

交银施罗德基金管理有限公司关于以通讯方式召开交银施罗德先进制造混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告

交银施罗德基金管理有限公司已于 2021 年 6 月 30 日在《上海证券报》及交银施罗德基金管理有限公司网站（www.fund001.com）发布了《交银施罗德基金管理有限公司关于以通讯方式召开交银施罗德先进制造混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》，并于 2021 年 7 月 1 日发布了第一次提示性公告。为了使本次基金份额持有人大会顺利召开，根据基金合同的相关规定，现发布本次基金份额持有人大会的第二次提示性公告。

一、召开会议基本情况

根据《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》”）和《交银施罗德先进制造混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，交银施罗德先进制造混合型证券投资基金（以下简称“本基金”，基金代码：前端 519704；后端 519705）的基金管理人交银施罗德基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会审议本基金调整投资范围及修改基金合同等相关事宜，会议的具体安排如下：

- 1、会议召开方式：通讯方式
- 2、会议投票表决起止时间：自 2021 年 7 月 1 日起至 2021 年 8 月 3 日 17:00 止（以基金管理人收到表决票的时间为准）

- 3、会议纸质表决票的寄达地点：

收件人：交银施罗德基金管理有限公司

地址：上海市浦东新区世纪大道 8 号国金中心二期 22 楼

邮政编码：200120

联系人：郝婷婷

联系电话：021-61055050

通过专人送交、邮寄送达的，请在信封背面注明系用于本基金基金份额持有人大会表决之用（如“交银施罗德先进制造混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”）。

二、会议审议事项

本次会议审议事项为《关于交银施罗德先进制造混合型证券投资基金调整投资范围及修改基金合同有关事项的议案》（见附件一）。

上述议案的内容说明见《关于交银施罗德先进制造混合型证券投资基金调整投资范围及修改基金合同有关事项议案的说明》（见附件四）。

三、基金份额持有人的权益登记日

本次会议的权益登记日为2021年6月30日，即该日在本基金登记机构登记在册的交银施罗德先进制造混合型证券投资基金全体基金份额持有人或其授权的代理人均有权参加本次基金份额持有人大会。

四、表决票的填写和寄交方式

本次持有人大会的表决方式仅限于书面纸质表决。

1、本次会议表决票见附件二。基金份额持有人可通过剪报、复印或登陆基金管理人网站（www.fund001.com）下载并打印等方式填制表决票。

2、基金份额持有人应当按照表决票的要求填写相关内容，其中：

（1）个人投资者自行投票的，需在表决票上签字，并提供本人身份证件正反面复印件；

（2）机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本单位公章或经授权的业务章（以下合称“公章”），并提供加盖公章的营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文或登记证书复印件等）；合格境外机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本单位公章（如有）或由授权代表在表决票上签字（如无公章），并提供该授权代表的身份证件、护照或其他身份证明文件的复印件，该合格境外机构投资者所签署的授权委托书或者证明该授权代表有权代表该合格境外机构投资者签署表决票

的其他证明文件，以及该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件，以及取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件；

(3) 基金份额持有人可根据本公告第五章节的规定授权其他个人或机构代其在本次基金份额持有人大会上投票。受托人接受基金份额持有人纸面方式授权代理投票的，应由受托人在表决票上签字或盖章，并提供授权委托书原件以及本公告“第五章节第(三)条授权方式”中所规定的基金份额持有人以及受托人的身份证明文件或机构主体资格证明文件；

(4) 以上各项中的公章、批文、开户证明及登记证书，以基金管理人的认可为准。

3、基金份额持有人或其代理人需将填妥的表决票和所需的相关文件自 2021 年 7 月 1 日起至 2021 年 8 月 3 日 17:00 以前（以表决票收件人收到表决票时间为准）通过专人送交、邮寄送达至以下地址下述收件人

收件人：交银施罗德基金管理有限公司

地址：上海市浦东新区世纪大道 8 号国金中心二期 22 楼

邮政编码：200120

联系人：郝婷婷

联系电话：021-61055050

通过专人送交、邮寄送达的，请在信封背面注明系用于本基金基金份额持有人大会表决之用（如“交银施罗德先进制造混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”）。

五、授权

为便于基金份额持有人有尽可能多的机会参与本次会议，使基金份额持有人在本次会议上充分表达其意志，基金份额持有人除可以直接投票外，还可以授权他人代其在基金份额持有人大会上投票。根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，基金份额持有人授权他人基金份额持有人大会上表决需符合以下规则：

(一) 委托人

本基金的基金份额持有人可委托他人代理行使本次基金份额持有人大会的表决权。

基金份额持有人在权益登记日是否持有基金份额以及所持有的基金份额的数额以登记机构的登记为准。

(二) 受托人

基金份额持有人可以委托本基金的基金管理人以及其他符合法律规定的机构和个人，代为行使本次基金份额持有人大会上的表决权。

(三) 授权方式

本基金的基金份额持有人仅可通过纸面的授权方式授权受托人代为行使表决权。授权委托书的样本请见本公告附件三。基金份额持有人可通过剪报、复印或登陆基金管理人网站（www.fund001.com）下载并打印等方式获取授权委托书样本。

1、基金份额持有人进行纸面授权所需提供的文件：

(1) 个人基金份额持有人委托他人投票的，受托人应提供由委托人填妥并签署授权委托书原件（授权委托书的格式可参考附件三的样本），并提供基金份额持有人的个人身份证明文件复印件。如受托人为个人，还需提供受托人的身份证明文件复印件；如受托人为机构，还需提供该受托人加盖公章的营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文或登记证书复印件等）。

(2) 机构基金份额持有人委托他人投票的，受托人应提供由委托人填妥的授权委托书原件（授权委托书的格式可参考附件三的样本）并在授权委托书上加盖该机构公章，并提供该机构持有人加盖公章的营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文或登记证书复印件等）。如受托人为个人，还需提供受托人的身份证明文件复印件；如受托人为机构，还需提供该受托人加盖公章的营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文或登记证书复印件等）。合格境外机构投资者委托他人投票的，受托人应提供由委托人填妥的授权委托书原件（授权委托书的格式可参考附件三的样本）并在授权委托书上加盖该机构公章（如有）或由授权代表在表决票上签字（如无公章），并提供该授权代表的身份证件、护照或其他身份证明文件的复印件，该合格境外机构投资者所签署的授权委托书或者证明该授权代表有权代表该合格境外机构

投资者签署表决票的其他证明文件，并提供该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件，以及取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件。如受托人为个人，还需提供受托人的身份证明文件复印件；如受托人为机构，还需提供该受托人加盖公章的营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文或登记证书复印件等）。

2、授权效力确定规则

（1）如果同一基金份额存在多次以有效纸面方式授权的，以时间在最后的一次纸面授权为准。同时多次以有效纸面方式授权的，若授权表示一致，以一致的授权表示为准；若授权表示不一致，视为无效授权；

（2）如委托人未在授权委托表示中明确其表决意见的，视为委托人授权受托人按照受托人的意志行使表决权；如委托人在授权委托表示中表达多种表决意见的，视为无效授权；

（3）如委托人既进行委托授权，自身又送达了有效表决票，则以自身有效表决票为准。

六、会议召开的条件和表决票数要求

本次会议召开的条件为：本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额应占权益登记日基金总份额的 50%以上；

本会议表决的票数要求为：《关于交银施罗德先进制造混合型证券投资基金调整投资范围及修改基金合同有关事项的议案》须经出席会议的基金份额持有人及其代理人所持表决权的三分之二以上通过方为有效。

基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效，基金管理人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会备案。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。

七、计票

1、本次通讯会议的计票方式为：由本基金管理人授权的两名监督员在基金托管人（中国农业银行股份有限公司）授权代表的监督下在表决截止日期后2个工作日内进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

2、表决票效力的认定如下：

（1）纸面表决票通过专人送交或邮寄送达本公告规定的收件人的，表决时间以收到时间为准。2021年8月3日17:00以后送达基金管理人的，为无效表决。

（2）纸面表决票的效力认定：

1）纸面表决票填写完整清晰，所提供文件符合本会议通知规定，且在截止时间之前送达基金管理人的，为有效表决票；有效表决票按表决意见计入相应的表决结果，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

2）如表决票上的表决意见未填或无法辨认其表决意见，但其他各项符合会议通知规定的，视为弃权表决，计入有效表决票并按“弃权”计入对应的表决结果，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

3）如表决票上签字或盖章部分填写无法辨认的，或未能提供有效证明基金份额持有人身份或代理人经有效授权的证明文件的，或未能在截止时间之前送达基金管理人的，均为无效表决票；无效表决票不计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

4）基金份额持有人重复提交表决票的，如各表决票表决意见相同，则视为同一表决票；如各表决票表决意见不相同，则按如下原则处理：

A. 送达时间不是同一天的，以最后送达的填写有效的表决票为准，先送达的表决票视为被撤回；

B. 送达时间为同一天的，视为在同一表决票上做出了不同表决意见，计入弃权表决票；

C. 送达时间按如下原则确定：专人送达的以实际递交时间为准，邮寄的以基金管理人收到的时间为准。

八、二次召集基金份额持有人大会及二次授权

根据《基金法》及《基金合同》的规定，本次持有人大会需要本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额应占权益登记日基金总份额的 50% 以上，方可召开。如果本次基金份额持有人大会不符合前述要求而不能成功召开，基金管理人可在规定时间内（即本次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，应当有代表本基金在权益登记日基金总份额三分之一以上（含三分之一）基金份额的持有人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见。

重新召开基金份额持有人大会时，除非授权文件另有载明，本次基金份额持有人大会授权期间基金份额持有人作出的各类授权依然有效，但如果授权方式发生变化或者基金份额持有人重新作出授权，则以最新方式或最新授权为准，详细说明见届时发布的重新召集基金份额持有人大会的通知（如有）。

九、本次持有人大会相关机构

1、召集人：交银施罗德基金管理有限公司

联系地址：上海市浦东新区世纪大道 8 号国金中心二期 22 楼

联系人：郝婷婷

联系电话：（021）61055050

客户服务电话：400-700-5000（免长途话费），（021）61055000

网址：www.fund001.com

2、基金托管人、监督人：中国农业银行股份有限公司

联系地址：北京市东城区建国门内大街69号

客户服务电话：95599

网址：www.abchina.com/cn/

3、公证机关：上海市东方公证处

联系地址：上海市凤阳路 660 号

联系人：林奇

联系电话：（021）62154848

邮政编码：200041

4、见证律师事务所：上海市通力律师事务所

联系电话：（021）31358666

十、重要提示

1、请基金份额持有人在提交表决票时，充分考虑邮寄在途时间，提前寄出表决票。

2、本次基金份额持有人大会有关公告可通过本基金管理人网站（www.fund001.com）查阅，投资者如有任何疑问，可致电本基金管理人客户服务电话 400-700-5000（免长途话费），（021）61055000 咨询。

3、基金管理人将在发布本公告后 2 个工作日内连续公布相关提示性公告，就持有人大会相关情况做必要说明，请予以留意。

4、本次基金份额持有人大会召开期间，投资者可以按照本基金招募说明书的相关规定正常办理申购、赎回业务，业务受理不受影响。相关业务受理若有变化，详见基金管理人发布的相关公告。

