

# 民生加银新能源智选混合型发起式证券 投资基金招募说明书

基金管理人：民生加银基金管理有限公司

基金托管人：中信银行股份有限公司

二〇二一年九月

## 重要提示

民生加银新能源智选混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）经2021年7月30日中国证监会证监许可【2021】2588号文注册。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值及市场前景做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

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

基金在投资运作过程中可能面临各种风险，既包括市场风险，也包括基金自身的管理风险、技术风险、合规风险以及本基金特有风险等。巨额赎回风险是开放式基金所特有的一种风险，即当单个开放日基金的净赎回申请超过上一开放日基金总份额的百分之十时，投资人将可能无法及时赎回持有的全部基金份额。

本基金是混合型证券投资基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金、但低于股票型基金。投资者应当认真阅读基金合同、招募说明书、基金产品资料概要等基金信息披露文件，了解基金的风险收益特征，根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和自身的风险承受能力相适应，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，并通过基金管理人或基金管理人委托的具有基金销售业务资格的其他机构购买基金。

本基金的投资范围包括存托凭证，若投资可能面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与创新企业、境外发行人、中国存托凭证发行机制以及交易机制等相关的风险。

基金管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。本基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现，基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自

行负担。投资有风险，投资人认购（或申购）本基金时应认真阅读本招募说明书。

本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过50%的除外。基金管理人、基金管理人高级管理人员或基金经理作为发起资金提供方除外。法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

## 目 录

重要提示.....	1
第一部分 绪言.....	4
第二部分 释义.....	5
第三部分 基金管理人.....	11
第四部分 基金托管人.....	29
第五部分 相关服务机构.....	34
第六部分 基金的募集.....	36
第七部分 基金备案.....	42
第八部分 基金份额的申购、赎回 .....	44
第九部分 基金的投资.....	56
第十部分 基金的财产.....	67
第十一部分 基金资产估值.....	68
第十二部分 基金费用与税收.....	75
第十三部分 基金的收益与分配.....	78
第十四部分 基金的会计与审计.....	80
第十五部分 基金的信息披露.....	81
第十六部分 侧袋机制.....	88
第十七部分 风险揭示.....	91
第十八部分 基金合同的变更、终止与基金财产清算.....	99
第十九部分 基金合同内容摘要.....	101
第二十部分 基金托管协议内容摘要.....	102
第二十一部分 对基金份额持有人的服务.....	103
第二十二部分 其他应披露事项.....	105
第二十三部分 招募说明书的存放及查阅方式.....	106
第二十四部分 备查文件.....	107

## 第一部分 绪言

《民生加银新能源智选混合型发起式证券投资基金招募说明书》（以下简称“招募说明书”或“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销售机构监督管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）及其他有关法律法规与《民生加银新能源智选混合型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。

本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集。本招募说明书由基金管理人解释。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写，并经中国证监会注册。基金合同是约定基金合同当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人，直至其不再持有本基金的基金份额，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的完全承认和接受，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。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。

## 第二部分 释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

- 1、基金或本基金：指民生加银新能源智选混合型发起式证券投资基金
- 2、基金管理人：指民生加银基金管理有限公司
- 3、基金托管人：指中信银行股份有限公司
- 4、基金合同：指《民生加银新能源智选混合型发起式证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充
- 5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《民生加银新能源智选混合型发起式证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
- 6、招募说明书或本招募说明书：指《民生加银新能源智选混合型发起式证券投资基金招募说明书》及其更新
- 7、基金份额发售公告：指《民生加银新能源智选混合型发起式证券投资基金基金份额发售公告》
- 8、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等
- 9、《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，经 2012 年 12 月 28 日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自 2013 年 6 月 1 日起实施，并经 2015 年 4 月 24 日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修正的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 10、《销售办法》：指中国证监会 2020 年 8 月 28 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 11、《信息披露办法》：指中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1 日实施的，并经 2020 年 3 月 20 日中国证监会《关于修改部分证券期货规章的

决定》修正的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

12、《运作办法》：指中国证监会 2014 年 7 月 7 日颁布、同年 8 月 8 日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

13、《流动性风险管理规定》：指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《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

14、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

15、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行保险监督管理委员会

16、基金合同当事人：指受基金合同约束，根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人

17、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

18、机构投资者：指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织

19、合格境外投资者：指符合《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》（包括其不时修订）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

20、投资人、投资者：指个人投资者、机构投资者、发起资金提供方、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人的合称

21、基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人

22、发起式基金：指基金管理人按照《运作办法》及中国证监会的规定募集基金时，使用基金管理人股东资金、基金管理人固有资金、基金管理人高级管理人员或者基金经理等人员资金认购基金的金额不少于一千万元人民币，且持有期不少于三年的证券投资基金

23、发起资金：指用于认购发起式基金且来源于基金管理人的股东资金、基金管理人固有资金、基金管理人的高级管理人员或基金经理等人员的资金

24、发起资金提供方：指以发起资金认购本基金且承诺以发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年的基金管理人的股东、基金管理人、基金管理人高级管理人员或基金经理（指基金管理人员中依法具有基金经理资格者，包括但不限于本基金的基金经理，同时也包括基金经理之外公司投研人员）等人员

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：指民生加银基金管理有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务协议，办理基金销售业务的机构

27、登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等

28、登记机构：指办理登记业务的机构。基金的登记机构为民生加银基金管理有限公司或接受民生加银基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构

29、基金账户：指登记机构为投资人开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户

30、基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构办理认购、申购、赎回、转换及转托管等业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户

31、基金合同生效日：指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期

32、基金合同终止日：指基金合同规定的基金合同终止事由出现后，基金财产清算完毕，清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期

33、基金募集期：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过 3 个月

34、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限



- 35、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日
- 36、T 日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日
- 37、T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日(不包含 T 日)
- 38、开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日
- 39、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
- 40、《业务规则》：指《民生加银基金管理有限公司开放式基金业务规则》，是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金登记方面的业务规则，由基金管理人和投资人共同遵守
- 41、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
- 42、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
- 43、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
- 44、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
- 45、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
- 46、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
- 47、巨额赎回：指本基金单个开放日，基金净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过上一开放日基金总份额的 10%
- 48、元：指人民币元
- 49、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

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

51、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

52、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

53、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

54、流动性受限资产：指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等

55、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

56、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

57、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

58、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

59、不可抗力：指基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

60、A 类基金份额：指在投资人认购、申购时收取认购、申购费用，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额

61、C 类基金份额：指在投资人认购、申购时不收取认购、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

62、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

63、基金产品资料概要：指《民生加银新能源智选混合型发起式证券投资基金基金产品资料概要》及其更新

## 第三部分 基金管理人

### 一、基金管理人概况

名称：民生加银基金管理有限公司

住所：深圳市福田区莲花街道福中三路2005号民生金融大厦13楼13A

办公地址：深圳市福田区莲花街道福中三路2005号民生金融大厦13楼13A

法定代表人：张焕南

成立时间：2008年11月3日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监许可[2008]1187号

组织形式：有限责任公司（中外合资）

注册资本：叁亿元人民币

存续期间：永续经营

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务

股权结构：公司股东为中国民生银行股份有限公司（持股63.33%）、加拿大皇家银行（持股30%）、三峡财务有限责任公司（持股6.67%）。

电话：010-68960030

传真：010-88566500

联系人：张冬梅

民生加银基金管理有限公司设有股东会、董事会、监事会；董事会下设专门委员会：审计委员会、合规与风险管理委员会、薪酬与提名委员会；经营管理层下设专门委员会：投资决策委员会、风险控制委员会、公募产品委员会和私募产品委员会，以及设立常设部门。投资决策委员会下设权益资产条线投资决策委员会、固收资产条线投资决策委员会、大类资产配置条线投资决策委员会、基金投资顾问投资决策委员会等四个资产条线投决会；常设部门包括：投资部、成长投资部、权益研究部、固定收益部、固收研究部、专户理财一部、专户理财二部、资产配置部、量化投资部、产品研发部、渠道管理部、机构一部、机构二部、机构三部、电子商务部、客户服务部、交易部、监察稽核部、风险管理部、运营管理部、信息技术部、深圳管理总部、综合管理部、办公

室、纪检监察室等部门。

## 二、主要人员情况

### 1、董事会成员基本情况

张焕南先生：董事长，硕士。历任宜兴市实验小学校长，无锡市委办公室副主任，市委副秘书长，江苏省政府办公厅财贸处处长，中国银监会江苏监管局调研员，中国银监会银行监管一部副主任，海南省政府副秘书长、研究室主任，民生银行董事会战投办主任。现任民生加银基金管理有限公司党委书记、董事长，民生加银资产管理有限公司党委书记、董事长。

李操纲先生：董事、总经理，博士。历任江苏经济管理干部学院经济系教师，华夏证券有限公司东四营业部副总经理、华夏证券有限公司清算中心总经理、华夏基金管理有限公司副总经理，中国金融在线有限公司首席运营官，阳光保险集团股份有限公司执行委员会委员，鹏扬基金管理有限公司副总经理。2019年3月加入民生加银基金管理有限公司，现任民生加银基金管理有限公司总经理。

宋永明先生：董事、副总经理，博士。历任中国建设银行山西省分行计划财务部科员，中国人民银行银行管理司监管制度处主任科员，中国银监会银行监管一部国有银行改革办公室秘书处主任科员，中国银监会人事部（党委组织部）综合处、机关人事处副处长，中国银监会办公厅处长，中国银监会城市银行部综合处兼城商行监管处处长，中国银监会国有重点金融机构监事会副巡视员（副局级）。2017年7月加入民生加银基金管理有限公司，现任民生加银基金管理有限公司党委委员、副总经理。

James Brace 先生：董事，学士。历任 Slaughter and May（司力达律师事务所）律师，Baring Asset Management Limited（霸菱资产管理）英国法律主管，UBS Phillip & Drew Asset Management 英国法律主管等职务。现任加拿大皇家银行子公司 BlueBay Asset Management LLP 总法律顾问、管理委员会成员，兼任 BlueBay Asset Management International Limited 执行董事、BlueBay Asset Management Corporation Limited 执行董事，民生加银资产管理有限公司董事。

王维绛先生：董事，学士。历任外汇管理局储备管理司副司长及首席投资官、汇丰集团伦敦总部及香港分行全球市场部董事总经理、加拿大皇家银行香

港分行资本市场部董事总经理、加拿大皇家银行北京分行行长。现任加拿大皇家银行董事总经理、香港分行中国区 CEO。

刘云德先生：董事，硕士。历任三峡财务有限责任公司综合管理部副经理、办公室副经理、党群工作部经理、稽核审计部经理等职务，现任三峡财务有限责任公司投资银行部经理。

任淮秀先生：独立董事，经济学博士。历任中国人民大学工业经济系讲师，基本建设经济教研室主任、党支部书记，投资经济系副系主任，投资经济系副教授，财金学院投资经济系系主任，人民大学财金学院副院长。现任中国人民大学财政金融学院教授委员会副主席，航天科技财务有限责任公司独立董事，北京农商银行独立董事。

吕益民先生：独立董事，博士，高级工程师。历任山西师范大学政教系教师，联想集团企划部经理，北京京华信托投资公司子公司总裁助理、副总裁，国家开发投资公司金融资产管理部主任兼国融资产管理公司总经理（法人代表）、金融投资部副总经理、战略发展部副主任兼国家开发投资公司研究中心主任，国投信托有限公司副总经理（主持工作）、总经理，中国融资租赁有限公司总裁、副董事长。现任中国海外控股集团有限公司首席经济学家，民建中央财政金融委员会副主任，南宁市政府顾问，中国社会科学院研究生院导师，晋能控股山西电力股份有限公司（上市公司）独立董事，读者传媒集团股份有限公司（上市公司）独立董事，重庆三峡银行股份有限公司独立董事，天银金融租赁股份有限公司外部监事，北京长峰医院股份有限公司监事会主席（外部监事）。

于学会先生：独立董事，学士。从事过 10 年企业经营管理工作。历任北京市汉华律师事务所律师、北京市必浩得律师事务所合伙人、律师。现任北京市众天律师事务所合伙人、律师，鲁证期货有限公司监事，信达期货有限公司独立董事，湖南艾美仑传媒有限公司董事，瑞达期货股份有限公司独立董事。

## 2、监事会成员基本情况

朱晓光先生：监事会主席，硕士，高级经济师。历任中国银行北京分行财会部副科长，中国民生银行总行财会部会计处处长，中国民生银行福州分行副行长，中国民生银行中小企业金融部副总经理兼财务总监，民生加银基金管理有限公司督察长、副总经理。现任民生加银基金管理有限公司监事会主席。

洗炳坤先生：北京大学法学学士、加拿大西安大略大学工商管理硕士。曾任香港人民入境事务处入境事务主任、香港邓何贝王律师行见习律师、法国东方汇理银行香港分行法律经理、法国兴业银行香港分行法律部经理、瑞士银行香港分行法律部董事、摩根大通银行香港分行中国合规部门主管（执行董事）。自 2008 年至今就职于加拿大皇家银行香港分行，现任亚太区法律部门主管（董事总经理），香港律师会会员，香港律师会海外律师委员会委员，香港证券及投资学会会员。

刘大明先生：监事，博士。历任北京师范大学出版社职员，北京光磊（博诚慧）文化发展有限公司业务主管，三峡财务有限责任公司研究发展部研究员及投资银行部研究员、部门经理助理。现任三峡财务有限责任公司投资银行部部门副经理，陕西煤业化工集团财务有限公司董事。

董文艳女士：监事，学士。曾就职于河南叶县教育局办公室从事统计工作，中国人民银行外管局从事稽核检查工作。2008 年加入民生加银基金管理有限公司，现任民生加银基金管理有限公司深圳管理总部负责人兼工会办公室主任。

刘静女士：监事，博士。曾就职于中国证监会稽查总队、稽查局。2015 年加入民生加银基金管理有限公司，现任民生加银基金管理有限公司风险管理部总监。

李杨女士：监事，硕士。曾就职于广发银行北京分行。2012 年加入民生加银基金管理有限公司，现任民生加银基金管理有限公司电子商务部总监。

### 3、高级管理人员基本情况

张焕南先生：董事长，简历见上。

李操纲先生：总经理，简历见上。

宋永明先生：副总经理，简历见上。

于善辉先生：副总经理，硕士。历任天相投资顾问有限公司董事、副总经理。2012 年加入民生加银基金管理有限公司，曾兼任金融工程与产品部总监、总经理助理。现任民生加银基金管理有限公司党委委员、副总经理。

邢颖女士：督察长，博士。历任中国人民武装警察部队学院法律教研室副教授、北京观韬律师事务所律师、湘财荷银基金管理有限公司产品部经理及监察稽核部副总监、大成基金管理有限公司监察稽核部经理、泰达宏利基金管理

有限公司法律合规部总经理、方正富邦基金管理有限公司监察稽核部总监，2012年4月加入民生加银基金管理有限公司，现任民生加银基金管理有限公司督察长，民生加银资产管理有限公司监事。

王国栋先生：副总经理，硕士。历任金融时报社证券新闻部、总编室编辑、记者，中国人民财产保险股份有限公司党委办公室/办公室品牌宣传处副处长、高级业务主管，中国出口信用保险公司党委办公室/办公室处长、主任助理，中国出口信用保险公司上海分公司党委委员、总经理助理，中国出口信用保险公司党委办公室/办公室副主任。2016年6月加入民生加银基金管理有限公司，曾任党委委员、董事会秘书，现任民生加银基金管理有限公司党委委员、副总经理。

朱永明先生：董事会秘书、财务负责人，硕士。曾就职于中国银行总行营业部，中国民生银行总行公司银行部、小企业金融事业部、董事会战略发展与投资管理委员会办公室。2018年加入民生加银基金管理有限公司，曾任总经理助理，现任董事会秘书、财务负责人，兼任综合管理部总监、办公室主任。

#### 4、本基金拟任基金经理

何江先生：清华大学流体力学硕士，16年证券从业经历，曾在上海海狮资产管理有限公司任投资总监、副总经理；工银瑞信基金管理有限公司指数投资部任基金经理、副总监，风险管理部数量分析师、高级经理、业务主管；金诚国际信用评估有限公司任信用分析师；北京方速信融有限公司任高级分析师；北京色诺芬信息服务有限公司任合伙人、研究部负责人。2019年4月加入民生加银基金管理有限公司，现任量化投资部总监、大类资产配置条线投资决策委员会联席主席、基金经理，自2019年12月至今担任民生加银沪深300交易型开放式指数证券投资基金、民生加银沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；自2020年12月至今担任民生加银中证200指数增强型发起式证券投资基金基金经理。

