

金鹰基金管理有限公司
关于以通讯方式召开金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）
基金份额持有人大会的第二次提示性公告

一、召开会议基本情况

金鹰基金管理有限公司已分别于 2021 年 11 月 29 日、2021 年 11 月 30 日在中国证监会规定媒介及金鹰基金管理有限公司网站（www.gefund.com.cn）发布了《金鹰基金管理有限公司关于以通讯方式召开金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会的公告》、《金鹰基金管理有限公司关于以通讯方式召开金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会的第一次提示性公告》。为了使本次基金份额持有人大会顺利召开，根据基金合同的相关规定，现发布本次基金份额持有人大会的第二次提示性公告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）基金合同》（以下简称“《基金合同》”）等有关规定，金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）的基金管理人金鹰基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）经与本基金的基金托管人交通银行股份有限公司协商一致，决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，审议《关于金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）转型有关事项的议案》。会议具体安排如下：

1、会议召开方式：通讯方式

2、会议投票表决起止时间：自 2021 年 11 月 29 日起，至 2021 年 12 月 28 日 17:00 止
（以基金管理人收到表决票的时间为准）

3、会议表决票的寄达地点

基金管理人：金鹰基金管理有限公司

办公地址：广东省广州市珠江东路 28 号越秀金融大厦 30 层

联系人：唐研然

联系电话：020-22825647

邮政编码：510630

请在信封表面注明：“金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会表决专用”。

二、会议审议事项

本次持有人大会拟审议的事项为《关于金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）转型有关事项的议案》（见附件一）。

上述议案的内容说明详见《关于金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）转型有关事项的说明》（见附件四）

三、权益登记日

本次大会的权益登记日为 2021 年 11 月 25 日，即当日交易结束后，在本基金登记机构登记在册的本基金全体基金份额持有人均有权参加本次基金份额持有人大会。

四、表决票的填写和寄交方式

1、本次会议表决票详见附件二，基金份额持有人可剪报、复印、登录本基金管理人网站（www.gefund.com.cn）下载并打印，或按附件二格式自制。

2、基金份额持有人应当按照表决票的要求填写相关内容，其中：

（1）个人投资者自行投票的，需在表决票上签字，并提供本人开立持有本基金基金份额的基金账户所使用的有效身份证件（包括身份证或其他能够证明其身份的有效证件或证明）正反面复印件。

（2）个人投资者委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供由被代理人填妥并签署的授权委托书原件（见附件三）以及被代理人开立持有本基金基金份额的基金账户所使用的有效身份证件（包括身份证或其他能够证明其身份的有效证件或证明）正反面复印件。

如代理人为个人，还需提供代理人的有效身份证件（包括身份证或其他能够证明其身份的有效证件或证明）正反面复印件；如代理人为机构，还需提供代理人加盖公章的营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文、开户证明或其他登记证书复印件等）。

（3）机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本单位公章，并提交加盖公章的该机构开立持有本基金基金份额的基金账户所使用的营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文、开户证明或其他登记证书复印件等）。

（4）机构投资者委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供由被代理人填妥并加盖公章的授权委托书原件（见附件三），以及加盖公章的被代理人开立持有本基金基金份额的基金账户所使用的营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文、开户证明或其他登记证书复印件等）。

如代理人为个人，还需提供代理人的有效身份证件（包括身份证或其他能够证明其身份的有效证件或证明）正反面复印件；如代理人为机构，还需提供代理人加盖公章的营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文、开户证明或其他登记证书复印件等）。

（5）以上各项及本公告正文中的公章、批文、开户证明及登记证书等文件，以基金管理人的认可为准。

3、基金份额持有人或其代理人需将填妥的表决票和所需的相关文件于前述会议投票表决起止时间内（以基金管理人收到表决票时间为准）通过专人送交或邮寄的方式送达至本公告列明的寄达地点，并请在信封表面注明：“金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）基金