5、如本次基金份额持有人大会不能成功召开或者未能通过本次会议审议的议案，根据《基金法》和《基金合同》的有关规定，本基金可能会重新召开基金份额持有人大会。

6、本公告的有关内容由交银施罗德基金管理有限公司负责解释。

交银施罗德基金管理有限公司

二〇二一年七月二日

附件一：《关于交银施罗德先进制造混合型证券投资基金调整投资范围及修改基金合同有关事项的议案》

附件二：《交银施罗德先进制造混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决票》

附件三：《授权委托书》

附件四：《关于交银施罗德先进制造混合型证券投资基金调整投资范围及修改基金合同有关事项议案的说明》

附件一：

关于交银施罗德先进制造混合型证券投资基金调整投资范围及修改 基金合同有关事项的议案

交银施罗德先进制造混合型证券投资基金基金份额持有人：

为保护基金份额持有人的利益，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《交银施罗德先进制造混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，本基金管理人经与基金托管人中国农业银行股份有限公司协商一致，提议召开本基金的基金份额持有人大会，审议本基金调整投资范围及修改基金合同事宜。基于此次本基金调整投资范围及修改基金合同事宜，按照现时有效的相关法律法规和中国证监会的有关规定对《基金合同》进行修订，修订内容包括在本基金投资范围中增加港股通标的股票，相应调整投资策略、业绩比较基准、投资比例限制、估值方法等内容，调整基金赎回费率、增加基金合同自动终止条款、增加 C 类基金份额、增加侧袋机制相关表述，并修改基金合同中根据上述调整需要同步进行修订的其他部分条款，以及按照最新的法律法规及证监会要求修改的内容。具体内容详见附件四《关于交银施罗德先进制造混合型证券投资基金调整投资范围及修改基金合同有关事项议案的说明》。

本议案如获得基金份额持有人大会审议批准，为实施本基金调整投资范围及修改基金合同事宜，提议授权基金管理人办理本次基金调整投资范围及修改基金合同的有关具体事宜，包括但不限于根据《关于交银施罗德先进制造混合型证券投资基金调整投资范围及修改基金合同有关事项议案的说明》对《基金合同》等法律文件进行修改和补充，并在本基金调整投资范围及修改基金合同实施前披露修改后的基金法律文件；提议授权基金管理人在本基金调整投资范围及修改基金合同实施前，制订有关基金调整投资范围及修改基金合同正式实施的日期等事项并提前公告。

以上议案，请予审议。

交银施罗德基金管理有限公司

二〇二一年六月三十日

附件二：

交银施罗德先进制造混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决
票

| | | | |
|---|-----------|-----------|-----------|
| 基金份额持有人姓名或名称： | | | |
| 证件号码（身份证件号/营业执照号）： | | | |
| 审议事项 | 同意 | 反对 | 弃权 |
| 《关于交银施罗德先进制造混合型证券投资基金调整投资范围及修改基金合同有关事项的议案》 | | | |
| 基金份额持有人/受托人签名或盖章 | | | |
| 年 月 日 | | | |
| 说明： 1. 本表决票中“证件号码”，仅指基金份额持有人持有本基金基金份额的基金账号当前所使用的证件号码，基金份额持有人若因证件号码发生过更新或其他原因不确定其基金账户当前所使用的证件号码，可拨打本基金管理人客户服务电话 400-700-5000（免长途话费），（021）61055000 查询。 2. 基金份额持有人/受托人就审议事项表示“同意”、“反对”或“弃权”意见的，在相应栏内划“√”，同一议案只能表示一项意见。 | | | |

3. 基金份额持有人开立持有本基金的基金账户为多个的，若无注明，以上表决意见视为基金份额持有人或其受托人就基金份额持有人全部基金账户所持有的本基金全部份额作出的表决意见。
4. 未填表示意见或无法辨认表决意见的表决票视为投票人放弃表决权利，其所持份额数的表决结果均计为“弃权”。
5. 本表决票可通过剪报、复印，或登陆基金管理人网站（www.fund001.com）下载并打印等方式获取。

附件三：

授权委托书

本人（或本机构）持有交银施罗德先进制造混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金份额，就交银施罗德基金管理有限公司官网（www.fund001.com）及《上海证券报》于2021年6月30日公布的《交银施罗德基金管理有限公司关于以通讯方式召开交银施罗德先进制造混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》所述需基金份额持有人大会审议的事项，本人（或本机构）的意见为（请在意见栏下方划“√”）：

| 同意 | 反对 | 弃权 |
|----|----|----|
| | | |

本人（或本机构）特此授权 _____ 代表本人（或本机构）参加审议上述事项的基金份额持有人大会，并按照上述意见行使表决权。

上述授权有效期自签署日起至审议上述事项的基金份额持有人大会会议结束之日止。若本基金重新召开审议相同议案的持有人大会的，以最多两次重新召开持有人大会为限，本授权继续有效。

委托人（签字/盖章）： _____

委托人证件号码（填写）： _____

受托人（签字/盖章）： _____

受托人证件号码（填写）： _____

签署日期： 年 月 日

授权委托书填写注意事项：

1. 基金份额持有人可以委托符合法律和本公告规定的机构和个人，代为行使本次基金份额持有人大会上的表决权。

2. 基金份额持有人开立持有本基金的基金账户为多个的，若仅以其中部分账户所持有的本基金基金份额授权受托人参会和投票的，应当注明该账户号码。若不注明的，视为授权受托人就其全部账户所持有的本基金份额参会和进行投票。如委托人未在授权委托表示中明确其表决意见的，视为委托人授权受托人按照受托人的意志行使表决权；如委托人在授权委托表示中表达多种表决意见的，视为无效授权。

3. 本授权委托书（样本）中“委托人证件号码”，仅指基金份额持有人持有本基金基金份额的基金账号当前所使用的证件号码，基金份额持有人若因证件号码发生过更新或其他原因不确定其基金账号当前所使用的证件号码，可拨打本基金管理人客户服务电话 400-700-5000（免长途话费），（021）61055000 查询。

4. 具体的授权效力确定规则请参见《交银施罗德基金管理有限公司关于以通讯方式召开交银施罗德先进制造混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》正文。

5. 如本次持有人大会权益登记日，投资者未在本基金登记机构登记在册，则其授权无效。

6. 授权委托书可通过剪报、复印或登陆基金管理人网站下载（www.fund001.com）并打印等方式获取，在填写完整并签字盖章后均为有效。

附件四：

关于交银施罗德先进制造混合型证券投资基金调整投资范围及修改基金合同有关事项议案的说明

一、重要提示

交银施罗德先进制造混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）于 2011 年 6 月 22 日成立并正式运作。根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《交银施罗德先进制造混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，本基金管理人交银施罗德基金管理有限公司经与基金托管人中国农业银行股份有限公司协商一致，提议召开本基金的基金份额持有人大会，审议本基金调整投资范围及修改基金合同事宜。

本次交银施罗德先进制造混合型证券投资基金调整投资范围及修改基金合同须经出席会议的基金份额持有人及其代理人所持表决权的三分之二以上通过方为有效，存在无法获得基金份额持有人大会表决通过的可能。

基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效，基金管理人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会备案。中国证监会对本次持有人大会表决通过的事项所作的任何决定或意见，均不代表其对本基金的价值或投资者的收益做出实质性判断或保证。

二、基金合同修改要点

（一）增加基金合同自动终止条款

对《基金合同》中“五、基金的存续”进行调整，增加自动终止条款，调整后的内容如下：

“《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 50 个工作日出现前述情形的，基金合同终止，不需召开基金份额持有人大会。”

（二）修改投资范围

将“港股通标的股票”纳入本基金的投资范围，并删除权证，变更后的投资范围如下：

“本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市

的股票（含创业板、科创板以及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、港股通标的股票、债券（含国债、央行票据、金融债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、企业债券、公司债券、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、可交换公司债券、次级债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、货币市场工具、债券回购、同业存单、银行存款（含协议存款、定期存款及其他银行存款）、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

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

基金的投资组合比例为：股票资产（含存托凭证）占基金资产的 50%-95%（其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0%-50%），投资于先进制造主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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

（三）修改投资策略

删除权证投资策略。

增加港股通标的股票投资策略，调整后的投资策略如下：

“2、股票投资

……

（4）港股通标的股票投资策略

本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场。本基金优先将基本面健康、业绩向上弹性较大、具有估值优势的港股纳入本基金的股票投资组合。

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。”

“4、可转换债券与可交换公司债券投资策略

本基金对于可转换债券与可交换公司债券股性的研究将完全依托于公司投研团队对标的股票的研究，在此基础上利用可转换债券与可交换公司债券定价模型，充分考虑转债发行后目标转债标的股票股价波动率可能出现的变化，对目标转债的股性进行合理定价。通过对标的转债股性与债性的合理定价，力求寻找出被市场低估的品种，构建本基金可转换债券与可交换公司债券的投资组合。”

（四）修改投资限制

变更后的投资限制如下：

“（七）投资限制

本基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）股票资产（含存托凭证）占基金资产的 50%-95%（其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0%-50%），投资于先进制造主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的 80%；

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

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

（4）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券（同一家公司在内地和香港同时上市的 A+H 股合计计算），不超过该证券的 10%，完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金品种可以不受此条款规定的比例限制；

（5）本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述比例限制；

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

产的投资；

(7) 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；

(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%；本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

(15) 当本基金投资股指期货时，则：

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

2) 本基金在任何交易日日终，持有的买入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）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

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

4) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差

计算)应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定;

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

(16) 本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%;

(17) 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;

(18) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述第(2)项、第(6)项、第(7)项、第(12)项以外,因证券、期货市场波动、证券发行人合并或基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的,基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整,但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的,从其规定。

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

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

(五) 调整业绩比较基准

调整后的业绩比较基准为:

“沪深 300 指数收益率×55%+恒生指数收益率×5%+中证综合债券指数收益率×40%

沪深 300 指数是沪深证券交易所第一次联合发布的反映 A 股市场整体走势的指数,由中证指数公司编制和维护,是在上海和深圳证券交易所中选取 300 只 A 股作为样本编制而成。该指数样本对沪深市场的覆盖度高,具有良好的市场代表性,投资者可以方便地从报纸、互联网等财经媒介中获取。沪深 300 指数引进国际指数编制和管理的经验,编制方法清晰透明,具有独立性和良好的市场流动性;与市场整体表现具有较高的相关度,且指数历史表现强于市场平均收益水平,适合作为本基金权益类资产投资的业绩比较基准。

恒生指数是由恒生指数服务有限公司编制,以香港股票市场中的 50 家上市股票为成份股样本,以其发行量为权数的加权平均股价指数,是反映香港股市价

幅趋势最有影响的一种股价指数。

中证综合债券指数是综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场国债、金融债、企业债、央行票据及短期融资券整体走势的跨市场债券指数，该指数旨在更全面地反映我国债券市场的整体价格变动趋势，具有较强的市场代表性。根据本基金的投资范围和投资比例，选用上述业绩比较基准能够客观、合理地反映本基金的风险收益特征。