#### 5、投资决策委员会

公司设投资决策委员会，下设权益资产条线投资决策委员会、固收资产条线投资决策委员会、大类资产配置条线投资决策委员会、基金投资顾问投资决策委员会等四个资产条线投决会。其中：

公司投资决策委员会：



主席：总经理李操纲

成员：董事长张焕南、副总经理于善辉、总经理助理兼专户理财二部总监刘霄汉、投资部总监柳世庆、资产配置部总监苏辛、交易部总监周晓芳

权益资产条线投资决策委员会：

联席主席：投资部总监柳世庆、总经理助理兼专户理财二部总监刘霄汉

成员：董事长张焕南、总经理李操纲、副总经理于善辉、成长投资部总监孙伟、权益研究部总监兼投资部副总监王亮、基金经理高松、交易部总监周晓芳

固收资产条线投资决策委员会：

成员：总经理李操纲、副总经理于善辉、总经理助理兼专户理财二部总监刘霄汉、专户理财一部负责人宋立军、固收研究部总监张汀、交易部总监周晓芳

大类资产配置条线投资决策委员会：

联席主席：资产配置部总监苏辛、量化投资部总监何江

成员：总经理李操纲、副总经理于善辉、交易部总监周晓芳

基金投资顾问投资决策委员会：

主席：资产配置部总监苏辛

成员：副总经理于善辉、权益研究部总监兼投资部副总监王亮、固收研究部总监张汀、交易部总监周晓芳、资产配置部研究员孔思伟

6、上述人员之间不存在亲属关系。

### 三、基金管理人的义务

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

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

2、办理基金备案手续；

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

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

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

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

7、依法接受基金托管人的监督；

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

9、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

10、编制季度报告、中期报告和年度报告；

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

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

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，保存期限不低于法律法规规定的最低期限；

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

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

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

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

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

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

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

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

25、执行生效的基金份额持有人大会的决议；

26、建立并保存基金份额持有人名册；

27、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

#### 四、基金管理人承诺

1、基金管理人承诺严格遵守《中华人民共和国证券法》，并建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止违反《中华人民共和国证券法》行为的发生；

2、基金管理人承诺严格遵守《基金法》、《运作办法》，建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止以下《基金法》、《运作办法》禁止的行为发生：

(1) 将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；

(2) 不公平地对待其管理的不同基金财产；

(3) 利用基金财产或职务之便为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；

(4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；

(5) 侵占、挪用基金财产；

(6) 泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

- (7) 玩忽职守，不按照规定履行职责；
- (8) 法律法规和中国证监会禁止的其他行为。

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

- (1) 越权或违规经营；
- (2) 违反基金合同或托管协议；
- (3) 损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益；
- (4) 在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；
- (5) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
- (6) 玩忽职守、滥用职权，不按照规定履行职责；

(7) 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；利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

(8) 除按法律法规、基金管理公司制度进行基金投资外，直接或间接进行其他股票交易；

(9) 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；

- (10) 故意损害投资人及其他同业机构、人员的合法权益；
- (11) 以不正当手段谋求业务发展；
- (12) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；
- (13) 信息披露不真实，有误导、欺诈成分；
- (14) 法律法规和中国证监会禁止的其他行为。

4、本基金管理人将根据基金合同的规定，按照招募说明书列明的投资目标、策略及限制等全权处理本基金的投资。

5、本基金管理人不得从事违反《基金法》的行为，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，保证基金财产不用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；

- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- (6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

#### 五、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被代理人、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、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，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

4、不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

#### 六、基金管理人的内部控制制度

本基金管理人即民生加银基金管理有限公司（以下简称“公司”）为保证本公司诚信、合法、有效经营，防范、化解经营风险和所管理的资产运作风险，充分保护资产委托人、公司和公司股东的合法权益，依据《基金法》、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》等法律法规和中国证监会的有关文件，以及《民生加银基金管理有限公司章程》，制定《民生加银基金管理有限公司内部控制大纲》。

内部控制体系是指公司为防范和化解风险，保证经营运作符合公司的发展规划，在充分考虑内外部环境的基础上，通过建立组织机制、运用管理方法、实施操作程序与控制措施而形成的系统。内部控制制度是公司为实现内部控制目标而建立的一系列组织机制、管理办法、操作程序与控制措施的总称。

内部控制制度由公司章程、内部控制大纲、基本管理制度、部门管理制度、各项具体业务规则等部分组成。

##### 1、内部控制的总体目标

(1) 保护基金投资人利益不受侵犯，维护股东的合法权益。

(2) 保证公司经营运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念。

(3) 建立和健全法人治理结构，形成合理的决策、执行和监督机制。

(4) 防范和化解经营风险，提高经营管理效益，确保经营业务的稳健运行和受托资产的安全完整，实现公司的持续、稳定、健康发展。

(5) 确保公司经营目标和发展战略的顺利实施。

(6) 确保基金、公司财务和其他信息真实、准确、完整、及时。

## 2、内部控制遵循以下原则

(1) 健全性原则。内部控制须覆盖公司的各项业务、各个部门和各级岗位，并渗透到各项业务过程，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，建立合理适用的内控程序，并适时调整和不断完善，维护内控制度的有效执行。

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

(4) 相互制约原则。公司内部部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡。

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

## 3、制定内部控制制度遵循以下原则

(1) 合法合规性原则。公司内控制度应当符合国家法律、法规、规章和各项规定。

(2) 全面性原则。内部控制制度应当涵盖公司经营管理的各个环节，不得留有制度上的空白和漏洞。

(3) 审慎性原则。制定内部控制制度应当以审慎经营、防范和化解风险为出发点。

(4) 有效性原则。内部控制制度应当是可操作的，有效的。

(5) 适时性原则。内部控制制度的制定应当随着有关法律法规的调整和公司经营战略、经营方针、经营理念等内外部环境的变化进行及时的修改或完善。

## 4、内部控制的基本要素

内部控制的基本要素包括控制环境、风险评估、控制活动、信息沟通和内部监控。

(1) 控制环境构成公司内部控制的基础，控制环境包括经营理念和内控文

化、公司治理结构、组织结构、员工道德素质等内容。

(2) 公司管理层应当牢固树立内控优先和风险管理理念，培养全体员工的风险防范意识，营造一个浓厚的内控文化氛围，保证全体员工及时了解国家法律法规和公司规章制度，使风险意识贯穿到公司各个部门、各个岗位和各个环节。

(3) 公司按“利益公平、信息透明、信誉可靠、责任到位”的基本原则制定治理结构，充分发挥独立董事和监事会的监督职能，严禁不正当关联交易、利益输送和内部人控制现象的发生，保护投资者利益和公司合法权益。

(4) 公司根据健全性、高效性、独立性、制约性、前瞻性及防火墙等原则设计内部组织架构，建立决策科学、运营规范、管理高效的运行机制，包括民主、透明的决策程序和管理议事规则，高效、严谨的业务执行系统，以及健全、有效的内部监督和反馈系统。

各职能部门是公司内部控制的具体实施单位。各部门在公司基本管理制度的基础上，根据具体情况制订本部门的业务管理规定、操作流程及内部控制规定，加强对业务风险的控制。部门管理层应定期对部门内风险进行评估，确定风险管理战略并实施，监控风险管理绩效，以不断改进风险管理能力。

(5) 公司设立顺序递进、权责统一、严密有效的内控防线：

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

2) 建立重要业务处理凭据传递和信息沟通机制，相关部门和岗位之间相互监督制衡。

3) 公司督察长和内部监察稽核部门独立于其他部门，对内部控制制度的执行情况实行严格的检查和反馈。

(6) 内部控制风险评估包括定期和不定期的风险评估、开展新业务之前的风险评估以及违规、投诉、危机事件发生后的风险评估等。

(7) 风险评估是每个控制主体的责任。

1) 董事会下属的合规与风险管理委员会和督察长对公司制度的合规性和有效性进行评估，并对公司与基金运作的合法合规性进行监督检查。

2) 投资决策委员会负责对基金投资过程中的市场风险进行评估和控制。

3) 各级部门负责对职责范围内的业务所面临的风险进行识别和评估。

(8) 授权控制是内部控制活动的基本要点，它贯穿于公司经营活动的始终。授权控制的主要内容包括：

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

2) 公司各业务部门、分支机构和公司员工必须在规定的授权范围内行使相应的职责。

3) 公司业务实行分级授权管理，任何部门和个人不得越级越权办理业务。

4) 公司重大业务的授权必须采取书面形式，授权书须明确授权内容和时效，经授权人签章确认后下达到被授权人，并报有关部门备案。

5) 公司授权要适当，对已获授权的部门和人员须建立有效的评价和反馈机制，对已不适用的授权须及时修改或取消。

(9) 建立完善的资产分离制度，基金资产与公司资产、不同基金的资产和其他委托资产要实行独立运作，单独核算。

(10) 建立科学、严格的岗位分离制度，业务授权、业务执行、业务记录和业务监督严格分离，投资和交易、交易和清算、基金会计和公司会计等重要岗位不得有人员重叠。重要业务部门和岗位须实行物理隔离。

(11) 制定切实有效的应急应变措施，建立危机处理机制和程序。

(12) 采用适当、有效的信息系统，识别、采集、加工并相互交流经营活动所需的一切信息。信息系统须保证业务经营信息和财务会计资料的真实性、准确性和完整性，必须能实现公司内部信息的沟通和共享，促进公司内部管理顺畅实施。

(13) 根据组织架构和授权制度，建立清晰的业务报告系统，凡是属于超越权限的任何决策必须履行规定的请示报告程序。

(14) 内部控制的监督完善由公司合规与风险管理委员会、督察长和监察稽核部等部门在各自的职权范围内开展。必要时，公司董事会、监事会、合规与风险管理委员会、总经理等均可聘请外部专家对公司内部控制进行检查和评价。

(15) 根据市场环境、新的金融工具、新的技术应用和新的法律法规等情况，公司须组织专门部门对原有的内部控制进行全面的检讨，审查其合法合规性、合理性和有效性，适时改进。



## 5、内部控制的主要内容

### (1) 研究业务控制主要内容包括：

- 1) 研究工作应保持独立、客观。
- 2) 建立严密的研究工作业务流程，形成科学、有效的研究方法。
- 3) 建立投资对象备选库制度，研究部门根据基金合同要求，在充分研究的基础上建立和维护备选库。
- 4) 建立研究与投资的业务交流制度，保持通畅的交流渠道。
- 5) 建立研究报告质量评价体系。

### (2) 投资决策业务控制主要内容包括：

- 1) 投资决策应当严格遵守法律法规的有关规定，符合基金合同所规定的投资目标、投资范围、投资策略、投资组合和投资限制等要求。
- 2) 健全投资决策授权制度，明确界定投资权限，严格遵守投资限制，防止越权决策。
- 3) 投资决策应当有充分的投资依据，重要投资要有详细的研究报告和风险分析支持，并有决策记录。
- 4) 建立投资风险评估与管理制度，在设定的风险权限额度内进行投资决策。
- 5) 建立科学的投资管理业绩评价体系，包括投资组合情况、是否符合基金产品特征和决策程序、基金绩效归因分析等内容。

### (3) 基金交易业务控制主要内容包括：

- 1) 基金交易实行集中交易制度，基金经理不得直接向交易员下达投资指令或者直接进行交易。
- 2) 公司应当建立交易监测系统、预警系统和交易反馈系统，完善相关的安全设施。
- 3) 投资指令应进行审核，确认其合法、合规与完整后方可执行，如出现指令违法违规或者其他异常情况，应当及时报告相应部门与人员。
- 4) 公司应当执行公平的交易分配制度，确保不同投资者的利益能够得到公平对待。
- 5) 建立完善的交易记录制度，交易记录应当及时进行反馈、核对并存档保管。

6) 建立科学的交易绩效评价体系。

7) 场外交易、网下申购等特殊交易应当根据内部控制的原则制定相应的流程和规则。

8) 建立严格有效的制度，防止不正当关联交易损害基金份额持有人利益。基金投资涉及关联交易的，应在相关投资研究报告中特别说明，并报公司相关部门批准。

(4) 基金清算和基金会计业务控制主要内容包括：

1) 规范基金清算交割和会计核算工作，在授权范围内，及时准确地完成基金清算，确保基金资产的安全。

2) 基金会计与公司会计在人员、空间、制度上严格分离。

3) 对所管理的基金以基金作为会计核算主体，每只基金分别设立不同的独立账户，进行单独核算，保证不同基金在名册登记、账户设置、资金划转、账簿记录等方面相互独立。

4) 公司应当采取合理的估值方法和科学的估值程序，公允反映基金所投资的有价证券在估值时点的价值。

5) 与托管银行间的业务往来严格按《托管协议》进行，分清权责，协调合作，互相监督。

(5) 基金营销业务控制主要内容包括：

1) 新产品开发前应进行充分的市场调研和可行性论证，进行风险识别，提出风险控制措施。

2) 以竭诚服务于基金投资者为宗旨，开展市场营销、基金销售及客户服务等各项业务，严禁误导和欺骗投资者。

3) 注重对市场的开发和培育，统一部署基金的营销战略计划，建立客户服务体系，为投资者提供周到的售前、售中和售后服务。

4) 以诚信为原则进行基金和公司的对外宣传，自觉维护公司形象。

(6) 信息披露控制主要内容包括：

1) 严格按照法律、法规和中国证监会的有关规定，建立完善的信息披露制度，保证公开披露的信息真实、准确、完整、及时。

2) 公司设立信息披露负责人，负责信息披露工作，进行信息的组织、审核和发布。

3) 公司对信息披露应当进行持续检查和评价,对存在的问题及时提出改进办法,对信息披露出现的失误提出处理意见,并追究相关人员的责任。

4) 公司掌握内幕信息的人员在信息公开披露前不得泄露其内容。

(7) 信息技术系统控制主要内容包括:

1) 根据国家有关法律法规的要求,遵循安全性、实用性、可操作性原则,严格制定信息系统的管理规章、操作流程、岗位手册和风险控制制度。

2) 信息技术系统的设计开发应符合国家、金融行业软件工程标准的要求,编写完整的技术资料;在实现业务电子化时,应设置保密系统和相应控制机制,并保证计算机系统的可稽性。

3) 对信息系统的项目立项、设计、开发、测试、运行和维护整个过程实施明确的责任管理,信息技术系统投入运行前,必须经过业务、运营、监察稽核等部门的联合验收。

4) 公司应当通过严格的授权制度、岗位责任制度、门禁制度、内外网分离制度等管理措施,确保系统安全运行。

5) 计算机机房、设备、网络等硬件要求应符合有关标准,设备运行和维护整个过程实施明确的责任管理,严格划分业务操作、技术维护等方面的职责。

6) 公司软件的使用应充分考虑软件的安全性、可靠性、稳定性和可扩展性,应具备身份验证、访问控制、故障恢复、安全保护、分权制约等功能。

7) 信息技术系统设计、软件开发等技术人员不得介入实际的业务操作。

8) 建立计算机系统的日常维护和管理,数据库和操作系统的密码口令应当分别由不同人员保管。用户使用的密码口令要定期更换,不得向他人透露。

9) 对信息数据实行严格的管理,保证信息数据的安全、真实和完整,并能及时、准确地传递到各职能部门。

10) 严格计算机交易数据的授权修改程序,建立电子信息数据的定期查验制度。

11) 建立电子信息数据的即时保存和备份制度,重要数据应当异地备份并且长期保存。

12) 指定专人负责计算机病毒防范工作,建立定期病毒检测制度。

13) 信息技术系统应当定期稽核检查,完善业务数据保管等安全措施,进

行排除故障、灾难恢复演习，确保系统可靠、稳定、安全地运行。

(8) 公司财务管理控制主要包括：

1) 公司根据国家颁布的会计准则和财务通则，严格按照公司财务和基金财务相互独立的原则制定公司会计制度、财务制度、会计工作操作流程和会计岗位工作手册，并针对各个风险控制点建立严密的会计系统控制。

