.com

(110) 中原证券

注册地址:郑州市郑东新区商务外环路 10 号

办公地址:河南省郑州市郑东新区商务外环路 10 号中原广发金融大厦 19 楼

法定代表人:菅明军

联系人:程月艳 李盼盼 党静

联系电话:0371-69099882

客户服务电话:95377

传真:0371--65585899

网址:www.ccnew.com

(111) 长量基金

注册地址:上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址:上海市浦东新区东方路 1267 号陆家嘴金融服务广场二期 11 层

法定代表人:张跃伟

联系人:孙娅雯

联系电话:021-20691819

客户服务电话:400-820-2899

传真:021-20691861

网址:www.erichfund.com

(112) 创金启富

注册地址:北京市西城区白纸坊东街 2 号院 6 号楼 712 室

办公地址:北京市西城区白纸坊东街 2 号院 6 号楼 712 室

法定代表人:梁蓉

联系人:魏素清

联系电话:010-66154828-8047

客户服务电话:010-66154828-8005

传真:010-63583991

网址:[www.5irich.com](http://www.5irich.com)

(113) 大智慧基金

注册地址:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路 428 号 1 号楼 1102 单元

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:张蜓

联系电话:021-20219988-35374

客户服务电话:021-20292031

传真:021-20219923

网址:<https://www.wg.com.cn/>

(114) 蛋卷基金

注册地址:北京市朝阳区创远路 34 号院 6 号楼 15 层 1501 室

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

联系电话:010-61840688

客户服务电话:400-159-9288

网址:<https://danjuanapp.com>

(115) 泛华普益

注册地址:四川省成都市成华区建设路 9 号高地中心 1101 室

办公地址:成都市金牛区花照壁西顺街 399 号 1 栋 1 单元龙湖西宸天街 B 座 1201 号

法定代表人:于海锋

联系人:陈丹

联系电话:15114053620

客户服务电话:400-080-3388

网址:www.puyifund.com

(116)富济基金

注册地址:深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路 3088 号中洲大厦 3203A 单元

办公地址:深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路 3088 号中洲大厦 3203A 单元

法定代表人:祝中村

联系人:曾瑶敏

联系电话:0755-83999907

客户服务电话:0755-83999907

传真:0755-83999926

网址:www.fujifund.cn

(117)海银基金

注册地址:中国(上海)自由贸易试验区银城中路 8 号 402 室

办公地址:上海市浦东新区银城中路 8 号海银金融中心 4 楼

法定代表人:巩巧丽

联系人:李卓楠

联系电话:021-80134149

客户服务电话:400-808-1016

传真:021-80133413

网址:www.fundhaiyin.com

(118)好买基金

注册地址:上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号

办公地址:上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903~906 室

法定代表人:杨文斌

联系人:高源

联系电话:021-36696312

客户服务电话:400-700-9665

传真:021-68596919

网址:www.ehowbuy.com

(119)恒天明泽

注册地址:北京市经济技术开发区宏达北路10号五层5122室

办公地址:北京市朝阳区东三环北路甲19号SOHO嘉盛中心30层3001室

法定代表人:周斌

联系人:侯艳红

联系电话:010-59313555

客户服务电话:400-8980-618

传真:010-59313586

网址:www.chtwm.com

(120)虹点基金

注册地址:北京市朝阳区东三环北路17号10层1015室

办公地址:北京市朝阳区东三环北路17号10层1015室

法定代表人:何静

联系人:王重阳

联系电话:010-65951887

客户服务电话:400-618-0707

网址:www.hongdianfund.com

(121)汇成基金

注册地址:北京市西城区宣武门外大街甲1号环球财讯中心D座4层401-2

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D座401

法定代表人:王伟刚

联系人:王骁骁

联系电话:010-56251471

客户服务电话:400-619-9059

网址:www.hcfunds.com

(122)济安财富

注册地址:北京市朝阳区太阳宫中路 16 号院 1 号楼 3 层 307

办公地址:北京市朝阳区太阳宫中路 16 号院 1 号楼冠捷大厦 3 层 307 单元

法定代表人:杨健

联系人:李海燕

联系电话:010-65309516

客户服务电话:400-673-7010

传真:010-65330699

网址:www.jianfortune.com

(123) 京东肯特瑞

注册地址:北京市海淀区西三旗建材城中路 12 号 17 号平房 157

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

层

法定代表人:李骏

联系人:邢锦超

客户服务电话:95118

网址:kenterui.jd.com

(124) 利得基金

注册地址:上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室

办公地址:上海市虹口区东大名路 1098 号浦江国际金融广场 53 层

法定代表人:李兴春

联系人:陈孜明

联系电话:86-021-50583533

客户服务电话:400 032 5885

传真:86-21-61101630

网址:www.leadfund.com.cn

(125) 联泰基金

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

办公地址:上海市长宁区福泉北路 518 号 8 座 3 楼

法定代表人:尹彬彬



联系人:陈东

联系电话:021-52822063

客户服务电话:400-118-1188

传真:021-52975270

网址:www.66zichan.com

(126)陆基金

注册地址:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路1333号14楼09单元

办公地址:上海市源深路1088号平安财富大厦7楼

法定代表人:陈祎彬

联系人:宁博宇

联系电话:021-20665952

客户服务电话:4008219031

传真:021-22066653

网址:www.lufunds.com

(127)蚂蚁基金

注册地址:浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路969号3幢5层599室

办公地址:浙江省杭州市西湖区万塘路18号黄龙时代广场B座6F

法定代表人:祖国明

联系人:韩爱彬

联系电话:0571-26888888

客户服务电话:4000-766-123

网址:http://www.fund123.cn/

(128)诺亚正行

注册地址:上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室

办公地址:上海市杨浦区长阳路1687号长阳谷2号楼

法定代表人:汪静波

联系人:李娟

联系电话:021-80358523

客户服务电话:400-821-5399

传真:021-80358749

网址:www.noah-fund.com

(129)浦领基金

注册地址:北京市朝阳区望京东园四区2号楼10层1001号04室

办公地址:北京市朝阳区望京浦项中心A座9层04-08

法定代表人:张昱

联系人:李艳

联系电话:010-59497361

客户服务电话:400-012-5899

传真:010-64788016

网址:www.zscffund.com

(130)钱景基金

注册地址:北京市海淀区中关村东路18号1号楼11层B-1108

办公地址:北京市海淀区中关村东路18号财智国际大厦B-1108

法定代表人:王利刚

联系人:白皓

联系电话:010-59422766

客户服务电话:400-893-6885

传真:010-62565181

网址:www.qianjing.com

(131)苏宁基金

注册地址:南京市玄武区苏宁大道1-5号

办公地址:南京市玄武区苏宁大道1-5号

法定代表人:王锋

联系人:冯鹏鹏

联系电话:025-66996699-882796

客户服务电话:95177

网址:www.snjijin.com

(132)天天基金

注册地址:上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

办公地址:上海市徐汇区宛平南路 88 号东方财富大厦

法定代表人:其实

联系人:屠彦洋

联系电话:021-54509977

客户服务电话:95021

传真:021-64385308

网址:www.1234567.com.cn

(133)通华财富

注册地址:上海市虹口区同丰路 667 弄 107 号 201 室

办公地址:上海市浦东新区金沪路 55 号通华科技大厦 2 楼

法定代表人:沈丹义

联系人:杨涛、庄洁茹

联系电话:021-60810586

客户服务电话:400-101-9301

传真:021-60810695

网址:www.tonghuafund.com

(134)同花顺

注册地址:浙江省杭州市文二西路 1 号 903 室

办公地址:杭州市余杭区五常街道同顺街 18 号同花顺大楼 4 层

法定代表人:吴强

联系人:吴强

联系电话:0571-88911818

客户服务电话:952555

传真:0571-86800423

网址:www.5ifund.com

(135)挖财基金

注册地址:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路 759 号 18 层 03 单元

办公地址:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路 759 号 18 层 03 单元

法定代表人:吕柳霞

联系人:毛善波

联系电话:021-50810687

客户服务电话:021-50810673

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

(136) 万得基金

注册地址:中国(上海)自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

办公地址:上海市浦东新区浦明路 1500 号万得大厦 11 楼

法定代表人:黄伟

联系人:徐亚丹

联系电话:021-50712782

客户服务电话:400-799-1888

网址:[www.520fund.com.cn](http://www.520fund.com.cn)

(137) 万家财富

注册地址:天津自贸区(中心商务区)迎宾大道 1988 号滨海浙商大厦公寓 2-2413 室

办公地址:北京市西城区丰盛胡同 28 号太平洋保险大厦 A 座 5 层

法定代表人:戴晓云

联系人:王芳芳

联系电话:010-59013828

客户服务电话:010-59013895

网址:<http://www.wanjiawealth.com/>

(138) 新浪仓石

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

办公地址:北京市海淀区西北旺东路 10 号院东区 3 号楼为明大厦 C 座

法定代表人:赵芯蕊

联系人:赵芯蕊

联系电话:010-62625768

客户服务电话:010-62675369

传真:010-62676582

网址:www.xincai.com

(139)一路财富

注册地址:北京市海淀区宝盛南路1号院20号楼9层101-14

办公地址:北京市海淀区宝盛南路奥北科技园20号楼国泰大厦9层

法定代表人:吴雪秀

联系人:董宣

联系电话:010-88312877

客户服务电话:400-001-1566

传真:010-88312099

网址:www.yilucaifu.com

(140)宜信普泽

注册地址:北京市朝阳区光华路7号楼20层20A1、20A2单元

办公地址:北京市朝阳区光华路7号楼20层20A1、20A2单元

法定代表人:才殿阳

联系人:魏晨

联系电话:13260309352

客户服务电话:400-6099-200

传真:010-59644044

网址:www.yixinfund.com

(141)盈米基金

注册地址:珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491(集中办公区)

办公地址:广州市海珠区阅江中路688号保利国际广场北塔33层

法定代表人:肖雯

联系人:邱湘湘

联系电话:020-89629099

客户服务电话:020-89629066

传真:020-89629011

网址:www.yingmi.cn

(142)展恒基金

注册地址:北京市朝阳区安苑路 11 号西楼 6 层 604、607

办公地址:北京市朝阳区北四环中路 27 号盘古大观 3205

法定代表人:闫振杰

联系人:武文佳

联系电话:010-59601399

客户服务电话:400-818-8000

传真:0351-4110714

网址:www.myfund.com

(143)中欧财富

注册地址:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路 333 号 502 室

办公地址:上海市虹口区公平路 18 号 8 栋嘉昱大厦 6 层

法定代表人:许欣

联系人:黎静

联系电话:021-68609600

客户服务电话:400-700-9700

网址:www.qiangungun.com

(144)众禄基金

注册地址:深圳市罗湖区笋岗街道笋西社区梨园路 8 号 HALO 广场一期四层 12-13 室

办公地址:深圳市罗湖区笋岗街道笋西社区梨园路 8 号 HALO 广场一期四层 12-13 室

法定代表人:薛峰

联系人:龚江江

联系电话:0755-33227950

客户服务电话:4006-788-887

传真:0755-33227951

网址:www.zlfund.cn      www.jjmmw.com

(145)奕丰金融

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

办公地址:深圳市南山区海德三道航天科技广场 A 座 17 楼 1704 室

法定代表人:TEO WEE HOWE

联系人:叶健

联系电话:0755-89460507

客户服务电话:400-684-0500

传真:0755-21674453

网址:www.ifastps.com.cn

(146) 晟视天下

注册地址:北京市怀柔区九渡河镇黄坎村 735 号 03 室

办公地址:北京市朝阳区朝外大街甲六号万通中心 D 座 21 层

法定代表人:蒋煜

联系人:史俊杰

联系电话:010-58170936

客户服务电话:010-58170761

传真:010-58170800

网址:www.shengshiview.com

(147) 深圳新兰德

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

办公地址:北京市西城区宣武门外大街 28 号富卓大厦 A 座 16 层

法定代表人:洪弘

联系人:文雯

联系电话:010-83363101

客户服务电话:400-166-1188

传真:010-83363010

网址:http://8.jrj.com.cn

(148) 中证金牛

注册地址:北京市丰台区东管头 1 号 2 号楼 2-45 室

办公地址:北京市西城区宣武门外大街甲 1 号环球财讯中心 A 座 5 层

法定代表人:钱昊旻

联系人:沈晨

联系电话:010-59336544

客户服务电话:4008-909-998

网址:www.jnlc.com

(149) 鑫鼎盛

注册地址:厦门市思明区鹭江道2号厦门第一广场西座1501-1502室

办公地址:厦门市思明区鹭江道2号厦门第一广场西座1501-1502室

法定代表人:陈洪生

联系人:梁云波

联系电话:0592-3122757

客户服务电话:400-6533-789

网址:www.xds.com.cn

(150) 东证期货

注册地址:中国(上海)自由贸易试验区浦电路500号上海期货大厦14层

办公地址:上海市黄浦区中山南路318号2号楼22楼

法定代表人:卢大印

联系人:张敏圆

联系电话:021-63325888-4259

客户服务电话:4008859999

传真:021-63326752

网址:www.dzqh.com.cn

(151) 中信建投期货

注册地址:重庆市渝中区中山三路131号希尔顿商务中心27楼、30楼

办公地址:重庆市渝中区中山三路107号皇冠大厦11楼

法定代表人:王广学

联系人:刘芸

联系电话:023-86769637

客户服务电话:400-8877-780

传真:023-86769629



网址:www.cfc108.com

(152) 中信期货

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

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

法定代表人:张皓

联系人:刘宏莹

联系电话:010-6083 3754

客户服务电话:400-990-8826

传真:021-60819988

网址:www.citicsf.com

#### (二) 基金登记结算机构

名称:中国证券登记结算有限责任公司

注册地址:北京西城区太平桥大街17号

办公地址:北京西城区太平桥大街17号

法定代表人:戴文华

电话:4008058058

传真:(010)50938907

联系人:赵亦清

#### (三) 律师事务所和经办律师

律师事务所:广东金桥百信律师事务所

地址:广州市珠江新城珠江东路16号高德置地冬广场G座24楼

负责人:聂卫国

电话:020-83338668

传真:020-83338088

经办律师:石向阳、莫哲

联系人:石向阳

#### (四) 会计师事务所和经办注册会计师

本基金的法定验资机构为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

会计师事务所：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

主要经营场所：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

执行事务合伙人：TonyMao 毛鞍宁

电话：010-58153000

传真：010-85188298

经办注册会计师：赵雅、李明明

联系人：赵雅

本基金的年度财务报表及其他规定事项的审计机构为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)。

会计师事务所：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼

办公地址：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼

首席合伙人：李丹

电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

经办注册会计师：陈熹、陈轶杰

联系人：周祎

## 六、基金的募集

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同的相关规定募集，本基金已经中国证券监督管理委员会 2018 年 6 月 6 日《关于准予易方达 3 年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）注册的批复》（证监许可[2018]926 号）注册。