如果上述基准指数停止计算编制或更改名称，或者市场推出更符合本基金投资目标和风险收益特征的指数，又或者今后法律法规发生变化，则本基金将视情况按照监管部门要求履行相关程序后调整本基金的业绩比较基准并公告。”

（六）修改风险收益特征

变更后的风险收益特征如下：

“本基金是一只混合型基金，其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。

本基金可投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。”

（七）修改估值方法等估值相关内容

变更后的估值方法如下：

“1、证券交易所上市的有价证券的估值

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

（2）交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（另有规定的除外），选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；

（3）交易所上市交易的可转换债券，按估值日收盘价减去可转换债券收盘价中所含债券（税后）应收利息后得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去可转换债

券收盘价中所含债券（税后）应收利息后得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

（4）交易所上市实行全价交易的债券（可转债除外），选取第三方估值机构提供的估值全价减去估值全价中所含的债券（税后）应收利息得到的净价进行估值；

（5）交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所市场挂牌转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值；

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

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

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

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

3、对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种，回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异，未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。

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

5、同一证券同时在两个或两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。

估值计算中涉及港币对人民币汇率的，将依据下列信息提供机构所提供的汇率为基准：当日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价。

税收：对于按照中国法律法规和基金投资境内外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。

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

7、本基金投资存托凭证的估值核算依照境内上市交易的股票执行。

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

9、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。”

同时对估值程序、估值错误的处理、暂停估值的情形、基金净值的确认、特殊情形的处理等内容根据监管要求进行更新。

（八）增设 C 类基金份额

增加“销售服务费”、“A 类基金份额”、“C 类基金份额”的释义。

增加“基金份额类别”等相关表述：

“本基金根据申购费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人申购时收取申购费用且不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资人申购时不收取申购费用，并从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。

本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置基金代码。由于基金费用的

不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值并单独公告。投资者可自行选择申购的基金份额类别。本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。

在不违反法律法规、基金合同的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，根据基金实际运作情况，基金管理人可增加或调整基金份额类别设置、对基金份额分类办法及规则进行调整并在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告，而无需召开基金份额持有人大会。”

其他与本基金增加 C 类基金份额相关的内容一并调整。

（九）增加基金费用的种类条款

增加基金费用的种类条款：

“9、基金的开户费用、账户维护费用；

10、因投资港股通标的股票而产生的各项合理费用；

11、本基金从 C 类基金份额的基金财产中计提的销售服务费；”

（十）增加投资港股通标的股票的信息披露条款

增加投资港股通标的股票的信息披露条款：

“基金应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露港股通标的股票的投资情况。法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定。”

（十一）增加侧袋机制相关表述

根据《公开募集证券投资基金侧袋机制指引（试行）》在《基金合同》相应章节增加侧袋机制相关表述。

（十二）调整基金赎回费率：

原赎回费率：

“本基金的赎回费率如下：

| | 持有期限 | 赎回费率 |
|------|-------------|-------|
| 赎回费率 | 7 日以内 | 1.5% |
| | 7 日（含）—30 日 | 0.75% |
| | 30 日（含）—1 年 | 0.5% |
| | 1 年（含）—2 年 | 0.2% |
| | 2 年以上（含） | 0 |

上表中的“年”指的是 365 个自然日。”

修改为：

“（1）本基金 A 类基金份额的赎回费率如下：

| | 持有期限 | A 类基金份额赎回费率 |
|--------------|--------------|-------------|
| A 类基金份额的赎回费率 | 7 日以内 | 1.5% |
| | 7 日（含）—30 日 | 0.75% |
| | 30 日（含）—6 个月 | 0.5% |
| | 6 个月以上（含） | 0 |

（2）本基金 C 类基金份额的赎回费率如下：

| | 持有期限 | C 类基金份额赎回费率 |
|--------------|-------------|-------------|
| C 类基金份额的赎回费率 | 7 日以内 | 1.5% |
| | 7 日（含）-30 日 | 0.5% |
| | 30 日以上（含） | 0 |

本基金 C 类基金份额的赎回费用由赎回 C 类基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回 C 类基金份额时收取，对 C 类基金份额持有人收取的赎回费全额计入基金财产。”

（十三）除根据上述主要内容的调整而做出的必要修改外，基金管理人拟同时根据法律法规变动及本基金实际操作的需要对《基金合同》的相关内容进行修订，基金管理人提请基金份额持有人大会授权基金管理人修订《基金合同》。

（十四）本次《基金合同》的具体修改内容请参照本说明的附表。

三、授权基金管理人办理本次基金调整投资范围及修改基金合同的有关具体事宜

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定，基金管理人提请基金份额持有人大会授权基金管理人办理本次基金调整投资范围及修改基金合同的有关具体事宜，包括但不限于根据《关于交银施罗德先进制造混合型证券投资基金调整投资范围及修改基金合同有关事项议案的说明》对《基金合同》等法律文件进行修改和补充，并在本基金调整投资范围及修改基金合同实施前披露修改后的基金法律文件，同时基金管理人在本基金调整投资范围及修改基金合同实施前，将根据基金份额持有人大会的授权，制订有关基金调整投资范围及修改基金合同正式实施的日期、实施前的申购赎回安排等事项的规则并提前公告。

四、修改基金合同的主要风险及预备措施

（一）持有人大会不能成功召开的风险

根据《基金法》及《基金合同》的规定，本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额应占权益登记日基金总份额的 50% 以上方可举行。为防范本次基金份额持有人大会不符合上述要求而不能成功召开，基金管理人将通过各种渠道联系基金份额持有人，积极邀请基金份额持有人自行或委托他人进行投票。

如有必要，基金管理人将推迟基金份额持有人大会的召开时间。

如在投票表决截止日后，因不符合上述条件本次基金份额持有人大会确实未能成功召开，基金管理人可在本次公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内就该次大会议案二次召集基金份额持有人大会。

（二）《基金合同》的修订方案被基金份额持有人大会否决的风险

在设计修改方案之前，基金管理人已对基金份额持有人进行了走访，认真听取了相关意见，拟定议案综合考虑了基金份额持有人的要求。如有必要，基金管理人将根据基金份额持有人意见，对《基金合同》的修订方案进行适当的调整，并重新公告。基金管理人可在必要情况下，推迟基金份额持有人大会的召开时间。

（三）《基金合同》修改前后的运作风险

为维护基金份额持有人利益，基金管理人将提前做好充分的内部沟通及外部沟通，避免基金合同修改后基金运作过程中出现相关操作风险、管理风险等运作风险，严格地控制本基金的市场风险。

五、基金管理人联系方式

基金份额持有人若对本方案的内容任何意见和建议，请通过以下方式联系基金管理人：

交银施罗德基金管理有限公司

客户服务电话：400-700-5000（免长途话费），（021）61055000

网址：www.fund001.com

特此说明。

交银施罗德基金管理有限公司

二〇二一年六月三十日

附件：交银施罗德先进制造混合型证券投资基金变更注册基金合同前后修改对

照表

| 章节（以变更后的章节为准） | 基金合同原条款 | 变更注册后基金合同的条款 |
|---------------|---|---|
| 全文 | “指定媒介”、“指定网站”、“指定报刊” | “规定媒介”、“规定网站”、“规定报刊” |
| 一、前言 | <p>（一）订立本基金合同的目的、依据和原则</p> <p>2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《中华人民共和国合同法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性规定》”）和其他有关法律法规。</p> | <p>（一）订立本基金合同的目的、依据和原则</p> <p>2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、<u>《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》</u>（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性规定》”）和其他有关法律法规。</p> |
| 一、前言 | | <p><u>（六）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规定范围内的香港联合交易所有限公司（以下简称“香港联合交易所”）上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）的，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险（港股市场实行 T+0 回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对基金的投资收益造成损失）、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险（在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险）等。具体风险烦请查阅本基金招募说明书的“风险揭示”章节的具体内容。</u></p> <p><u>基金可根据投资策略需要或不同配置地市</u></p> |

| | | |
|------|---|--|
| | | 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。 |
| 一、前言 | (八)本基金合同关于基金产品资料概要的编制、披露及更新等内容,将不晚于2020年9月1日起执行。 | |
| 二、释义 | 8、基金产品资料概要:指《交银施罗德先进制造混合型证券投资基金基金产品资料概要》及其更新 (本基金合同关于基金产品资料概要的编制、披露及更新等内容,将不晚于2020年9月1日起执行) | 8、基金产品资料概要:指《交银施罗德先进制造混合型证券投资基金基金产品资料概要》及其更新 |
| 二、释义 | 11、《销售办法》:指《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订 | 11、《销售办法》:指《 <u>公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法</u> 》及颁布机关对其不时做出的修订 |
| 二、释义 | 17、银行业监督管理机构:指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会 | 17、银行业监督管理机构:指中国人民银行和/或中国 <u>银行保险</u> 监督管理委员会 |
| 二、释义 | 21、合格境外机构投资者:指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》及相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者 22、人民币合格境外机构投资者:指按照《人民币合格境外机构投资者境内证券投资试点办法》及相关法律法规规定,运用来自境外的人民币资金进行中国境内证券投资的境外机构投资者 | 21、合格境外投资者:指符合《 <u>合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者境内证券期货投资管理办法</u> 》及相关法律法规规定使用来自境外的资金进行境内证券期货投资的境外机构投资者,包括合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者 |
| 二、释义 | 23、基金投资者或投资者:指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者、 人民币合格境外机构投资者 ,以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者 | 22、基金投资者或投资者:指个人投资者、机构投资者、合格境外投资者,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者 |
| 二、释义 | 31、基金合同生效日:指根据2018年2月13日至2018年3月19日基金份额持有人大会审议通过的《关于交银施罗德先进制造 | 30、基金合同生效日:指根据2021年XX月XX日至2021年XX月XX日基金份额持有人大会审议通过的《关于交银施罗德先 |

| | | |
|------|---|--|
| | 混合型证券投资基金调整投资范围及修改基金合同有关事项的议案》所修订的《交银施罗德先进制造混合型证券投资基金基金合同》生效日 | 进制造混合型证券投资基金调整投资范围及修改基金合同有关事项的议案》所修订的《交银施罗德先进制造混合型证券投资基金基金合同》生效日 |
| 二、释义 | 40、开放日：指为基金投资者办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日 | 39、开放日：指为基金投资者办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日（若该工作日为非港股通交易日，则本基金可不开放） |
| 二、释义 | 57、基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、股指期货合约、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和 | 56、基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、股指期货合约、银行存款本息、基金应收款项及其他资产的价值总和 |
| 二、释义 | 62、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。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定 | 65、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 |
| 二、释义 | | <p>60、港股通：指内地投资者委托内地证券公司，经由内地证券交易所在香港设立的证券交易服务公司，向香港联合交易所进行申报，买卖规定范围内的香港联合交易所上市</p> <p>的股票</p> <p>61、销售服务费：指从基金财产中计提的，用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务的费用</p> <p>62、A类基金份额：指在投资人申购时收取申购费用且不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额</p> <p>63、C类基金份额：指在投资人申购时不收取申购费用，并从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额</p> <p>66、侧袋机制：指将基金投资组合中的特定资产从原有账户分离至一个专门账户进行处置清算，目的在于有效隔离并化解风险，确保投资者得到公平对待，属于流动性风险管理工具。侧袋机制实施期间，原有账户称为主袋账户，专门账户称为侧袋账户</p> |