份额持有人大会表决专用”。

五、计票

1、本次通讯会议的计票方式为：由基金管理人授权的两名监督员在基金托管人授权代表的监督下于本公告所通知的表决截止日期后 2 个工作日内进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。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。

2、基金份额持有人所持每份基金份额享有一票表决权，且每一基金份额享有平等的表决权。

3、表决票效力的认定如下：

(1) 表决票填写完整清晰，所提供文件符合本公告规定，且在截止时间之前送达指定联系地址的，为有效表决票；有效表决票按表决意见计入相应的表决结果，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

(2) 如表决票上的表决意见未选、多选、模糊不清或相互矛盾，但其他各项符合本公告规定的，视为弃权表决，计入有效表决票；并按“弃权”计入对应的表决结果，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

(3) 如表决票上的签字或盖章部分填写不完整、不清晰的，或未能提供有效证明基金份额持有人身份或代理人经有效授权的证明文件的，或未能在截止时间之前送达指定联系地址的，均为无效表决票；无效表决票不计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

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

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

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

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

六、会议决议的生效条件

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

2、本次议案审议事项经提交有效表决票的本基金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。

3、本次基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效，本基金管理人自决议通过之日起五日内报中国证监会备案。

七、二次召集基金份额持有人大会及二次授权

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及《基金合同》的规定，本次持有人大会需要

到会者在权益登记日代表的有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）方可召开。若到会者在权益登记日所持有的有效基金份额低于上述规定比例的，基金管理人可以在本次基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一（含三分之一）以上的基金份额的持有人参加，方可召开。

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

八、本次持有人大会相关机构

1、会议召集人：金鹰基金管理有限公司

2、基金托管人：交通银行股份有限公司

3、公证机关：广东省广州市南方公证处

联系人：赵萍

联系电话：020-83355889

4、见证律师事务所：广东岭南律师事务所

联系人：伍瑞祥

联系电话：020-81836088

九、重要提示

1、关于本次议案的说明见附件四。

2、请基金份额持有人在提交表决票时，充分考虑邮寄在途时间，提前寄出表决票。

3、本次基金份额持有人大会有关公告可通过本基金管理人网站(www.gefund.com.cn)查阅，投资者如有任何疑问，可致电本基金管理人客户服务电话(400-6135-888)咨询。

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

5、本公告的有关内容由金鹰基金管理有限公司负责解释。

金鹰基金管理有限公司

2021年12月1日

附件一：《关于金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）转型有关事项的议案》

附件二：《金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会表决票》

附件三：《授权委托书》

附件四：《关于金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）转型有关事项的说明》

附件一：

关于金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF） 转型有关事项的议案

金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）基金份额持有人：

为顺应市场环境变化，更好地满足广大投资者的理财需求、为投资者提供多样化理财服务，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，本基金管理人经与基金托管人交通银行股份有限公司协商一致，决定召开本基金的基金份额持有人大会，审议将本基金转型为“金鹰先进制造股票型证券投资基金（LOF）”并对《基金合同》进行修订的有关事项，具体修订内容包括：修改基金名称，增设C类基金份额，修改基金的投资目标、投资范围、投资策略、投资比例限制、业绩比较基准、基金费用、收益分配原则、估值方法等相关条款。具体内容详见附件四《关于金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）转型有关事项的说明》。

为实施本基金的转型方案，提请基金份额持有人大会授权基金管理人据此落实相关事项，并授权基金管理人可根据实际情况做相应调整。具体安排详见基金管理人届时发布的相关公告。

以上议案，请予审议。

金鹰基金管理有限公司

2021年11月29日

附件三：

授权委托书

兹委托 先生/女士/公司代表本人（或本机构）参加投票截止日为 2021 年 12 月 28 日的以通讯方式召开的金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会，并代为全权行使对议案的表决权。表决意见以代理人的表决意见为准。

若金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）重新召集审议相同议案的持有人大会的，本授权继续有效。