2) 公司应当明确职责划分，在岗位分工的基础上明确各会计岗位职责，严禁需要相互监督的岗位由一人独自操作全过程。

3) 建立凭证制度，通过凭证设计、登录、传递、归档等一系列凭证管理制度，确保正确记载经济业务，明确经济责任。

4) 建立账务组织和账务处理体系，正确设置会计账簿，有效控制会计记账程序。

5) 建立复核制度，通过会计复核和业务复核防止会计差错的产生。

6) 建立严格的成本控制和业绩考核制度，强化会计的事前、事中和事后监督。

7) 制定财务收支审批制度和费用报销管理办法，自觉遵守国家财税制度和财经纪律。

8) 制定完善的会计档案保管和财务交接制度，财会部门应妥善保管密押、业务用章、支票等重要凭据和会计档案，严格会计资料的调阅手续，防止会计数据的毁损、散失和泄密。

9) 强化财产登记保管和实物资产盘点制度。

(9) 监察稽核控制主要包括：

1) 公司设立督察长，对董事会负责。根据公司监察稽核工作的需要和董事会授权，督察长可以列席公司相关会议，调阅公司相关档案，就内部控制制度的执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能。

2) 督察长应当定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况，董事会应当对督察长的报告进行审议。

3) 公司设立监察稽核部门，对公司经营层负责，开展监察稽核工作，公司应保证监察稽核部门的独立性和权威性。

4) 全面推行监察稽核工作的责任管理制度，明确监察稽核部门各岗位的具体职责，配备充足的监察稽核人员，严格监察稽核人员的专业任职条件，严格

监察稽核的操作程序和组织纪律。

5) 公司应当强化内部检查制度，通过定期或不定期检查内部控制制度的执行情况，确保公司各项经营管理活动的有效运行。

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

#### 6、基金管理人关于内部控制制度的声明

(1) 公司承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确。

(2) 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。

## 第四部分 基金托管人

### 一、基金托管人情况

#### （一）基本情况

名称：中信银行股份有限公司（简称“中信银行”）

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

法定代表人：李庆萍

成立时间：1987年4月20日

组织形式：股份有限公司

注册资本：489.35亿元人民币

存续期间：持续经营

批准设立文号：中华人民共和国国务院办公厅国办函[1987]14号

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[2004]125号

联系人：中信银行资产托管部

联系电话：4006800000

传真：010-85230024

客服电话：95558

网址：bank.ecitic.com

经营范围：保险兼业代理业务；吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；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；提供保管箱服务；结汇、售汇业务；代理开放式基金业务；办理黄金业务；黄金进出口；开展证券投资基金、企业年金基金、保险资金、合格境外机构投资者托管业务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。（企业依法自主选择经营项目，开展经营活动；依法须经批准的项目，经相关部门批准后依批准的内容开展经营活动；不得从事本市产业政策禁止和限制类项目的经营活动。）

中信银行成立于1987年，是中国改革开放中最早成立的新兴商业银行之一，是中国最早参与国内外金融市场融资的商业银行，并以屡创中国现代金融史上多个第一而蜚声海内外，为中国经济建设做出了积极贡献。2007年4月，中信银行实现在上海证券交易所和香港联合交易所A+H股同步上市。

中信银行以建设成为“有担当、有温度、有特色、有价值”的最佳综合金融服务提供者作为发展愿景，充分发挥中信集团“金融+实业”综合平台优势，坚持“以客为尊、改革推动、科技兴行、轻型发展、合规经营、人才强行”，向企业客户和机构客户提供公司银行业务、国际业务、金融市场业务、机构业务、投资银行业务、交易银行业务、托管业务等综合金融解决方案，向个人客户提供零售银行、信用卡、消费金融、财富管理、私人银行、出国金融、电子银行等多元化金融产品及服务，全方位满足企业、机构及个人客户的综合金融服务需求。

截至2020年末，中信银行在国内153个大中城市设有1,405家营业网点，在境内外下设中信国际金融控股有限公司、信银（香港）投资有限公司、中信金融租赁有限公司、信银理财有限责任公司、中信百信银行股份有限公司、阿尔金银行和浙江临安中信村镇银行股份有限公司7家附属机构。其中，中信国际金融控股有限公司子公司中信银行（国际）在香港、澳门、纽约、洛杉矶、新加坡和中国内地设有34家营业网点和2家商务中心。信银（香港）投资有限公司在香港和境内设有3家子公司。信银理财有限责任公司为中信银行全资理财子公司。

中信百信银行股份有限公司为中信银行与百度公司发起设立的国内首家具有独立法人资格的直销银行。阿尔金银行在哈萨克斯坦设有7家营业网点和1个私人银行中心。

中信银行坚持服务实体经济，稳健经营，与时俱进。经过30余年的发展，中信银行已成为一家总资产规模超7万亿元、员工人数近6万名，具有强大综合实力和品牌竞争力的金融集团。

2020年，中信银行在英国《银行家》杂志“全球银行品牌500强排行榜”中排名第21位；中信银行一级资本在英国《银行家》杂志“世界1000家银行排名”中排名第24位。

## （二）主要人员情况

方合英先生，中信银行执行董事、行长兼财务总监。方先生于2018年9月加入中信银行董事会。方先生自2014年8月起任中信银行党委委员，2014年11月起任中

信银行副行长，2017年1月起兼任中信银行财务总监，2019年2月起任中信银行党委副书记。方先生现同时担任信银（香港）投资有限公司、中信银行（国际）有限公司及中信国际金融控股有限公司董事。此前，方先生于2013年5月至2015年1月任中信银行金融市场业务总监，2014年5月至2014年9月兼任中信银行杭州分行党委书记、行长；2007年3月至2013年5月任中信银行苏州分行党委书记、行长；2003年9月至2007年3月历任中信银行杭州分行行长助理、党委委员、副行长；1996年12月至2003年9月在中信银行杭州分行工作，历任信贷部科长、副总经理，富阳支行行长、党组书记，国际结算部副总经理，零售业务部副总经理，营业部总经理；1996年7月至1996年12月任浦东发展银行杭州城东办事处副主任；1992年12月至1996年7月在浙江银行学校实验城市信用社信贷部工作，历任信贷员、经理、总经理助理；1991年7月至1992年12月在浙江银行学校任教师。方先生为高级经济师，毕业于北京大学，获高级管理人员工商管理硕士学位，拥有二十余年中国银行业从业经验。

谢志斌先生，中信银行副行长，分管托管业务。谢先生自2019年6月起担任中信银行副行长，自2019年2月起担任中信银行党委委员。此前，谢先生于2015年7月至2019年1月任中国光大集团股份公司纪委书记、党委委员。2012年3月至2015年7月任中国出口信用保险公司总经理助理，期间于2014年1月至2015年7月挂职任内蒙古自治区呼和浩特市委常委、副市长。2011年3月至2012年3月任中国出口信用保险公司党委委员、总经理助理。2001年10月至2011年3月历任中国出口信用保险公司人力资源部职员、总经理助理、副总经理、总经理（党委组织部部长助理、副部长、部长），深圳分公司党委书记，河北省分公司负责人、党委书记、总经理。1991年7月至2001年10月历任中国人民保险公司科员、主任科员、副处长。谢先生为经济师，毕业于中国人民大学，获经济学博士学位。

杨璋琪先生，中信银行资产托管部总经理，硕士研究生学历。杨先生2018年1月至2019年3月，任中信银行金融同业部副总经理；2015年5月至2018年1月，任中信银行长春分行副行长；2013年4月至2015年5月，任中信银行机构业务部总经理助理；1996年7月至2013年4月，就职于中信银行北京分行（原总行营业部），历任支行行长、投资银行部总经理、贸易金融部总经理。

### （三）基金托管业务经营情况



2004年8月18日，中信银行经中国证券监督管理委员会和中国银行业监督管理委员会批准，取得基金托管人资格。中信银行本着“诚实信用、勤勉尽责”的原则，切实履行托管人职责。

截至2021年第一季度末，中信银行托管202只公开募集证券投资基金，以及基金公司、证券公司资产管理产品、信托产品、企业年金、股权基金、QDII等其他托管资产，托管总规模达到10.97万亿元人民币。

#### （四）基金托管人的内部控制制度

1、内部控制目标。强化内部管理，确保有关法律法规及规章在基金托管业务中得到全面严格的贯彻执行；建立完善的规章制度和操作规程，保证基金托管业务持续、稳健发展；加强稽核监察，建立高效的风险监控体系，及时有效地发现、分析、控制和避免风险，确保基金财产安全，维护基金份额持有人利益。

2、内部控制组织结构。中信银行总行建立了风险管理委员会，负责全行的风险控制和风险防范工作；托管部内设内控合规岗，专门负责托管部内部风险控制，对基金托管业务的各个工作环节和业务流程进行独立、客观、公正的稽核监察。

3、内部控制制度。中信银行严格按照《基金法》以及其他法律法规及规章的规定，以控制和防范基金托管业务风险为主线，制定了《中信银行基金托管业务管理办法》、《中信银行基金托管业务内部控制管理办法》和《中信银行托管业务内控检查实施细则》等一整套规章制度，涵盖证券投资基金托管业务的各个环节，保证证券投资基金托管业务合法、合规、持续、稳健发展。

4、内部控制措施。建立了各项规章制度、操作流程、岗位职责、行为规范等，从制度上、人员上保证基金托管业务稳健发展；建立了安全保管基金财产的物质条件，对业务运行场所实行封闭管理，在要害部门和岗位设立了安全保密区，安装了录像、录音监控系统，保证基金信息的安全；建立严密的内部控制防线和业务授权管理等制度，确保所托管的基金财产独立运行；营造良好的内部控制环境，开展多种形式的持续培训，加强职业道德教育。

#### （五）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

基金托管人根据《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同、托管协议和有关法律法规及规章的规定，对基金的投资运作、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的基金业绩表现数据等进行监督和核查。

如基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同和有关法律法规及规章的行为，将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金托管人发现基金管理人重大违规行为或违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人将以书面形式报告中国证监会。

## 第五部分 相关服务机构

### 一、销售机构及联系人

#### 1、直销机构

民生加银基金管理有限公司

住所：深圳市福田区莲花街道福中三路2005号民生金融大厦13楼13A

办公地址：深圳市福田区莲花街道福中三路2005号民生金融大厦13楼13A

法定代表人：张焕南

客服电话：400-8888-388

联系人：林泳江

电话：0755-23999809

传真：0755-23999810

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

#### 2、非直销销售机构

详见基金份额发售公告或基金管理人网站公示信息。

3、基金管理人可根据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》和本基金《基金合同》等的规定，选择其他符合要求的机构销售本基金，并在基金管理人网站公示。

### 二、基金登记机构

名称：民生加银基金管理有限公司

住所：深圳市福田区莲花街道福中三路2005号民生金融大厦13楼13A

办公地址：深圳市福田区莲花街道福中三路2005号民生金融大厦13楼13A

法定代表人：张焕南

电话：0755-23999888

传真：0755-23999833

联系人：蔡海峰

### 三、出具法律意见书的律师事务所和经办律师

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心19楼

办公地址：上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心19楼

负责人：韩炯

经办律师：安冬、陈颖华

电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：陈颖华

四、审计基金财产的会计师事务所和经办注册会计师

名称：毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：北京市东城区东长安街1号东方广场毕马威大楼8层

办公地址：北京市东城区东长安街1号东方广场毕马威大楼8层

执行事务合伙人：邹俊

经办注册会计师：窦友明、王磊

电话：010-85085000 0755-25471000

传真：010-85085111 0755-82668930

联系人：蔡正轩

## 第六部分 基金的募集

### 一、募集的依据

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》、基金合同及其他有关规定，经2021年7月30日中国证监会证监许可【2021】2588号文注册。

### 二、基金类型、存续期限及运作方式

基金类型：混合型证券投资基金

存续期限：不定期

运作方式：契约型开放式

### 三、基金份额类别

本基金根据认购、申购费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为A类和C类基金份额。在投资人认购、申购时收取认购、申购费用、不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为A类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费、在投资人认购、申购时不收取认购、申购费用的基金份额，称为C类基金份额。

本基金A类、C类基金份额分别设置基金代码，分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值。

投资人可自行选择认购或申购的基金份额类别。本基金不同基金份额类别之间不得相互转换。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，经与基金托管人协商一致，基金管理人可增加、减少或调整基金份额类别设置、变更收费方式或者停止现有基金份额的销售、对基金份额分类办法及规则进行调整等，并在调整实施之日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告，不需要召开基金份额持有人大会。

### 四、募集期限

本基金的发售募集期为2021年9月13日—2021年9月24日，本基金于该期间向社会公开发售。募集期限自基金份额发售之日起最长不得超过3个月。

基金管理人有权根据基金募集的实际情况按照相关程序延长或缩短发售募集期，此类变更适用于所有销售机构。

具体规定详见本基金的基金份额发售公告及其他销售机构相关公告。

## 五、募集对象

符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、发起资金提供方、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人。

## 六、募集规模

本基金的最低募集份额总额为1000万份。本基金为发起式基金，发起资金提供方认购本基金的总金额不少于1000万元（不含认购费），且持有期限自基金合同生效日起不少于3年，法律法规和监管机构另有规定的除外。

本基金可设置募集规模上限，具体规模上限及规模控制的方案详见基金份额发售公告或其他公告。

## 七、募集方式及场所

通过基金销售网点（包括基金管理人的直销柜台、网上直销及其他销售机构的销售网点，具体名单见基金份额发售公告等相关公告）公开发售。销售机构办理本基金业务网点的具体情况和联系方式，请参见本基金的基金份额发售公告以及基金管理人网站披露的基金销售机构名录。

## 八、基金份额发售面值、认购价格及计算公式、认购费用

### 1、基金份额发售面值

本基金每份基金份额发售面值为人民币1.00元。

### 2、认购价格

本基金认购价格以基金份额发售面值为基准进行计算。

### 3、认购费用

本基金A类基金份额收取认购费用，C类基金份额不收取认购费用。本基金A类基金份额的认购费用不列入基金财产，主要用于基金的市场推广、销售、登记等募集期间发生的各项费用。

本基金对通过直销中心认购A类基金份额的养老金客户与除此之外的其他投资者实施差别的认购费率。养老金账户，包括养老基金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金，包括全国社会保障基金、可以投资基金的地方社会保障基金、企业年金单一计划以及集合计划。如将来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，本公司将依据规定将其纳入养老金账

户范围。非养老金客户指除养老金客户外的其他投资者。

投资本基金A类基金份额的养老金账户，在基金管理人的直销中心办理账户认证手续后，即可享受认购费率1折优惠。基金招募说明书规定认购费率为固定金额的，则按基金招募说明书中费率规定执行，不再享有费率优惠。

通过基金管理人的直销中心认购本基金A类基金份额的养老金客户认购费率如下：

单笔认购金额 M	认购费率
M < 100 万元	0.12%
100 万元 ≤ M < 200 万元	0.08%
200 万元 ≤ M < 500 万元	0.06%
M ≥ 500 万元	每笔 1000 元

非养老金投资者认购本基金A类基金份额的认购费率如下：

单笔认购金额 M	认购费率
M < 100 万元	1.20%
100 万元 ≤ M < 200 万元	0.80%
200 万元 ≤ M < 500 万元	0.60%
M ≥ 500 万元	每笔 1000 元

投资人同日或异日多次认购A类基金份额，须按每次认购所对应的费率档次分别计费。当需要采取比例配售方式对有效认购金额进行部分确认时，投资人认购费率按照认购申请确认金额所对应的费率计算，认购申请确认金额不受认购最低限额的限制。

本基金参加各销售机构发起的基金认购费率优惠活动，具体费率优惠方案以销售机构的安排为准，请关注销售机构公告或询问销售机构。

#### 4、认购份额的计算

(1) 若投资者选择认购A类基金份额，则认购份额的计算公式为：

1) 认购费用适用比例费率时，认购份额的计算方法如下：

认购费用 = (认购金额 × 认购费率) ÷ (1 + 认购费率)