| | | |
|-----------|--|---|
| | | <u>67、特定资产：包括：（一）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的资产；（二）按摊余成本计量且计提资产减值准备仍导致资产价值存在重大不确定性的资产；（三）其他资产价值存在重大不确定性的资产</u> |
| 二、释义 | <u>63、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</u> | <u>68、规定媒介：指符合中国证监会规定条件的用以进行信息披露的全国性报刊及《信息披露办法》规定的互联网网站（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</u> |
| 二、释义 | <u>64、《业务规则》：指《中国证券登记结算有限责任公司开放式证券投资基金及证券公司集合资产管理计划份额登记及资金结算业务指南》及其后修订，是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金登记方面的业务规则，由基金管理人和投资人共同遵守</u> | <u>69、《业务规则》：指中国证券登记结算有限责任公司相关业务规则及其不时做出的修订</u> |
| 三、基金的基本情况 | （二）基金的类别 混合型基金 | （二）基金的类别 混合型 <u>证券投资基金</u> |
| 三、基金的基本情况 | | <u>（六）基金份额类别</u> <u>本基金根据申购费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人申购时收取申购费用且不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资人申购时不收取申购费用，并从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。</u> <u>本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置基金代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值并单独公告。投资者可自行选择申购的基金份额类别。本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。</u> <u>在不违反法律法规、基金合同的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，根据基金实际运作情况，基金管理人可增加或调整基金份额类别设置、对基金</u> |

| | | |
|---------------------|---|--|
| | | <p>份额分类办法及规则进行调整并在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在<u>规定媒介上公告，而无需召开基金份额持有人大会。</u></p> |
| <p>四、基金的历史沿革</p> | | <p><u>自 2021 年 XX 月 XX 日至 2021 年 XX 月 XX 日交银施罗德先进制造混合型证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会，大会于 2021 年 XX 月 XX 日审议通过了《关于交银施罗德先进制造混合型证券投资基金调整投资范围及修改基金合同有关事项的议案》，内容包括在交银施罗德先进制造混合型证券投资基金的投资范围中增加港股通标的股票，相应调整投资策略、投资比例限制、业绩比较基准、估值方法等内容，并调整基金赎回费率、增加基金合同自动终止条款、增加 C 类基金份额、增加侧袋机制相关表述及修改基金合同其他条款等事项，上述基金份额持有人大会决议事项自表决通过之日起生效。自 2021 年 XX 月 XX 日起，根据《关于交银施罗德先进制造混合型证券投资基金调整投资范围及修改基金合同有关事项的议案》修改而成的《交银施罗德先进制造混合型证券投资基金基金合同》生效。</u></p> |
| <p>五、基金的存续</p> | <p>《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。</p> | <p>《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 50 个工作日出现前述情形的，<u>基金合同终止，不需召开基金份额持有人大会。</u></p> |
| <p>六、基金份额的申购与赎回</p> | <p>(二) 申购和赎回的开放日及开放时间 1、开放日及开放时间 基金投资者在开放日申请办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时</p> | <p>(二) 申购和赎回的开放日及开放时间 1、开放日及开放时间 基金投资者在开放日申请办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时</p> |

| | | |
|----------------------------|---|--|
| | <p>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。</p> | <p>间(若该工作日为非港股通交易日,则本基金可不开放)。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。</p> |
| <p>六、基金份额的申购与赎回</p> | <p>(三) 申购与赎回的原则</p> <p>4、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销;</p> <p>5、基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可更改上述原则,但最迟应在新的原则实施前依照有关规定在指定媒介上公告。</p> | <p>(三) 申购与赎回的原则</p> <p>4、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销,但申请经登记机构受理的不得撤销;</p> <p>5、基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可更改上述原则,但最迟应在新的原则实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。</p> |
| <p>六、基金份额的申购与赎回</p> | <p>(六) 申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>1、本基金份额净值的计算,保留到小数点后4位,小数点后第5位四舍五入,由此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(包括该日)内公告。遇特殊情况,经中国证监会同意,可以适当延迟计算或公告。</p> <p>2、申购份额的计算及余额的处理方式:本基金申购份额的计算及余额的处理方式详见《招募说明书》。本基金的申购费率由基金管理人决定,并在招募说明书中列示。申购的有效份额为净申购金额除以当日的基金份额净值,有效份额单位为份。</p> <p>3、赎回金额的计算及处理方式:本基金赎回金额的计算及余额的处理方式详见《招募说明书》。本基金的赎回费率由基金管理人决定,并在招募说明书中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金</p> | <p>(六) 申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p><u>1、本基金基金份额分为A类基金份额和C类基金份额。投资人申购A类基金份额在申购时支付申购费用;申购C类基金份额不支付申购费用,并从该类别基金资产中计提销售服务费。</u></p> <p>2、本基金A类基金份额和C类基金份额的份额净值的计算,均保留到小数点后4位,小数点后第5位四舍五入,由此产生的收益或损失由基金财产承担。T日的基金份额净值在当天收市后计算,并在T+1日(包括该日)内公告。遇特殊情况,经中国证监会同意,可以适当延迟计算或公告。</p> <p>3、申购份额的计算及余额的处理方式:本基金申购份额的计算及余额的处理方式详见《招募说明书》。本基金A类基金份额的申购费率由基金管理人决定,并在招募说明书及基金产品资料概要中列示。申购A类基金份额或C类基金份额的有效份额为净申购金额除以当日该类基金份额的基金份额净值,有效份额单位为份。</p> <p>4、赎回金额的计算及处理方式:本基金赎回金额的计算及余额的处理方式详见《招募说明书》。本基金A类基金份额和C类基金份额的赎回费率由基金管理人决定,并在招募说明书及基金产品资料概要中列示。赎回</p> |

| | | |
|----------------------------|---|--|
| | <p>份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。</p> <p>4、申购费用由投资人承担，不列入基金财产。</p> <p>5、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。赎回费用纳入基金财产的比例详见招募说明书，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。对持续持有期少于 7 日的投资人收取不低于 1.5% 的赎回费并全额计入基金财产。</p> | <p>金额为按实际确认的 <u>A 类基金份额和 C 类基金份额有效赎回份额</u>乘以当日<u>该类基金份额净值</u>并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。</p> <p>5、<u>本基金 A 类基金份额的申购费用</u>由<u>申购 A 类基金份额的投资人</u>承担，不列入基金财产。</p> <p>6、<u>本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额的赎回费用</u>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。赎回费用纳入基金财产的比例详见招募说明书，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。对持续持有期少于 7 日的投资人收取不低于 1.5% 的赎回费并全额计入基金财产。</p> |
| <p>六、基金份额的申购与赎回</p> | <p>(八) 拒绝或暂停申购的情形</p> <p>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：</p> <p>2、证券/期货交易所交易时间临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；</p> <p>8、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p> | <p>(八) 拒绝或暂停申购的情形</p> <p>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：</p> <p>2、证券/期货交易所交易时间<u>非正常停市或港股通临时停市</u>，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；</p> <p><u>7、港股通交易每日额度不足。</u></p> <p><u>9、法律法规规定、中国证监会认定或基金合同约定的</u>其他情形。</p> |
| <p>六、基金份额的申购与赎回</p> | <p>(九) 暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>发生下列情形时，基金管理人可暂停接受基金投资者的赎回申请或延缓支付赎回款项：</p> <p>2、证券/期货交易所交易时间临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；</p> <p>3、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回，导致本基金的现金支付出现困难；</p> <p>6、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p> <p>发生上述情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项时，基金管理人应在当日向中国证监会备案，已成功确认的赎回申请，基金管理人应</p> | <p>(九) 暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>发生下列情形时，基金管理人可暂停接受基金投资者的赎回申请或延缓支付赎回款项：</p> <p>2、证券/期货交易所交易时间<u>非正常停市或港股通临时停市</u>，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；</p> <p>3、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回；</p> <p>6、法律法规规定、<u>中国证监会认定或基金合同约定的</u>其他情形。</p> <p>发生上述情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项时，基金管理人应<u>及时报</u>中国证监会备案，已成功确认的赎回申请，基金管理人应</p> |

| | | |
|------------------|--|---|
| | 足额支付；如暂时不能足额支付，可延期支付。 | 足额支付；如暂时不能足额支付，可延期支付。 |
| 六、基金份额的 申购与赎回 | <p>(十) 巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>(1) 巨额赎回的场外处理方式</p> <p>2) 部分延期赎回：当基金管理人认为支付基金投资者的赎回申请有困难或认为支付投资者的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一工作日基金总份额的 10%的前提下，对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；基金投资者未能赎回部分，投资者在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获赎回的部分申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以该开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，并以此类推，直到全部赎回为止。如基金投资者在提交赎回申请时未作明确选择，投资者未能赎回部分作自动延期赎回处理。</p> <p>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日基金总份额 20% 的情形下，基金管理人有权采取如下措施：对于该类基金份额持有人当日超过 20% 的赎回申请，可以对其赎回申请延期办理；对于该类基金份额持有人未超过上述比例的部分，基金管理人可以根据前段“1) 全额赎回”或“2) 部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。但是，如该类基金份额持有人在当日选择取消赎回，则其当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。</p> | <p>(十) 巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>(1) 巨额赎回的场外处理方式</p> <p>2) 部分延期赎回：当基金管理人认为支付基金投资者的赎回申请有困难或认为支付投资者的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一工作日基金总份额的 10%的前提下，对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；基金投资者未能赎回部分，投资者在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获赎回的部分申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，并以此类推，直到全部赎回为止。如基金投资者在提交赎回申请时未作明确选择，投资者未能赎回部分作自动延期赎回处理。</p> <p>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日基金总份额 20% 的情形下，基金管理人有权采取如下措施：对于基金份额持有人当日超过 20% 的赎回申请，可以对其赎回申请延期办理；对于基金份额持有人未超过上述比例的部分，基金管理人可以根据前段“1) 全额赎回”或“2) 部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。但是，如该类基金份额持有人在当日选择取消赎回，则其当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。</p> |
| 六、基金份额的 | (十一) 暂停申购或赎回的公告和重新开 | (十一) 暂停申购或赎回的公告和重新开 |