委托人（签字/盖章）：

委托人证件号码：

委托人基金账号：

代理人（签字/盖章）：

代理人证件号码：

委托日期： 年 月 日

附注：

1、本授权委托书中“委托人证件号码”，指基金份额持有人在开立持有本基金基金份额的基金账户时所使用的证件号码或该证件号码的更新。

2、“基金账号”指持有本基金基金份额的基金账户号码。同一基金份额持有人拥有多个基金账户且需要按照不同账户持有的基金份额分别行使授权的，应当填写基金账号；其他情况可不必填写。此处空白、多填、错填、无法识别等情况，将被默认为代表此基金份额持有人所持有的本基金所有份额。

3、此授权委托书可剪报、复印、打印或按以上格式自制，填写完整并签字盖章后均为有效。

附件四：

关于金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）转型有关事项的说明

一、声明

为顺应市场环境变化，更好地满足广大投资者的理财需求、提供多样化理财服务，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）基金合同》（以下简称“《基金合同》”）等有关规定，经本基金管理人提议，并与基金托管人交通银行股份有限公司协商一致，决定以通讯方式召开金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”或“金鹰量化精选（LOF）”）的基金份额持有人大会，审议《关于金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）转型有关事项的议案》，将本基金转型为金鹰先进制造股票型证券投资基金（LOF）（以下简称“金鹰先进制造（LOF）”）。

本基金由原金鹰中证 500 指数分级证券投资基金（以下简称“金鹰中证 500 指数分级”）召开基金份额持有人大会表决通过后转型而来，《基金合同》自 2016 年 8 月 25 日起生效。金鹰中证 500 指数分级经中国证监会证监许可[2012]247 号文准予募集，基金成立日为 2012 年 6 月 5 日。

本次转型事项属于对本基金原注册事项的实质性调整，经基金管理人向中国证监会申请，已获中国证监会准予变更注册。

本次基金份额持有人大会需由到会者在权益登记日代表的有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一以上（含二分之一）方可召开，且议案需经参加本次持有人大会表决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，故本次转型事项存在未能达到开会条件或无法获得持有人大会表决通过的可能。

中国证监会对持有人大会表决通过的事项所作的任何决定或意见，均不表明其对本基金的投资价值、市场前景或者投资人的收益做出实质性判断或保证。

二、基金转型方案要点

（一）变更基金名称

基金名称由“金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）”变为“金鹰先进制造股票型证券投资基金（LOF）”。

（二）变更投资范围

转型后基金投资范围增加创业板股票、存托凭证、港股通标的股票、央行票据、政府支持机构债、同业存单，允许参与融资业务，并减少权证、中小企业私募债。

具体而言，金鹰先进制造（LOF）的投资范围明确为：“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（包括主板、创业板、存托凭证及其他中国证监会允许基金投资的股票）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、政府支持机构债、金融债、企业债、公司债、次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（含协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金可根据法律法规的规定参与融资业务。

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

本基金股票资产占基金资产的比例为 80%-95%（其中，投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%），投资于本基金界定的“先进制造”主题相关证券资产的比例不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%；其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

如法律法规或监管机构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调整上述投资品种的投资比例。”

（三）增设投资主题

转型前，金鹰量化精选（LOF）主要采用多种量化模型进行选股；转型后，金鹰先进制造（LOF）将主要采用主题投资策略，投资于“先进制造”主题相关证券资产的比例不低于非现金基金资产的 80%，主题的界定详见后文“六、转型前后基金合同修订对照表”中“第十三部分 基金的投资”。

（四）修改投资策略、投资限制

依据转型后金鹰先进制造（LOF）的投资范围、投资主题，相应修订投资策略、业绩比较基准、投资限制等内容。

（五）调整基金份额类别设置

本基金转型前为单一基金份额，转型后新增一类基金份额。基金转型后，原金鹰量化精选（LOF）场内份额转换为金鹰先进制造（LOF）A 类基金份额场内份额，原金鹰量化精选（LOF）场外份额转换为金鹰先进制造（LOF）A 类基金份额场外份额，登记结算机构保持不变，仍为中国证券登记结算有限责任公司；转型后基金增设一类场外份额，即金鹰先进制造（LOF）C 类基金份额，登记机构为金鹰基金管理有限公司。