净认购金额 = 认购金额 - 认购费用

认购份额=（净认购金额+利息）÷基金份额发售面值

2) 认购费用为固定金额时，认购份额的计算方法如下：

认购费用=固定金额

净认购金额=认购金额-认购费用

认购份额=（净认购金额+利息）÷基金份额发售面值

（2）若投资者认购本基金C类基金份额的计算方式

C类基金份额不收取认购费，而是从本类别基金资产中计提销售服务费。

认购份额=（认购金额+认购利息）÷基金份额发售面值

例：假设某非养老金投资者投资100,000元认购本基金A类基金份额，适用的认购费率为1.20%，认购期利息为10元，则该投资者认购可得到的A类基金份额为：

认购费用=（100,000×1.20%）÷（1+1.20%）=1,185.77（元）

净认购金额=100,000-1,185.77=98,814.23（元）

认购份额=（98,814.23+10）÷1.00=98,824.23（份）

即某非养老金投资者投资100,000元认购本基金A类基金份额，假定认购期利息为10元，可得到98,824.23份A类基金份额（含利息折份额部分）。

注：上述举例中的“认购期利息为10元”，仅供举例说明，不代表实际的最终利息计算结果，最终利息的具体金额及利息结转的基金份额的具体数额以基金登记机构的记录为准。

例：假定某投资者投资100,000元认购本基金C类基金份额，认购金额在募集期产生的利息为10元。则该投资者可认购得到C类基金份额为：

认购份额=（100,000 + 10）/1.00 = 100,010.00（份）

即某投资者投资100,000元认购本基金C类基金份额，假定认购金额在募集期产生的利息为10元，可得到100,010.00份C类基金份额（含利息折份额部分）。

注：上述举例中的“认购金额在募集期产生的利息为10元”，仅供举例说明，不代表实际的最终利息计算结果，最终利息的具体金额及利息结转的基金份额的具体数额以基金登记机构的记录为准。

#### 5、认购份额余额的处理方式

上述计算结果（包括认购份额）均保留到小数点后2位，小数点2位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。



## 九、投资人对基金份额的认购

### 1、认购时间

本基金的认购时间为2021年9月13日—2021年9月24日，发售募集期间每天的具体业务办理时间，由本基金份额发售公告或各销售机构的相关公告或者通知规定。

各个销售机构在本基金发售募集期内对于个人投资者或机构投资者的具体业务办理时间可能不同，若本招募说明书或基金份额发售公告没有明确规定，则由各销售机构自行决定每天的业务办理时间。

### 2、投资者认购应提交的文件和办理的手续：

详见基金份额发售公告及销售机构发布的相关公告。

### 3、认购原则

(1) 基金份额的认购采用金额认购方式；

(2) 投资人认购时，须按销售机构规定的方式全额缴款；

(3) 基金投资人在基金募集期内可以多次认购基金份额。认购费按每笔基金份额认购申请单独计算，认购一经受理不得撤销；

(4) 若投资人的认购申请被部分确认为无效，基金管理人应当将无效申请部分对应的认购款项退还给投资人。

### 4、认购的限额

(1) 投资人通过其他销售机构每次认购本基金的最低认购金额为10元（含认购费），通过民生加银基金直销机构每次认购基金的最低认购金额为10元（含认购费），超过最低认购金额的部分不设金额级差，销售机构若有不同规定，以销售机构规定为准，但不得低于10元的最低限额规定；

(2) 募集期内，单个投资人的累计认购规模没有限制，但如本基金单个投资人（基金管理人、基金管理人高级管理人员或基金经理作为发起资金提供方除外）累计认购的基金份额数达到或者超过基金总份额的50%，基金管理人可以采取比例确认等方式对该投资人的认购申请进行限制。基金管理人接受某笔或者某些认购申请有可能导致投资者变相规避前述50%比例要求的，基金管理人有权拒绝该等全部或者部分认购申请。投资人认购的基金份额数以基金合同生效后登记机构的确认为准；

(3) 基金管理人可根据有关法律法规的规定和市场情况，调整认购的数额限

制，基金管理人最迟应于调整实施前2个工作日在规定媒介上予以公告。

## 十、认购的方式与确认

### 1、认购方式

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

### 2、认购确认

基金销售机构对认购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认购申请。认购的确认以登记机构的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利，否则，由此产生的投资人任何损失由投资人自行承担。

对于T日（此处，特指发售募集期内的工作日）交易时间内受理的认购申请，在正常情况下，基金登记机构将在T+1日（同上）就申请的有效性进行确认。但对申请有效性的确认仅代表确实接受了投资人的认购申请，认购申请的成功确认应以基金登记机构在本基金募集结束后的登记确认结果为准。投资人可以在基金合同生效后到各销售网点或以其规定的其他合法方式查询最终确认情况。

## 十一、募集期间认购资金利息的处理方式

有效认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有，其中利息转份额以登记机构的记录为准。

## 十二、募集期内募集资金的管理

基金募集期间募集的资金应当存入专门账户，在基金募集结束前任何人不得动用。

## 十三、募集期间费用

基金募集期间的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用，不得从基金财产中列支。

## 第七部分 基金备案

### 一、基金备案的条件

本基金自基金份额发售之日起 3 个月内，在发起资金提供方认购本基金的金额不少于 1000 万元人民币且发起资金提供方承诺持有期限不少于 3 年的条件下，基金募集期届满或基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售，并在 10 日内聘请法定验资机构验资，验资报告需对发起资金提供方及其持有份额进行专门说明，基金管理人自收到验资报告之日起 10 日内，向中国证监会办理基金备案手续。

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

### 二、基金合同不能生效时募集资金的处理方式

如果募集期限届满，未满足基金备案条件，基金管理人应当承担下列责任：

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

### 三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

《基金合同》生效满 3 年后的对应日，若基金资产净值低于 2 亿元，《基金合同》应当终止，且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续。若届时法律法规或中国证监会规定发生变化，上述终止规定被取消、更改或补充时，则本基金可以参照届时有效的法律法规或中国证监会规定执行。

《基金合同》生效满 3 年后继续存续的，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当在 10 个工

作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并在 6 个月内召开基金份额持有人大会进行表决。

法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

## 第八部分 基金份额的申购、赎回

### 一、申购和赎回场所

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

### 二、申购和赎回的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

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

#### 2、申购、赎回开始日及业务办理时间

基金管理人自基金合同生效之日起不超过 3 个月开始办理申购，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。

基金管理人自基金合同生效之日起不超过 3 个月开始办理赎回，具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。

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

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

### 三、申购与赎回的原则

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

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；

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

5、基金管理人有权决定本基金的总规模限额，但应最迟在新的限额实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告；

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

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

#### 四、申购与赎回的程序

##### 1、申购和赎回的申请方式

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

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

##### 2、申购和赎回的款项支付

投资者申购基金份额时，必须在规定的时间内全额交付申购款项，投资人交付申购款项，申购成立；登记机构确认基金份额时，申购生效。基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；登记机构确认赎回时，赎回生效。投资者赎回申请生效后，基金管理人将在 T+7 日(包括该日)内支付赎回款项。在发生巨额赎回或基金合同载明的其他暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。遇证券/期货交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其他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，则赎回款项划付时间相应顺延。

基金管理人可以在法律法规和基金合同允许的范围内，对上述业务办理时间进行调整，基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

##### 3、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或

赎回申请日(T日),在正常情况下,本基金登记机构在T+1日内对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请,投资人应在T+2日后(包括该日)及时到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功,则申购款项退还给投资人。

基金销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定成功,而仅代表销售机构确实接收到申请。申购、赎回的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况,投资者应及时查询。因投资者怠于履行该项查询等各项义务,致使其相关权益受损的,基金管理人、基金托管人、基金销售机构不承担由此造成的损失或不利后果。

4、如未来法律法规或监管机构对上述内容另有规定,从其规定。

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

## 五、申购和赎回的数量限制

### 1、申请申购基金的最低金额限制

投资者申购本基金份额时,通过其他销售机构每笔申购金额不得低于10元(含申购费),通过民生加银基金直销机构每笔申购金额不得低于10元(含申购费),超过最低申购金额的部分不设金额级差;定期定额投资计划、比例配售和红利再投资不受此最低申购金额规定限制;销售机构若有不同规定,以销售机构规定为准,但不得低于10元的最低金额限制。

### 2、申请赎回基金的份额

投资者赎回本基金份额时,可申请将其持有的部分或全部基金份额赎回。本基金的投资者每个交易账户每笔最低赎回份额为10份,销售机构若有不同规定,以销售机构规定为准,但不得低于10份的最低限额规定。

### 3、在销售机构保留的基金份额数量限制

本基金的投资者每个交易账户的最低基金份额余额为10份,本基金不对单个投资者累计持有的基金份额上限进行限制,但单一投资者(基金管理人、基金管理人高级管理人员或基金经理作为发起资金提供方除外)持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的50%(在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过50%的除外);销售机构若有不同规定,以销售机构规定为准,但不得低于10份的最低限额规定。

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

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

#### 六、申购、赎回费用

本基金 A 类基金份额收取申购费用，C 类基金份额不收取申购费用。本基金 A 类基金份额的申购费用由申购 A 类基金份额的投资人承担，不列入基金财产，主要用于 A 类基金份额的市场推广、销售、登记等各项费用。

本基金对通过直销中心申购 A 类基金份额的养老金客户与除此之外的其他投资者实施差别的申购费率。养老金账户，包括养老基金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金，包括全国社会保障基金、可以投资基金的地方社会保障基金、企业年金单一计划以及集合计划。如将来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，本公司将依据规定将其纳入养老金账户范围。非养老金客户指除养老金客户外的其他投资者。

投资本基金 A 类基金份额的养老金账户，在基金管理人的直销中心办理账户认证手续后，即可享受申购费率 1 折优惠。基金招募说明书规定申购费率为固定金额的，则按基金招募说明书中费率规定执行，不再享有费率优惠。

通过基金管理人的直销中心申购本基金 A 类基金份额的养老金客户申购费率如下：

单笔申购金额 M	申购费率
M < 100 万元	0.15%
100 万元 ≤ M < 200 万元	0.10%
200 万元 ≤ M < 500 万元	0.08%
M ≥ 500 万元	每笔 1000 元

非养老金投资者申购本基金 A 类基金份额的申购费率如下：



单笔申购金额 M	申购费率
M < 100 万元	1.50%
100 万元 ≤ M < 200 万元	1.00%
200 万元 ≤ M < 500 万元	0.80%
M ≥ 500 万元	每笔 1000 元

投资人同日或异日多次申购A类基金份额，须按每次申购所对应的费率档次分别计费。当需要采取比例配售方式对有效申购金额进行部分确认时，投资人申购费率按照申购申请确认金额所对应的费率计算，申购申请确认金额不受申购最低限额的限制。

本基金参加各销售机构发起的基金申购费率优惠活动，具体费率优惠方案以销售机构的安排为准，请关注销售机构公告或询问销售机构。

## 2、赎回费用

本基金的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。本基金赎回费率随赎回基金份额持有时间的增加而递减，具体见下表：

本基金 A 类基金份额的赎回费率如下：

持有基金时间 T	赎回费率	赎回费归入基金财产的比例
T < 7 天	1.50%	100%
7 天 ≤ T < 30 天	0.75%	100%
30 天 ≤ T < 90 天	0.50%	75%
90 天 ≤ T < 180 天	0.50%	50%
T ≥ 180 天	0.00%	-

本基金 C 类基金份额的赎回费率如下：

持有基金时间 T	赎回费率	赎回费归入基金财产的比例
T < 7 天	1.50%	100%
7 天 ≤ T < 30 天	0.50%	100%
T ≥ 30 天	0.00%	-

投资人通过日常申购所得基金份额，持有期限自登记机构确认登记之日起计算。

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

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

5、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情形下根据市场情况开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率、赎回费率。

## 七、申购份额与赎回金额的计算及处理方式

### 1、基金份额净值的计算

本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码，分别计算和公告各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。本基金各类基金份额净值的计算，保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T 日的各类基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，经履行适当程序，可以适当延迟计算或公告。

### 2、申购份额的计算

(1) 若投资者选择申购 A 类基金份额，则申购份额的计算公式为：

1) 申购费用适用比例费率时，申购份额的计算方法如下：

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

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

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

2) 申购费用为固定金额时，申购份额的计算方法如下：

$$\text{申购费用} = \text{固定金额}$$

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

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

(2) 若投资者选择申购 C 类基金份额，则申购份额的计算公式为：

$$\text{申购份额} = \text{申购金额} / \text{T 日 C 类基金份额的基金份额净值}$$

例：假设某非养老金投资者投资 100,000 元申购本基金 A 类基金份额，适用

的申购费率为 1.50%，T 日 A 类基金份额的基金份额净值为 2.0000 元，则该投资人申购可得到的 A 类基金份额为：

$$\text{申购费用} = (100,000 \times 1.50\%) \div (1 + 1.50\%) = 1,477.83 \text{ (元)}$$

$$\text{净申购金额} = 100,000 - 1,477.83 = 98,522.17 \text{ (元)}$$

$$\text{申购份额} = 98,522.17 \div 2.0000 = 49,261.09 \text{ (份)}$$

即非养老金投资者投资 100,000 元申购本基金 A 类基金份额，假设申购当日 A 类基金份额的基金份额净值为 2.0000 元，则可以得到 49,261.09 份 A 类基金份额。

例：假设某投资者投资 100,000 元申购本基金 C 类基金份额，适用的申购费率为 0.00%，T 日 C 类基金份额的基金份额净值为 2.0000 元，则该投资者申购可得到的 C 类基金份额为：

$$\text{申购份额} = 100,000.00 \div 2.0000 = 50,000.00 \text{ (份)}$$

即：投资者投资 100,000 元申购本基金 C 类基金份额，假设申购当日 C 类基金份额的基金份额净值为 2.0000 元，则可以得到 50,000.00 份 C 类基金份额。

(3) 上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

### 3、赎回金额的计算

#### (1) 计算公式

若投资者赎回基金份额（A 类或 C 类），则赎回金额的计算公式为：

$$\text{赎回总额} = \text{赎回份数} \times \text{T 日该类基金份额的基金份额净值}$$

$$\text{赎回费用} = \text{赎回总额} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{赎回金额} = \text{赎回总额} - \text{赎回费用}$$

例：假设某投资人在 T 日赎回 10,000 份 A 类基金份额，持有时间为 5 天，适用的赎回费率为 1.50%，假设 T 日 A 类基金份额的基金份额净值为 2.0000 元，则其获得的赎回金额计算如下：

$$\text{赎回总额} = 10,000 \times 2.0000 = 20,000.00 \text{ (元)}$$

$$\text{赎回费用} = 20,000.00 \times 1.50\% = 300.00 \text{ (元)}$$

$$\text{赎回金额} = 20,000.00 - 300.00 = 19,700.00 \text{ (元)}$$

即：投资者赎回本基金 A 类基金份额 10,000 份，持有时间为 5 天，假定赎回当日 A 类基金份额的基金份额净值为 2.0000 元，则其可得到的赎回金额为

19,700.00 元。

例：假设某投资人在 T 日赎回 10,000 份基金 C 类基金份额，持有时间为 40 天，适用的赎回费率为 0，假设 T 日 C 类基金份额的基金份额净值为 2.0000 元，则其获得的赎回金额计算如下：

赎回总额=10,000×2.0000=20,000.00（元）

赎回费用=20,000.00×0=0.00（元）

赎回金额=20,000.00-0.00=20,000.00（元）

即：投资者赎回本基金 C 类基金份额 10,000 份，持有时间为 40 天，假定赎回当日 C 类基金份额的基金份额净值为 2.0000 元，则其可得到的赎回金额为 20,000.00 元。

(2) 上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

#### 八、拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

- 1、因不可抗力导致基金无法正常运作。
- 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。
- 3、证券、期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
- 4、接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。
- 5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或出现其他可能对基金业绩产生负面影响，或发生其他损害现有基金份额持有人利益的情形。
- 6、基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术故障等异常情况导致基金销售系统或基金登记系统或基金会计系统无法正常运行。
- 7、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者（基金管理人、基金管理人高级管理人员或基金经理作为发起资金提供方除外）持有基金份额的比例达到或者超过 50%，或者变相规避 50%集中度的情形时。
- 8、申购申请超过基金管理人设定的单日净申购比例上限、单一投资者单日或单笔申购金额上限的。

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

10、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第 1、2、3、5、6、9、10 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在规定媒介上刊登暂停申购公告。当发生上述第 7、8 项情形时，基金管理人可以采取比例确认等方式对该投资人的申购申请进行限制，基金管理人也有权拒绝该等全部或者部分申购申请。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

九、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。

3、证券、期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

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

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

7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。若出现上述第 4 项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未

获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

## 十、巨额赎回的情形及处理方式

### 1、巨额赎回的认定

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

### 2、巨额赎回的处理方式

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

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

(2) 部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额 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该类基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。部分延期赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

若基金发生巨额赎回，且单个基金份额持有人赎回申请超过上一开放日基金总份额 10%以上，基金管理人可以先行对该单个基金份额持有人超出 10%的赎回申请实施延期办理。对于该单个基金份额持有人赎回申请未超过上一开放日基金总份额 10%（含 10%）的赎回申请，基金管理人根据前段“(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。对于上述因延期办理而未能赎回部分，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。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。部分延期赎回不受单笔赎回最低份额的限制。基金管理人在履行适当程序后，有权根据当时市场环境调整前述比例及处理规则，并在规定媒介上进行公告。