| | | |
|-----------------------|--|--|
| <p>申购与赎回</p> | <p>放申购或赎回的公告</p> <p>2、暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应依照《信息披露管理办法》的有关规定，在<u>指定媒介</u>上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近 1 个工作日的基金份额净值。</p> | <p>放申购或赎回的公告</p> <p>2、暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应依照《信息披露管理办法》的有关规定，在<u>规定媒介</u>上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近 1 个工作日<u>各类基金份额</u>的基金份额净值。</p> |
| <p>六、基金份额的申购与赎回</p> | <p>(十六) 其他情形</p> <p>基金份额的冻结和解冻业务，由注册登记机构办理。</p> <p>注册登记机构只受理国家有关机关依法要求的基金份额的冻结与解冻以及注册登记机构认可的其他情况的基金份额的冻结与解冻。基金份额被冻结的，被冻结部分所产生的权益按照法律法规、监管规章以及国家有关机关的要求决定是否冻结。</p> <p>当基金份额处于冻结状态时，注册登记机构或其他相关机构有权拒绝该部分基金份额的赎回、转出、非交易过户以及基金的转托管申请。</p> | <p>(十六) <u>基金份额的冻结和解冻</u></p> <p>基金登记机构只受理国家有<u>权</u>机关依法要求的基金份额的冻结与解冻，以及登记机构<u>认可、符合法律法规</u>的其他情况下的冻结与解冻。</p> |
| <p>六、基金份额的申购与赎回</p> | | <p>(十七) <u>实施侧袋机制期间本基金的申购与赎回</u></p> <p><u>本基金实施侧袋机制的，本基金的申购和赎回安排详见招募说明书或相关公告。</u></p> <p>(十八) <u>其他业务</u></p> <p><u>在不违反法律法规及中国证监会规定的前提下，基金管理人可在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情形下，办理基金份额的质押业务或其他基金业务，基金管理人可制定相应的业务规则，并依照《信息披露办法》的有关规定进行公告。</u></p> |
| <p>七、基金合同当事人及权利义务</p> | <p>(二) 基金托管人</p> <p>1、基金托管人简况</p> <p>注册资本：<u>叁仟贰佰肆拾柒亿玖仟肆佰壹拾壹万柒仟元</u></p> <p>3、基金托管人的义务</p> <p>(9) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料<u>不少于 15 年</u>；</p> | <p>(二) 基金托管人</p> <p>1、基金托管人简况</p> <p>注册资本：<u>34,998,303.4 万元人民币</u></p> <p>3、基金托管人的义务</p> <p>(9) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料<u>不低于法律法规规定的最低期限</u>；</p> |

| | | |
|----------------|---|--|
| 七、基金合同当事人及权利义务 | (三) 基金份额持有人每份基金份额具有同等的合法权益。 | (三) 基金份额持有人 <u>同一类别的</u> 每份基金份额具有同等的合法权益。 |
| 八、基金份额持有人大会 | <p>(二) 召开事由</p> <p>1.当出现或需要决定下列事由之一的,经基金管理人、基金托管人或单独或合计持有基金份额 10%以上(“以上”含本数,下同)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)提议时,应当召开基金份额持有人大会,法律法规和中国证监会另有规定的除外:</p> <p>(1) 终止基金合同;</p> <p>(7) 调整基金管理人、基金托管人的报酬标准;</p> <p>2.出现以下情形之一的,可由基金管理人和基金托管人协商后修改,不需召开基金份额持有人大会:</p> <p>(1) <u>在法律法规和本基金合同规定的范围内且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下</u>,调整基金的申购费率、调低赎回费率、变更或增加收费方式;</p> | <p>(二) 召开事由</p> <p>1.当出现或需要决定下列事由之一的,经基金管理人、基金托管人或单独或合计持有基金份额 10%以上(“以上”含本数,下同)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)提议时,应当召开基金份额持有人大会,法律法规和中国证监会另有规定的除外:</p> <p>(1) 终止基金合同,<u>基金合同另有规定的除外</u>;</p> <p>(7) 调整基金管理人、基金托管人的报酬标准<u>或提高销售服务费率</u>;</p> <p>2. <u>在法律法规和本基金合同规定的范围内且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下</u>,出现以下情形之一的,可由基金管理人和基金托管人协商后修改,不需召开基金份额持有人大会:</p> <p>(1) 调整基金的申购费率、调低赎回费率及<u>销售服务费率</u>、变更或增加收费方式;</p> <p>(2) <u>调整基金份额类别设置、对基金份额分类办法及规则进行调整</u>;</p> |
| 八、基金份额持有人大会 | <p>(六) 议事内容与程序</p> <p>2、议事程序</p> <p>(2) 通讯方式开会</p> <p>在通讯表决开会的方式下,首先由召集人提前 30 日公布提案,在所通知的表决截止日期后 2 个工作日内在公证机构监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。如监督人经通知但拒绝到场监督,则在<u>公证机关</u>监督下形成的决议有效。</p> | <p>(六) 议事内容与程序</p> <p>2、议事程序</p> <p>(2) 通讯方式开会</p> <p>在通讯表决开会的方式下,首先由召集人提前 30 日公布提案,在所通知的表决截止日期后 2 个工作日内在<u>公证机构</u>监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。如监督人经通知但拒绝到场监督,则在<u>公证机关</u>监督下形成的决议有效。</p> |
| 八、基金份额持有人大会 | | <p><u>(十)、实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定</u></p> <p><u>若本基金实施侧袋机制,则相关基金份额或表决权</u>的比例指主袋份额持有人和侧袋份</p> |

| | | |
|-----------------------------|---|---|
| | | <p><u>额持有人分别持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例,但若相关基金份额持有人大会召集和审议事项不涉及侧袋账户的,则仅指主袋份额持有人持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例:</u></p> <p><u>1、基金份额持有人行使提议权、召集权、提名权所需单独或合计代表相关基金份额10%以上(含10%);</u></p> <p><u>2、现场开会的到会者在权益登记日代表的基金份额不少于本基金在权益登记日相关基金份额的二分之一(含二分之一);</u></p> <p><u>3、通讯开会的直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日相关基金份额的二分之一(含二分之一);</u></p> <p><u>4、在参与基金份额持有人大会投票的基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日相关基金份额的二分之一、召集人在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内就原定审议事项重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上(含三分之一)相关基金份额的持有人参与或授权他人参与基金份额持有人大会投票;</u></p> <p><u>5、现场开会由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的50%以上(含50%)选举产生一名基金份额持有人或代理人作为该次基金份额持有人大会的主持人;</u></p> <p><u>6、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;</u></p> <p><u>7、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。</u></p> <p><u>同一主侧袋账户内的每份基金份额具有平等的表决权。</u></p> |
| <p>九、基金管理人、基金托管人</p> | <p>(一) 基金管理人的更换</p> <p>2、基金管理人的更换程序</p> | <p>(一) 基金管理人的更换</p> <p>2、基金管理人的更换程序</p> |

| | | |
|------------------------------|--|---|
| <p>的更换条件和程序</p> | <p>更换基金管理人必须依照如下程序进行： （5）审计：原任基金管理人职责终止的，应当按照法律法规规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报中国证监会备案；审计费用在基金财产中列支；</p> | <p>更换基金管理人必须依照如下程序进行： （5）审计：原任基金管理人职责终止的，应当按照法律法规规定聘请符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所对基金财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报中国证监会备案；审计费用在基金财产中列支；</p> |
| <p>九、基金管理人、基金托管人的更换条件和程序</p> | <p>（二）基金托管人的更换 2、基金托管人的更换程序 （5）审计：原任基金托管人职责终止的，应当按照规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计，并予以公告，同时报中国证监会备案；审计费用从基金财产中列支；</p> | <p>（二）基金托管人的更换 2、基金托管人的更换程序 （5）审计：原任基金托管人职责终止的，应当按照规定聘请符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所对基金财产进行审计，并予以公告，同时报中国证监会备案；审计费用从基金财产中列支；</p> |
| <p>十二、基金的投资</p> | <p>（三）投资范围 本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板以及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证）、债券（含国债、央行票据、金融债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、企业债券、公司债券、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、可交换公司债券、次级债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、货币市场工具、债券回购、同业存单、银行存款（含协议存款、定期存款及其他银行存款）、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。 基金的投资组合比例为：股票资产（含存托凭证）占基金资产的 50%-95%，其中，投资于先进制造主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、</p> | <p>（三）投资范围 本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含创业板、科创板以及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、<u>港股通标的股票</u>、债券（含国债、央行票据、金融债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、企业债券、公司债券、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、可交换公司债券、次级债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、货币市场工具、债券回购、同业存单、银行存款（含协议存款、定期存款及其他银行存款）、<u>资产支持证券</u>、<u>股指期货</u>以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。 基金的投资组合比例为：股票资产（含存托凭证）占基金资产的 50%-95%（其中投资于<u>港股通标的股票的比例占股票资产的 0%-50%</u>），投资于先进制造主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不</p> |

| | | |
|----------|---|--|
| | 存出保证金、应收申购款等。 | 低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。 |
| 十二、基金的投资 | <p>(四) 投资策略</p> <p>1、资产配置</p> <p>本基金将通过“自上而下”的定性分析和定量分析相结合形成对不同资产市场表现的预测和判断，确定基金资产在股票、债券及货币市场工具等各类别资产间的分配比例，并随着各类证券风险收益特征的相对变化，动态调整组合中各类资产的比例，以规避或控制市场风险，提高基金收益率。</p> <p>2、股票投资</p> <p>3、债券投资</p> <p>在全球经济的框架下，本基金管理人对宏观经济运行趋势及其引致的财政货币政策变化作出判断，运用数量化工具，对未来市场利率趋势及市场信用环境变化作出预测，并综合考虑利率变化对不同债券品种的影响、收益率水平、信用风险的大小、流动性的好坏等因素，构造债券组合。在具体操作中，本基金运用久期控制策略、期限结构配置策略、类属配置策略、骑乘策略、杠杆放大策略和换券等多种策略，获取债券市场的长期稳定收益。</p> | <p>(四) 投资策略</p> <p>1、资产配置</p> <p>本基金将通过“自上而下”的定性分析和定量分析相结合形成对不同资产市场表现的预测和判断，确定基金资产在<u>沪深 A 股、港股</u>、债券及货币市场工具等各类别资产间的分配比例，并随着各类证券风险收益特征的相对变化，动态调整组合中各类资产的比例，以规避或控制市场风险，提高基金收益率。</p> <p>2、股票投资</p> <p><u>(4) 港股通标的股票投资策略</u></p> <p><u>本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场。本基金优先将基本面健康、业绩向上弹性较大、具有估值优势的港股纳入本基金的股票投资组合。</u></p> <p><u>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。</u></p> <p>3、债券投资</p> <p>在全球经济的框架下，本基金管理人对宏观经济运行趋势及其引致的财政货币政策变化作出判断，运用数量化工具，对未来市场利率趋势及市场信用环境变化作出预测，并综合考虑利率变化对不同债券品种的影响、收益率水平、信用风险的大小、流动性的好坏等因素，构造债券组合。在具体操作中，本基金运用久期控制策略、期限结构配置策略、类属配置策略、骑乘策略、杠杆放大策略和换券等多种策略，<u>以期</u>获取债券市场的长期稳定收益。</p> |
| 十二、基金的投资 | <p>4、权证投资</p> <p>本基金的权证投资以权证的市场价值分析为基础，配以权证定价模型寻求其合理估值</p> | |