（六）调整基金费用设置

1、增加销售服务费

转型前，金鹰量化精选（LOF）不收取销售服务费；转型后，金鹰先进制造（LOF）增设

的C类基金份额收取销售服务费。具体计提方法、计提标准和支付方式如下：

“本基金的销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值的0.40%的年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

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

H为C类基金份额每日应计提的基金销售服务费

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算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给登记结算机构，由登记结算机构代收后支付给销售机构。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。”

2、调整申购费率

(1) 转型前，金鹰量化精选（LOF）的申购费率如下表：

| 项目 | 申购金额 A (元) | 费率 |
|--------|---------------------|----------|
| 场外申购费率 | A < 100 万 | 1.50% |
| | 100 万 ≤ A < 200 万 | 0.80% |
| | 200 万 ≤ A < 500 万 | 0.30% |
| | A ≥ 500 万 | 1000 元/笔 |
| 场内申购费率 | 由基金场内销售机构参照场外申购费率执行 | |

(2) 转型后，金鹰先进制造（LOF）C类基金份额不收取申购费用，A类基金份额申购费率（场内、场外申购费率相同）如下表：

| 申购金额 M (元) | A类基金份额申购费率 (场内、场外) |
|-------------------|-----------------------|
| M < 100 万 | 1.50% |
| 100 万 ≤ M < 200 万 | 0.80% |
| 200 万 ≤ M < 500 万 | 0.30% |
| M ≥ 500 万 | 1000 元/笔 |

3、调整赎回费率

(1) 转型前，金鹰量化精选（LOF）的赎回费率如下：

| 项目 | 持有基金份额期限 (T) | 费率 |
|--------|---------------|-------|
| 场外赎回费率 | T < 7 天 | 1.50% |
| | 7 天 ≤ T < 1 年 | 0.50% |
| | 1 年 ≤ T < 2 年 | 0.30% |
| | T ≥ 2 年 | 0 |
| 场内赎回费率 | T < 7 天 | 1.50% |

| 项目 | 持有基金份额期限 (T) | 费率 |
|----|--------------|------|
| | T ≥ 7 天 | 0.5% |

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，其中对于持续持有期少于7日的投资者收取不低于1.5%的赎回费并全额计入基金财产；持续持有期大于等于7日的投资者收取的赎回费中不低于25%的部分归基金财产所有，其余部分用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

(2) 转型后，金鹰先进制造 (LOF) 的赎回费率如下，其中 A 类基金份额场内和场外赎回费率相同：

| 持有基金份额期限 (Y) | A 类基金份额赎回费率 (场内、场外) | C 类基金份额赎回费率 |
|------------------|------------------------|-------------|
| Y < 7 日 | 1.50% | 1.50% |
| 7 日 ≤ Y < 30 日 | 0.75% | 0.50% |
| 30 日 ≤ Y < 180 日 | 0.50% | 0% |
| Y ≥ 180 日 | 0% | 0% |

对持续持有期少于30日（不含）的投资者收取的赎回费全额计入基金财产；对持续持有期在30日以上（含）且少于90日（不含）的投资者收取的赎回费不低于赎回费总额的75%计入基金财产；对持续持有期在90日以上（含）且少于180日（不含）的投资者收取的赎回费不低于赎回费总额的50%计入基金财产；对持续持有期在180日以上（含）的投资者，应当将不低于赎回费总额的25%计入基金财产。赎回费中计入基金财产之余的费用用于支付登记费和其他必要的手续费。

(七) 修改基金资产估值相关表述

转型后，根据金鹰先进制造 (LOF) 的投资范围及监管部门最新有关规定，对“基金资产估值”章节估值方法等相关内容进行相应修订。

(八) 调整基金收益分配方式

转型前，金鹰量化精选 (LOF) 每年收益分配次数最多为12次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的10%。转型后，金鹰先进制造 (LOF) 对每年收益分配次数及每次收益分配比例没有明确限制。