本基金为契约型开放式混合型证券投资基金，基金的存续期为不定期。

本基金募集期间每份基金份额初始面值为人民币 1.00 元。

本基金募集期自 2018 年 6 月 11 日至 2018 年 6 月 19 日。

募集对象为符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者及中国证监会允许购买证券投资基金的特定机构投资者。具体发售对象见基金份额发售公告以及基金管理人届时发布的相关公告。

## 七、基金合同的生效

### （一）基金合同的生效

本基金基金合同于 2018 年 7 月 5 日正式生效。自基金合同生效日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

### （二）基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

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

法律法规或基金合同另有规定时，从其规定。

## 八、基金份额的上市交易

### 一、基金的上市

如基金具备下列条件，基金管理人可依据《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》，向深圳证券交易所申请本基金基金份额的上市交易。

- 1、本基金募集金额不少于 2 亿元人民币；
- 2、本基金基金份额持有人不少于 1000 人；
- 3、深圳证券交易所规定的其他条件。

在确定上市交易的时间后，基金管理人将依据法律法规的规定在指定媒介刊登基金份额上市交易公告书。

### 二、上市交易的地点

深圳证券交易所

### 三、上市交易的时间

本基金已于 2019 年 3 月 29 日通过深圳证券交易所上市交易。

### 四、上市交易的规则

本基金基金份额在深圳证券交易所的上市交易需遵循《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》、《深圳证券交易所交易规则》等有关规定。

### 五、上市交易的费用

基金份额上市交易的费用按照深圳证券交易所有关规定办理。

### 六、上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市

上市基金份额的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市等事项按照《基金法》相关规定和深圳证券交易所的相关规定执行。具体情况见基金管理人届时相关公告。

若根据深圳证券交易所的相关规定，当基金发生深圳证券交易所证券相关业务规则规定的因不再具备上市条件而应当终止上市的情形时，本基金将变更为非上市基金，除此之外，本基金的基金名称，开放期和封闭运作期安排，基金费率，基金的投资范围和投资策略等均不变，无需召开基金份额持有人大会。

### 七、上市交易的行情揭示

基金份额在深圳证券交易所挂牌交易，交易行情通过行情发布系统揭示。行情发布系统

同时揭示基金前一交易日的份额净值。

#### 八、其他

1、相关法律法规、《业务规则》、中国证监会及深圳证券交易所对基金上市交易的规则等相关规定内容进行调整的，《基金合同》可相应予以修改，此事项无须召开基金份额持有人大会审议。

2、若深圳证券交易所、登记结算机构增加了基金上市交易的新功能，本基金可以增加相应功能，无需召开基金份额持有人大会审议。

## 九、基金份额的申购、赎回

### （一）申购和赎回的场所

本基金场外申购与赎回场所为基金管理人的直销网点及其他基金场外销售机构的销售网点。在证券交易所、登记结算机构等相关机构具备条件的情况下，本基金在受限开放期内可接受场内申购申请。场内申购和赎回场所为深圳证券交易所内具有基金销售业务资格并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的会员单位。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变更或增减销售机构，并在基金管理人网站公示。基金投资人应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。若基金管理人或其指定的销售机构开通电话、传真或网上等交易方式，投资人可以通过上述方式进行申购与赎回。

### （二）申购和赎回办理的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

本基金合同生效后的前三年为封闭运作期，在封闭运作期内，本基金每 6 个月受限开放一次，每个受限开放期的首日为本基金基金合同生效日起每 6 个月的月度对日。本基金的每个受限开放期不少于 5 个工作日、不超过 10 个工作日，具体的受限开放期时间由基金管理人在开始办理申购前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上予以公告。在封闭运作期内，本基金不办理赎回业务。在受限开放期内，本基金可以接受基金份额的申购申请，但不接受基金份额的赎回申请。

基金合同生效三年后，本基金转为上市开放式基金（LOF），基金管理人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。开放日的具体业务办理时间在招募说明书或相关公告中载明。

若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施前依照《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

在确定申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应在申购、赎回开放前依照《信息披露

办法》的有关规定在指定媒介上公告申购与赎回的开始时间。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购或者赎回或者转换。办理申购与赎回业务的具体事宜见基金管理人届时发布的相关公告。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记结算机构确认接受的，其基金份额申购、赎回价格为下一开放日基金份额申购、赎回的价格。

本基金自转为上市开放式基金（LOF）之日起 30 天内开始办理场内与场外份额的申购、赎回业务，具体业务办理时间在相关公告中规定。

### （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、场外基金份额持有人赎回时，基金管理人按先进先出的原则，对该持有人账户在该销售机构托管的基金份额进行处理，即按照投资人持有份额登记日期的先后次序进行顺序赎回。

5、投资者申购、赎回场内基金份额时，需遵守深圳证券交易所和登记结算机构的相关《业务规则》。若相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所或登记结算机构对申购、赎回业务等规则有新的规定，按新规定执行。

基金管理人可在不违反法律法规的情况下，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。

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

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本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，本基金登记结算机构在 T+1 日内对该交易的有效性进行确认。T 日提交的有效申请，投资人应在 T+2 日后（包括该日）到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功，则申购款项本金退还给投资人。

销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申购、赎回申请。申购、赎回的确认以登记结算机构的确认结果为准。对于申购申请及申购份额的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利。

在不违反法律法规的前提下，登记结算机构可根据《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。

### 3、申购和赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式，若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功。若申购不成功或无效，基金管理人或基金管理人指定的非直销销售机构将投资人已缴付的申购款项本金退还给投资人。

基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立，赎回是否生效以登记结算机构确认为准。基金份额持有人赎回申请成功后，基金管理人将在 T+7 日（包括该日）内支付赎回款项。如遇国家外汇局相关规定有变更或本基金境外投资主要市场的交易清算规则有变更、基金境外投资主要市场及外汇市场休市或暂停交易、登记结算公司系统故障、交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其它非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程，则赎回款项的支付时间可相应顺延。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。

### （五）申购与赎回的数额限制

#### 1、申购金额的限制

投资人通过场外非直销销售机构或本公司网上交易系统首次申购的单笔最低限额为人民币 1 元，追加申购单笔最低限额为人民币 1 元；投资人通过本公司直销中心首次申购的单笔最低限额为人民币 50,000 元，追加申购单笔最低限额是人民币 1,000 元。投资人通过本基金场内销售机构申购本基金份额时，每笔申购金额最低为 1 元，同时申购金额必须是整数金额。在符合法律法规规定的前提下，各销售机构对申购限额及交易级差有其他规定的，需同时遵循该销售机构的相关规定。（以上金额均含申购费）。

投资人将当期分配的基金收益转购基金份额或采用定期定额投资计划时,不受最低申购金额的限制。

对于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, 基金管理人有权采取控制措施。

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

基金管理人可根据具体情况进行调整, 具体控制方案见届时相关公告。

## 2、赎回份额的限制

投资人可将其全部或部分基金份额赎回。基金份额持有人在办理场外赎回时, 单笔赎回不得少于 1 份(如该账户在该销售机构托管的该基金余额不足 1 份, 则必须一次性赎回该基金全部份额); 若某笔赎回将导致投资人在该销售机构托管的该基金余额不足 1 份时, 基金管理人有权将投资人在该销售机构托管的该基金剩余份额一次性全部赎回。在符合法律法规规定的前提下, 各销售机构对赎回份额限制有其他规定的, 需同时遵循该销售机构的相关规定。

基金份额持有人在办理场内赎回时, 单笔赎回不得少于 1 份, 同时赎回份额必须是整数份额。

3、对于场内申购、赎回及持有场内份额的数量限制, 深圳证券交易所和登记结算机构的相关业务规则有最新规定的, 从其最新规定办理;

4、基金管理人可在不违反法律法规的情况下, 调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制, 或者新增基金规模控制措施。基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

## (六) 基金的申购费和赎回费

1、本基金的申购费用由申购基金份额的投资人承担, 不列入基金财产, 主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。赎回费用由基金赎回人承担。

## 2、申购费率

本基金场内场外申购费率相同。

在封闭运作期的受限开放期内, 投资者申购本基金的申购费率见下表:

| 投资者类别 | 申购费率 |
|-------|------|
| 个人投资者 | 0.6% |
| 机构投资者 | 0.6% |

封闭运作期届满转为上市开放式基金（LOF）后，投资者申购本基金的申购费率见下表：

| 申购金额 M（元）（含申购费） | 申购费率      |
|-----------------|-----------|
| M<100 万元        | 1.50%     |
| 100 万元≤M<200 万元 | 1.20%     |
| 200 万元≤M<500 万元 | 0.30%     |
| M≥500 万元        | 每笔 1000 元 |

在申购费按金额分档的情况下，如果投资者多次申购，申购费适用单笔申购金额所对应的费率。

### 3、赎回费率

本基金场内场外赎回费率相同。赎回费率见下表：

| 持有时间（天） | 赎回费率  | 归入基金资产比例 |
|---------|-------|----------|
| 0-6     | 1.50% | 100%     |
| 7-29    | 0.75% | 100%     |
| 30-89   | 0.50% | 75%      |
| 90-179  | 0.50% | 50%      |
| 180-364 | 0.30% | 25%      |
| 365-544 | 0.10% | 25%      |
| 545-729 | 0.05% | 25%      |
| 730 及以上 | 0%    | ---      |

投资者份额持有时间记录规则以登记结算机构最新业务规则为准，具体持有时间以登记结算机构系统记录为准。

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。对持有期少于 30 天（不含）的基金份额持有人所收取赎回费用全额计入基金财产；对持有期在 30 天以上（含）且少于 90 天（不含）的基金份额持有人所收取赎回费用总额的 75%计入基金财产；对持有期在 90 天以上（含）且少于 180 天（不含）的基金份额持有人所收取赎回费用总额的 50%计入基金财产；对持续持有期 180 天以上（含）的基金份额持有人

所收取赎回费用总额的 25%计入基金财产；其余用于支付市场推广、注册登记费和其他手续费。

4、基金管理人可以在基金合同规定的范围内调整申购费率、赎回费率或变更收费方式，调整后的申购费率、赎回费率或变更的收费方式在更新的《招募说明书》中列示。上述费率或收费方式如发生变更，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

#### （七）申购和赎回的数额和价格

##### 1、申购和赎回数额、余额的处理方式

（1）申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后，以申购当日基金份额净值为基准计算。场外申购涉及金额、份额的计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。场内申购涉及金额的计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产；场内申购涉及份额的计算结果按截位法保留至整数位，整数位后小数部分的份额对应的资金返还至投资者资金账户。

（2）赎回金额的处理方式：赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以申请当日基金份额净值为基准并扣除相应的费用后的余额，赎回费用、赎回金额的单位为人民币元，计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

##### 2、申购份额的计算

净申购金额=申购金额/（1+申购费率）

（注：对于适用固定金额申购费的申购，净申购金额=申购金额-固定申购费金额）

申购费用=申购金额-净申购金额

申购份额=净申购金额/T 日基金份额净值

例：在封闭运作期的受限开放期内，某个人投资者投资 100,000 元场外申购本基金，申购费率为 0.6%，假设申购当日基金份额净值为 1.0400 元，则其可得到的申购份额为：

净申购金额=100,000/（1+0.6%）=99,403.58 元

申购费用=100,000-99,403.58=596.42 元

申购份额=99,403.58/1.0400=95,580.37 份

例：在封闭运作期的受限开放期内，某个人投资者投资 100,000 元场内申购本基金，申

购费率为 0.6%，假设申购当日基金份额净值为 1.0400 元，则其可得到的申购份额为：

$$\text{净申购金额} = 100,000 / (1 + 0.6\%) = 99,403.58 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 100,000 - 99,403.58 = 596.42 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 99,403.58 / 1.0400 = 95,580 \text{ 份（保留至整数位）}$$

$$\text{实际净申购金额} = 95,580 \times 1.0400 = 99,403.20 \text{ 元}$$

$$\text{退款金额} = 100,000 - 99,403.20 - 596.42 = 0.38 \text{ 元}$$

### 3、赎回金额的计算

赎回金额的计算方法如下：

$$\text{赎回费用} = \text{赎回份额} \times T \text{ 日基金份额净值} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{赎回金额} = \text{赎回份额} \times T \text{ 日基金份额净值} - \text{赎回费用}$$

例：某投资人在本基金进入开放期后从场外赎回 10,000 份基金份额，假设该笔份额持有期限为 6 天，则对应的赎回费率为 1.5%，假设赎回当日基金份额净值是 1.0160 元，则其可得到的赎回金额为：

$$\text{赎回费用} = 10,000 \times 1.0160 \times 1.5\% = 152.40 \text{ 元}$$

$$\text{赎回金额} = 10,000 \times 1.0160 - 152.40 = 10,007.60 \text{ 元}$$

即：投资人场外赎回本基金 10,000 份基金份额，假设赎回当日基金份额净值是 1.0160 元，则其可得到的赎回金额为 10,007.60 元。

例：某投资人在本基金进入开放期后从场外赎回 10,000 份基金份额，假设该笔份额持有期限为 10 天，则对应的赎回费率为 0.75%，假设赎回当日基金份额净值是 1.0160 元，则其可得到的赎回金额为：

$$\text{赎回费用} = 10,000 \times 1.0160 \times 0.75\% = 76.20 \text{ 元}$$

$$\text{赎回金额} = 10,000 \times 1.0160 - 76.20 = 10,083.80 \text{ 元}$$

即：投资人场外赎回本基金 10,000 份基金份额，假设赎回当日基金份额净值是 1.0160 元，则其可得到的赎回金额为 10,083.80 元。

例：某投资人在本基金进入开放期后从场外赎回 10,000 份基金份额，假设该笔份额持有期限为 1100 天，则对应的赎回费率为 0%，假设赎回当日基金份额净值是 1.0160 元，则其可得到的赎回金额为：

$$\text{赎回费用} = 10,000 \times 1.0160 \times 0\% = 0.00 \text{ 元}$$

$$\text{赎回金额} = 10,000 \times 1.0160 - 0.00 = 10,160.00 \text{ 元}$$

即：投资人场外赎回本基金 10,000 份基金份额，假设赎回当日基金份额净值是 1.0160 元，则其可得到的赎回金额为 10,160.00 元。

#### 4、基金份额净值的计算公式

计算日基金份额净值=计算日基金资产净值/计算日基金总份额。

本基金份额净值的计算，保留到小数点后四位，小数点后第五位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，基金份额净值可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。