| | | |
|----------|---|---|
| | 水平，以主动式的科学投资管理为手段，充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征，通过资产配置、品种与类属选择，追求基金资产稳定的当期收益。 | |
| 十二、基金的投资 | | 4、可转换债券与可交换公司债券投资策略 本基金对于可转换债券与可交换公司债券股性的研究将完全依托于公司投研团队对标的股票的研究，在此基础上利用可转换债券与可交换公司债券定价模型，充分考虑转债发行后目标转债标的股票股价波动率可能出现的变化，对目标转债的股性进行合理定价。通过对标的转债股性与债性的合理定价，力求寻找出被市场低估的品种，构建本基金可转换债券与可交换公司债券的投资组合。 |
| 十二、基金的投资 | <p>(五) 业绩比较基准</p> <p>沪深 300 指数收益率×60%+中证综合债券指数收益率×40%</p> <p>如果上述基准指数停止计算编制或更改名称，或者市场推出更符合本基金投资目标和风险收益特征的指数，又或者今后法律法规发生变化，则本基金将视情况并经履行相关程序后调整本基金的业绩比较基准并公告。</p> | <p>(五) 业绩比较基准</p> <p>沪深 300 指数收益率×55%+恒生指数收益率×5%+中证综合债券指数收益率×40%</p> <p>恒生指数是由恒生指数服务有限公司编制，以香港股票市场中的 50 家上市股票为成份股样本，以其发行量为权数的加权平均股价指数，是反映香港股市价幅趋势最有影响的一种股价指数。</p> <p>如果上述基准指数停止计算编制或更改名称，或者市场推出更符合本基金投资目标和风险收益特征的指数，又或者今后法律法规发生变化，则本基金将视情况按照监管部门要求履行相关程序后调整本基金的业绩比较基准并公告。</p> |
| 十二、基金的投资 | (六) 风险收益特征 | (六) 风险收益特征 本基金可投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。 |
| 十二、基金的投资 | <p>(七) 投资限制本基金的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>(1) 股票资产（含存托凭证）占基金资产</p> | <p>(七) 投资限制</p> <p>本基金的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>(1) 股票资产（含存托凭证）占基金资产</p> |

| | |
|--|--|
| <p>的 50%-95%，其中投资于先进制造主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的 80%；</p> <p>(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%；</p> <p>(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%；</p> <p>—(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%；—</p> <p>—(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%；—</p> <p>—(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%；—</p> <p>(8) 本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 30%；</p> <p>(14) 当本基金投资股指期货时，则： 2) 本基金在任何交易日日终，持有的买入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； 除上述第 (2) 项、第 (9) 项、第 (10) 项、</p> | <p>的 50%-95% <u>（其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0%-50%）</u>，投资于先进制造主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的 80%；</p> <p>(3) 本基金持有一家公司发行的证券 <u>（同一家公司在内地和香港同时上市的 A+H 股合计计算）</u>，其市值不超过基金资产净值的 10%；</p> <p>(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 <u>（同一家公司在内地和香港同时上市的 A+H 股合计计算）</u>，不超过该证券的 10%，<u>完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金品种可以不受此条款规定的比例限制；</u></p> <p>(5) 本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 30%；<u>完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述比例限制；</u></p> <p>(15) 当本基金投资股指期货时，则： 2) 本基金在任何交易日日终，持有的买入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）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；</p> |
|--|--|

| | | |
|----------|---|--|
| | <p>第(15)项以外,因证券、期货市场波动、证券发行人合并或基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的,基金管理人应当在10个交易日内进行调整,但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的,从其规定。</p> <p>基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。在上述期间内,本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。</p> | <p>除上述第(2)项、第(6)项、第(7)项、第(12)项以外,因证券、期货市场波动、证券发行人合并或基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的,基金管理人应当在10个交易日内进行调整,但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的,从其规定。</p> <p>基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。在上述期间内,本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。<u>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。</u></p> |
| 十二、基金的投资 | (九)…… | <p>(九)……<u>如法律、行政法规或监管部门取消上述规定,如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后,本基金可不受上述规定的限制。</u></p> <p><u>(十一)侧袋机制的实施和投资运作安排当基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时,根据最大限度保护基金份额持有人利益的原则,基金管理人经与基金托管人协商一致,并咨询会计师事务所意见后,可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制。</u></p> <p><u>侧袋机制实施期间,本部分约定的投资组合比例、投资策略、组合限制、业绩比较基准、风险收益特征等约定仅适用于主袋账户。侧袋账户的实施条件、实施程序、运作安排、投资安排、特定资产的处置变现和支付等对投资者权益有重大影响的事项详见招募说明书的规定。</u></p> |
| 十三、基金的财产 | <p>(一)基金资产总值</p> <p>基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券、股指期货合约、银行存款本息、基金应收申购款以及其他资产的价值总和。</p> | <p>(一)基金资产总值</p> <p>基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券、股指期货合约、银行存款本息、基金应收款项以及其他资产的价值总和。</p> |
| 十四、基金资产 | | <p>(四)估值原则</p> <p><u>基金管理人在确定相关金融资产和金融负</u></p> |

| | | |
|-------------------|---|--|
| <p>的估值</p> | | <p>债的公允价值时，应符合《企业会计准则》、<u>监管部门有关规定。</u></p> <p><u>1、对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会计准则规定的例外情况外，应将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。</u></p> <p><u>与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。</u></p> <p><u>2、对不存在活跃市场的投资品种，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。</u></p> <p><u>3、如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上的，应对估值进行调整并确定公允价值。</u></p> |
| <p>十四、基金资产的估值</p> | <p>(四) 估值方法</p> <p>1、证券交易所上市的有价证券的估值</p> <p>(1) 交易所上市的有价证券（包括股票、权证等，另有规定的除外），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</p> | <p>(五) 估值方法</p> <p>1、证券交易所上市的有价证券的估值</p> <p>(1) 交易所上市的有价证券（包括股票等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券</p> |

| | | |
|---------|--|--|
| | <p>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;</p> <p>(2)交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(另有规定的除外),选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值;</p> <p>(3)交易所市场上市交易的可转换债券,按估值日收盘价减去可转换债券收盘价中所含债券应收利息后得到的净价进行估值;</p> <p>(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。</p> | <p>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;</p> <p>(2)交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(另有规定的除外),选取<u>估值日</u>第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值;</p> <p>(3)交易所上市交易的可转换债券,按估值日收盘价减去可转换债券收盘价中所含债券<u>(税后)</u>应收利息后得到的净价进行估值;估值日没有交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化,按最近交易日债券收盘价减去可转换债券收盘价中所含债券<u>(税后)</u>应收利息后得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种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;</p> <p><u>(4)交易所上市实行全价交易的债券(可转债除外),选取第三方估值机构提供的估值全价减去估值全价中所含的债券(税后)应收利息得到的净价进行估值;</u></p> <p><u>(5)交易所上市不存在活跃市场的有价证券,采用估值技术确定公允价值。交易所市场挂牌转让的资产支持证券,采用估值技术确定公允价值;</u></p> <p><u>(6)对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券,对存在活跃市场的情况下,应以活跃市场上未经调整的报价作为估值日的公允价值;对于活跃市场报价未能代表估值日公允价值的情况下,应对市场报价进行调整以确认估值日的公允价值;对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下,应采用估值技术确定其公允价值。</u></p> |
| 十四、基金资产 | (四) 估值方法 | (五) 估值方法 |

| | | |
|-------------------|---|---|
| <p>的估值</p> | <p>2、<u>证券交易所发行未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：</u></p> <p>（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；</p> <p>（2）首次公开发行未上市的股票和权证，采用估值技术确定公允价值；</p> <p>（3）首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值；</p> <p>（4）交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，采用估值技术确定公允价值。</p> | <p>2、<u>处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：</u></p> <p>（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；<u>该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；</u></p> <p>（2）首次公开发行未上市的股票和债券，采用估值技术确定公允价值，<u>在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；</u></p> <p><u>（3）在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</u></p> |
| <p>十四、基金资产的估值</p> | <p>（四）估值方法</p> <p>3、银行间市场上市交易的固定收益品种，选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值。银行间市场发行未上市的固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。</p> <p>5、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值。</p> | <p>（五）估值方法</p> <p>3、<u>对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种，回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异，未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。</u></p> <p>5、<u>同一证券同时在两个或两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。估值计算中涉及港币对人民币汇率的，将依据下列信息提供机构所提供的汇率为基准：当日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价。</u></p> <p><u>税收：对于按照中国法律法规和基金投资境</u></p> |

| | | |
|--------------------------|---|--|
| | <p>6、<u>摆动定价机制</u>：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。</p> <p>8、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，按法律法规以及监管部门最新规定估值。</p> | <p><u>内外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</u>，本基金将按权责发生制原则进行估值；<u>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</u>，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。</p> <p>6、当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。</p> <p>8、<u>如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的</u>，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。</p> <p>9、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<u>国家</u>最新规定估值。</p> |
| <p>十四、基金资产的估值</p> | <p>(五) 估值程序</p> <p>基金日常估值由基金管理人进行。基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以书面形式报给基金托管人，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人，由基金管理人依据本基金合同和有关法律法规的规定予以公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。</p> <p>(六) 估值错误的处理</p> <p>基金管理人、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</p> | <p>(六) 估值程序</p> <p>1、<u>基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到0.0001元，小数点后第5位四舍五入</u>。基金管理人可以设立<u>大额赎回情形下的净值精度应急调整机制</u>，具体可参见相关公告。国家另有规定的，从其规定。<u>基金管理人于每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。如遇特殊情况，经履行适当程序，可以适当延迟计算或公告。</u></p> <p>2、<u>基金管理人应每个工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或本基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人依据基金合同和相关法律法规的规定对外公布。</u></p> <p>(七) 估值错误的处理</p> <p>基金管理人、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</p> |

| | | |
|--|---|---|
| | <p>性、及时性。</p> <p>本基金合同的当事人应按照以下约定处理：</p> <p>1、<u>差错类型</u></p> <p>本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人或<u>注册登记机构或基金销售机构或投资者自身的过错造成差错</u>，导致其他当事人遭受损失的，<u>差错的责任人应当对由于该差错遭受损失的当事人（“受损方”）按下述“差错处理原则”给予赔偿。</u></p> <p>上述差错的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等；<u>对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平不能预见、不能避免、不能克服，则属不可抗力，按照下述规定执行。</u></p> <p>由于不可抗力原因造成投资者的交易资料灭失或被错误处理或造成其他<u>差错</u>，因不可抗力原因出现<u>差错</u>的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该<u>差错</u>取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。</p> <p>2、<u>差错处理原则</u></p> <p>（1）<u>差错</u>已发生，但尚未给当事人造成损失时，<u>差错</u>责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正<u>差错</u>发生的费用由<u>差错</u>责任方承担；由于<u>差错</u>责任方未及时更正已产生的<u>差错</u>，给当事人造成损失的，由<u>差错</u>责任方承担；若<u>差错</u>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<u>该当事人</u>应当承担相应赔偿责任。<u>差错</u>责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保<u>差错</u>已得到更正；</p> <p>（2）<u>差错</u>的责任方对<u>可能导致</u>有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且</p> | <p>性、及时性。<u>当基金份额净值小数点后4位以内(含第4位)发生估值错误时，视为基金份额净值错误。</u></p> <p>本基金合同的当事人应按照以下约定处理：</p> <p>1、<u>估值错误类型</u></p> <p>本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、<u>或登记机构、或销售机构、或投资人自身的过错造成估值错误</u>，导致其他当事人遭受损失的，<u>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。</u></p> <p>上述<u>估值错误</u>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。<u>对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平无法预见、无法避免、无法抗拒，则属不可抗力，按照下述规定执行。</u></p> <p>由于不可抗力原因造成<u>投资人</u>的交易资料灭失或被错误处理或造成其他<u>错误</u>等，因不可抗力原因出现<u>估值错误</u>的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该<u>估值错误</u>取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。</p> <p>2、<u>估值错误处理原则</u></p> <p>（1）<u>估值错误</u>已发生，但尚未给当事人造成损失时，<u>估值错误</u>责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正<u>估值错误</u>发生的费用由<u>估值错误</u>责任方承担；由于<u>估值错误</u>责任方未及时更正已产生的<u>估值错误</u>，给当事人造成损失的，由<u>估值错误</u>责任方对<u>直接损失承担赔偿责任</u>；若<u>估值错误</u>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<u>其</u>应当承担相应赔偿责任。<u>估值错误</u>责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保<u>估值错误</u>已得到更正。</p> <p>（2）<u>估值错误</u>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</p> |
|--|---|---|