(九) 其他

根据最新法律法规、证券投资基金基金合同填报指引的规定以及转型后的金鹰先进制造 (LOF) 的产品特征，对基金合同中的其他相关条款进行了修改和补充。

(十) 转型后基金的基本情况

- 1、基金名称：金鹰先进制造股票型证券投资基金 (LOF)
- 2、基金的类别：股票型基金

3、基金的运作方式：契约型开放式

4、基金的投资目标：本基金主要投资于推动制造业升级和新兴产业发展所需的行业，通过精选股票和严格的风险控制，力争实现超过业绩比较基准的长期回报。

5、基金存续期限：不定期

6、基金份额类别：本基金根据销售费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者申购时收取申购费用，且不计提销售服务费的，称为A类基金份额；在投资者申购时不收取申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为C类基金份额。两类基金份额分别设置代码，分别计算并公布基金份额净值和基金份额累计净值。

三、授权基金管理人办理本次基金转型和基金合同修改的有关具体事宜

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定，基金管理人提请基金份额持有人大会授权基金管理人办理本次基金转型的有关具体事宜，包括但不限于根据《关于金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）转型有关事项的说明》对《基金合同》等法律文件进行修改和补充，并在实施转型前披露修改后的基金法律文件。《金鹰先进制造股票型证券投资基金（LOF）基金合同》自基金转型基准日次日起生效，《金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）基金合同》自同一日起失效。

基金管理人将在基金份额持有人大会决议生效后实施转型，并于转型前预留不少于五个交易日的选择期（具体以基金管理人届时发布的公告为准）。基金份额持有人在金鹰量化精选（LOF）正式转型前，可选择卖出、赎回或转换转出本基金基金份额等方式退出。在选择期间，由于金鹰量化精选（LOF）需应对赎回、转出等情况，基金份额持有人同意在选择期豁免金鹰量化精选（LOF）基金合同中约定的投资组合比例限制等条款。基金管理人提请基金份额持有人大会授权基金管理人据此落实相关事项，并授权基金管理人可根据实际情况做相应调整，以及根据实际情况可暂停或调整申购、赎回、转换等业务。

四、基金转型的可行性

1、转型方案符合现行法律法规及《基金合同》规定

根据法律法规的相关规定及《基金合同》的约定，基金转型需召开基金份额持有人大会；参与投票的基金份额持有人或其代理人所代表的基金份额需占权益登记日基金总份额的二分之一以上（含二分之一）；基金转型属于一般决议，经参与投票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）通过后，决议即可生效。因此，基金转型不存在法律方面的障碍。

2、方案有成熟、清晰的实施流程

为了保障本基金持有人大会的顺利召开以及基金转型的顺利实施，本基金管理人成立了专项小组筹备持有人大会及转型工作，对持有人大会的召开及基金转型相关的会计处理、注

册登记、系统准备方面进行了深入研究,并就本次转型方案与基金托管人、深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司、律师事务所、会计师事务所、公证机构以及投资者等各相关方进行了充分沟通,做好了召开持有人大会及基金转型的相关准备。因此,本次转型不存在运营技术层面的障碍。

3、律师、基金托管人对转型方案的意见

经与律师及基金托管人沟通,律师及基金托管人对本基金召开持有人大会审议基金转型事项不持异议。

五、基金转型的主要风险及预备措施

1、基金份额持有人大会不能成功召集的风险

为防范本次基金份额持有人大会不符合会议召开要求而不能成功召集,基金管理人将在会前尽可能与基金份额持有人进行预沟通,争取更多的持有人参加基金份额持有人大会。如持有人大会未能成功召集,则基金管理人可准备二次召集持有人大会。

2、议案被基金份额持有人大会否决的风险

在提议基金转型并设计具体方案之前,基金管理人已与部分基金份额持有人进行了沟通,认真听取了相关意见,在拟定议案时综合考虑了基金份额持有人的要求。议案公告后,基金管理人还将再次征询基金份额持有人的意见。如有必要,基金管理人将根据基金份额持有人意见,对转型方案和程序进行适当修订,并重新公告。基金管理人可在必要情况下,推迟基金份额持有人大会的召开时间。如基金转型方案未获得基金份额持有人大会通过,则基金管理人拟按照有关规定向持有人大会重新提交方案。