#### （八）申购和赎回的登记

正常情况下，投资者 T 日申购基金成功后，登记结算机构在 T+1 日为投资者增加权益并办理登记手续，投资人自 T+2 日起（含该日）有权赎回该部分基金份额。

基金份额持有人 T 日赎回基金成功后，正常情况下，登记结算机构在 T+1 日为其办理扣除权益的登记手续。

在不违反法律法规的前提下，登记结算机构可以对上述登记办理时间进行调整，基金管理人应于开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

#### （九）巨额赎回的情形及处理方式

##### 1、巨额赎回的认定

本基金封闭运作期届满转为上市开放式基金（LOF）后，若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过前一日的基金总份额的 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、部分延期赎回或暂停赎回。

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

（2）部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的 10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的

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

若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额 30% 的，基金管理人有权对该单个基金份额持有人超出该比例的赎回申请实施延期办理；对该单个基金份额持有人剩余赎回申请，基金管理人可以按照下述方式与其他账户的赎回申请一并办理：1）全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。2）部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人应当在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的 10% 的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

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

（4）巨额赎回业务的场内处理，按照深圳证券交易所及登记结算机构的有关《业务规则》办理。

### 3、巨额赎回的公告

当发生上述巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，并在 2 日内在指定媒介上刊登公告。

（十）拒绝或暂停申购、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形及处理

1、发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

- (1) 因不可抗力导致基金无法正常运作。
- (2) 发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时。
- (3) 本基金投资的证券交易场所停止交易。
- (4) 基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。
- (5) 因港股通交易当日额度使用完毕而暂停或停止接受买入申报，或者发生证券交易服务公司等机构认定的交易异常情况并决定暂停提供部分或者全部港股通服务，或者发生其他影响通过内地与香港股票市场交易互联互通机制进行正常交易的情形。
- (6) 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，或基金管理人认定的其他损害现有基金份额持有人利益的情形。
- (7) 基金管理人、基金托管人、登记结算机构、销售机构、支付结算机构等因异常情况导致基金销售系统、基金销售支付结算系统、基金登记系统、基金会计系统等无法正常运行。
- (8) 基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过 50%，或者变相规避 50%集中度的情形时。
- (9) 当一笔新的申购申请被确认成功，使本基金总规模超过基金管理人规定的本基金总规模上限时；或使本基金单日申购金额或净申购比例超过基金管理人规定的当日申购金额或净申购比例上限时；或该投资人累计持有的份额超过单个投资人累计持有的份额上限时；或该投资人当日申购金额超过单个投资人单日或单笔申购金额上限时。
- (10) 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暂停接受基金申购申请的措施。
- (11) 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第 (1)、(2)、(3)、(5)、(6)、(7)、(9)、(10)、(11) 项情形且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项本金将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

2、本基金封闭运作期届满转为上市开放式基金（LOF）后，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。
- (3) 本基金投资的证券交易所停止交易。
- (4) 连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。
- (5) 继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时，可暂停接受投资人的赎回申请。

(6) 当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当采取延缓支付赎回款或暂停接受基金赎回申请的措施。

- (7) 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形且基金管理人决定暂停接受基金份额持有人赎回申请或延缓支付赎回款项时，基金管理人应报中国证监会备案。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。

### 3、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

(1) 发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人应在规定期限内指定媒介上刊登暂停公告。

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

## 十、基金转换和定期定额投资计划

### （一）基金转换

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

### （二）定期定额投资计划

本基金封闭运作期届满并进入开放期后,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。

## 十一、基金的转托管、质押、非交易过户、冻结与解冻

### （一）基金的转托管

#### 1、系统内转托管

（1）系统内转托管，指基金份额持有人将其持有的基金份额在登记结算系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记系统内不同会员单位（交易单元）之间进行转托管的行为。

（2）基金份额登记在证券登记系统的基金份额持有人在变更办理场内赎回或上市交易的会员单位时，须办理已持有基金份额的系统内转托管。

（3）基金份额登记在登记结算系统的基金份额持有人在变更办理基金份额赎回业务的销售机构（网点）时，须办理已持有基金份额的系统内转托管。

#### 2、跨系统转托管

（1）跨系统转托管，指持有人将其持有的基金份额在登记结算系统和证券登记系统之间进行转托管的行为。

（2）基金份额跨系统转托管的具体业务按照深圳证券交易所及登记结算机构的相关规定办理。

3、基金销售机构或登记结算机构有权对办理转托管业务收取相关费用。

### （二）基金份额的质押

在条件许可的情况下，基金登记结算机构可依据相关法律法规及其业务规则，办理基金份额质押业务，并可收取一定的手续费。

### （三）基金的非交易过户

基金的非交易过户是指基金登记结算机构受理继承、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结算机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资人。

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

### （四）基金的冻结与解冻

基金登记结算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,以及登记结算机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。

## 十二、基金的投资

### （一）投资目标

在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。

### （二）投资范围

本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、政策性金融债、中央银行票据、信用等级在 AAA（含）以上的债券及非金融企业债务融资工具等）、债券回购、同业存单、银行存款（包含协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具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，本基金可以将其纳入投资范围。

本基金封闭运作期内股票投资占基金资产的 0-100%。

### （三）投资策略

本基金在封闭运作期内主要采用战略配售和固定收益两种投资策略。

#### 1、战略配售股票投资策略

本基金主要投资通过战略配售取得的股票。

本基金将积极关注、深入分析并论证战略配售股票的投资机会，通过综合分析行业景气度、行业竞争格局、公司基本面、公司治理状况、公司估值水平、公司业务持续性和盈利确定性等多方面因素，并结合市场未来走势等判断，精选战略配售股票。

在战略配售股票锁定期结束后，本基金将根据对证券内在投资价值和成长性的判断，结合市场环境分析，选择适当的时机卖出。

#### 2、存托凭证投资策略

本基金可投资存托凭证，本基金将结合对宏观经济状况、行业景气度、公司竞争优势、公司治理结构、估值水平等因素的分析判断，选择投资价值高的存托凭证进行投资。

#### 3、固定收益证券投资策略

##### （1）债券投资策略

在债券投资方面，本基金将主要通过类属配置与券种选择两个层次进行投资管理。在类属配置层次，本基金结合对宏观经济、市场利率、供求变化等因素的综合分析，根据交易所

市场与银行间市场类属资产的风险收益特征,定期对投资组合类属资产进行优化配置和调整,确定类属资产的最优权重。

在券种选择上,本基金以长期利率趋势分析为基础,结合经济变化趋势、货币政策及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素,实施积极主动的债券投资管理。

随着国内债券市场的深入发展和结构性变迁,更多债券新品种和交易形式将增加债券投资盈利模式,本基金将密切跟踪市场动态变化,选择合适的介入机会,谋求高于市场平均水平的投资回报。

#### (2) 银行存款、同业存单投资策略

本基金根据宏观经济指标分析各类资产的预期收益率水平,并据此制定和调整资产配置策略。当银行存款、同业存单投资具有较高投资价值时,本基金将积极关注银行存款、同业存单的投资机会并进行合理配置。

#### (四) 业绩比较基准

本基金业绩比较基准: 沪深 300 指数收益率 $\times$ 60%+中债总指数收益率 $\times$ 40%。

本基金选定被市场广泛认同的沪深 300 指数作为权益部分的业绩比较基准,选定中债总指数作为固定收益部分的业绩比较基准。此外,本基金还参考预期的大类资产配置比例设置了业绩比较基准的权重。

如果指数编制单位更改以上指数名称、停止或变更以上指数的编制或发布,或以上指数由其他指数替代、或由于指数编制方法等重大变更导致以上指数不宜继续作为业绩比较基准,或市场上出现其他代表性更强、更加适用于本基金的业绩比较基准时,本基金管理人可以根据本基金的投资范围和投资策略,调整基金的业绩比较基准,但应在取得基金托管人同意后报中国证监会备案,并及时公告,无须召开基金份额持有人大会审议。

#### (五) 风险收益特征

本基金为混合型证券投资基金,其预期风险与预期收益水平低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金。

#### (六) 投资禁止行为与限制

##### 1、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) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- (5) 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；
- (6) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

## 2、投资组合限制

### (1) 投资组合限制

- 1) 本基金投资于股票资产的比例为 0-100%；
- 2) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；
- 3) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；
- 4) 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；
- 5) 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%；在全国银行间同业市场的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；
- 6) 本基金总资产不得超过基金净资产的 200%；
- 7) 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%；
- 8) 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。
- 9) 本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行，与境内上市交易的股票合并计算。
- 10) 法律法规及中国证监会规定的其他投资比例限制。

除上述第 4)、8) 项外，因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。上述期间，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本基金合同生效之日起开始。

## 3、基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人

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

4、法律法规或监管部门取消上述组合限制、禁止行为规定或从事关联交易的条件和要求,本基金可不受相关限制。法律法规或监管部门对上述组合限制、禁止行为规定或从事关联交易的条件和要求进行变更的,本基金可以变更后的规定为准。经与基金托管人协商一致并履行适当程序后,基金管理人可依据法律法规或监管部门规定对基金合同进行变更。

#### (七) 本基金转为上市开放式基金(LOF)后基金投资相关安排

##### 1、投资目标

在控制风险的前提下,追求超越业绩比较基准的投资回报。

##### 2、投资范围

本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括创业板、中小板以及其他依法发行上市的股票、存托凭证)、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的香港证券市场股票(以下简称“港股通股票”)、国内依法发行上市的债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、次级债、企业债、短期融资券、中期票据、公司债、可转换债券(含可分离交易可转债)、可交换债券、证券公司短期公司债券、中小企业私募债等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、权证、股指期货、国债期货、股票期权及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,本基金可以将其纳入投资范围。

本基金股票资产占基金资产的比例为60%-95%(其中港股通股票不超过股票资产的50%);每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后,本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的5%,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。权证、股指期货、国债期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

##### 3、投资策略

###### (1) 资产配置策略



本基金基于定量与定性相结合的宏观及市场分析，综合考虑国内外宏观经济环境、政策形势、市场估值与流动性等因素，对国内外证券市场当期的系统性风险以及可预见的未来时期内各大类资产的预期风险和预期收益率进行分析评估，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

### 1）地区配置策略

本基金将对内地和香港地区进行自上而下的研究，主要通过对财政金融政策、GDP 增长率、物价水平、利率走势、汇率走势、证券市场相对估值水平等方面的分析，对内地和香港地区的投资价值进行综合评价，作为进行地区配置的依据。

### 2）行业配置策略

本基金将通过分析以下因素，对各行业的投资价值进行综合评估，从而确定并动态调整行业配置比例。

#### a. 行业景气度

本基金将密切关注国家相关产业政策、规划动态，并结合行业数据持续跟踪、上下游产业链深入调研等方法，根据相关行业盈利水平的横向与纵向比较，适时对各行业景气度周期与行业未来盈利趋势进行研判，重点投资于景气度较高且具有可持续性的行业。

#### b. 行业竞争格局

本基金主要通过密切跟踪行业进入者的数量、行业内各公司的竞争策略及各公司产品或服务的市场份额来判断公司所处行业竞争格局的变化，重点投资于行业竞争格局良好的行业。

### 3）个股投资策略

在行业配置的基础上，本基金将重点投资于满足基金管理人以下分析标准的公司：公司经营稳健，盈利能力较强或具有较好的盈利预期；财务状况运行良好，资产负债结构相对合理，财务风险较小；公司治理结构合理、管理团队相对稳定、管理规范、具有清晰的长期愿景与企业文化、信息透明。

### 4）估值水平分析

本基金将根据上市公司的行业特性及公司本身的特点，选择合适的股票估值方法。可供选择的估值方法包括市盈率法（P/E）、市净率法（P/B）、市盈率—长期成长法（PEG）、企业价值/销售收入（EV/SALES）、企业价值/息税折旧摊销前利润法（EV/EBITDA）、自由现金流贴现模型（FCFF，FCFE）或股利贴现模型（DDM）等。

#### 5) 股票组合的构建与调整

在以上分析的基础上，本基金将进行股票组合的构建。当内地、香港、行业或公司的基本面、股票的估值水平出现较大变化时，本基金将对股票组合适时进行动态调整。

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。

#### (3) 存托凭证投资策略

本基金可投资存托凭证，本基金将结合对宏观经济状况、行业景气度、公司竞争优势、公司治理结构、估值水平等因素的分析判断，选择投资价值高的存托凭证进行投资。

#### (4) 债券投资策略

在债券投资方面，本基金将主要通过类属配置与券种选择两个层次进行投资管理。在类属配置层次，本基金结合对宏观经济、市场利率、供求变化等因素的综合分析，根据交易所市场与银行间市场类属资产的风险收益特征，定期对投资组合类属资产进行优化配置和调整，确定类属资产的最优权重。

在券种选择上，本基金以长期利率趋势分析为基础，结合经济变化趋势、货币政策及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素，实施积极主动的债券投资管理。

随着国内债券市场的深入发展和结构性变迁，更多债券新品种和交易形式将增加债券投资盈利模式，本基金将密切跟踪市场动态变化，选择合适的介入机会，谋求高于市场平均水平的投资回报。

#### (5) 资产支持证券投资策略

本基金可在综合考虑预期收益率、信用风险、流动性等因素的基础上，选择投资价值较高的资产支持证券进行投资。

#### (6) 证券公司短期公司债券投资策略

本基金可根据内部的信用分析方法对可选的证券公司短期公司债券品种进行筛选，并严格控制单只证券公司短期公司债券的投资比例。此外，由于证券公司短期公司债券整体流动性相对较差，本基金将对拟投资或已投资的证券公司短期公司债券进行流动性分析和监测，选择流动性相对较好的品种进行投资。