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

### 3、巨额赎回的公告

当发生上述巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，并在两日内在指定媒介上刊登公告。

#### 十一、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

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

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

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

#### 十二、基金转换

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基金合同的规定制定并公告，并提前告知基金托管人与相关机构。

#### 十三、基金份额的转让

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

#### 十四、基金的非交易过户

基金的非交易过户是指基金登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资人。

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

#### 十五、基金的转托管

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

#### 十六、定期定额投资计划

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

#### 十七、基金份额的冻结和解冻

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

#### 十八、实施侧袋机制期间本基金的申购与赎回

本基金实施侧袋机制的，本基金的申购和赎回安排详见本招募说明书“侧袋机制”部分的规定或相关公告。



## 第九部分 基金的投资

### 一、投资目标

本基金通过量化模型筛选新能源产业中具有长期竞争力的上市公司，在严格控制风险和保证良好流动性的前提下，力争获取相对业绩比较基准的超额收益。

### 二、投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括创业板及其他依法发行上市的股票、存托凭证)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券等)、资产支持证券、同业存单、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款、通知存款及其他银行存款)、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权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，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金股票资产占基金资产的比例 60%-95%，投资于新能源主题相关证券资产占非现金基金资产的比例不低于 80%。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，应当保持不低于基金资产净值的 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金参与股指期货、国债期货、股票期权交易，应符合法律法规规定和基金合同约定的投资限制并遵守相关期货等交易所的业务规则。

### 三、投资策略

#### 1、资产配置策略

本基金通过对宏观经济、微观经济运行态势、政策环境、利率走势、证券市场走势及证券市场现阶段的系统性风险以及未来一段时期内各大类资产的风险和预期收益率进行分析评估，实现投资组合动态管理最优化。

## 2、股票投资策略

本基金为新能源方向的主题量化基金，主要利用量化选股模型，力争实现超越基准指数的投资收益。

### （1）新能源主题的界定

本基金通过对新能源产业主题相关的企业进行深入细致的研究分析，投资于符合新能源产业趋势的成长股，深入挖掘新能源产业主题相关股票的投资价值，分享新能源产业主题所带来的投资机会。本基金对新能源产业主题的界定如下：

直接从事新能源产业相关领域的企业，主要包括：

a、太阳能、风能、光伏、水能、核能、生物质能、地热能、海洋能和氢能等的生产和利用及相关技术服务；

b、新能源相关的工程建设、能源传输和运营行业（包括新能源电站的建设、智能电网、电站运营、分布式能源管理、合同能源管理等）；

c、新能源汽车及智能汽车相关行业（包括新能源及智能汽车整车、装备、关键零部件、原材料及相关技术服务等）；

d、动力电池相关行业（包括动力电池、装备、原材料及上游矿产资源的生产与制造等）；

e、储能和交互设备的生产和研发行业（包括电池、电容器、充电桩、电缆等的研发生产制造，及与其相关的原材料生产与制造）；

f、其他与新能源产业相关的领域；

### （2）个股投资策略

#### 1) 量化投资策略

量化投资策略主要采用三大类量化模型分别用以评估资产定价、控制风险和优化交易。根据模型结果基金管理人结合市场环境进行组合投资。

超额收益模型：该模型通过构建多因子量化系统，综合评估上市公司的盈利、成长、价值、规模、反转、波动以及流动性等多方面因子，以自下而上为主，自上而下为辅，选择出定价偏低的资产进行投资以获取超额收益，回避定价过高的资产。

风险模型：该模型通过风险预测和控制投资组合对各类风险因子的敞口，如市场、行业和风格等，力求将投资组合的风险控制在合理范围内。

成本模型：该模型根据各类资产的市场交易活跃度、市场冲击成本、印花税、佣金等数据预测本基金的交易成本，有效控制基金的换手率，达到优化投资组合的目的。

## 2) 模型的应用与调整

在正常的市场情况下，本基金将主要依据量化投资模型的运行结果来进行组合的构建。同时，基金管理人也会定期对模型的有效性进行检验和更新，以反映市场结构趋势的变化。在市场出现非正常波动或基金管理人预测市场可能出现重大非正常波动时，本基金将结合市场情况做出具有一定前瞻性的判断，临时调整各因子类别的具体组成及权重。本基金也会随着研发的进展采用其他具有竞争性的量化投资模型。

## (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。

## 3、债券投资策略

本基金的债券投资策略主要包括可转换债券投资策略、可分离交易可转债投资策略、可交换债券投资策略和普通债券投资策略。

### (1) 可转换债券投资策略

基于行业分析、企业基本面分析和可转换债券估值模型分析，并结合市场环境情况等，本基金在一、二级市场投资可转换债券，以达到在严格控制风险的基础上，实现基金资产稳健增值的目的。

#### 1) 行业配置策略

可转换债券有别于一般债券，其自身含有的期权价值与公司股票价格走势、波动率水平等密切相关。本基金将采用“自上而下”的分析方法，综合考虑各种宏观因素，以实现最优的行业配置。本基金将根据宏观经济走势、经济周期，以及阶段性市场投资主题的变化，综合考虑宏观调控目标、产业结构调整等因素，精选成长前景明确或受益政策扶持的行业内公司发行的可转换债券进行投资布局。另外，由于宏观经济所处的时期和市场发展的阶段不同，不同行业的可转换

债券也将表现出不同的风险收益特征。在经济复苏的初期，持有资源类行业的可转换债券将获得良好的投资收益；而在经济衰退时期，持有防御类非周期行业的可转换债券，将获得更加稳定的收益。

## 2) 个券选择策略

本基金将运用企业基本面分析和理论价值分析策略，在严格控制风险的前提下，精选个券，力争实现较高的投资收益。

企业基本面分析策略是指本基金将采取定性分析（经济周期、行业地位、竞争优势、治理结构等）与定量分析（P/B、P/E、PEG 等）相结合的方式，对可转换债券对应的标的股票进行深入研究，精选具有良好成长性且估值相对合理的标的股票，达到分享正股上涨收益的目的。

理论价值分析策略是指本基金将结合可转换债券的条款，根据其标的股票股价的波动率水平、分红率、市场的基准利率、可转换债券的剩余期限、当前股价水平等因素，运用 BS 模型以及蒙特卡洛模型等，计算期权价值，从而确定可转换债券的理论价值。可转换债券的理论价值分为纯债价值和期权价值。其中纯债价值由当期贴现利率水平、债券的信用评级、剩余期限等因素决定，其中关键因素是当期贴现利率水平；期权价值主要与发债主体的行业发展前景、公司基本面、公司股价历史波动率、分红率、市场基准利率和可转换债券的剩余期限相关。

## 3) 转股策略

在转股期内，当本基金所持有可转换债券市场交易价格显著低于转股平价时，即转股溢价率明显为负时，本基金将通过转股并卖出股票以实现收益；当可转换债券流动性不能满足组合需求时，本基金将通过转股来保障基金财产的流动性；当正股价格上涨且满足提前赎回触发条件时，本基金将首先通过转股来锁定已有收益，并进一步分析正股未来的价格走势，做出继续持有正股或立即卖出的决定。

## 4) 条款博弈策略

国内可转换债券一般设置提前赎回、向下修正转股价、提前回售等条款，其中赎回条款赋予发行人提前赎回可转换债券的权力，修正条款赋予发行人向下修正转股价格的权力，回售条款赋予投资者将可转换债券回售给发行人的权利，这些条款将对可转换债的价值产生影响。例如，当正股价格持续低于转股价达到一定程度，如发行人向下修正转股价，则可转换债券的转股价值得到大幅提高，同

时降低了未来由于正股价格下降带来的可能损失。

本基金将深入分析公司基本面，包括经营状况和财务状况，预测其未来发展战略和融资需求，结合流动性、到期收益率、纯债溢价率等因素，充分发掘这些条款给可转换债券带来的投资机会。

#### 5) 套利策略

本基金将密切关注以下两种套利机会:①在可转换债券的转股期内，当转换溢价为负时，可以买入可转换债券并及时转股，然后在二级市场卖出股票，以获取套利收益;②在可转换债券发行期内，当可转换债券的优先配售条款具有吸引力时，可以买入股票并配售可转换债券,待其上市后再卖出，以获取收益。

#### (2) 可分离交易可转债投资策略

可分离交易可转债是指认股权证和债券分离交易的可转换公司债券，即是一种附认股权证的公司债，上市后可分离为纯债和认股权证两部分。可分离交易可转债是债券和股票的混合融资品种，它与传统可转换债券的本质区别在于上市后债券与期权可分离交易。但是，不论是认股权证还是标的股票，与传统可转换债券内含的期权之间都具有很强的相关性。因此，分离交易后的纯债和认股权证组合在一起仍然具有传统可转换债券的部分特征，甚至也可以构造出类可转换债券品种。可分离交易可转债的投资策略与传统可转换债券的投资策略类似。本基金将综合分析纯债部分的收益性、流动性，以及发债公司基本面等情况，以此为基础判断纯债部分的投资价值。此外，本基金将通过调整纯债和认股权证或标的股票之间的比例，来组合成不同风险收益特征的类可转换债券产品，并根据不同的市场环境适时进行动态调整。

#### (3) 可交换债券投资策略

本基金重视对可交换债券对应股票的分析与研究，选择那些公司和行业景气趋势回升、成长性好、安全边际较高的品种进行投资。在基本面分析的基础上，综合分析可交换债券的债性特征、股性特征等因素，结合各种定价模型和规范化估值工具，对于债券进行科学的价值分析和价值投资。

#### (4) 普通债券投资策略

本基金将采取利率策略、信用策略和个券选择策略，判断不同债券在经济周期的不同阶段的相对投资价值，并确定不同债券在组合资产中的配置比例，实现组合的稳健增值。其中利率策略是指本基金通过全面研究和分析宏观经济运行情

况和金融市场资金供求状况变化趋势及结构，结合对财政政策、货币政策等宏观经济政策取向的研判，从而预测出金融市场利率水平变动趋势；信用策略是指本基金依靠内部信用评级系统跟踪研究发债主体的经营状况、财务指标等情况，对其信用风险进行评估，以此作为个券选择的基本依据；个券选择策略是指通过自上而下和自下而上相结合的研究方法，形成具体的投资策略。

#### 4、股指期货投资策略

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

#### 5、国债期货投资策略

本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对债券交易市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

#### 6、股票期权投资策略

本基金按照风险管理的原则，在严格控制风险的前提下，以套期保值为主要目的，选择流动性好、交易活跃的期权合约进行投资。本基金基于对证券市场的判断，结合期权定价模型，选择估值合理的期权合约。

#### 7、资产支持证券投资策略

在有效控制风险的前提下，本基金对资产支持证券从以下方面综合定价，选择低估的品种进行投资。主要包括信用因素、流动性因素、利率因素、税收因素和提前还款因素。

### 四、投资限制

#### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

(1) 本基金股票资产占基金资产的 60%-95%，投资于新能源主题相关证券资产比例不低于非现金基金资产的 80%；

(2) 本基金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所需缴纳的交易保证金后，持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，前述现金资产不包括结算备付金、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%，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) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；

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

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

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

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

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

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

(13) 本基金的资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

(14) 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本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；

(15) 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；

(16) 本基金参与股指期货交易，需遵守下列投资比例限制：

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

2) 本基金在任何交易日日终，持有的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%；

3) 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%；

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

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

(17) 本基金参与国债期货交易的，应当遵守下列要求：

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

2) 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%；

3) 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；

4) 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%；

(18) 本基金参与股票期权交易的，需遵守下列投资比例限制：

1) 本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%；

2) 本基金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；

3) 本基金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；

(19) 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；

(20) 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。

除第（2）、（10）、（14）、（15）项外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

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

法律法规或监管部门对上述投资限制、投资禁止等作出强制性调整的，本基金应当按照法律法规或监管部门的规定执行；如法律法规或监管部门修改或调整上述投资限制、投资禁止性规定，且该等调整或修改属于非强制性的，基金管理人有权在履行适当程序后按照法律法规或监管部门调整或修改后的规定执行，并向投资者履行信息披露义务。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

(1) 承销证券；

(2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；

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

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

法律、行政法规或监管部门取消或变更上述禁止或限制性规定，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准。

### 五、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为： $\text{中证新能源指数收益率} \times 75\% + \text{中债新综合财富指数收益率} \times 25\%$

中证新能源指数以中证全指为样本空间，选取涉及可再生能源生产、新能源应用、新能源存储以及新能源交互设备等业务的上市公司股票作为成份股，以反映新能源产业相关上市公司的整体表现，为市场提供多样化的投资标的。

中债新综合财富指数隶属于中债总指数族分类，该指数成份券包含除资产支持证券、美元债券、可转债以外剩余的所有公开发行的可流通债券，是一个反映境内人民币债券市场价格走势情况的宽基指数，是中债指数应用最广泛指数之一。因此，中债新综合财富指数是衡量本基金债券投资业绩的理想基准。

若未来法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者市场发生变化导致本业绩比较基准不再适用或本业绩比较基准停止发布，本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，在与基金托管人协商一致并报中国证监会备案后，适当调整业绩比较基准并及时公告，而无需召

开基金份额持有人大会。

## 六、风险收益特征

本基金是混合型证券投资基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金、但低于股票型基金。

## 七、基金管理人代表基金行使股东或债权人权利的处理原则及方法

1、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东或债权人权利，保护基金份额持有人的利益；

2、不谋求对上市公司的控股；

3、有利于基金财产的安全与增值；

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

## 八、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。

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“侧袋机制”部分的规定。

## 第十部分 基金的财产

### 一、基金资产总值

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

### 二、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### 三、基金财产的账户

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

### 四、基金财产的保管和处分

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

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

## 第十一部分 基金资产估值

### 一、估值日

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

### 二、估值对象

基金所拥有的股票、资产支持证券、股指期货合约、国债期货合约、股票期权合约、债券、同业存单和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

### 三、估值原则

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

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

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

（二）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。

（三）如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25%以上的，应对

估值进行调整并确定公允价值。

#### 四、估值方法

##### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

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

(2) 交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值。

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

(4) 对在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；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，按最近交易日收盘价减去可转换债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

(5) 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应收利息（税后）得到的净价进行估值。

(6) 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，如基金管理人认为成本能够近似体现公允价值，基金管理人应持续评估上述做法的适当性，并在情况发生改变时做出适当调整。

##### 2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

(2) 首次公开发行未上市的股票、债券，采用估值技术确定公允价值，在估

值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

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

(4) 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。

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、本基金投资的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。

5、本基金投资的期权合约，根据相关法律法规以及监管部门的规定估值。

6、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。

7 同业存单按估值日第三方估值机构提供的估值净价估值；选定的第三方估值机构未提供估值价格的，按成本估值。

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

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

10、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。

11、存在相关法律法规以及监管部门有相关规范且适用于本基金的，从其规

定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

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

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致意见的，基金管理人向基金托管人出具加盖公章的书面说明后，按照基金管理人对基金净值信息的计算结果对外予以公布。由此给基金份额持有人和基金造成的损失以及因该交易日基金资产净值计算顺延错误而引起的损失，由基金管理人负责赔付。

## 五、估值程序

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

基金管理人于每个估值日计算基金资产净值及各类基金份额净值，并按规定公告。

2、基金管理人应每个估值日对基金资产估值。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。基金管理人每个估值日对基金资产估值后，将各类基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人按规定对外公布。

## 六、估值错误的处理

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

基金合同的当事人应按照以下约定处理：

### 1、估值错误类型

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



值错误处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

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

## 2、估值错误处理原则

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

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

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

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

## 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

(4) 根据估值错误处理的方法，需要修改基金登记机构交易数据的，由基金

登记机构进行更正，并就估值错误的更正向有关当事人进行确认。

#### 4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

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

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

(3) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。如果行业另有通行做法，基金管理人和基金托管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。

### 七、暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场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；

4、法律法规规定、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

### 八、基金净值的确认

基金资产净值和各类基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个估值日交易结束后计算当日的基金资产净值和各类基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金净值按规定予以公布。

### 九、特殊情况的处理

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

2、由于不可抗力原因，或证券、期货交易所及登记结算公司、存款银行发送的数据错误等，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但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消除或减轻由此造成的影响。

## 十、实施侧袋机制期间的基金资产估值

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。

## 第十二部分 基金费用与税收

### 一、基金费用的种类

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

### 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 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，在次月月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径和协商一致的支付方式进行资金支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力等，支付日期顺延。费用扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