3、持有人集中赎回基金份额的流动性风险

在本基金关于召开基金份额持有人大会的公告发布后,基金份额持有人可能选择赎回其持有的基金份额。在召开持有人大会及转型实施之前,持有人申请赎回其持有的基金份额按照《基金合同》约定的方式进行。但如果发生了巨额赎回或触发暂停赎回的情形,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,或暂停接受基金的赎回申请。同时,基金管理人将尽可能提前做好流动性安排,保持充足、易变现的流动资产,以应对持有人可能的集中赎回。

六、转型前后基金合同修订对照表

| 章节 | 转型前基金合同 | 转型后基金合同 |
|------------|--|---|
| 全文 | 金鹰 量化精选 股票型证券投资基金(LOF) | 金鹰 先进制造 股票型证券投资基金(LOF) |
| | <u>指定</u> 媒介/网站/报刊 | <u>规定</u> 媒介/网站/报刊 |
| | <u>书面</u> 表决意见、 <u>书面</u> 意见 | 表决意见 |
| 第一部分 前言 | 一、订立本基金合同的目的、依据和原则 2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国 合 同法》(以下简称“《 合同 法》”)、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金 | 一、订立本基金合同的目的、依据和原则 2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国 民 法典》(以下简称“《 民法 典》”)、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公 |

| | | |
|--------------------|---|---|
| | <p>法》)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)</p> <p>三、金鹰量化精选股票型证券投资基金(LOF)由金鹰中证500指数分级证券投资基金转型而来,金鹰中证500指数分级证券投资基金由基金管理人依照《基金法》、基金合同及其他有关规定募集,并经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)核准。</p> <p>金鹰中证500指数分级证券投资基金经中国证监会变更注册为本基金,并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。</p> <p>投资者应当认真阅读基金合同、基金招募说明书、基金产品资料概要等信息披露文件,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。</p> <p>六、基金合同约定的基金产品资料概要的编制、披露与更新要求,自《信息披露办法》实施之日起一年后开始执行。</p> | <p>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销售机构监督管理办法》(以下简称“《销售办法》”)</p> <p>三、金鹰先进制造股票型证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”)由原金鹰量化精选股票型证券投资基金(LOF)转型而来,该基金由原金鹰中证500指数分级证券投资基金转型而来。金鹰中证500指数分级证券投资基金由基金管理人依照《基金法》、基金合同及其他有关规定募集,并经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)注册。转型后的金鹰先进制造股票型证券投资基金(LOF)已经中国证监会变更注册。</p> <p>中国证监会对金鹰量化精选股票型证券投资基金(LOF)转型为本基金的变更注册,并不表明其对本基金的投资价值和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。</p> <p>投资者应当认真阅读基金招募说明书、基金合同、基金产品资料概要等信息披露文件,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。</p> <p>五、本基金投资内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(以下简称“港股通标的股票”),会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险,包括港股市场股价波动较大的风险(港股市场实行T+0回转交易,且对个股不设涨跌幅限制,港股股价可能表现出比A股更为剧烈的股价波动)、汇率风险(汇率波动可能对基金的投资收益造成损失)、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险(在内地开市香港休市的情形下,港股通不能正常交易,港股不能及时卖出,可能带来一定的流动性风险)等。</p> <p>此外,本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化,选择将部分基金资产投资于港股通标的股票或选择不将基金资产投资于港股通标的股票,基金资产并非必然投资港股通标的股票。</p> <p>六、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,本基金还将面临投资存托凭证的特殊风险。</p> |
| <p>第二部分 释义</p> | <p>1、基金或本基金:指金鹰量化精选股票型证券投资基金(LOF),本基金由金鹰中证500指数分级证券投资基金转型而来</p> <p>8、基金转型:指对“金鹰中证500指数分级证券投资基金”更名为“金鹰量化精选股票型证券投资基金(LOF)”、变更基金类别、修改基金投资目标、投资范围、投资策略、估值、费用等条款的一系列事项的通称</p> <p>10、《基金法》:指自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会员第十四次会议《全国人民代表大会常务委会员关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修改的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订</p> | <p>1、基金或本基金:指金鹰先进制造股票型证券投资基金(LOF)</p> <p>8、上市交易公告书:指《金鹰先进制造股票型证券投资基金(LOF)上市交易公告书》</p> <p>10、《基金法》:指2003年10月28日经第十届全国人民代表大会常务委会员第五次会议通过,经2012年12月28日第十一届全国人民代表大会常务委会员第三十次会议修订,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会员第十四次会议《全国人民代表大会常务委会员关于修改〈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</p> <p>11、《证券法》:指1998年12月29日颁布、1999年7月1日实施,2019年12月28日第十三届全国人民代表大会常务委会员第十五次会议第二次修订并于2020年3月1日起施行的《中华人民共和国证券</p> |