#### (7) 中小企业私募债投资策略

本基金可在控制信用风险、流动性风险的基础上，对中小企业私募债进行投资，主要采取分散化投资策略，控制个债持有比例。同时，紧密跟踪研究发债企业的基本面变化，并据

此调整投资组合，控制投资风险。

#### （8）衍生产品投资策略

##### 1）股指期货、国债期货、股票期权投资策略

本基金可投资股指期货、国债期货、股票期权。若本基金投资股指期货、国债期货、股票期权，将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货、国债期货、股票期权合约进行交易，以对冲投资组合的风险、有效管理现金流量或降低建仓或调仓过程中的冲击成本等。

##### 2）权证投资策略

权证为本基金辅助性投资工具。权证的投资原则为有利于基金资产增值、控制下跌风险、实现保值和锁定收益。

3）本基金将关注其他金融衍生产品的推出情况，如法律法规或监管机构允许基金投资前述衍生工具，本基金将按届时有效的法律法规和监管机构的规定，制定与本基金投资目标相适应的投资策略和估值政策，在充分评估衍生产品的风险和收益的基础上，谨慎地进行投资。

（9）为了更好地实现投资目标，在综合考虑预期风险、收益、流动性等因素的基础上，本基金可参与融资业务。在条件许可的情况下，基金管理人可根据相关法律法规，参与融券业务和转融通证券出借业务。

（10）未来，随着市场的发展和基金管理运作的需要，基金管理人可以在不改变投资目标的前提下，遵循法律法规的规定，相应调整或更新投资策略，并在招募说明书更新中公告。

#### 4、业绩比较基准

本基金业绩比较基准： $\text{沪深 300 指数收益率} \times 45\% + \text{中证港股通综合指数收益率} \times 35\% + \text{中债总指数收益率} \times 20\%$ 。

本基金可投资于国内市场股票、债券、银行存款以及港股通股票等。因此，本基金选定被市场广泛认同的沪深 300 指数和中证港股通综合指数作为权益部分的业绩比较基准，选定中债总指数作为固定收益部分的业绩比较基准。此外，本基金还参考预期的大类资产配置比例设置了业绩比较基准的权重。

如果指数编制单位更改以上指数名称、停止或变更以上指数的编制或发布，或以上指数由其他指数替代、或由于指数编制方法等重大变更导致以上指数不宜继续作为业绩比较基准，或市场上出现其他代表性更强、更加适用于本基金的业绩比较基准时，本基金管理人可以根

据本基金的投资范围和投资策略，调整基金的业绩比较基准，但应在取得基金托管人同意后报中国证监会备案，并及时公告，无须召开基金份额持有人大会审议。

#### 5、风险收益特征

本基金为混合型证券投资基金，其预期风险与预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

开放运作后，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证券市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、投资于香港证券市场的风险、以及通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险等特有风险。本基金通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险详见招募说明书。

#### 6、投资禁止行为与限制

##### （1）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) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- 5) 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；
- 6) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

##### （2）组合限制

1) 本基金股票资产占基金资产的比例为 60%-95%（其中投资于港股通股票的比例不超过股票资产的 50%）；

2) 每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

- 3) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；
- 4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；
- 5) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；
- 6) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

- 7) 本基金在任何交易日买入权证的总金额, 不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%;
- 8) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例, 不得超过基金资产净值的 10%;
- 9) 本基金持有的全部资产支持证券, 其市值不得超过基金资产净值的 20%;
- 10) 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例, 不得超过该资产支持证券规模的 10%;
- 11) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券, 不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%;
- 12) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间, 如果其信用等级下降、不再符合投资标准, 应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出;
- 13) 基金财产参与股票发行申购, 本基金所申报的金额不超过本基金的总资产, 本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;
- 14) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%; 在全国银行间同业市场的债券回购最长期限为 1 年, 债券回购到期后不得展期;
- 15) 本基金总资产不得超过基金净资产的 140%;
- 16) 本基金持有单只中小企业私募债券, 其市值不得超过本基金资产净值的 10%;
- 17) 本基金投资于股指期货, 还应遵循如下投资组合限制: 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%; 在任何交易日日终, 持有的买入国债期货和股指期货合约价值与有价证券市值之和, 不得超过基金资产净值的 95%, 其中, 有价证券指股票、债券(不含到期日在一年以内的政府债券)、权证、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等; 在任何交易日终, 持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%; 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值, 合计(轧差计算)占基金资产的比例为 60%-95%; 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%;
- 18) 本基金投资于国债期货, 还应遵循如下投资组合限制: 在任何交易日日终, 本基金持有的买入国债期货合约价值, 不得超过基金资产净值的 15%; 本基金在任何交易日日终, 持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%; 本基金在任何交易日内交易(不包括平仓)的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 30%;

本基金所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定；

19) 本基金参与股票期权交易的，应当符合下列要求：基金因未平仓的期权合约支付和收取的权利金总额不得超过基金资产净值的 10%；开仓卖出认购期权的，应持有足额标的证券；开仓卖出认沽期权的，应持有合约行权所需的全额现金或交易所规则认可的可冲抵期权保证金的现金等价物；未平仓的期权合约面值不得超过基金资产净值的 20%。其中，合约面值按照行权价乘以合约乘数计算；

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

21) 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%。

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

23) 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。

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

25) 法律法规及中国证监会规定的其它投资比例限制。

除上述第 2)、12)、13)、22)、23) 项外，因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

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

审查。

(4) 法律法规或监管部门取消上述组合限制、禁止行为规定或从事关联交易的条件和要求,本基金可不受相关限制。法律法规或监管部门对上述组合限制、禁止行为规定或从事关联交易的条件和要求进行变更的,本基金可以变更后的规定为准。经与基金托管人协商一致并履行适当程序后,基金管理人可依据法律法规或监管部门规定对基金合同进行变更。

(八) 基金管理人代表基金行使所投资证券产生权利的处理原则及方法

1、有利于基金资产的安全与增值。

2、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人或股东权利,保护基金份额持有人的利益。

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

(九) 基金投资组合报告(未经审计)

本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。

本基金的托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同的规定,复核了本报告的内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告有关数据的期间为 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 3 月 31 日。

1、报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目            | 金额(元)             | 占基金总资产的比例(%) |
|----|---------------|-------------------|--------------|
| 1  | 权益投资          | 4,944,199,828.45  | 17.41        |
|    | 其中:股票         | 4,944,199,828.45  | 17.41        |
| 2  | 固定收益投资        | 20,314,438,869.44 | 71.52        |
|    | 其中:债券         | 20,314,438,869.44 | 71.52        |
|    | 资产支持证券        | -                 | -            |
| 3  | 贵金属投资         | -                 | -            |
| 4  | 金融衍生品投资       | -                 | -            |
| 5  | 买入返售金融资产      | 2,853,985,091.97  | 10.05        |
|    | 其中:买断式回购的买入返售 | -                 | -            |

|   |              |                   |        |
|---|--------------|-------------------|--------|
|   | 金融资产         |                   |        |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 4,388,056.25      | 0.02   |
| 7 | 其他资产         | 286,708,475.14    | 1.01   |
| 8 | 合计           | 28,403,720,321.25 | 100.00 |

## 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

### (1) 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|------------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | 20,453,534.22    | 0.07         |
| B  | 采矿业              | —                | —            |
| C  | 制造业              | 2,391,894,540.69 | 8.42         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 23,290,052.76    | 0.08         |
| E  | 建筑业              | —                | —            |
| F  | 批发和零售业           | 20,254.06        | 0.00         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 466,012,098.30   | 1.64         |
| H  | 住宿和餐饮业           | —                | —            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 1,113,421.77     | 0.00         |
| J  | 金融业              | 1,669,066,090.93 | 5.88         |
| K  | 房地产业             | 10,200.30        | 0.00         |
| L  | 租赁和商务服务业         | —                | —            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 372,181,406.60   | 1.31         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 158,228.82       | 0.00         |
| 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               | 4,944,199,828.45 | 17.41        |

## 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<br>(%) |
|----|--------|------|-------------|------------------|-------------|
| 1  | 601658 | 邮储银行 | 283,124,500 | 1,661,940,815.00 | 5.85        |
| 2  | 000333 | 美的集团 | 6,396,516   | 525,985,510.68   | 1.85        |
| 3  | 601816 | 京沪高铁 | 79,659,198  | 466,006,308.30   | 1.64        |
| 4  | 000651 | 格力电器 | 6,322,443   | 396,417,176.10   | 1.40        |
| 5  | 603259 | 药明康德 | 2,652,317   | 371,854,843.40   | 1.31        |
| 6  | 600519 | 贵州茅台 | 183,538     | 368,727,842.00   | 1.30        |
| 7  | 600887 | 伊利股份 | 6,479,994   | 259,394,159.82   | 0.91        |
| 8  | 000858 | 五粮液  | 829,800     | 222,369,804.00   | 0.78        |
| 9  | 002415 | 海康威视 | 3,426,100   | 191,518,990.00   | 0.67        |
| 10 | 000538 | 云南白药 | 1,532,744   | 184,710,979.44   | 0.65        |

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      | 1,119,902,000.00  | 3.94         |
| 2  | 央行票据      | -                 | -            |
| 3  | 金融债券      | 3,614,425,000.00  | 12.73        |
|    | 其中：政策性金融债 | 3,614,425,000.00  | 12.73        |
| 4  | 企业债券      | 1,366,611,869.44  | 4.81         |
| 5  | 企业短期融资券   | -                 | -            |
| 6  | 中期票据      | 2,241,935,000.00  | 7.89         |
| 7  | 可转债（可交换债） | -                 | -            |
| 8  | 同业存单      | 11,971,565,000.00 | 42.16        |
| 9  | 其他        | -                 | -            |
| 10 | 合计        | 20,314,438,869.44 | 71.53        |

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<br>(%) |
|----|--------|----------|------------|------------------|------------------|
| 1  | 180212 | 18 国开 12 | 18,600,000 | 1,869,858,000.00 | 6.58             |

|   |           |               |            |                |      |
|---|-----------|---------------|------------|----------------|------|
|   |           |               |            | 0              |      |
| 2 | 112006065 | 20 交通银行 CD065 | 10,000,000 | 982,200,000.00 | 3.46 |
| 3 | 112004019 | 20 中国银行 CD019 | 10,000,000 | 981,600,000.00 | 3.46 |
| 4 | 112109081 | 21 浦发银行 CD081 | 10,000,000 | 978,400,000.00 | 3.45 |
| 5 | 112017276 | 20 光大银行 CD276 | 10,000,000 | 977,900,000.00 | 3.44 |

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

11、投资组合报告附注

(1) 2020 年 4 月 20 日，中国银行保险监督管理委员会对中国邮政储蓄银行股份有限公司的如下违法违规行为作出罚款 190 万元的行政处罚决定：邮储银行监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在（一）资金交易信息漏报严重；（二）贷款核销业务漏报或错报；（三）贸易融资业务漏报；（四）分户账明细记录应报未报；（五）分户账账户数据应报未报；（六）错报总账会计数据；（七）关键且应报字段漏报或填报错误。2020 年 12 月 25 日，中国银行保险监督管理委员会针对中国邮政储蓄银行股份有限公司的如下违法违规行为作出罚款 4550 万元的行政处罚决定：1、同业投资业务接受第三方金融机构信用担保；2、买入返售项下的金融资产不符合监管规定；3、信贷资产收益权转让业务接受交易对手兜底承诺；4、同业投资按照穿透原则对应至最终债务人未纳入统一授信管理；5、个别产

业基金同业投资业务违规投向股权；6、同业投资投前调查不尽职；7、资金违规支付股票定向增发款；8、同业投资资金（通过置换方式）违规投向“四证”不全的房地产项目；9、债务性资金用作固定资产投资项目资本金；10、资金违规通过融资平台公司为地方政府融资；11、未进行资金投向风险审查和合规性审查；12、理财投资收益未及时确认为收入；13、部分分行为非保本理财产品出具保本承诺；14、出具与事实不符的理财投资清单；15、投资权益类资产的理财产品违规面向一般个人客户销售；16、理财投资接受第三方银行信用担保；17、代客理财资金用于本行自营业务，未实现风险隔离；18、理财产品相互交易，未实现风险隔离；19、通过基础资产在理财产品之间的非公允交易人为调节收益；20、理财风险准备金用于期限错配引发的应收未收利息垫款；21、使用非代客资金为理财产品垫款；22、未在理财产品存续期内披露非标资产风险状况发生实质性变化的信息；23、未按照《保险兼业代理协议》约定收取代销手续费；24、债券承销与投资业务未建立“防火墙”制度；25、部分重要岗位人员未按照规定期限轮岗；26、未按规定披露代销产品信息。

2020年4月20日，中国银行保险监督管理委员会对交通银行股份有限公司如下违法违规行为作出“罚款260万元”的行政处罚：交通银行监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在（一）理财产品数量漏报；（二）资金交易信息漏报严重；（三）贸易融资业务漏报；（四）信贷业务担保合同漏报；（五）分户账明细记录应报未报；（六）分户账账户数据应报未报；（七）关键且应报字段漏报或填报错误。2020年7月28日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局对交通银行股份有限公司太平洋信用卡中心的如下违法违规行为作出“责令改正，并处罚款共计100万元”的行政处罚：1. 2019年6月，该中心对某客户个人信息未尽安全保护义务；2. 2019年5月、7月，该中心对部分信用卡催收外包管理严重不审慎。2020年8月6日，上海市黄浦区城市管理行政执法局对交通银行太平洋信用卡中心上海分中心占用城市道路的行为罚款300元。

2020年4月20日，中国银行保险监督管理委员会对中国银行股份有限公司的如下违法违规行为作出罚款270万元的行政处罚决定：中国银行监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在（一）理财产品数量漏报；（二）资金交易信息漏报严重；（三）贸易融资业务漏报；（四）分户账明细记录应报未报；（五）分户账账户数据应报未报；（六）关键且应报字段漏报或填报错误。2020年12月1日，中国银行保险监督管理委员会对中国银行股份有限公司“原油宝”产品风险事件中的如下违法违规行为作出罚款5050万元的行政处罚决定：产品管理不规范，包括保证金相关合同条款不清晰、产品后评价工作不独立、未对产