#### 2、基金托管人的托管费

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，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，在次月月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径和协商一致的支付方式进行资金支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力等，支付日期顺延。费用扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

### 3、C 类基金份额的销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费将专门用于本基金 C 类基金份额的销售与基金份额持有人服务。

在通常情况下，销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值的 0.40% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，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，在次月月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径和协商一致的支付方式进行资金支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力等，支付日期顺延。费用扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

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

### 三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

### 四、实施侧袋机制期间的基金费用

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，详见招募说明书“侧袋机制”部分的规定。

## 五、基金税收

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

鉴于基金管理人为本基金的利益投资、运用基金财产过程中，可能因法律法规、税收政策的要求而成为纳税义务人，就归属于基金的投资收益、投资回报和 / 或本金承担纳税义务。因此，本基金运营过程中由于上述原因发生的增值税等税负，仍由本基金财产承担，届时基金管理人与基金托管人可能通过本基金财产账户直接缴付，或划付至基金管理人账户并由基金管理人依据税务部门要求完成税款申报缴纳。

## 第十三部分 基金的收益与分配

### 一、基金利润的构成

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

### 二、基金可供分配利润

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

### 三、基金收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下，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，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为同一类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的某一类基金份额净值减去该类别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、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人与基金托管人协商一致后，可对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

本基金每次收益分配比例详见届时基金管理人发布的公告。

### 四、收益分配方案

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

### 五、收益分配方案的确定、公告与实施

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

## 六、基金收益分配中发生的费用

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

## 七、实施侧袋机制期间的收益分配

本基金实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配。



## 第十四部分 基金的会计与审计

### 一、基金会计政策

1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；

2、基金的会计年度为公历年度的 1 月 1 日至 12 月 31 日；基金首次募集的会计年度按如下原则：如果《基金合同》生效少于 2 个月，可以并入下一个会计年度披露；

3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；

4、会计制度执行国家有关会计制度；

5、本基金独立建账、独立核算；

6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；

7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

### 二、基金的年度审计

1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的符合《中华人民共和国证券法》规定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 日内在规定媒介公告。

## 第十五部分 基金的信息披露

一、本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《流动性风险管理规定》、《基金合同》及其他有关规定。

### 二、信息披露义务人

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

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

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

三、本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

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

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

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

### 五、公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

（一）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规定网站上；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，并登载在规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。

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

## （二）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规定媒介上。

## （三）《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规定媒介上登载《基金合同》生效公告。

## （四）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

至少每周在规定网站披露一次各类基金份额净值和基金份额累计净值。

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

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

#### （五）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。

#### （六）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，将年度报告登载在规定网站上，并将年度报告提示性公告登载在规定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经符合《中华人民共和国证券法》规定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，将中期报告登载在规定网站上，并将中期报告提示性公告登载在规定报刊上。

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，将季度报告登载在规定网站上，并将季度报告提示性公告登载在规定报刊上。

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

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

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

#### （七）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，并登载在规定报刊和规定网站上。

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

- 1、基金份额持有人大会的召开及决定的事项；
- 2、《基金合同》终止、基金清算；
- 3、转换基金运作方式、基金合并；
- 4、更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；
- 5、基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；
- 6、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- 7、基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人的实际控制人变更；
- 8、基金募集期延长或提前结束募集；
- 9、基金管理人的高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；
- 10、基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十，基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十；
- 11、涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼或者仲裁；
- 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，但中国证监会另有规定的除外；
- 14、基金收益分配事项；
- 15、管理费、托管费、销售服务费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- 16、某类基金份额净值计价错误达该类基金份额净值百分之零点五；
- 17、本基金开始办理申购、赎回；

- 18、本基金发生巨额赎回并延期办理；
- 19、本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；
- 20、本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；
- 21、发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；
- 22、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；
- 23、调整基金份额类别设置；
- 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。

#### （八）澄清公告

在《基金合同》存续期限内，任何公共媒介中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动，以及可能损害基金份额持有人权益的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清。

#### （九）基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

#### （十）基金投资股指期货的信息披露

基金管理人应在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露股指期货交易情况，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。

#### （十一）基金投资国债期货的信息披露

基金管理人应在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书更新等文件中披露国债期货交易情况，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等。

#### （十二）基金投资股票期权的信息披露

基金管理人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。

#### （十三）基金投资资产支持证券的信息披露

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

#### （十四）清算报告

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。

#### （十五）发起资金认购份额报告

基金管理人应当按照相关法律的规定和监管机构的要求，在基金合同生效公告、基金年度报告、中期报告、季度报告中分别披露基金管理人固有资金、基金管理人高级管理人员、基金经理等人员（可以包括基金经理之外公司投研人员）以及基金管理人股东持有基金的份额、期限及期间的变动情况。

#### （十六）实施侧袋机制期间的信息披露

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书的规定进行信息披露，详见招募说明书“侧袋机制”部分的规定。

#### （十七）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规定。

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、各类基金份额净值、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、基金托管人应当在规定报刊中选择一家报刊披露本基金的信息。基金管理人、基金托管人应当向中国证监会基金电子披露网站报送拟披露的基金信息，并保证相关报送信息的真实、准确、完整、及时。

基金管理人、基金托管人除依法在规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规定媒介披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

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

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

#### 七、信息披露文件的存放与查阅

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

#### 八、暂停或延迟披露基金信息的情形

当出现下述情况时，基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金信息：

- 1、不可抗力；
- 2、出现基金合同约定的暂停估值的情形；
- 3、法律法规、基金合同或中国证监会规定的情况。



## 第十六部分 侧袋机制

### 一、侧袋机制的实施条件

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。

基金管理人应当在启用侧袋机制后及时发布临时公告，并在五个工作日内聘请侧袋机制启用日发表意见且符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所进行审计并披露专项审计意见。

### 二、实施侧袋机制期间基金份额的申购与赎回

1、启用侧袋机制当日，基金登记机构以基金份额持有人的原有账户份额为基础，确认相应侧袋账户基金份额持有人名册和份额；当日收到的申购申请，按照启用侧袋机制后的主袋账户份额办理；当日收到的赎回申请，仅办理主袋账户的赎回申请并支付赎回款项。

2、实施侧袋机制期间，基金管理人不得办理侧袋账户份额的申购、赎回和转换；同时，基金管理人按照基金合同和招募说明书的约定办理主袋账户份额的赎回，并根据主袋账户运作情况确定是否暂停申购。

3、除基金管理人应按照主袋账户的份额净值办理主袋账户份额的申购和赎回外，本招募说明书“基金份额的申购、赎回”部分的申购、赎回规定适用于主袋账户份额。巨额赎回按照单个开放日内主袋账户份额净赎回申请超过前一开放日主袋账户总份额的10%认定。

### 三、实施侧袋机制期间的基金投资

侧袋机制实施期间，招募说明书“基金的投资”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。基金管理人计算各项投资运作指标和基金业绩指标时仅需考虑主袋账户资产。

基金管理人原则上应当在侧袋机制启用后20个交易日内完成对主袋账户投资组合的调整，因资产流动性受限等中国证监会规定的情形除外。

基金管理人不得在侧袋账户中进行除特定资产处置变现以外的其他投资操作。

### 四、实施侧袋机制期间的基金估值

本基金实施侧袋机制的，基金管理人和基金托管人应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。侧袋账户的会计核算应符合《企业会计准则》的相关要求。

#### 五、实施侧袋账户期间的基金费用

1、本基金实施侧袋机制的，管理费和托管费等费用按主袋账户基金资产净值作为基数计提。

2、与侧袋账户有关的费用可从侧袋账户中列支，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。

#### 六、侧袋账户中特定资产的处置变现和支付

特定资产以可出售、可转让、恢复交易等方式恢复流动性后，基金管理人应当按照基金份额持有人利益最大化原则，采取将特定资产予以处置变现等方式，及时向侧袋账户份额持有人支付对应变现款项。

侧袋机制实施期间，无论侧袋账户资产是否全部完成变现，基金管理人都应当及时向侧袋账户全部份额持有人支付已变现部分对应的款项。若侧袋账户资产无法一次性完成处置变现，基金管理人在每次处置变现后均应按照相关法律法规要求及时发布临时公告。

侧袋账户资产全部完成变现并终止侧袋机制后，基金管理人应及时聘请符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所进行审计并披露专项审计意见。

#### 七、侧袋机制的信息披露

##### 1、临时公告

在启用侧袋机制、处置特定资产、终止侧袋机制以及发生其他可能对投资者利益产生重大影响的事项后基金管理人应及时发布临时公告。

##### 2、基金净值信息

基金管理人应按照招募说明书“基金的信息披露”部分规定的基金净值信息披露方式和频率披露主袋账户份额的基金份额净值和基金份额累计净值。实施侧袋机制期间本基金暂停披露侧袋账户份额净值和累计净值。

##### 3、定期报告

侧袋机制实施期间，基金管理人应当在基金定期报告中披露报告期内侧袋账户相关信息，基金定期报告中的基金会计报表仅需针对主袋账户进行编制。会计师事务所对基金年度报告进行审计时，应对报告期内基金侧袋机制运行相关的会计核算和年度报告披露等发表审计意见。

八、本部分关于侧袋机制的相关规定，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，或将来法律法规或监管规则针对侧袋机制的内容有进一步规定的，基金管理人经与基金托管人协商一致并履行适当程序后，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。

## 第十七部分 风险揭示

### 一、市场风险

本基金主要投资于证券市场，而证券市场价格受政治、经济、投资心理和交易制度等各种因素的影响会产生波动，从而对本基金投资产生潜在风险，导致基金收益水平发生波动。

#### 1、政策风险

货币政策、财政政策、产业政策等国家宏观经济政策的变化对证券市场产生一定影响，从而导致投资对象价格波动，影响基金收益而产生的风险。

#### 2、经济周期风险

证券市场是国民经济的晴雨表，而经济运行则具有周期性的特点。随着宏观经济运行的周期性变化，基金所投资于证券的收益水平也会随之变化，从而产生风险。

#### 3、利率风险

金融市场利率的变化直接影响着债券的价格和收益率，也会影响企业的融资成本和利润，进而影响基金持仓证券的收益水平。

#### 4、购买力风险

基金收益的一部分将通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀的影响而使购买力下降，从而使基金的实际投资收益下降。

### 二、管理风险

基金运作过程中由于基金投资策略、人为因素、管理系统设置不当造成操作失误或公司内部失控而可能产生的损失。管理风险包括：

1、决策风险：指在基金投资的投资策略制定、投资决策执行和投资绩效监督检查过程中，由于决策失误可能给基金资产造成的损失。

2、操作风险：指在基金投资决策执行中，由于投资指令不明晰、交易操作失误等人为因素可能导致的损失。

3、技术风险：是指由于信息系统设置不当等因素可能造成的损失。

### 三、信用风险

本基金在投资过程中，主要面临以下两类信用风险：

第一类是所投资的债券自身的信用风险，包括：违约风险，主要是指债券发行

人未能履行约定契约中的义务而造成经济损失的风险，即发行人不能履行还本付息的责任而使基金资产的预期收益与实际收益发生偏离所造成损失的风险；信用评级调整风险，主要是指由于经济周期、行业周期、公司经营管理等因素发生不利变化，致使债券发行人的财务状况恶化，偿债能力降低，由此造成债券信用评级降低、价格下跌，造成基金资产损失的风险。

第二类信用风险是债券交易对手的风险，主要是指在债券的交易过程中，由于交易对手方不能足额按时交割，导致本基金可能无法按时收到或足额收到应得的证券或价款而造成价款或证券的损失的风险，或者是指在回购交易的过程中，融资方无法按时支付回购本金和利息所带来的风险。

#### 四、本基金特有风险

##### 1、股指期货的投资风险

**杠杆风险：**因股指期货采用保证金交易而存在杠杆，基金财产可能因此产生更大的收益波动。

**基差风险：**在利用股指期货对冲市场系统风险时，基金资产可能因为股指期货合约与标的指数价格变动方向不一致而承担基差风险。因存在基差风险，在股指期货合约展期操作时，基金资产可能因股指期货合约之间价差的异常变动而遭受展期风险。

**股指期货展期时的流动性风险：**本基金持有的股指期货头寸需要进行展期操作，平仓持有的股指期货合约，换成其他月份股指期货合约，当股指期货市场流动性不佳、交易量不足时，将会导致展期操作执行难度提高、交易成本增加，从而可能对基金资产造成不利的影响。

**期货盯市结算制度带来的现金管理风险：**股指期货采取保证金交易制度，保证金账户实行当日无负债结算制度，资金管理要求高。当市场持续向不利方向波动导致期货保证金不足，如果未能在规定的时间内补足保证金，按规定将被强制平仓，可能给基金资产带来超出预期的损失。

**到期日风险：**股指期货合约到期时，本基金的账户如仍持有未平仓合约，交易所将按照交割结算价将账户持有的合约进行现金交割，因此无法继续持有到期合约，具有到期日风险。

**对手方风险：**基金管理人运用基金资产投资于股指期货时，会尽力选择资信状态优良、风险控制能力强的期货公司作为经纪商，但不能杜绝在极端情况下，所选

择的期货公司在交易过程中存在违法、违规经营行为或破产清算导致基金资产遭受损失。

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

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

## 2、国债期货的投资风险

国债期货的投资可能面临市场风险、基差风险、流动性风险。市场风险是因期货市场价格波动使所持有的期货合约价值发生变化的风险。基差风险是期货市场的特有风险之一，是指由于期货与现货间的价差的波动，影响套期保值或套利效果，使之发生意外损益的风险。流动性风险可分为两类：一类为流通量风险，是指期货合约无法及时以所希望的价格建立或了结头寸的风险，此类风险往往是由市场缺乏广度或深度导致的；另一类为资金量风险，是指资金量无法满足保证金要求，使得所持有的头寸面临被强制平仓的风险。

## 3、资产支持证券的投资风险

本基金对固定收益类资产的投资中将资产支持证券纳入到投资范围当中，可能带来以下风险：

①**信用风险：**基金所投资的资产支持证券之债务人出现违约，或在交易过程中发生交收违约，或由于资产支持证券信用质量降低导致证券价格下降，造成基金财产损失。

②**利率风险：**市场利率波动会导致资产支持证券的收益率和价格的变动，一般而言，如果市场利率上升，本基金持有资产支持证券将面临价格下降、本金损失的风险，而如果市场利率下降，资产支持证券利息的再投资收益将面临下降的风险。

③**流动性风险：**受资产支持证券市场规模及交易活跃程度的影响，资产支持证券可能无法在同一价格水平上进行较大数量的买入或卖出，存在一定的流动性风险。

④**提前偿付风险：**债务人可能会由于利率变化等原因进行提前偿付，从而使基金资产面临再投资风险。

⑤操作风险：基金相关当事人在业务各环节操作过程中，因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险，例如，越权违规交易、交易错误、IT 系统故障等风险。

⑥法律风险：由于法律法规方面的原因，某些市场行为受到限制或合同不能正常执行，导致基金财产的损失。

#### 4、股票期权的投资风险

本基金的投资范围包括股票期权，股票期权的风险主要包括市场风险、流动性风险、保证金风险、信用风险和操作风险等。市场风险指由于标的价格变动而产生的衍生品的价格波动。流动性风险指当基金交易量大于市场可报价的交易量而产生的风险。保证金风险指由于无法及时筹措资金满足建立或者维持衍生品合约头寸所要求的保证金而带来的风险。信用风险指交易对手不愿或无法履行契约的风险。操作风险则指因交易过程、交易系统、人员疏失、或其他不可预期时间所导致的损失。

#### 5、流通受限证券投资风险

本基金的一部分资产将可能投资于流通受限证券。流通受限证券包括非公开发行股票、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，所包括的风险主要有由锁定期导致的流动性风险，以及由估值方法的原因导致的本基金的基金净值偏离所持有股票的收盘价所对应的净值等风险。

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

#### 7、合同终止的风险

《基金合同》生效满 3 年后的对应日，若基金资产净值低于 2 亿元，《基金合同》应当终止，且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续。故本基金面临无

法存续的风险。

## 五、职业道德风险

职业道德风险是指员工不遵守职业操守，发生违法、违规行为从而可能导致的损失。

## 六、流动性风险

因市场交易量不足，导致证券不能迅速、低成本地转变为现金的风险。同时在开放式基金申购赎回过程中，可能会发生巨额赎回的情形。巨额赎回可能会产生基金仓位调整的困难，导致流动性风险，甚至影响基金份额净值。