| | |
|--|---|
| <p>仅对<u>差错</u>的有关直接当事人负责,不对第三方负责;—</p> <p>(3) 因<u>差错</u>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<u>差错</u>责任方仍应对<u>差错</u>负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失,则<u>差错</u>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<u>差错</u>责任方;—</p> <p>(4) <u>差错</u>调整采用尽量恢复至假设未发生<u>差错</u>的正确情形的方式;—</p> <p>—(5) <u>差错</u>责任方拒绝进行赔偿时,如果因基金管理人的行为造成基金财产损失时,基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿,如果因基金托管人的行为造成基金财产损失时,基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。基金管理人、基金托管人之外的第三方造成基金财产的损失,并拒绝进行赔偿时,由基金管理人负责向<u>差错</u>方追偿;—</p> <p>—(6) 如果出现<u>差错</u>的当事人未按规定对受损方进行赔偿,并且依据法律法规、基金合同或其他规定,基金管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任,则基金管理人有权向有责任的当事人进行追索,并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失;—</p> <p>—(7)按法律法规规定的其他原则处理<u>差错</u>。</p> <p>3、<u>差错</u>处理程序</p> <p><u>差错</u>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:</p> <p>(1) 查明<u>差错</u>发生的原因,列明所有的当事人,并根据<u>差错</u>发生的原因确定<u>差错</u>的责任方;</p> | <p><u>估值错误</u>的有关直接当事人负责,不对第三方负责。—</p> <p>(3) 因<u>估值错误</u>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<u>估值错误</u>责任方仍应对<u>估值错误</u>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(“<u>受损方</u>”),则<u>估值错误</u>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<u>估值错误</u>责任方。—</p> <p>(4) <u>估值错误</u>调整采用尽量恢复至假设未发生<u>估值错误</u>的正确情形的方式。—</p> <p>—(5) 按法律法规规定的其他原则处理<u>估值错误</u>。</p> <p>3、<u>估值错误</u>处理程序</p> <p><u>估值错误</u>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:</p> <p>(1) 查明<u>估值错误</u>发生的原因,列明所有的当事人,并根据<u>估值错误</u>发生的原因确定</p> |
|--|---|

| | | |
|--|---|--|
| | <p>(2) 根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估;</p> <p>(3) 根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失;</p> <p>(4) 根据差错处理的方法, 需要修改基金注册登记机构交易数据的, 由基金注册登记机构进行更正, 并就差错的更正向有关当事人进行确认。</p> <p>4、基金份额净值差错处理的原则和方法</p> <p>—(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; 当错误达到或超过基金资产净值的0.25%时, 基金管理人应当及时通知基金托管人并报中国证监会; 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、通报基金托管人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。—</p> <p>—(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:—</p> <p>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, 按基金会计责任方的建议执行, 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;—</p> <p>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, 基金份额净值出错且造成基金份额持有人损失的, 应根据</p> | <p><u>估值错误</u>的责任方;</p> <p>(2) 根据<u>估值错误</u>处理原则或当事人协商的方法对因<u>估值错误</u>造成的损失进行评估;</p> <p>(3) 根据<u>估值错误</u>处理原则或当事人协商的方法由<u>估值错误</u>的责任方进行更正和赔偿损失;</p> <p>(4) 根据<u>估值错误</u>处理的方法, 需要修改基金登记机构交易数据的, 由基金登记机构进行更正, 并就<u>估值错误</u>的更正向有关当事人进行确认。</p> <p>4、基金份额净值估值错误处理的方法如下:</p> <p><u>(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。</u></p> <p><u>(2) 错误偏差达到基金份额净值的 0.25% 时, 基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案; 错误偏差达到基金份额净值的 0.5% 时, 基金管理人应当公告, 并报中国证监会备案。</u></p> <p><u>(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。</u></p> |
|--|---|--|

| | | |
|--------------------------|---|--|
| | <p>法律法规的规定对基金份额持有人或基金支付赔偿金,就实际向基金份额持有人或基金支付的赔偿金额,其中基金管理人承担50%,基金托管人承担50%;</p> <p>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;</p> <p>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),基金托管人在履行了正常的复核程序后仍不能发现该错误,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。</p> <p>—(3) 基金管理人和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差,以基金管理人计算结果为准。—</p> <p>—(4) 前述内容如法律法规或者监管部门另有规定的,从其规定。如果行业有通行做法,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。—</p> | |
| <p>十四、基金资产的估值</p> | <p>(七) 暂停估值的情形</p> <p>1、基金投资所涉及的证券/期货交易所遇法定节假日或因其他原因暂停交易时;</p> <p>2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时;</p> <p>3、当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时,经与基金托管人协商确认后,基金管理人应当暂停基金估值;</p> <p>4、中国证监会和基金合同认定的其他情形。</p> | <p>(八) 暂停估值的情形</p> <p>1、基金投资所涉及的证券、期货市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;</p> <p>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;</p> <p>3、当特定资产占前一估值日基金资产净值50%以上的,经与基金托管人协商确认后,基金管理人应当暂停估值;</p> <p>4、<u>法律法规</u>、中国证监会和基金合同认定的其它情形。</p> |
| <p>十四、基金资产的估值</p> | <p>(六) 基金净值的确认</p> <p>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</p> | <p>(九) 基金净值的确认</p> <p>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</p> |

| | | |
|-------------|---|---|
| | <p>人负责进行复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后将当日的净值计算结果发送给基金托管人。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，由基金管理人依据本基金合同和有关法律法规的规定对基金净值予以公布。</p> <p>基金份额净值的计算精确到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。</p> | <p>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，由基金管理人依据基金合同和<u>相关法律法规</u>的规定对基金净值予以公布。</p> |
| 十四、基金资产的估值 | <p>(九) 特殊情形的处理</p> <p>1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第5项进行估值时，所造成的误差不得作为基金资产估值错误处理。</p> <p>2、由于<u>证券/期货交易所或登记结算公司、证券经纪机构、期货经纪公司发送的数据错误，有关会计制度变化或由于其他不可抗力原因</u>，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。</p> | <p>(<u>十</u>) 特殊情形的处理</p> <p>1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第<u>8</u>项进行估值时，所造成的误差不得作为基金资产估值错误处理。</p> <p>2、由于<u>不可抗力原因，或由于证券、期货交易所、证券经纪机构、期货公司及登记结算公司发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等</u>，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资产估值错误，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。</p> |
| 十四、基金资产的估值 | | <p><u>(十一)实施侧袋机制期间的基金资产估值</u> 本基金实施侧袋机制的，应根据本部分的约定对主袋账户资产进行估值并披露主袋账户的基金净值信息，暂停披露侧袋账户份额净值。</p> |
| 十五、基金的费用与税收 | <p>(一) 基金费用的种类</p> <p>9、按照国家有关规定可以在基金财产中列支的其他费用。</p> | <p>(一) 基金费用的种类</p> <p><u>9、基金的开户费用、账户维护费用；</u></p> <p><u>10、因投资港股通标的股票而产生的各项合理费用；</u></p> <p><u>11、本基金从C类基金份额的基金财产中计提的销售服务费；</u></p> <p><u>12、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。</u></p> |
| 十五、基金的费用 | <p>(二) 基金费用计提方法、计提标准和支付</p> | <p>(二) 基金费用计提方法、计提标准和支付</p> |

| | | |
|--------------------|--|--|
| <p>用与税收</p> | <p>方式</p> <p>1、基金管理人的管理费</p> <p>在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：</p> <p>2、基金托管人的托管费</p> <p>在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：</p> <p>3、上述（一）中 3到9项费用由基金托管人根据其他有关法律法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。</p> | <p>方式</p> <p>1、基金管理人的管理费</p> <p>在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 <u>1.5%</u>年费率计提。计算方法如下：</p> <p>2、基金托管人的托管费</p> <p>在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 <u>0.25%</u>年费率计提。计算方法如下：</p> <p><u>3、C类基金份额的销售服务费</u></p> <p><u>本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.4%年费率计提。计算方法如下：</u></p> <p><u>$H = E \times 0.4\% \div \text{当年天数}$</u></p> <p><u>H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费</u></p> <p><u>E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值</u></p> <p><u>C 类基金份额销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人代付给销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。</u></p> <p><u>C 类基金份额的销售服务费将专门用于本基金的市场推广、销售与基金份额持有人服务。</u></p> <p>4、上述“(一)基金费用的种类”中第 <u>3 到 10 项、第 12 项</u>费用，由基金托管人根据其他有关法律法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。</p> <p><u>(四) 实施侧袋机制期间的基金费用</u></p> <p><u>本基金实施侧袋机制的，与侧袋账户有关的费用可以从侧袋账户中列支，但应待侧袋账户资产变现后方可列支，有关费用可酌情收取或减免，但不得收取管理费，详见招募说</u></p> |
|--------------------|--|--|

| | | |
|-------------|---|--|
| | | 明书的规定。 |
| 十六、基金的收益与分配 | <p>(三) 收益分配原则</p> <p>本基金收益分配应遵循下列原则：</p> <p>1.本基金的每份基金份额享有同等分配权；</p> <p>2.在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为10次，每份基金份额每次分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的10%；若基金合同生效不满3个月，可不进行收益分配；</p> <p>3.基金收益分配基准日的基金份额净值减去每份基金份额收益分配金额后不能低于面值；</p> <p>4.本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，基金投资者可选择现金红利或将现金红利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；</p> | <p>(三) 收益分配原则</p> <p>本基金收益分配应遵循下列原则：</p> <p>1、<u>由于本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同；本基金同一基金份额类别的每一基金份额享有同等分配权；</u></p> <p>2、<u>在符合有关基金分红条件的前提下，本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；</u></p> <p>3、<u>基金收益分配后任一类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的任一类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；</u></p> <p>4、<u>本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，基金投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金份额持有人可对其持有的A类基金份额和C类基金份额分别选择不同的收益分配方式；</u></p> |
| 十六、基金的收益与分配 | <p>(六) 收益分配中发生的费用</p> <p>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，注册登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。</p> | <p>(六) 收益分配中发生的费用</p> <p><u>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，注册登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为相应类别的基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。</u></p> |
| 十六、基金的收益与分配 | | <p>(七) <u>实施侧袋机制期间的收益分配</u></p> <p><u>本基金实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配，详见招募说明书的规定。</u></p> |
| 十七、基金的会 | (二) 基金的审计 | (二) 基金的审计 |