品开展压力测试相关工作等；风险管理不审慎，包括市场风险限额设置存在缺陷、市场风险限额调整和超限操作不规范、交易系统功能存在缺陷未按要求及时整改等；内控管理不健全，包括绩效考核和激励机制不合理、消费者权益保护履职不足、全行内控合规检查未涵盖全球市场部对私产品销售管理等；销售管理不合规，包括个别客户年龄不满足准入要求、部分宣传销售文本内容存在夸大或者片面宣传、采取赠送实物等方式销售产品等。

2020年8月10日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局对上海浦东发展银行股份有限公司如下违法违规行为作出“责令改正，并处罚款共计2100万元”的行政处罚：1. 未按专营部门制规定开展同业业务；2. 同业投资资金违规投向“四证”不全的房地产项目；3. 延迟支付同业投资资金吸收存款；4. 为银行理财资金投向非标准化债权资产违规提供担保；5. 未按规定进行贷款资金支付管理与控制；6. 个人消费贷款贷后管理未尽职责；7. 通过票据转贴现业务调节信贷规模；8. 银行承兑汇票业务保证金来源审核未尽职责；9. 办理无真实贸易背景的贴现业务；10. 委托贷款资金来源审查未尽职责；11. 未按权限和程序办理委托贷款业务；12. 未按权限和程序办理非融资性保函业务。2020年11月26日，国家外汇管理局上海市分局对上海浦东发展银行股份有限公司如下违法违规行为罚款140万元人民币：1、违反公正、公平、诚信原则，违规开展外汇市场交易。2、违反银行交易记录管理规定。

2020年4月20日，中国银行保险监督管理委员会对中国光大银行股份有限公司的如下违法违规行为作出“罚款160万元”的行政处罚决定：光大银行监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送（一）分户账明细记录应报未报；（二）关键且应报字段漏报或填报错误；（三）向检查组提供与事实不符的材料；（四）账户设置不能如实反映业务实际。2020年10月20日，国家外汇管理局北京外汇管理部对中国光大银行股份有限公司违反银行交易记录管理规定的行为，处60万元人民币罚款，要求该行对直接负责的主管人员和其他直接责任人员给予处分。2020年10月20日，国家外汇管理局北京外汇管理部对中国光大银行股份有限公司违规开展外汇交易的行为，处60万元人民币罚款，要求该行对直接负责的主管人员和其他直接责任人员给予处分。

2020年4月20日，中国银行保险监督管理委员会对中信银行股份有限公司的如下违法违规行为作出罚款160万元的行政处罚决定：中信银行监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在（一）理财产品数量漏报；（二）信贷资产转让业务漏报；（三）贸易融资业务漏报；（四）分户账明细记录应报未报；（五）分户账账户数据应报未报；（六）关键且应报字段漏报或填报错误。2020年8月25日，国家外汇管理局北京外汇管理部对中信银行

的如下违法违规行为作出“给予警告，没收违法所得 14857527.66 元人民币，并处 1177.04 万元人民币罚款”的行政处罚决定：违规办理内保外贷业务；办理经常项目资金收付，未对交易单证的真实性及其与外汇收支的一致性进行合理审查；违反规定办理资本项目资金收付；违反规定办理售汇业务；违反外汇账户管理规定。2020 年 11 月 26 日，国家外汇管理局北京外汇管理部对中信银行违反规定办理售汇业务的行为，没收违法所得 661782.53 元人民币，并处 40 万元人民币罚款。2021 年 2 月 5 日，中国人民银行对中信银行的如下违法违规行为罚款 2890 万元：1. 未按规定履行客户身份识别义务；2. 未按规定保存客户身份资料和交易记录；3. 未按规定报送大额交易报告和可疑交易报告；4. 与身份不明的客户进行交易。2021 年 3 月 17 日，中国银行保险监督管理委员会对中信银行的如下违法违规行为罚款 450 万元：一、客户信息保护体制机制不健全；柜面非密查询客户账户明细缺乏规范、统一的业务操作流程与必要的内部控制措施，乱象整治自查不力；二、客户信息收集环节管理不规范；客户数据访问控制管理不符合业务“必须知道”和“最小授权”原则；查询客户账户明细事由不真实；未经客户本人授权查询并向第三方提供其个人银行账户交易信息；三、对客户敏感信息管理不善，致其流出至互联网；违规存储客户敏感信息；四、系统权限管理存在漏洞，重要岗位及外包机构管理存在缺陷。

2020 年 8 月 21 日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局对兴业银行股份有限公司资金营运中心的如下违法违规行为作出“责令改正，并处罚款人民币 50 万元”的行政处罚决定：2017 年 7 月至 2019 年 6 月，该中心黄金租赁业务严重违反审慎经营规则。2020 年 8 月 31 日，中国银保监会福建监管局对兴业银行股份有限公司的如下违法违规行为作出“没收违法所得 6,361,807.97 元，并合计处以罚款 15,961,807.97 元”的行政处罚决定：同业投资用途不合规、授信管理不尽职、采用不正当手段吸收存款、理财资金间接投资本行信贷资产收益权、非洁净转让信贷资产、违规接受地方财政部门担保。2020 年 9 月 4 日，中国人民银行福州中心支行对兴业银行股份有限公司的如下违法违规行为作出“给予警告，没收违法所得 10,875,088.15 元，并处 13,824,431.23 元罚款”的行政处罚决定：1. 为无证机构提供转接清算服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性的规定；2. 为支付机构超范围（超业务、超地域）经营提供支付服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性；3. 违规连通上、下游支付机构，提供转接清算服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性；4. 违反银行卡收单外包管理规定；5. 未按规定履行客户身份识别义务。2020 年 10 月 22 日，

中国银行保险监督管理委员会上海监管局对兴业银行股份有限公司信用卡中心的如下违法违规行为作出“责令改正，并处罚款人民币 50 万元”的行政处罚决定：信用卡授信审批严重违反审慎经营规则。

本基金投资邮储银行、20 交通银行 CD065、20 中国银行 CD019、21 浦发银行 CD081、20 光大银行 CD276、21 中信银行 CD062、21 兴业银行 CD136、21 光大银行 CD066 的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除邮储银行、20 交通银行 CD065、20 中国银行 CD019、21 浦发银行 CD081、20 光大银行 CD276、21 中信银行 CD062、21 兴业银行 CD136、21 光大银行 CD066 外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

（2）本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

（3）其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）          |
|----|---------|----------------|
| 1  | 存出保证金   | 670,198.04     |
| 2  | 应收证券清算款 | —              |
| 3  | 应收股利    | —              |
| 4  | 应收利息    | 286,038,277.10 |
| 5  | 应收申购款   | —              |
| 6  | 其他应收款   | —              |
| 7  | 待摊费用    | —              |
| 8  | 其他      | —              |
| 9  | 合计      | 286,708,475.14 |

（4）报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

（5）报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 十三、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，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金合同生效日为 2018 年 7 月 5 日，基金合同生效以来（截至 2020 年 12 月 31 日）的投资业绩及与同期基准的比较如下表所示：

| 阶段                                  | 净值增长率<br>(1) | 净值增长率<br>标准差 (2) | 业绩比较<br>基准收益<br>率 (3) | 业绩比较<br>基准收益<br>率标准差<br>(4) | (1) - (3) | (2)-(4) |
|-------------------------------------|--------------|------------------|-----------------------|-----------------------------|-----------|---------|
| 自基金合同生效<br>日至 2018 年 12 月<br>31 日   | 2.58%        | 0.06%            | -5.13%                | 0.89%                       | 7.71%     | -0.83%  |
| 2019 年 1 月 1 日至<br>2019 年 12 月 31 日 | 6.24%        | 0.18%            | 22.08%                | 0.74%                       | -15.84%   | -0.56%  |
| 2020 年 1 月 1 日至<br>2020 年 12 月 31 日 | 4.29%        | 0.31%            | 16.26%                | 0.84%                       | -11.97%   | -0.53%  |
| 自基金合同生效<br>日至 2020 年 12 月<br>31 日   | 13.65%       | 0.23%            | 34.50%                | 0.81%                       | -20.85%   | -0.58%  |

本基金历任基金经理情况：肖林，管理时间为 2018 年 7 月 5 日至 2019 年 9 月 9 日。

## 十四、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的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和。

### （二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### （三）基金财产的账户

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

### （四）基金财产的保管和处分

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

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



## 十五、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、衍生工具和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

### （三）估值方法

#### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

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

（2）交易所上市交易或挂牌转让的不含权和含权固定收益品种，选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价；

（3）交易所上市交易的可转换债券，选取每日收盘价作为估值全价；

（4）交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募债券，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。

#### 2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

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

（3）在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

#### 3、全国银行间债券市场交易的固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

4、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

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

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

7、本基金投资存托凭证的估值核算，依照境内上市交易的股票执行。

8、汇率

如本基金投资股票市场交易互联互通机制允许买卖的境外证券市场上市的股票，涉及相关货币对人民币汇率的，届时根据相关法律法规及监管机构的要求确定汇率来源，如法律法规及监管机构无相关规定，基金管理人与基金托管人协商一致后确定本基金的估值汇率来源。

9、税收

对于按照中国法律法规和基金投资股票市场交易互联互通机制涉及的境外交易场所所在地的法律法规规定应交纳的各项税金，本基金将按权责发生制原则进行估值；对于因税收规定调整或其他原因导致基金实际交纳税金与估算的应交税金有差异的，基金将在相关税金调整日或实际支付日进行相应的估值调整。

10、如有充分理由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。

11、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。

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

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

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

#### （四）估值程序

1、基金份额净值是按照每个估值日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

每个估值日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

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

#### （五）估值错误的处理

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

各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、或登记结算机构、或销售机构、或投资人自身的过错造成估值错误，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该估值错误遭受损失当事人（“受损方”）的直接损失按下述“估值错误处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

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

##### 2、估值错误处理原则

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

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

（3）因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但估值错误责任方仍应对估值错误负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利

造成其他当事人的利益损失(“受损方”),则估值错误责任方应赔偿受损方的损失,并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利;如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方,则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给估值错误责任方。

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

(5) 按法律法规规定的其他原则处理估值错误。

### 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,需要修改基金登记结算机构交易数据的,由基金登记结算机构进行更正,并就估值错误的更正向有关当事人进行确认。

### 4、基金份额净值估值错误处理的方法如下:

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

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

(3) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的,从其规定处理。

### (六) 暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;

2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时;

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

4、法律法规规定、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

### (七) 基金净值的确认

用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算,基金托管人

负责进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的基金资产净值和基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对外公布。

#### （八）特殊情况的处理

1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 10 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

2、由于证券交易所、登记结算公司及存款银行等第三方机构发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等非基金管理人与基金托管人原因，或由于其他不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

## 十六、基金的收益分配

### （一）基金利润的构成

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

### （二）基金可供分配利润

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

### （三）基金收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，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。登记在登记结算系统基金份额持有人开放式基金账户下的场外基金份额，可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。登记在证券登记系统基金份额持有人深圳证券账户下的场内基金份额收益分配方式为现金分红。具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及登记结算机构的相关规定；若深圳证券交易所或登记结算机构对收益分配的相关业务规则有新的规定，按其新规定执行。

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

4、同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

5、在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可在履行适当程序后调整基金收益的分配原则和支付方式；

6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

### （四）收益分配方案

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

### （五）收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，在 2 日内在指定媒介公

告。

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

#### （六）基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记结算机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额。红利再投资的计算方法等有关事项遵循深圳证券交易所及登记结算机构的相关规定。

## 十七、基金的费用与税收

### （一）封闭运作期内基金费用

#### 1、封闭运作期内基金费用的种类

- （1）基金管理人的管理费；
- （2）基金托管人的托管费；
- （3）《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- （4）《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费；
- （5）基金份额持有人大会费用；
- （6）基金的证券交易费用；
- （7）基金的银行汇划费用；
- （8）证券账户开户费用、银行账户维护费用；
- （9）基金上市初费及上市月费；
- （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。

#### 2、封闭运作期内基金费用计提方法、计提标准和支付方式

##### （1）基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.10% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，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、休息日等，支付日期顺延。

##### （2）基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.03% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.03\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值



基金托管费每日计提,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、休息日等,支付日期顺延。

(3) 封闭运作期内,本基金每年计提的管理费和托管费合计不超过4000万元,若当年计提的费用合计已达到4000万元,则当年内不再计提管理费和托管费。

(4) 上述“1、封闭运作期内基金费用的种类中第(3)－(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。

## (二) 开放运作后基金费用

### 1、开放运作后基金费用的种类

- (1) 基金管理人的管理费;
- (2) 基金托管人的托管费;
- (3) 《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;
- (4) 《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费;
- (5) 基金份额持有人大会费用;
- (6) 基金的证券交易费用;
- (7) 基金的银行汇划费用;
- (8) 证券账户开户费用、银行账户维护费用;
- (9) 因投资内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的香港证券市场股票而产生的各项合理费用;
- (10) 基金上市初费及上市月费;
- (11) 按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

### 2、开放运作后基金费用计提方法、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1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下:

$$H=E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提,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、休息日等，支付日期顺延。

#### （2）基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 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

基金托管费每日计提，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、休息日等，支付日期顺延。

（3）上述“1、开放运作后基金费用的种类中第（3）—（11）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）与基金销售有关的费用

1、本基金申购费、赎回费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式请详见本招募说明书“九、基金份额的申购、赎回”中的“（六）基金的申购费和赎回费”与“（七）申购和赎回的数额和价格”中的相关规定。

2、基金管理人可以在基金合同规定的范围内调整申购费率、赎回费率或变更收费方式，调整后的申购费率、赎回费率或变更的收费方式在更新的《招募说明书》中列示。上述费率或收费方式如发生变更，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

#### （五）基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## 十八、基金的会计与审计

### （一）基金会计政策

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

### （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在 2 日内在指定媒介公告。

## 十九、基金的信息披露

（一）本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《基金合同》及其他有关规定。相关法律法规关于信息披露的披露方式、登载媒介、报备方式等规定发生变化时，本基金从其最新规定。