### （一）基金申购、赎回安排

投资人具体请参见本招募说明书“第八部分 基金份额的申购、赎回”，详细了解本基金的申购以及赎回安排。

### （二）拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括创业板及其他依法发行上市的股票、存托凭证)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券等)、资产支持证券、同业存单、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款、通知存款及其他银行存款)、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权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，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金股票资产占基金资产的比例 60%-95%，投资于新能源主题相关证券资产占非现金基金资产的比例不低于 80%。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，应当保持不低于基金资产净值的 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金参与股指期货、国债期货、股票期权交易，应符合法律法规规定和基金合同约定的投资限制并遵守相关期货等



交易所的业务规则。

投资标的流动性属性是重要的投资依据，通过对各类金融工具进行流动性分类管理，分散安排各类资产到期时间分布，有效保障基金流动性安全。

### （三）巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

在投资中，本基金将严格遵守基金合同中的相关规定，“本基金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所需缴纳的交易保证金后，持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，前述现金资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等”；同时，坚持适度分散的整体投资策略，在投资品种的筛选上严格控制流动性风险，最大限度降低巨额赎回情形下可能出现的流动性风险。

为应对巨额赎回情形下可能发生的流动性风险，基金管理人在认为支付投资人的赎回申请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，可采取部分延期赎回、延缓支付赎回款项、暂停赎回或者对赎回比例过高的单一投资者延期办理部分赎回申请的流动性风险管理措施，详细规则参见招募说明书第八部分之“十、巨额赎回的情形及处理方式”的相关约定。

### （四）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

本基金管理人在确保投资者得到公平对待的前提下，将在特定情形下运用流动性风险管理工具对申购、赎回申请等进行适度调整，包括但不限于：

- 1、延期办理巨额赎回申请；
- 2、暂停接受赎回申请；
- 3、延缓支付赎回款项；
- 4、收取短期赎回费；
- 5、暂停基金估值；
- 6、摆动定价；
- 7、实施侧袋机制；
- 8、中国证监会认定的其他措施。

针对实施上述备用的流动性风险管理工具，基金管理人制定了详细的业务流程。包括经严格审批的延迟支付流程、巨额赎回执行流程、延期办理赎回和暂停赎回的执行和信息披露流程等。基金投资者可能因为上述机制的启动而导致延迟收到赎回

款项或提高申赎成本。

同时，基金管理人将密切关注市场资金动向，提前调整投资和头寸安排，尽可能的避免出现不得不实施上述备用风险管理工具的流动性风险，将对投资者可能出现的潜在影响降至最低。

#### （五）实施侧袋机制对投资者的影响

侧袋机制是一种流动性风险管理工具，是将特定资产分离至专门的侧袋账户进行处置清算，并以处置变现后的款项向基金份额持有人进行支付，目的在于有效隔离并化解风险。但基金启用侧袋机制后，侧袋账户份额将停止披露基金份额净值，并不得办理申购、赎回和转换，仅主袋账户份额正常开放赎回，因此启用侧袋机制时持有基金份额的持有人将在启用侧袋机制后同时持有主袋账户份额和侧袋账户份额，侧袋账户份额不能赎回，其对应特定资产的变现时间具有不确定性，最终变现价格也具有不确定性并且有可能大幅低于启用侧袋机制时的特定资产的估值，基金份额持有人可能因此面临损失。

实施侧袋机制期间，因本基金不披露侧袋账户份额的净值，即便基金管理人在基金定期报告中披露报告期末特定资产可变现净值或净值区间的，也不作为特定资产最终变现价格的承诺，因此对于特定资产的公允价值和最终变现价格，基金管理人不承担任何保证和承诺的责任。

基金管理人将根据主袋账户运作情况合理确定申购政策，因此实施侧袋机制后主袋账户份额存在暂停申购的可能。

启用侧袋机制后，基金管理人计算各项投资运作指标和基金业绩指标时仅需考虑主袋账户资产，并根据相关规定对分割侧袋账户资产导致的基金净资产减少进行按投资损失处理，因此本基金披露的业绩指标不能反映特定资产的真实价值及变化情况。

#### 六、合规性风险

合规性风险是指在基金管理或运作过程中，违反国家法律、法规的规定，或者基金投资违反法规及基金合同有关规定的风险。

#### 七、本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险

本基金法律文件投资章节有关风险收益特征的表述是基于投资范围、投资比例、证券市场普遍规律等做出的概述性描述，代表了一般市场情况下本基金的长期

风险收益特征。销售机构(包括基金管理人直销机构和其他销售机构)根据相关法律法规对本基金进行风险评价,不同的销售机构采用的评价方法也不同,因此销售机构的风险等级评价与基金法律文件中风险收益特征的表述可能存在不同,投资人在购买本基金时需按照销售机构的要求完成风险承受能力与产品风险之间的匹配检验。

#### 八、税负增加风险

财政部、国家税务总局财政[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》第四条规定:“资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。”鉴于基金合同中基金管理人的管理费中不包括产品运营过程中发生的税款,本基金运营过程中需要缴纳增值税应税的,将由基金份额持有人承担并从基金资产中支付,按照税务机关的规定以基金管理人为增值税纳税人履行纳税义务,因此可能增加基金份额持有人的投资税费成本。

#### 九、其他风险

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

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

## 第十八部分 基金合同的变更、终止与基金财产清算

### 一、《基金合同》的变更

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

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自生效后执行，自决议生效后两日内在规定媒介公告。

### 二、《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：

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

### 三、基金财产的清算

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

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、符合《中华人民共和国证券法》规定的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

#### 4、基金财产清算程序：

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

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

(6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；

(7) 对基金剩余财产进行分配。

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

#### 四、清算费用

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

#### 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后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告，基金财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

#### 七、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存，保存期限不低于法律法规规定的最低期限。

## 第十九部分 基金合同内容摘要

基金合同内容摘要，请见附件一。

## 第二十部分 基金托管协议内容摘要

基金托管协议内容摘要，请见附件二。

## 第二十一部分 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以下一系列服务：

### 一、基金份额持有人登记服务

基金管理人或者委托基金登记机构为基金份额持有人提供登记服务。基金登记机构配备安全、完善的电脑系统及通讯系统，准确、及时地为基金份额持有人办理基金账户与基金份额的登记、管理、托管与转托管，基金份额持有人名册的管理，权益分配时红利的登记、派发，基金交易份额的清算过户和基金交易资金的交收等服务。

### 二、网上交易服务

基金管理人为基金份额持有人提供网上交易平台。通过先进的网络通讯技术，为基金份额持有人提供高效安全的基金交易服务、及时迅捷的基金信息和理财服务。

### 三、主动通知服务

基金管理人可以通过电子邮件、短信、主动致电等方式为基金份额持有人提供各项主动通知服务；基金管理人公告及重要信息将通过规定媒介发布。基金管理人可以为基金份额持有人提供以电子形式为主的确认单、对账单等基金信息服务。

### 四、查询服务

为方便基金份额持有人随时了解基金管理人相关信息及投资资讯，基金管理人开通24小时自动语音服务、网上查询等方式。通过以上方式可进行基金管理人信息查询和基金份额持有人账户信息查询。

### 五、在线客服

基金份额持有人可以访问基金管理人网站www.msjyfund.com.cn，登陆在线客服，实现基金管理人与投资人网上面对面答疑解惑。

### 六、多元资料索取

基金管理人为基金份额持有人提供详细的专业基金投资资料，便于办理各种交易手续，同时为方便基金份额持有人索取，基金管理人提供了多元化的资料索取服务，索取途径多样，资料内容丰富详尽。

所有对外公布文件及各种相关历史文件均可向客户服务人员索取，客户服务人



员可通过传真、Email提供；同时，基金管理人网站上提供各种资料、业务表单及公告下载。

#### 七、资讯服务定制

为进一步提高基金运作的透明度，提升服务品质，使基金份额持有人及时了解基金投资资讯，基金管理人推出全方位资讯服务定制项目。基金份额持有人可通过客服热线、基金管理人网站、短信定制各种资讯，基金管理人通过传真、Email、短信等多渠道发送资讯定制服务。

#### 八、投资业务咨询

基金管理人的专业客户服务代表将在规定的工作时间内回答客户提出的问题，提供关于基金投资全方位的咨询服务。

#### 九、投诉与建议的受理

基金管理人认为基金份额持有人的合理建议是基金管理人发展的动力与方向。如果对基金管理人提供的各种服务感到不满意或有其他需求，可通过电话、来信、传真、Email、手机短信等各种方式随时向基金管理人提出，也可直接与客户服务人员联系，基金管理人将采用限期处理、分级管理的原则，及时处理客户的投诉与建议。

#### 十、客户互动活动

基金管理人为基金份额持有人举办各种互动活动，如基金份额持有人见面会、理财讲座等，以加强基金份额持有人与基金管理人之间的互动联系。

十一、基金管理人有权根据基金份额持有人的需要、市场状况以及基金管理人服务能力的变化，增加、修改上述服务项目。

#### 十二、基金管理人客户服务中心联系方式

客户服务电话：400-8888-388

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

客户服务电子信箱：[services@msjyfund.com.cn](mailto:services@msjyfund.com.cn)

十三、如本招募说明书存在任何您/贵机构无法理解的内容，可通过上述方式联系本公司。请确保投资前，您/贵机构已经全面理解了本招募说明书。

## 第二十二部分 其他应披露事项

本基金的其他应披露事项将严格按照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》等相关法律法规规定的内容与格式进行披露，并在规定媒介上公告。

## 第二十三部分 招募说明书的存放及查阅方式

### 一、招募说明书的存放地点

本招募说明书存放在基金管理人、基金托管人、其他基金销售机构的住所，并刊登在基金管理人、基金托管人、其他基金销售机构的网站上。

### 二、招募说明书的查阅方式

投资人可在办公时间免费查阅本基金的招募说明书，或通过基金管理人、基金托管人、其他基金销售机构的网站查询，也可按工本费购买本招募说明书的复印件，但内容应以本基金招募说明书的正本为准。

## 第二十四部分 备查文件

备查文件等文本存放在基金管理人、基金托管人和其他基金销售机构的住所，在办公时间内可供免费查阅。

（一）中国证监会准予民生加银新能源智选混合型发起式证券投资基金募集注册的文件；

（二）《民生加银新能源智选混合型发起式证券投资基金基金合同》；

（三）《民生加银新能源智选混合型发起式证券投资基金托管协议》；

（四）法律意见书；

（五）基金管理人业务资格批件、营业执照；

（六）基金托管人业务资格批件、营业执照；

（七）中国证监会要求的其他文件。

民生加银基金管理有限公司

2021年9月8日

## 附件一：基金合同内容摘要

（本摘要如与基金合同正文不符，以基金合同正文为准）

### 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）基金管理人的权利与义务

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

（1）依法募集资金；

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

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

（4）销售基金份额；

（5）按照规定召集基金份额持有人大会；

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

（7）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

（8）选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；

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

（10）依据《基金合同》及有关法律、法规规定决定基金收益的分配方案；

（11）在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购、赎回与转换申请；

（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，为基金的利益依法为基金进行融资；

（14）以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

(15) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券、期货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、转换和非交易过户等的业务规则；

(17) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

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

(2) 办理基金备案手续；

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

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

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

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

(7) 依法接受基金托管人的监督；

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

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(10) 编制季度报告、中期报告和年度报告；

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

(12) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，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，保存期限不低于法律法规规定的最低期限；

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

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

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

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

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

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

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

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

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(26) 建立并保存基金份额持有人名册；

(27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## (二) 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，为基金开设资金账户、证券账户等投资所需账户，为基金办理证券、期货交易资金清算；

(5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

(6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

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

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

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

(5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

(6) 按规定开设基金财产的资金账户、证券账户等投资所需账户，按照《基



金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

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

(8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、各类基金份额净值、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，保存期限不低于法律法规规定的最低期限；

(12) 从基金管理人或其委托的登记机构处接收并保存基金份额持有人名册；

(13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

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

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

(16) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；

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

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

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

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

- (21) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- (22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

### (三) 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。

同一类别的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) 依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；
- (4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会；
- (5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- (6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- (7) 监督基金管理人的投资运作；
- (8) 对基金管理人、基金托管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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) 交纳基金认购、申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；
- (5) 在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有

限责任；

- (6) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；
- (7) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- (8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
- (9) 发起资金提供方持有认购的基金份额不少于 3 年；
- (10) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## 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，但法律法规和中国证监会另有规定的除外：

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

有人大会的事项。

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

(1) 法律法规要求增加的基金费用的收取；

(2) 调整本基金的申购费率、调低赎回费率、调低销售服务费率或变更收费方式、调整本基金的基金份额类别的设置或分类规则；

(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、登记机构、基金销售机构调整有关申购、赎回、转换、基金交易、非交易过户、转托管等业务规则；

(6) 按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

## (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开时，由基金托管人召集。

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

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

60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%以上（含 10%）的

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

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

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

（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，在规定媒介公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

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

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

3、如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。基金管理人或

基金托管人拒不派代表对表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。

#### （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、通讯开会等方式或法律法规、监管机构允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

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

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

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

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

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

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

通知不参加收取书面表决意见的，不影响表决效力；

(3) 本人直接出具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基金总份额的二分之一（含二分之一）；若本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）基金份额的持有人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见；

(4) 上述第(3)项中直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并与基金登记机构记录相符。

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

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

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

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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



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

#### （七）计票

##### 1、现场开会

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

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

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

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

##### 2、通讯开会

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

#### （八）生效与公告

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

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 日内在规定媒介上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金

份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

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

（九）实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定

若本基金实施侧袋机制，则相关基金份额或表决权的比例指主袋份额持有人和侧袋份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：

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%）；

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）；

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）；

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；

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作为该次基金份额持有人大会的主持人；

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；

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。

同一主侧袋账户内的每份基金份额具有平等的表决权。

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

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自生效后执行，自决议生效后两日内在规定媒介公告。

#### （二）《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：

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

#### （三）基金财产的清算

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

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、符合《中华人民共和国证券法》规定的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

#### 4、基金财产清算程序：

- （1）《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；

(2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；

(3) 对基金财产进行估值和变现；

(4) 制作清算报告；

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

(6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；

(7) 对基金剩余财产进行分配。

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

#### (四) 清算费用

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

#### (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后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告，基金财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

#### (七) 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存，保存期限不低于法律法规规定的最低期限。

### 四、争议解决方式

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，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，除非仲裁裁决另有规定，仲裁费由败诉方承担。

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

《基金合同》受中国法律（为本基金合同之目的，不包括香港、澳门和台湾法律）管辖。

#### 五、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

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

**附件二：基金托管协议内容摘要**

（本摘要如与基金托管协议正文不符，以基金托管协议正文为准）

**一、基金托管协议当事人****（一）基金管理人**

名称：民生加银基金管理有限公司

住所：深圳市福田区莲花街道福中三路 2005 号民生金融大厦 13 楼 13A

办公地址：深圳市福田区莲花街道福中三路 2005 号民生金融大厦 13 楼 13A

法定代表人：张焕南

设立日期：2008 年 11 月 3 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许可[2008]1187

号

组织形式：有限责任公司（中外合资）

注册资本：叁亿元

存续期限：永续经营

**（二）基金托管人**

名称：中信银行股份有限公司（简称“中信银行”）

住所：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

成立时间：1987 年 4 月 20 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：489.35 亿元人民币

存续期间：持续经营

批准设立文号：中华人民共和国国务院办公厅国办函[1987]14 号

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[2004]125 号

经营范围：保险兼业代理业务（有效期至 2020 年 09 月 09 日）；吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；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；提供保管箱服务；结汇、售汇业务；代理开放式基金业务；办理黄金业务；黄金进出口；开展证券投资基金、企业年金基金、保险资金、合格境外机构投资者托管业务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。（企业依法自主选择经营项目，开展经营活动；依法须经批准的项目，经相关部门批准后依批准的内容开展经营活动；不得从事本市产业政策禁止和限制类项目的经营活动。）

## 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和基金合同的约定，对下述基金投资范围、投资对象进行监督。本基金将投资于以下金融工具：

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括创业板及其他依法发行上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券等）、资产支持证券、同业存单、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款、通知存款及其他银行存款）、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权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，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金股票资产占基金资产的比例60%-95%，投资于新能源主题相关证券资产占非现金基金资产的比例不低于80%。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，应当保持不低于基金资产净值的5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金参与股指期货、国债期货、股票期权交易，应符合法律法规规定和基金合同约定的投资限制并遵守相关期货等交易所的业务规则。