| | | |
|-------------------|---|--|
| <p>计和审计</p> | <p>1、基金管理人聘请具有<u>证券、期货相关业务资格</u>的会计师事务所及其注册会计师对本基金年度财务报表及其他规定事项进行审计。会计师事务所及其注册会计师与基金管理人、基金托管人相互独立。</p> | <p>1、基金管理人聘请符合《<u>中华人民共和国证券法</u>》规定的会计师事务所及其注册会计师对本基金年度财务报表及其他规定事项进行审计。会计师事务所及其注册会计师与基金管理人、基金托管人相互独立。</p> |
| <p>十八、基金的信息披露</p> | <p>(二) 信息披露义务人 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<u>中国证监会指定的全国性报刊(以下简称“指定报刊”)</u>及<u>指定互联网网站(以下简称“指定网站”)</u>等媒介披露,并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。</p> | <p>(二) 信息披露义务人 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符合<u>中国证监会规定条件的全国性报刊(以下简称“规定报刊”)</u>及《<u>信息披露办法</u>》规定的<u>互联网网站(以下简称“规定网站”)</u>等媒介披露,并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。</p> |
| <p>十八、基金的信息披露</p> | <p>(五) 公开披露的基金信息 公开披露的基金信息包括: 1、招募说明书、基金合同、托管协议、基金产品资料概要 基金经中国证监会准予变更注册后,基金管理人根据《<u>信息披露办法</u>》的规定将招募说明书、基金合同摘要登载在<u>指定媒介</u>上;基金管理人、基金托管人应当将基金合同、托管协议登载在网站上。</p> | <p>(五) 公开披露的基金信息 公开披露的基金信息包括: 1、招募说明书、基金合同、托管协议、基金产品资料概要 基金经中国证监会准予变更注册后,基金管理人根据《<u>信息披露办法</u>》的规定将招募说明书、基金合同登载在<u>规定网站</u>上;基金管理人、基金托管人应当将基金合同、托管协议登载在网站上。</p> |
| <p>十八、基金的信息披露</p> | <p>(五) 公开披露的基金信息 2、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发售公告,并在披露招募说明书的当日登载于<u>指定媒介</u>上。 3、基金开始申购、赎回公告 基金管理人应于申购开始日、赎回开始日前在<u>指定媒介</u>上公告。</p> | <p>(五) 公开披露的基金信息</p> |
| <p>十八、基金的信息披露</p> | <p>(五) 公开披露的基金信息 5、基金净值信息 《基金合同》生效后,在开始办理基金份额申购或者赎回前,基金管理人应当至少每周在<u>指定网站</u>披露一次基金份额净值和基金份额累计净值。</p> | <p>(五) 公开披露的基金信息 3、基金净值信息 《基金合同》生效后,在开始办理基金份额申购或者赎回前,基金管理人应当至少每周在<u>规定网站</u>分别披露一次 <u>A 类基金份额和 C 类基金份额</u>所对应的基金份额净值和基</p> |

| | | |
|------------|---|--|
| | <p>在开始办理基金份额申购或者赎回后,基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日,通过指定网站、销售机构网站或者营业网点披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。</p> <p>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。</p> | <p>基金份额累计净值。</p> <p>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,通过规定网站、销售机构网站或者营业网点分别披露开放日的 A 类基金份额和 C 类基金份额所对应的基金份额净值和基金份额累计净值。</p> <p>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<u>规定网站</u>披露半年度和年度最后一日 A 类基金份额和 C 类基金份额所对应的基金份额净值和基金份额累计净值。</p> |
| 十八、基金的信息披露 | <p>(五) 公开披露的基金信息</p> <p>6、基金定期报告,包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告</p> <p>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。</p> <p>《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。</p> | <p>(五) 公开披露的基金信息</p> <p>4、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</p> <p>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<u>规定网站</u>上,并将年度报告提示性公告登载在<u>规定报刊</u>上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计。</p> |
| 十八、基金的信息披露 | <p>(五) 公开披露的基金信息</p> <p>7、临时报告</p> <p>(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;</p> <p>(16) 基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五;</p> | <p>(五) 公开披露的基金信息</p> <p>5、临时报告</p> <p>(15) 管理费、托管费、<u>销售服务费</u>、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更;</p> <p>(16) <u>任一</u>类基金份额净值计价错误达<u>该类</u>基金份额净值百分之零点五;</p> <p><u>(24) 本基金连续 30 个工作日、40 个工作日、45 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;</u></p> <p>8、<u>实施侧袋机制期间的信息披露</u></p> <p><u>本基金实施侧袋机制的,相关信息披露义务人应当根据法律法规、基金合同和招募说明</u></p> |

| | | |
|--|--|---|
| | <p>10、基金投资股指期货情况 本基金投资股指期货,基金管理人需按照法规要求在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书(更新)等文件中披露股指期货交易情况,包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等,并充分揭示股指期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标等。</p> <p>11、基金投资资产支持证券情况 本基金投资资产支持证券,基金管理人应在基金年度报告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末所有的资产支持证券明细。基金管理人应在基金季度报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期末按市值占基金净资产比例大小排序的前10名资产支持证券明细。</p> <p>12、基金投资流通受限证券情况 本基金投资流通受限证券,基金管理人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。</p> | <p>书的规定进行信息披露,详见招募说明书的规定。</p> <p>9、清算报告 <u>基金合同终止的,基金管理人应当依法组织清算小组对基金财产进行清算并作出清算报告。清算报告应当经过符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计,并由律师事务所出具法律意见书。清算小组应当将清算报告登载在规定网站上,并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。</u></p> <p>10、基金投资股指期货情况 本基金可投资股指期货,基金管理人需按照法规要求在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书(更新)等文件中披露股指期货交易情况,包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等,并充分揭示股指期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标等。</p> <p>11、基金投资资产支持证券情况 本基金可投资资产支持证券,基金管理人应在基金年度报告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末所有的资产支持证券明细。基金管理人应在基金季度报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期末按市值占基金净资产比例大小排序的前10名资产支持证券明细。</p> <p>12、基金投资流通受限证券情况 本基金可投资流通受限证券,基金管理人应在基金投资非公开发行股票后两个交易日内,在中国证监会规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。</p> <p>13、基金投资港股通标的股票情况 <u>基金应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书(更新)等文件中披露港股通标的股票的投资情况。法律法规</u></p> |
|--|--|---|

| | | |
|-----------------------|--|--|
| | | 或中国证监会另有规定的，从其规定。 |
| 十八、基金的信息披露 | （七）信息披露文件的存放与查阅 依法必须披露的信息发布后，基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于各自住所，供社会公众查阅、复制。 | （七）信息披露文件的存放与查阅 依法必须披露的信息发布后，基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于各自 <u>办公场所</u> ，供社会公众查阅、复制。 |
| 十九、基金合同的变更、终止与基金财产的清算 | （一）基金合同的变更 2.但出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会决议，由基金管理人和基金托管人同意变更后公布经修订的基金合同，并报中国证监会备案： （1）在法律法规和本基金合同规定的范围内调整基金的申购费率、调低赎回费率、变更或增加收费方式； | （一）基金合同的变更 2.但出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会决议，由基金管理人和基金托管人同意变更后公布经修订的基金合同，并报中国证监会备案： （1）在法律法规和本基金合同规定的范围内调整基金的申购费率、调低赎回费率及 <u>销售服务费率</u> 、变更或增加收费方式； |
| 十九、基金合同的变更、终止与基金财产的清算 | （二）本基金合同的终止 有下列情形之一的，本基金合同应当终止： 4.相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。 | （二）本基金合同的终止 有下列情形之一的，本基金合同应当终止： 4. <u>连续50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，基金合同终止，不需召开基金份额持有人大会；</u> 5. <u>基金合同、</u> 相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。 |
| 十九、基金合同的变更、终止与基金财产的清算 | （三）基金财产的清算 1.基金财产清算小组 （2）基金清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金清算小组可以聘用必要的工作人员。 6.基金财产清算账册及文件的保存 基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 <u>15年以上</u> 。 | （三）基金财产的清算 1.基金财产清算小组 （2）基金清算小组成员由基金管理人、基金托管人、 <u>符合《中华人民共和国证券法》</u> 规定的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金清算小组可以聘用必要的工作人员。 6.基金财产清算账册及文件的保存 基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 <u>不低于法律法规规定的最低期限</u> 。 |
| 二十、违约责任 | （一）基金管理人、基金托管人在履行各自职责的过程中，违反《基金法》规定或者本基金合同约定，给基金财产或者基金份额持有人造成损害的，应当分别对各自的行为依 | （一）基金管理人、基金托管人在履行各自职责的过程中，违反《基金法》规定或者本基金合同约定，给基金财产或者基金份额持有人造成损害的，应当分别对各自的行为依 |

| | | |
|-------------|---|---|
| | 法承担赔偿责任;因共同行为给基金财产或者基金份额持有人造成损害的,应当承担连带赔偿责任。对损失的赔偿,仅限于直接损失。但是发生下列情况的,当事人可以免责: | 法承担赔偿责任;因共同行为给基金财产或者基金份额持有人造成损害的,应当承担连带赔偿责任。对损失的赔偿,仅限于直接损失。但是发生下列情况的,当事人免责: |
| 二十、违约责任 | (五)由于不可抗力,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,由此造成基金财产或基金投资者损失,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减轻或消除由此造成的影响。 | (五)由于基金管理人、基金托管人不可控制的因素导致业务出现差错,基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查,但是未能发现该错误的,由此造成基金财产或基金投资者损失,基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。 |
| 二十一、争议的处理 | 对于因本基金合同产生或与本基金合同有关的争议,基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的,任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会,按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的,对当事人均有约束力。 本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。 | 对于因本基金合同产生或与本基金合同有关的争议,基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的,任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会,按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的,对当事人均有约束力。 <u>除非仲裁裁决另有规定,仲裁费由败诉方承担。</u> 本基金合同适用中华人民共和国法律(不含港澳台地区法律)并从其解释。 |
| 二十二、基金合同的效力 | (一)本基金合同由原《交银施罗德先进制造混合型证券投资基金基金合同》修订而来,经基金管理人和基金托管人加盖公章以及双方法定代表人或授权代表签章,并经基金管理人向中国证监会办理基金变更注册手续获得中国证监会书面确认。经 2018年3月20日交银施罗德先进制造混合型证券投资基金的基金份额持有人大会决议通过,并报中国证监会备案,自 2018年3月21日起修订后的基金合同生效。基金合同的有效期限自其生效之日起至该基金财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止。 | (一)本基金合同由原《交银施罗德先进制造混合型证券投资基金基金合同》修订而来,经基金管理人和基金托管人加盖公章以及双方法定代表人或授权代表签章,并经基金管理人向中国证监会办理基金变更注册手续获得中国证监会书面确认。经 2021年XX月XX日交银施罗德先进制造混合型证券投资基金的基金份额持有人大会决议通过,并报中国证监会备案,自 2021年XX月XX日起修订后的基金合同生效。基金合同的有效期限自其生效之日起至该基金财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止。 |