### （二）信息披露义务人

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律、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。如同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证不同文本的内容一致。不同文本之间发生歧义的，以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

### （五）公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

- 1、基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议、基金产品资料概要

（1）《基金合同》是界定《基金合同》当事人的各项权利、义务关系，明确基金份额持

有人大会召开的规则及具体程序,说明基金产品的特性等涉及基金投资者重大利益的事项的法律文件。

(2) 基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项,说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。基金合同生效后,基金招募说明书的信息发生重大变更的,基金管理人应当在三个工作日内,更新基金招募说明书并登载在指定网站上;基金招募说明书其他信息发生变更的,基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的,基金管理人不再更新基金招募说明书。

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

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

## 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、基金份额上市交易公告书

基金份额获准在证券交易所上市交易的,基金管理人应当在基金份额上市交易 3 个工作日前,将基金份额上市交易公告书登载在指定媒介上。

## 5、基金净值信息

### (1) 封闭运作期内基金资产净值、基金份额净值公告

《基金合同》生效后,基金上市交易前,基金管理人应当至少每周在指定网站披露一次基金份额净值和基金份额累计净值。

基金上市交易后,基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日,通过指定网站、基金销

售机构网站或者营业网点披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

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

#### （2）开放运作后基金资产净值、基金份额净值公告

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

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

#### 6、基金份额申购、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。

#### 7、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。

报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情形，基金管理人应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告文件中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产品的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

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

#### 8、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）基金终止上市交易、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）基金管理公司变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人的实际控制人变更；
- （8）基金募集期延长或提前结束募集；
- （9）基金管理人的高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；
- （10）基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十，基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十；
- （11）涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼或者仲裁；
- （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，中国证监会另有规定的情形除外；
- （14）基金收益分配事项；
- （15）管理费、托管费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- （16）基金份额净值估值错误达基金份额净值百分之零点五；
- （17）本基金开始办理申购、赎回；
- （18）本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；

- (19) 基金份额停牌、复牌、暂停上市、恢复上市或终止上市交易；
- (20) 调整基金份额类别的设置；
- (21) 基金推出新业务或服务；
- (22) 本基金进入受限开放期；
- (23) 本基金转为上市开放式基金（LOF）；
- (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规定的其他事项。

#### 9、澄清公告

在基金合同期限内，任何公共媒体中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动，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、基金上市交易的证券交易所。

#### 10、清算报告

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

#### 11、基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报国务院证券监督管理机构备案，并予以公告。

12、本基金投资中小企业私募债券的，应当在基金投资中小企业私募债券后两个交易日内，在中国证监会指定媒介披露所投资中小企业私募债券的名称、数量、期限、收益率等信息，并在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露中小企业私募债券的投资情况。

本基金投资流通受限证券的，应在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。

本基金投资股指期货的，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。

本基金投资国债期货的，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）等文件中披露国债期货交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示国债期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标。

本基金投资资产支持证券的，应在基金年报及中期报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细，并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。

本基金参与股票期权交易的，应当在定期信息披露文件中披露参与股票期权交易的有关情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标、估值方法等，并充分揭示股票期权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。

本基金参与融资交易的，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。

本基金参与港股通交易的，应当在定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露参与港股通交易的相关情况。

当相关法律法规关于上述信息披露的规定发生变化时，基金管理人将按最新规定进行信息披露。

### 13、关联交易公告

披露内容包括但不限于交易事项概述、交易标的基本情况、交易数量、交易金额、交易定价依据、关联人名称、交易各方的关联关系等。

### 14、中国证监会规定的其他信息

#### （六）信息披露事务管理

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

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

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定，对基金

管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告、更新的招募说明书、基金产品资料概要、基金清算报告等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人进行书面或电子确认。

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

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

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

#### （七）信息披露文件的存放与查阅

依法必须披露的信息发布后，基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于公司办公场所、基金上市交易的证券交易所，供社会公众查阅、复制。

## 二十、风险揭示

### （一）本基金的特有风险

1、本基金基金合同生效后进入三年的封闭运作期，封闭运作期间投资者不能赎回基金份额。本基金在封闭运作期间，基金份额可上市交易，投资者可在二级市场买卖基金份额。受市场供需关系等各种因素的影响，投资者买卖基金份额有可能面临相应的折溢价风险。

2、本基金封闭运作期内主要参与战略配售股票的投资，战略配售股票有可能出现股价波动较大的情况，投资者有可能面临战略配售股票价格大幅波动的风险。

3、本基金以投资战略配售股票为主要投资策略，需参与并接受发行人的战略配售股票，由此产生的投资风险与价格波动由投资者自行承担。

#### 4、资产配置风险

封闭运作期内，本基金主要参与战略配售股票的投资，也可投资于国内依法发行上市的债券等。当战略配售股票市场上行时，本基金可能过少配置相关资产从而无法获得相应收益；当战略配售股票市场下行时，本基金可能过多配置相关资产从而导致较大损失，相关市场变化以及本基金的资产配置情况将影响基金业绩表现。

封闭运作期届满转为上市开放式基金（LOF）后，本基金股票资产的投资比例为 60%-95%，属于股票仓位偏高且相对稳定的混合型基金，受股票市场系统性风险影响较大，如果股票市场出现整体下跌，本基金的净值表现将受到影响。

#### 5、封闭运作期内主要参与战略配售股票投资的风险

封闭运作期内，本基金主要投资战略配售股票，鉴于战略配售股票具有高波动性的特征，在获取其带来收益的同时须承受该部分基金资产波动带来的风险，即价格波动风险。此外，战略配售股票在发行时明确了一定期限锁定期，该类证券在锁定期内的流动性较差，存在市场或个券出现大幅调整时无法及时卖出的风险，可能给投资者带来损失。如果估值日处于锁定期的战略配售股票初始取得成本低于证券交易所上市交易的同一证券的市价，将按照监管机构或行业协会有关规定确定证券公允价值，本基金基金份额净值可能由于估值方法的原因偏离所持有证券的收盘价所对应的净值，投资者在二级市场交易以及在受限开放期申购本基金时，需考虑该估值方式对基金份额净值及二级市场交易价格的影响。

#### 6、封闭运作期不能赎回且二级市场交易折价的风险

本基金合同生效后的前三年为封闭运作期，封闭运作期内本基金不开放赎回业务，如本基金上市，投资者可通过二级市场交易卖出基金份额。但是，在证券市场持续下跌、基金二级市场交易不活跃等情形下，有可能出现基金份额二级市场交易价格低于基金份额净值的情形，即基金折价交易，从而影响持有人收益或产生损失，可能会对投资者的资金安排及投资计划产生一定的影响，请投资者在理性判断的基础上做出投资选择。

#### 7、基金份额无法上市或终止上市的风险

本基金设置封闭运作期，投资者在本基金封闭运作期内不能按照基金份额净值赎回基金，但可在本基金上市后通过交易所交易基金份额。若本基金不符合证券交易所上市条件而无法上市或被终止上市，或被基金份额持有人大会决议提前终止上市，基金份额持有人持有的基金份额将不能继续进行二级市场交易，从而面临封闭运作期间无法退出本基金的风险。

#### 8、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险

基金份额持有人通过交易所交易基金份额时，由于受二级市场供求关系等诸多因素的影响，存在基金份额二级市场交易价格不同于基金份额净值的情形，即存在二级市场交易价格折溢价的风险。

9、封闭运作期届满转为上市开放式基金（LOF）后，本基金投资范围包括股指期货、国债期货、股票期权等金融衍生品，股指期货、国债期货、股票期权等金融衍生品投资可能给本基金带来额外风险。投资股指期货、国债期货的风险包括但不限于杠杆风险、保证金风险、期货价格与基金投资品种价格的相关度降低带来的风险等；投资股票期权的风险包括但不限于市场风险、流动性风险、交易对手信用风险、操作风险、保证金风险等；由此可能增加本基金净值的波动性。

10、封闭运作期届满转为上市开放式基金（LOF）后，本基金的投资范围包括中小企业私募债，由于该类债券采取非公开方式发行和交易，并不公开各类材料（包括招募说明书、审计报告等），外部评级机构一般不对这类债券进行外部评级，可能会降低市场对这类债券的认可度，从而影响这类债券的市场流动性。另一方面，由于中小企业私募债的债券发行主体资产规模较小、经营的波动性较大，且各类材料不公开发布，也大大提高了分析并跟踪发债主体信用基本面的难度。由此可能给基金净值带来不利影响或损失。

11、封闭运作期届满转为上市开放式基金（LOF）后，本基金的投资范围包括资产支持证券，资产支持证券存在一定的信用风险、利率风险、流动性风险、提前偿付风险、操作风险和法律风险，由此可能给基金净值带来不利影响或损失。

## 12、通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于港股通股票的风险

封闭运作期届满转为上市开放式基金（LOF）后，本基金的投资范围包括内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的港股通股票，除与其他投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临以下特有风险，包括但不限于：

### （1）投资于香港证券市场的特有风险

1）香港证券市场与内地证券市场规则差异的风险。香港证券市场与内地证券市场存在诸多差异，本基金参与港股通交易需遵守内地与香港相关法律、行政法规、部门规章、规范性文件 and 业务规则，对香港证券市场有所了解。以上情形可能增加本基金的投资风险。

2）股价较大波动的风险。港股股票可能出现因公司基本面变化、第三方研究分析报告的观点、异常交易情形等原因引起股价较大波动。此外，港股市场实行 T+0 回转交易机制，且个股涨跌幅不设限制，加之香港市场结构性产品和衍生品种类相对丰富以及做空机制的存在，港股股价受到意外事件影响可能表现出更为剧烈的股价波动，由此增加本基金净值的波动风险。

3）中小市值公司投资风险。中小市值公司存在业绩不稳定、股价波动性较大、市场流动性较差等风险，若本基金投资中小市值股票，本基金的投资风险可能增加。

4）股份数量、股票面值大幅变化的风险。部分港股上市公司基本面变化大，股票价格低，可能存在大比例折价供股或配股、频繁分拆合并股份的行为，投资者持有的股份数量、股票面值可能发生大幅变化，由此可能增加本基金的投资风险。

5）停牌风险。与内地市场相比，香港市场股票停牌制度存在一定差异，港股股票可能出现长时间停牌现象，由此可能增加本基金的投资风险。

6）直接退市风险。与内地市场相比，香港市场股票交易没有退市风险警示、退市整理等安排，相关股票存在直接退市的风险。港股股票一旦退市，本基金将面临无法继续通过港股通买卖相关股票的风险。此外，港股通股票退市后，中国证券登记结算有限责任公司通过香港结算继续为本基金提供的退市股票名义持有人服务可能会受限。以上情况可能增加本基金的投资风险。

7）交收制度带来的风险。香港证券市场与内地证券市场在证券资金的交收期安排上存在差异，香港证券市场的交收期为 T+2 日，卖出资金回到本基金人民币账户的周期比内地证券市场要长，此外港股的交收可能因香港出现台风或黑色暴雨等发生延迟交易。因此，本基金可能面临卖出港股后资金不能及时到账，而造成支付赎回款日期比正常情况延后而带来流

动性风险。

(2) 通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的特有风险

1) 港股通规则变动带来的风险。本基金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) 港股通股票范围受限及动态调整的风险

本基金可以通过港股通买卖的股票存在一定的范围限制，且港股通股票名单会动态调整。对于被调出的港股通股票，自调整之日起，本基金将不得再行买入。以上情形可能对本基金带来不利影响。

3) 基金净值波动风险。在内地与香港股票市场交易互联互通机制下，只有内地和香港两地均为交易日且能够满足结算安排的交易日才为港股通交易日，存在港股通交易日不连贯的情形，而导致基金所持的港股组合在后续港股通交易日开市交易中集中体现市场反应而造成其价格波动骤然增大，进而导致本基金所持港股组合在资产估值上出现波动增大的风险。

4) 交易失败及交易中断的风险。在内地与香港股票市场交易互联互通机制下，港股通交易存在每日额度限制，本基金可能面临每日额度不足而交易失败的风险。若香港联交所与内地交易所的证券交易服务公司之间的报盘系统或者通信链路出现故障，可能导致 15 分钟以上不能申报和撤销申报的交易中断风险；

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

6) 汇率风险。在内地与香港股票市场交易互联互通机制下，港股的买卖是以港币报价、人民币支付，本基金承担港币对人民币汇率波动的风险；同时，由于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，最终结算汇率为相关机构日终确定的数值。此外，若因汇率大幅波动等原因，可能会导致本基金的账户透支风险。因此，本基金面临汇率波动的不确定性风险，由此可能增加本基金的风险。

7) 交易价格受限的风险。港股通股票不设置涨跌幅限制，但根据联交所业务规则，适用市场波动调节机制的港股通股票的买卖申报可能受到价格限制。此外，对于适用收市竞价

交易的港股通股票，收市竞价交易时段的买卖申报也将受到价格限制。以上情形可能增加本基金的投资风险。

8) 港股通制度下对公司行为的处理规则带来的风险。本基金因所持香港证券市场股票权益分派、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香港联交所上市证券，只能通过港股通卖出，但不得买入；因港股通股票权益分派或者转换等情形取得的香港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。本基金存在因上述规则，利益得不到最大化甚至受损的风险。

9) 结算风险。香港结算机构可能因极端情况存在无法交付证券和资金的结算风险；另外港股通境内结算实施分级结算原则，本基金可能面临以下风险：因结算参与人未完成与中国结算的集中交收，导致本基金应收资金或证券被暂不交付或处置；结算参与人对本基金出现交收违约导致本基金未能取得应收证券或资金；结算参与人向中国结算发送的有关本基金的证券划付指令有误的导致本基金权益受损；其他因结算参与人未遵守相关业务规则导致本基金利益受到损害的情况。

### (3) 其他可能的风险

除上述风险外，本基金投资内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的香港证券市场股票，还可能面临的其他风险，包括但不限于：

1) 封闭运作期届满转为上市开放式基金（LOF）后的开放日为上海证券交易所、深圳证券交易所的工作日，但若该工作日非港股通交易日，则本基金不开放申购和赎回，投资人无法进行申购与赎回；