(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下述基金投资比例进行监督:

(1) 本基金股票资产占基金资产的60%-95%，投资于新能源主题相关证券资产比例不低于非现金基金资产的80%；

(2) 本基金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所需缴纳的交易保证金后，持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，前述现金资产不包括结算备付金、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%，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) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的10%；

(7) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的20%；

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

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

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

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



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

(13) 本基金的资产总值不得超过基金资产净值的140%；

(14) 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本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；

(15) 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；

(16) 本基金参与股指期货交易，需遵守下列投资比例限制：

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

2) 本基金在任何交易日日终，持有的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%；

3) 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%；

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

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

(17) 本基金参与国债期货交易的，应当遵守下列要求：

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

2) 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%；

3) 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；

4) 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%；

(18) 本基金参与股票期权交易的，需遵守下列投资比例限制：

1) 本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%；

2) 本基金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；

3) 本基金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；

(19) 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；

(20) 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。

除第（2）、（10）、（14）、（15）项外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

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

法律法规或监管部门对上述投资限制、投资禁止等作出强制性调整的，本基金应当按照法律法规或监管部门的规定执行；如法律法规或监管部门修改或调整上述投资限制、投资禁止性规定，且该等调整或修改属于非强制性的，基金管理人有权在履行适当程序后按照法律法规或监管部门调整或修改后的规定执行，并应向投资者履行信息披露义务。

（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下述基金投资禁止行为进行监督：

根据法律法规的规定及基金合同的约定，本基金禁止从事下列行为：

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

法律法规或监管部门取消或调整上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按调整后的规定执行。

(四) 基金托管人依据有关法律法规的规定和基金合同的约定对于基金关联投资限制进行监督：

根据法律法规有关基金禁止从事的关联交易的规定，基金管理人和基金托管人应事先相互提供与本机构有控股关系的股东或与本机构有重大利害关系的公司名单及其更新，加盖公章并书面提交，并确保所提供名单的真实性、完整性、全面性。名单变更后基金管理人应及时发送基金托管人，基金托管人于2个工作日内进行回函确认已知名单的变更。名单变更时间以基金管理人收到基金托管人回函确认的时间为准。如果基金托管人在运作中严格遵循了监督流程，基金管理人仍违规进行交易，并造成基金资产损失的，由基金管理人承担责任，基金托管人不承担任何损失和责任。

若基金托管人发现基金管理人与关联方进行法律法规禁止基金从事的交易时，基金托管人应及时提醒并协助基金管理人采取必要措施阻止该交易的发生，若基金托管人采取必要措施后仍无法阻止该交易发生时，基金托管人有权向中国证监会报告，由此造成的损失和责任由基金管理人承担。对于交易所场内已成交的违规交易，基金托管人应按相关法律法规和交易所规则的规定进行结算，同时向中国证监会报告，基金托管人不承担由此造成的损失和责任。

(五) 基金托管人依据有关法律法规的规定和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：

(1) 基金托管人依据有关法律法规的规定和基金合同的约定对于基金管理人参与银行间债券市场交易时面临的交易对手资信风险进行监督。

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银行间债券市场交易对手的名单，并按照审慎的风险控制原则在该名单中约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金托管人在收到名单后2个工作日内回函确认收到该名单。基金管理人应定期或不定期对银行间债券市场现券及回购交易对手的名单进行更新，名单中增加或减少银行间债券市场交易对手时须及时通知基金托管人，基金托管人于2个工作日内回函确认收到后，对名单进行更新。基金管理人收到基金托管人书面确认后，被确认调整的名单开始生效，新名单生效前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照双方原定协议进行结算。

如果基金托管人发现基金管理人与不在名单内的银行间债券市场交易对手进行交易，应及时提醒基金管理人撤销交易，经提醒后基金管理人仍执行交易并造成基金资产损失的，基金托管人不承担责任。

(2) 基金托管人对于基金管理人参与银行间债券市场交易的交易方式的控制。

基金管理人在银行间债券市场进行现券买卖和回购交易时，需按交易对手名单中约定的该交易对手所适用的交易结算方式进行交易。如果基金托管人发现基金管理人没有按照事先约定的有利于信用风险控制的方式进行交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人与交易对手重新确定交易方式，经提醒后仍未改正并造成基金资产损失的，基金托管人不承担责任。

(3) 基金管理人有责任控制交易对手的资信风险，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。若未履约的交易对手在基金管理人确定的时间内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。

(六) 基金托管人对基金投资流通受限证券的监督：

(1) 基金投资流通受限证券，此处的流通受限证券与上文所述的流动性受限资产并不完全一致，应遵守《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。流通受限证券指由《上市公司证券发行管理办

法》规范的非公开发行股票、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。

(2) 基金管理人应在基金首次投资流通受限证券前,向基金托管人提供经基金管理人董事会批准的有关基金投资流通受限证券的投资决策流程、风险控制制度。基金投资非公开发行股票,基金管理人还应提供基金管理人董事会批准的流动性风险处置预案。上述资料应包括但不限于基金投资流通受限证券的投资额度和投资比例控制情况。

基金管理人应至少于首次执行投资指令之前2个工作日将上述资料书面发至基金托管人,保证基金托管人有足够的时间进行审核。基金托管人应在收到上述资料后2个工作日内,以书面或其他双方认可的方式确认收到上述资料。

(3) 基金投资流通受限证券前,基金管理人应向基金托管人提供符合法律法规要求的有关必要书面信息。基金管理人应保证上述信息的真实、完整,并应至少于拟执行投资指令前将上述信息书面发至基金托管人。

(4) 基金托管人应对基金管理人是否遵守法律法规、投资决策流程、风险控制制度情况进行监督,并审核基金管理人提供的有关书面信息。基金托管人认为上述资料可能导致基金出现风险的,有权要求基金管理人在投资流通受限证券前就该风险的消除或防范措施进行补充书面说明,否则,基金托管人有权拒绝执行有关指令。因拒绝执行该指令造成基金财产损失的,基金托管人不承担任何责任,并有权报告中国证监会。

如基金管理人和基金托管人无法达成一致,应及时上报中国证监会请求解决。如果基金托管人切实履行监督职责,则不承担任何责任。如果基金托管人没有切实履行监督职责,导致基金出现风险,基金托管人应承担相应责任。

#### (七) 基金托管人对基金投资中期票据的监督:

(1) 基金管理人管理的基金在投资中期票据前,基金管理人须根据法律、法规、监管部门的规定,制定严格的关于投资中期票据的风险控制制度和流动性风险处置预案,并书面提供给基金托管人,基金托管人依据上述文件对基金管理人投资中期票据的额度和比例进行监督。

(2) 如未来有关监管部门发布的法律法规对证券投资基金投资中期票据另有

规定的，从其约定。

(3) 基金托管人有权监督基金管理人在相关基金投资中期票据时的法律法规遵守情况，有关制度、信用风险、流动性风险处置预案的完善情况，有关额度、比例限制的执行情况。基金托管人发现基金管理人的上述事项违反法律法规和基金合同以及本协议的规定，应及时以书面形式通知基金管理人纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人应按相关托管协议要求向基金托管人及时发出回函，并及时改正。基金托管人有权随时对所通知事项进行复查，督促基金管理人改正。如果基金管理人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。如果基金托管人未能切实履行监督职责，导致基金出现风险，基金托管人应承担相应责任。

(八) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人选择存款银行进行监督：

基金投资银行定期存款的，基金管理人应根据法律法规的规定及基金合同的约定，确定符合条件的所有存款银行的名单，并及时提供给基金托管人，基金托管人依据以对基金投资银行存款的交易对手是否符合有关规定进行监督。

本基金投资银行存款应符合如下规定：

(1) 基金管理人、基金托管人应当与存款银行建立定期对账机制，确保基金银行存款业务账目及核算的真实、准确。

(2) 基金管理人与基金托管人应根据相关规定，就本基金银行存款业务另行签订书面协议，明确双方在相关协议签署、账户开设与管理、投资指令传达与执行、资金划拨、账目核对、到期兑付、文件保管以及存款证实书的开立、传递、保管等流程中的权利、义务和职责，以确保基金财产的安全，保护基金份额持有人的合法权益。

(3) 基金托管人应加强对基金银行存款业务的监督与核查，严格审查、复核相关协议、账户资料、投资指令、存款证实书等有关文件，切实履行托管职责。

(4) 基金管理人与基金托管人在开展基金存款业务时，应严格遵守《基金法》、《运作办法》等有关法律法规，以及国家有关账户管理、利率管理、支付结算等的各项规定。

基金托管人对基金管理人选择存款银行的监督应依据基金管理人向基金托管人

提供的符合条件的存款银行的名单执行，如基金托管人发现基金管理人将基金资产投资于该名单之外的存款银行，有权拒绝执行。该名单如有变更，基金管理人应在启用新名单前提前2个工作日将新名单发送给基金托管人。

（九）基金托管人对基金管理人业务进行监督和核查的有关措施：

（1）基金托管人应根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金资产净值计算、各类基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、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。

（2）基金托管人发现基金管理人的投资运作及其他运作违反《基金法》、基金合同、本托管协议及其他有关规定时，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应在下一个工作日及时核对，并以书面形式向基金托管人发出回函，进行解释或举证。

（3）在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

（4）基金托管人发现基金管理人的投资指令违反相关法律法规规定或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人。

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

（6）基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查，必须在规定时间内答复基金托管人并改正，就基金托管人的疑义进行解释或举证，对基金托管人按照法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

（7）基金托管人发现基金管理人重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

（8）基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠基金托管人根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍基金托管人进行有效监督，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。

(9) 基金管理人应遵守中华人民共和国反洗钱法律法规，不参与涉嫌洗钱、恐怖融资、扩散融资等违法犯罪活动；主动配合基金托管人客户身份识别与尽职调查，提供真实、准确、完整客户资料，遵守基金托管人反洗钱与反恐怖融资相关管理规定。对具备合理理由怀疑涉嫌洗钱、恐怖融资的客户，基金托管人将按照中国人民银行反洗钱监管规定采取必要管控措施。

### 三、基金管理人 对基金托管人的业务核查

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

(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、本托管协议及其他有关规定时，基金管理人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确认并以书面形式向基金管理人发出回函。在限期内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正，并予协助配合。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正或未在合理期限内确认的，基金管理人应报告中国证监会。基金管理人 有义务要求基金托管人赔偿基金因此所遭受的损失。

(三) 基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应立即报告中国证监会和银行业监督管理机构，同时通知基金托管人限期纠正。

(四) 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。

(五) 基金托管人无正当理由，拒绝、阻挠基金管理人根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍基金管理人进行有效监督，情节严重或经基金管理人提出警告仍不改正的，基金管理人应报告中国证监会。

### 四、基金财产的保管

#### (一) 基金财产保管的原则

1. 基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产；



2. 基金托管人应安全保管基金财产。除依据法律法规规定、基金合同和本托管协议约定及基金管理人的正当指令外，不得自行运用、处分、分配基金的任何财产；

3. 基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券/期货账户；

4. 基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，与基金托管人的其他业务和其他基金的托管业务实行严格的分账管理，确保基金财产的完整与独立；

5. 基金托管人根据基金管理人的指令，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；

6. 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资产。

## （二）募集资金的验资

1. 基金募集期间募集的资金应存于基金管理人在具备基金销售业务资格的商业银行或者从事客户交易结算交易资金存管的商业银行等营业机构开立的“基金募集专户”。该账户由基金管理人开立并管理。

2. 基金募集期满或基金提前结束募集时，发起资金认购金额、发起资金提供方及其承诺的认购基金份额持有期限符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，基金管理人应将募集的属于本基金财产的全部资金划入基金托管人为本基金开立的资产托管专户中，基金托管人在收到资金当日出具确认文件。同时，基金管理人应聘请符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所进行验资，出具验资报告，验资报告需对发起资金提供方及其持有份额进行专门说明，出具的验资报告应由参加验资的2名以上（含2名）中国注册会计师签字有效。

3. 若基金募集期限届满，未能达到基金备案条件，由基金管理人按规定办理退款事宜。

## （三）基金的银行账户的开立和管理

1. 基金托管人以本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刻制、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有关法律法规以及银行业监督管理机构的有关规定。

#### （四）基金证券账户与证券交易资金账户的开设和管理

1. 基金托管人以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司开设证券账户。

2. 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上海分公司/深圳分公司开立基金证券交易资金账户，用于证券清算。

3. 基金证券账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借和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。

#### （五）债券托管账户的开立和管理

1. 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；基金托管人负责以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司开设银行间债券市场债券托管账户，并由基金托管人负责基金的债券的后台匹配及资金的清算。

2. 基金管理人和基金托管人应一起负责为基金对外签订全国银行间国债市场回购主协议，正本由基金托管人保管，基金管理人保存副本。

#### （六）期货的相关账户的开立和管理

1. 基金管理人、基金托管人应当按照相关规定开立期货结算账户、期货资金账户，在中国金融期货交易所获取交易编码。期货结算账户名称、期货资金账户名称及交易编码对应名称应按照有关规定设立。

2. 基金托管人已取得期货保证金存管银行资格，基金管理人授权基金托管人办理相关银期转账业务。

#### （七）其他账户的开设和管理

在本托管协议生效之后，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。

#### （八）基金财产投资的有关实物证券、银行定期存款存单等有价凭证的保管

基金财产投资的有关实物证券由基金托管人存放于基金托管人的保管库；其中实物证券也可存入中央国债登记结算有限责任公司或中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司或票据营业中心的代保管库。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。属于基金托管人控制下的实物证券在基金托管人保管期间的损坏、灭失，由此产生的责任应由基金托管人承担。基金托管人对基金托管人以外机构实际有效控制的证券不承担保管责任。

#### （九）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有关的重大合同的原件分别应由基金托管人、基金管理人保管。基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时，应保证基金一方持有两份以上的正本原件，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人在合同签署后30个工作日内通过专人送达、挂号邮寄等安全方式将合同送达基金托管人处。合同应存放于基金管理人和基金托管人各自文件保管部门，保存期限不低于法律法规规定的最低期限。对于无法取得二份以上的正本的，基金管理人应向基金托管人提供加盖授权业务章的合同传真件，未经双方协商或未在合同约定范围内，合同原件不得转移，由基金管理人保管。

### 五、基金资产净值计算和会计核算

#### 1. 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。各类基金份额净值是指估值日该类基金资产净值除以该日该类基金份额总份额后的数值。各类基金份额净值的计算均保留到小数点后4位，小数点后第5位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。基金管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的，从其规定。

#### 2. 复核程序

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基金合同的规定暂停估值时除外。估值原则应符合基金合同、《证券投资基金会计核算办法》及其他法律、法规的规定。基金资产净值和各类基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个估值日交易结束后计算

当日的基金资产净值和各类基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金净值予以公布。

3. 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，基金管理人向基金托管人出具加盖公章的书面说明后，按照基金管理人对基金净值信息的计算结果对外予以公布。由此给基金份额持有人和基金造成的损失以及因该交易日基金资产净值计算顺延错误而引起的损失，由基金管理人负责赔付。

## 六、基金份额持有人名册的保管

基金管理人和基金托管人须分别妥善保管的基金份额持有人名册，基金份额持有人名册的内容必须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的基金登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，登记机构的保管期限自基金账户销户之日起不得少于 20 年。基金管理人和基金托管人应按照目前相关规则分别保管基金份额持有人名册。保管方式可以采用电子或文档的形式，保存期限不低于法律法规规定的最低期限。

基金管理人应当及时向基金托管人定期或不定期提交下列日期的基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容必须包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。基金托管人可以采用电子或文档的形式妥善保管基金份额持有人名册，保存期限不低于法律法规规定的最低期限。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。

若基金管理人或基金托管人由于自身原因无法妥善保管基金份额持有人名册，应按有关法规规定各自承担相应的责任。

## 七、托管协议的变更和终止

### （一）托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议的内容进行变更。变更后的托管协议，其内容不得与基金合同的规定有任何冲突。本托管协议的变更报中国证监会备案。

### （二）基金托管协议终止的情形

发生以下情况，本托管协议终止：

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

## 八、争议解决方式

本协议及本协议项下各方的权利和义务适用中华人民共和国法律（为本协议之目的，不包括香港、澳门和台湾法律），并按照中华人民共和国法律解释。

凡因本协议产生的及与本协议有关的争议，甲乙双方均应协商、调解解决；协商、调解不成的，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，按照该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，除非仲裁裁决另有规定，仲裁费用由败诉方承担。

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