2) 因港股通交易当日额度使用完毕而暂停或停止接受买入申报，或者发生证券交易服务公司等机构认定的交易异常情况并决定暂停提供部分或者全部港股通服务，或者发生其他影响通过股票市场交易互联互通机制进行正常交易的情形，本基金可能发生拒绝或暂停申购，暂停赎回或延缓支付赎回款的情形，可能影响投资人的申购以及份额持有人的赎回。

(4) 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。

### 13、投资于存托凭证的风险

本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同

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

## （二）市场风险

本基金投资于内地和香港证券市场，而证券市场价格因受到经济因素、政治因素、投资者心理和交易制度等各种因素的影响而产生波动，从而导致基金收益水平发生变化，产生风险。主要的风险因素包括：

### 1、政策风险

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

### 2、利率风险

利率风险主要是指因金融市场利率的波动而导致证券市场价格和收益率变动的风险。利率直接影响着债券的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。本基金为混合型基金，可投资于股票、债券等证券，其收益水平可能会受到利率变化的影响。

### 3、购买力风险

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实际收益率。

### 4、信用风险

信用风险主要指债券、票据发行主体、存款银行信用状况可能恶化而可能产生的到期不能兑付的风险。

### 5、公司经营风险

上市公司的经营状况受多种因素的影响，如管理能力、行业竞争、市场前景、技术更新、新产品研究开发等都会导致公司盈利发生变化。如果基金所投资的上市公司经营不善，其证券价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，使基金投资收益下降。虽然基金可以通过投资多样化来分散这种非系统风险，但不能完全避免。



## 6、经济周期风险

随着经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化，基金投资的收益水平也会随之变化，从而产生风险。

### （三）流动性风险

#### 1、流动性风险评估

在封闭运作期内，本基金主要参与战略配售股票的投资，并可投资于国内依法发行上市的债券等。战略配售股票在发行时明确了一定期限锁定期，该类证券在锁定期内的流动性较差，存在市场或个券出现大幅调整时无法及时卖出的风险，可能给投资者带来损失。

封闭运作期届满转为上市开放式基金（LOF）后，本基金可投资于国内依法发行上市的股票、港股通股票、债券等。一般情况下，上述资产市场流动性较好。但不排除在特定阶段、特定市场环境下特定投资标的出现流动性较差的情况。因此，本基金投资于上述资产时，可能存在以下流动性风险：一是基金管理人建仓或进行组合调整时，可能由于特定投资标的流动性相对不足而无法按预期的价格买进或卖出；二是为应付投资者的赎回，基金被迫以不当的价格卖出股票、债券或其他资产。两者均可能使基金净值受到不利影响。

#### 2、巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

封闭运作期届满转为上市开放式基金（LOF）后，当发生巨额赎回时，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、部分延期赎回或暂停赎回。具体具体情形、程序见招募说明书“九、基金份额的申购、赎回”之“（九）巨额赎回的情形及处理方式”。

发生延期赎回、暂停赎回等情形时，投资人面临无法全部赎回或无法及时获得赎回资金的风险。在本基金延期办理投资者赎回申请的情况下，投资者未能赎回的基金份额还将面临净值波动的风险。

#### 3、除巨额赎回情形外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

除巨额赎回情形外，本基金备用流动性风险管理工具包括但不限于暂停接受赎回申请、延缓支付赎回款项、收取短期赎回费、暂停基金估值、摆动定价以及证监会认定的其他措施。

暂停接受赎回申请、延缓支付赎回款项等工具的情形、程序见招募说明书“九、基金份额的申购、赎回”之“（十）拒绝或暂停申购、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形及处理”的相关规定。若本基金暂停接受投资者的赎回申请，投资者在暂停赎回期间将无法赎回其持有的基金份额。若本基金延缓支付赎回款项，赎回款支付时间将后延，可能对投资者的资金

安排带来不利影响。

短期赎回费适用于持续持有期少于 7 日的投资者，费率为 1.5%。短期赎回费由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取，并全额计入基金财产。短期赎回费的收取将使得投资者在持续持有期限少于 7 日时会承担较高的赎回费。

暂停基金估值的情形、程序见招募说明书“十四、基金资产的估值”之“（六）暂停估值的情形”的相关规定。若本基金暂停基金估值，一方面投资者将无法知晓本基金的基金份额净值，另一方面基金将延缓支付赎回款项或暂停接受基金申购赎回申请，延缓支付赎回款项可能影响投资者的资金安排，暂停接受基金申购赎回申请将导致投资者无法申购或赎回本基金。

采用摆动定价机制的情形、程序见招募说明书“十四、基金资产的估值”之“（三）估值方法”的相关规定。若本基金采取摆动定价机制，投资者申购基金获得的申购份额及赎回基金获得的赎回金额均可能受到不利影响。

（四）本基金法律文件中涉及基金风险特征的表述与销售机构对基金的风险评级可能不一致的风险

本基金基金合同、招募说明书等法律文件中涉及基金风险收益特征或风险状况的表述仅为主要基于基金投资方向与策略特点的概括性表述；而本基金各销售机构依据中国证券投资基金业协会发布的《基金募集机构投资者适当性管理实施指引（试行）》及内部评级标准，将基金产品按照风险由低到高顺序进行风险级别评定划分，其风险评级结果所依据的评价要素可能更多、范围更广，与本基金法律文件中的风险收益特征或风险状况表述并不必然一致或存在对应关系。同时，不同销售机构因其采取的具体评价标准和方法的差异，对同一产品风险级别的评定也可能各有不同；销售机构还可能根据监管要求、市场变化及基金实际运作情况等适时调整对本基金的风险评级。敬请投资人知悉，在购买本基金时按照销售机构的要求完成风险承受能力与产品风险之间的匹配检验，并须及时关注销售机构对于本基金风险评级的调整情况，谨慎作出投资决策。

#### （五）管理风险

1、在基金管理运作过程中，基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的占有以及对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平。

2、基金管理人的管理手段和管理技术等因素的变化也会影响基金收益水平。

#### （六）税收风险

在本基金存续期间,税收征管部门可能会对增值税等应税行为的认定以及适用的税率等进行调整。届时,基金管理人将执行更新后的政策,可能会因此导致基金资产实际承担的税费发生变化。该等情况下,基金管理人有权根据法律法规及税收政策的变化相应调整税收处理,该等调整可能会影响到基金投资者的收益,也可能导致基金财产的估值调整。由于前述税收政策变化导致对基金资产的收益影响,将由持有该基金的基金投资者承担。对于现有税收政策未明确事项,本基金主要参照行业协会建议方案进行处理,可能会与税收征管认定存在差异,从而产生税费补缴及滞纳金,该等税费及滞纳金将由基金财产承担。

#### （七）其他风险

1、因技术因素而产生的风险,如电脑等技术系统的故障或差错产生的风险。

2、因战争、自然灾害等不可抗力导致的基金管理人、基金托管人、基金服务机构等机构无法正常工作,从而影响基金运作的风险。

3、因金融市场危机、代理商违约、基金托管人违约等超出基金管理人自身控制能力的因素出现,可能导致基金或者基金份额持有人利益受损的风险。

4、因固定收益类金融工具主要在场外市场进行交易,场外市场交易现阶段自动化程度较场内市场低,本基金在投资运作过程中可能面临操作风险。

5、其他意外导致的风险。

## 二十一、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### （一）《基金合同》的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于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表决通过之日起生效，自决议生效后两日内在指定媒介公告。

### （二）《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

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

### （三）基金财产的清算

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

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

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

#### 4、基金财产清算程序：

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

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

(6) 将清算报告报中国证监会备案并公告;

(7) 对基金财产进行分配。

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

#### (四) 清算费用

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

#### (五) 基金财产清算剩余资产的分配

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

#### (六) 基金财产清算的公告

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

#### (七) 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 二十二、基金合同的内容摘要

### 一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

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

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》、招募说明书等信息披露文件；
- （2）了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；
- （3）关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；

- (4) 缴纳基金认购、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定；
- (8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## (二) 基金管理人的权利与义务

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

- (1) 依法募集资金；
- (2) 自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
- (3) 依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- (4) 销售基金份额；
- (5) 按照规定召集基金份额持有人大会；
- (6) 依据《基金合同》及有关法律规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- (7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- (8) 选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；
- (9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记结算机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；
- (10) 依据《基金合同》及有关法律规规定决定基金收益的分配方案；
- (11) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购、赎回和转换申请；
- (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，为基金的利益依法进行融资；
- (14) 以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

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

(16) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管和收益分配等业务规则；

(17) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、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办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

(2) 办理基金备案手续；

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

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

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

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

(7) 依法接受基金托管人的监督；

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

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(10) 编制季度报告、中期报告和年度报告；

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

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

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



(14) 按规定受理申购与赎回申请, 及时、足额支付赎回款项;

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

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

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

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

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

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

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

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

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

(24) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件, 《基金合同》不能生效, 基金管理人承担全部募集费用, 将已募集资金并加计银行同期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。

### (三) 基金托管人的权利与义务

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

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

产；

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

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

(4) 根据相关市场规则，为基金开设证券账户、为基金办理证券交易资金清算。

(5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

(6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

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

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

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

(5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

(6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户，按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

(7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；

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

(9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

(10) 对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告出具意见，说明基金管

理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行；如果基金管理人未执行《基金合同》规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

- (11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；
- (12) 建立并保存基金份额持有人名册；
- (13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
- (14) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；
- (15) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
- (16) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；
- (17) 参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- (18) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人；
- (19) 因违反《基金合同》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- (20) 按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿；
- (21) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；
- (22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## 二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

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

本基金份额持有人大会暂不设日常机构。

### (一) 召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会，但法律法规、中国证监会和基金合同另有规定的除外：

- (1) 终止《基金合同》；
- (2) 更换基金管理人；
- (3) 更换基金托管人；

- (4) 转换基金运作方式;
  - (5) 调整基金管理人、基金托管人的报酬标准;
  - (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) 终止基金上市,但因基金不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市的除外;
  - (10) 变更基金份额持有人大会程序;
  - (11) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会;
  - (12) 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;
  - (13) 对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项;
  - (14) 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、在不违反法律法规规定及基金合同约定以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下,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》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式;
  - (3) 因相应的法律法规发生变动而应当对《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重大变化;
  - (5) 基金管理人、基金登记结算机构、基金销售机构,在法律法规规定或中国证监会许可的范围内调整有关认购、申购、赎回、转换、基金交易、非交易过户、转托管、转让、质押等业务规则;
  - (6) 在对基金份额持有人利益无实质不利影响的情况下,在法律法规规定或中国证监会许可的范围内基金推出新业务或服务;
  - (7) 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。

## （二）会议召集人及召集方式

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

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。

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

4、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开。

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

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

## （三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

- （1）会议召开的时间、地点和会议形式；
- （2）会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；
- （3）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；

(4) 授权委托证明的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；

(5) 会务常设联系人姓名及联系电话；

(6) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；

(7) 召集人需要通知的其他事项。

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

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

(四) 基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式或法律法规、中国证监会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的有关证明文件、受托出席会议者出示的委托人的代理投票授权委托证明及有关证明文件符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定；

(2) 经核对，到会者在权益登记日代表的有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）。

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

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

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

(3) 本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）；

(4) 上述第（3）项中直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的有关证明文件、受托出具书面意见的代理人出示的委托人的代理投票授权委托证明及有关证明文件符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并与基金登记注册机构记录相符。

### 3、重新召集基金份额持有人大会的条件

基金份额持有人大会应当有代表二分之一以上基金份额的持有人参加，方可召开。

参加基金份额持有人大会的持有人的基金份额低于上述规定比例的，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应当有代表三分之一以上基金份额的持有人参加，方可召开。

4、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。

5、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，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

## （五）议事内容与程序

### 1、议事内容及提案权

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

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

## 2、议事程序

### （1）现场开会

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

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

### （2）通讯开会

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

## （六）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

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

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

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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



具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

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

#### （七）计票

##### 1、现场开会

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

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

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

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

##### 2、通讯开会

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

#### （八）生效与公告

基金份额持有人大会的决议，自表决通过之日起生效。

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决议自生效之日起 2 日内在指定媒介上公告。

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

约束力。

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

### 三、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

#### （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基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效，自决议生效后两日内在指定媒介公告。

#### （二）《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

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

#### （三）基金财产的清算

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

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

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

#### 4、基金财产清算程序：

- （1）《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；

- (2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认;
- (3) 对基金财产进行估值和变现;
- (4) 制作清算报告;
- (5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计, 聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书;
- (6) 将清算报告报中国证监会备案并公告;
- (7) 对基金财产进行分配。

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

#### (四) 清算费用

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

#### (五) 基金财产清算剩余资产的分配

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

#### (六) 基金财产清算的公告

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

#### (七) 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

### 四、争议解决方式

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

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

《基金合同》受中国法律管辖。

#### 五、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

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

1、《基金合同》经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字或盖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。

## 二十三、基金托管协议的内容摘要

### 一、托管协议当事人

#### （一）基金管理人

名称：易方达基金管理有限公司

注册地址：广东省珠海市横琴新区宝华路6号105室-42891（集中办公区）

办公地址：广东省广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40-43楼

邮政编码：510620

法定代表人：刘晓艳

成立日期：2001年4月17日

批准设立机关及批准设立文号：中国证券监督管理委员会，证监基金字[2001]4号

组织形式：有限责任公司

注册资本：13,244.2万元人民币

存续期间：持续经营

经营范围：公开募集证券投资基金管理、基金销售、特定客户资产管理

#### （二）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

（一）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。《基金合同》明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应严格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。

1、本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、政策性金融债、中央银行票据、信用等级在 AAA（含）以上的债券及非金融企业债务融资工具等）、债券回购、同业存单、银行存款（包含协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具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，本基金可以将其纳入投资范围。

本基金封闭运作期内股票投资占基金资产的 0-100%。

2、本基金转为上市开放式基金（LOF）后，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括创业板、中小板以及其他依法发行上市的股票、存托凭证）、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的香港证券市场股票（以下简称“港股通股票”）、国内依法发行上市的债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、次级债、企业债、短期融资券、中期票据、公司债、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券、证券公司短期公司债券、中小企业私募债等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、权证、股指期货、国债期货、股票期权及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金可以将其纳入投资范围。

本基金股票资产占基金资产的比例为 60%-95%（其中港股通股票不超过股票资产的 50%）；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。权证、股指期货、国债期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

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

### 1、封闭运作期内投资组合限制

（1）本基金投资于股票资产的比例为 0-100%；

- (2) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；
- (3) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；
- (4) 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；
- (5) 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%；在全国银行间同业市场的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；
- (6) 本基金总资产不得超过基金净资产的 200%；
- (7) 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%；
- (8) 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。
- (9) 本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行，与境内上市交易的股票合并计算。
- (10) 法律法规及中国证监会规定的其它投资比例限制。

除上述第(4)、(8)项外，因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。上述期间，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本基金合同生效之日起开始。

## 2、本基金转为上市开放式基金（LOF）后投资组合限制

- (1) 本基金股票资产占基金资产的比例为 60%-95%（其中投资于港股通股票的比例不超过股票资产的 50%）；
- (2) 每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；
- (3) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；
- (4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；
- (5) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；
- (6) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；
- (7) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；
- (8) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净

值的 10%；

(9) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

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

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

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

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

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

(15) 本基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

(16) 本基金持有单只中小企业私募债券，其市值不得超过本基金资产净值的 10%；

(17) 本基金投资于股指期货，还应遵循如下投资组合限制：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%；在任何交易日日终，持有的买入国债期货和股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；在任何交易日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例为 60%-95%；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%；

(18) 本基金投资于国债期货，还应遵循如下投资组合限制：在任何交易日日终，本基金持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的 15%；本基金在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%；本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 30%；本基金所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定；

(19) 本基金参与股票期权交易的，应当符合下列要求：基金因未平仓的期权合约支付和收取的权利金总额不得超过基金资产净值的 10%；开仓卖出认购期权的，应持有足额标的证券；开仓卖出认沽期权的，应持有合约行权所需的全额现金或交易所规则认可的可冲抵期权保证金的现金等价物；未平仓的期权合约面值不得超过基金资产净值的 20%。其中，合约面值按照行权价乘以合约乘数计算；



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

(21) 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%。

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

(23) 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。

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

(25) 法律法规及中国证监会规定的其他投资比例限制。

本基金在进行期货投资之前,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》。

除上述第(2)、(12)、(13)、(22)、(23)项外,因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的,基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整,但中国证监会规定的特殊情形除外。

(三) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定,对本托管协议第十五条第九款基金投资禁止行为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的原则,防范利益冲突,相关交易必须事先得到基金托管人的同意,并履行信息披露义务。

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

基金管理人负责对交易对手的资信控制,按银行间债券市场的交易规则进行交易,并负

责解决因交易对手不履行合同而造成的纠纷及损失，基金托管人不承担由此造成的任何法律责任及损失。若未履约的交易对手在基金托管人与基金管理人确定的时间前仍未承担违约责任及其他相关法律责任的，基金管理人可以对相应损失先行予以承担，然后再向相关交易对手追偿。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，基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任。

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

基金管理人投资流通受限证券，应事先根据中国证监会相关规定，明确基金投资流通受限证券的比例，制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险。基金托管人对基金管理人是否遵守相关制度、流动性风险处置预案以及相关投资额度和比例等的情况进行监督。

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

本基金投资的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，及因流通受限证券存管直接影响本基金安全的责任及损失，由基金管理人承担。

本基金投资流通受限证券，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，基金管理人应保证提供足额现金确保基金的支付结算，并承担所有损失。对本基金因投资流通受限证券导致的流动性风险，基金托管人不不承担任何责任。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，基金管理人应在两个工作日内编制临时报告书，予以公告。

5、基金托管人根据有关规定有权对基金管理人进行以下事项监督：

（1）本基金投资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。

（六）基金投资中小企业私募债券，基金管理人应根据审慎原则，制定严格的投资决策流程、风险控制制度和信用风险、流动性风险处置预案，并经董事会批准，以防范信用风险、流动性风险等各种风险。

基金托管人对基金投资中小企业私募债券是否符合比例限制进行事后监督，如发现异常情况，应及时以书面形式通知基金管理人。基金管理人应积极配合和协助乙方的监督和核查。基金因投资中小企业私募债券导致的信用风险、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。

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

（八）基金托管人发现基金管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作违反法律法规、《基金合同》和本托管协议的规定，应及时以电话提醒或书面提示等方式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到书面通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函，就基金托管人的疑义进

行解释或举证，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金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。

（九）基金管理人有权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。

（十）若基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反《基金合同》约定的，应当立即通知基金管理人，由此造成的损失由基金管理人承担。

（十一）基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为，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、基金管理人应对基金托管人的业务核查

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

（二）基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、《基金合同》、本协议及其他有关规定时，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正。基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式给基金管理人发出回函，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复基金管理人并改正。

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

重或经基金管理人提出警告仍不改正的，基金管理人应报告中国证监会。

#### 四、基金财产保管

##### （一）基金财产保管的原则

- 1、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。
- 2、基金托管人应安全保管基金财产。
- 3、基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户。
- 4、基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立。
- 5、基金托管人按照《基金合同》和本协议的约定保管基金财产，如有特殊情况双方可另行协商解决。基金托管人未经基金管理人的指令，不得自行运用、处分、分配本基金的任何资产（不包含基金托管人依据中国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。
- 7、除依据法律法规和《基金合同》的规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

##### （二）基金募集期间及募集资金的验资

- 1、基金募集期间募集的资金应存于基金募集专户。该账户由基金管理人开立并管理。
- 2、基金募集期满或基金停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，基金管理人应将属于基金财产的全部资金划入基金托管人开立的基金银行账户，同时在规定时间内，聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的 2 名或 2 名以上中国注册会计师签字方为有效。
- 3、若基金募集期限届满，未能达到《基金合同》生效的条件，由基金管理人按规定办理退款等事宜。

##### （三）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。

#### （四）基金证券账户和结算备付金账户的开立和管理

1、基金托管人在中国证券登记结算有限责任公司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，由基金管理人依据中国证券登记结算公司相关规定，委托有交易关系的证券公司负责办理。销户完成后，基金管理人需将相关证明提供至基金托管人。账户注销期间如需基金托管人提供配合的，基金托管人应予以配合。

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。

#### （五）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。

#### （六）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。

#### （七）基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的有关实物证券、银行存款开户证实书等有价凭证由基金托管人存放于基金托管人的保管库，也可存入中央国债登记结算有限责任公司、中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司/北京分公司或票据营业中心的代保管库，保管凭证由基金托管人持有。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任何责任。

#### （八）与基金财产有关的重大合同的保管

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

### 五、基金资产净值计算和会计核算

#### （一）基金资产净值的计算、复核与完成的时间及程序

1、基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的金额。基金份额净值是按照每个交易日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到 0.0001 元，小数点后

第五位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

每个交易日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

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

## （二）基金资产估值方法和特殊情形的处理

### 1、估值对象

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

### 2、估值方法

#### （1）证券交易所上市的有价证券的估值

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

2) 交易所上市交易或挂牌转让的不含权和含权固定收益品种，选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价；

3) 交易所上市交易的可转换债券，选取每日收盘价作为估值全价；

4) 交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募债券，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。

#### （2）处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

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

3) 在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。



(3) 全国银行间债券市场交易的固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

(4) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

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

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

(7) 本基金投资存托凭证的估值核算，依照境内上市交易的股票执行。

(8) 汇率

如本基金投资股票市场交易互联互通机制允许买卖的境外证券市场上市的股票，涉及相关货币对人民币汇率的，汇率来源详见招募说明书。

(9) 税收

对于按照中国法律法规和基金投资股票市场交易互联互通机制涉及的境外交易场所所在地的法律法规规定应交纳的各项税金，本基金将按权责发生制原则进行估值；对于因税收规定调整或其他原因导致基金实际交纳税金与估算的应交税金有差异的，基金将在相关税金调整日或实际支付日进行相应的估值调整。

(10) 如有充分理由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。

(11) 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。

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

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

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

### 3、特殊情形的处理

基金管理人、基金托管人按估值方法的第(10)项进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

#### (三) 基金份额净值错误的处理方式

1、当基金份额净值小数点后4位以内(含第4位)发生差错时，视为基金份额净值错误；基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；错误偏差达到基金份额净值的0.25%时，基金管理人应当通报基金托管人；错误偏差达到基金份额净值的0.5%时，基金管理人应当公告，并报中国证监会备案；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、由于证券交易所及登记结算公司等第三方机构发送的数据错误，有关会计制度变化或由于其他不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误而造成的基金份额净值计算错误，基金管理人、基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

4、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。

5、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。

#### （四）暂停估值与公告基金份额净值的情形

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

#### （五）基金会计制度

按国家有关部门规定的会计制度执行。

#### （六）基金账册的建立

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

#### （七）基金财务报表与报告的编制和复核

##### 1、财务报表的编制

基金财务报表由基金管理人编制，基金托管人复核。

##### 2、报表复核

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

##### 3、财务报表的编制与复核时间安排

###### （1）报表的编制

基金管理人应当在每月结束后 5 个工作日内完成月度报表的编制；在季度结束之日起 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。

(八) 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结算机构根据基金管理人的指令编制和保管，基金管理人和基金托管人应分别保管基金份额持有人名册，保存期不少于 15 年。如不能妥善保管，则按相关法规承担责任。

在基金托管人要求或编制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

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。

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。

本协议受中国法律管辖。

## 八、基金托管协议的变更、终止与基金财产的清算

### (一) 托管协议的变更程序

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

### (二) 托管协议终止的情形

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

### （三）基金财产的清算

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

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

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

#### 4、基金财产清算程序：

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

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

#### 6、清算费用

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

#### 7、基金财产清算剩余资产的分配

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

#### 8、基金财产清算的公告

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

#### 9、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 二十四、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。以下是主要的服务内容，基金管理人根据基金份额持有人的需要和市场的变化，有权增加、修改这些服务项目：

### （一）基金份额持有人投资交易确认服务

登记结算机构保留基金份额持有人名册上列明的所有基金份额持有人的基金交易记录。基金管理人直销网点应根据在基金管理人直销网点进行交易的投资者的要求提供成交确认单。基金非直销销售机构应根据在其销售网点进行交易的投资者的要求提供成交确认单。

### （二）基金份额持有人交易记录查询服务

本基金份额持有人可通过基金管理人的客户服务中心查询历史交易记录。

### （三）基金份额持有人的对账单服务

1、基金份额持有人可登录本公司网站（<http://www.efunds.com.cn>）查阅对账单。

2、本公司至少每年度以电子邮件、短信或其他形式向通过易方达直销系统持有本公司基金份额的基金份额持有人提供基金保有情况信息，基金份额持有人也可以向本公司定制电子邮件形式的月度对账单。

具体查阅和定制账单的方法可参见本公司网站或拨打客服热线咨询。

### （四）定期定额投资计划

基金管理人可利用非直销销售机构网点和本公司网上交易系统为投资者提供定期定额投资的服务（本公司网上交易系统的定期定额投资服务目前仅对个人投资者开通）。通过定期定额投资计划，投资者可以通过固定的渠道，定期定额申购基金份额，具体实施方法见有关公告。

### （五）资讯服务

#### 1、客户服务电话

投资者如果了解基金产品、服务等信息，或反馈投资过程中需要投诉与建议的情况，可拨打如下电话：4008818088。投资者如果认为自己不能准确理解本基金《招募说明书》、《基金合同》的具体内容，也可拨打上述电话详询。

#### 2、互联网站及电子信箱

网址：<http://www.efunds.com.cn>

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



## 二十五、其他应披露事项

| 公告事项                                                     | 披露日期       |
|----------------------------------------------------------|------------|
| 易方达基金管理有限公司旗下基金 2020 年第 1 季度报告提示性公告                      | 2020-04-21 |
| 易方达基金管理有限公司关于旗下部分基金获配三利谱（002876）非公开发行 A 股的公告             | 2020-06-19 |
| 易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告                                    | 2020-06-22 |
| 关于易方达 3 年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）第四个受限开放期开放申购业务的公告     | 2020-07-02 |
| 易方达基金管理有限公司关于旗下部分基金获配中石科技（300684）非公开发行 A 股的公告            | 2020-07-04 |
| 易方达基金管理有限公司旗下基金 2020 年第 2 季度报告提示性公告                      | 2020-07-21 |
| 易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告                                    | 2020-07-24 |
| 易方达基金管理有限公司旗下基金 2020 年中期报告提示性公告                          | 2020-08-28 |
| 易方达基金管理有限公司关于旗下部分基金获配格尔软件（603232）非公开发行 A 股的公告            | 2020-09-04 |
| 易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告                                    | 2020-09-19 |
| 易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告                                    | 2020-09-30 |
| 易方达基金管理有限公司关于旗下部分基金修订基金合同、托管协议的公告                        | 2020-10-14 |
| 易方达基金管理有限公司关于设立深圳分公司的公告                                  | 2020-10-28 |
| 易方达基金管理有限公司旗下基金 2020 年第 3 季度报告提示性公告                      | 2020-10-28 |
| 易方达基金管理有限公司关于通过大泰金石基金销售有限公司购买并持有本公司旗下基金的投资者及时办理转托管的提示性公告 | 2020-10-31 |
| 易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告                           | 2020-11-06 |
| 关于警惕冒用易方达基金管理有限公司名义进行诈骗活动的特别提示公告                         | 2020-12-10 |
| 易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告                                    | 2020-12-12 |
| 关于易方达 3 年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）第五个受限开放期开放申购业务的公告     | 2020-12-31 |
| 易方达基金管理有限公司旗下基金 2020 年第 4 季度报告提示性公告                      | 2021-01-21 |
| 易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告                                    | 2021-01-23 |
| 易方达基金管理有限公司关于修订旗下部分基金托管协议的公告                             | 2021-03-27 |
| 易方达基金管理有限公司旗下基金 2020 年年度报告提示性公告                          | 2021-03-30 |
| 易方达基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告                       | 2021-04-02 |

注：以上公告事项披露在规定媒介及基金管理人网站上。

## 二十六、招募说明书的存放及查阅方式

本招募说明书存放在基金管理人、基金托管人及其他基金销售机构处，投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与公告的内容完全一致。

## 二十七、备查文件

1、中国证监会准予易方达 3 年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）注册的文件；

2、《易方达 3 年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同》；

3、《易方达 3 年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）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。

存放地点：基金管理人、基金托管人处

查阅方式：投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

2021 年 5 月 28 日