| | |
|---|--|
| | <u>法》及颁布机关对其不时做出的修订</u> |
| 11、《销售办法》：指中国证监会 <u>2013年3月15日颁布、同年6月1日实施的《证券投资基金销售管理办法》</u> 及颁布机关对其不时做出的修订 | 12、《销售办法》：指中国证监会 <u>2020年8月28日</u> 颁布、同年 <u>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》</u> 及颁布机关对其不时做出的修订 |
| 12、《信息披露办法》：指中国证监会 2019年7月26日颁布、同年9月1日实施的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订 | 13、《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， <u>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》</u> 及颁布机关对其不时做出的修订 |
| | 15、 <u>《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</u> |
| 19、合格境外 机构 投资者：指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理办法》及相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者 | 21、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》及相关法律法规规定， <u>可以使用来自境外的资金</u> 投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者， <u>包括合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者</u> |
| 20、投资者：指个人投资者、机构投资者 和 合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者的合称 | 22、投资者：指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者 和人民币合格境外机构投资者 以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者的合称 |
| 22、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金， <u>发售基金份额</u> ，办理基金份额的申购、赎回、转换、 <u>非交易过户</u> 、转托管及定期定额投资等业务。 | 24、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，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 |
| 23、销售机构：指金鹰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， <u>代为办理基金销售业务的机构</u> ，以及 <u>可通过深圳证券交易所交易系统办理基金销售业务的会员单位。其中可通过深圳证券交易所交易系统办理本基金销售业务的机构必须是具有基金销售业务资格、并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的深圳证券交易所会员单位</u> | 25、销售机构：指金鹰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， <u>代为办理基金销售业务的机构</u> ，以及 <u>具有基金销售业务资格且经深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司认可的深圳证券交易所会员单位</u> |
| 27、登记机构：指办理登记业务的机构。基金的登记机构为金鹰基金管理有限公司或接受金鹰基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构 | 27、登记 结算 机构：指办理登记业务的机构， <u>基金的登记结算机构为金鹰基金管理有限公司或接受金鹰基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构。本基金A类基金份额的登记结算机构为中国证券登记结算有限责任公司，C类基金份额的登记结算机构为金鹰基金管理有限公司</u> |
| 28、登记结算系统：指中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统。 <u>通过场外销售机构认购、申购的基金份额登记在本系统</u> | 28、登记结算系统：指中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统 |
| 29、证券登记系统：指中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记系统。 <u>通过场内会员单位认购、申购或买入的基金份额登记在本系统</u> | 29、证券登记 结算 系统：指中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记 结算 系统 |
| 30、 <u>开放式</u> 基金账户：指投资者 <u>通过场外销售机构在中国证券登记结算有限责任公司注册的开放式基金账户、用于记录其持有的、基金管理人管理的基金份额余额及其变动情况的账户，记录在该账户下的基金份额登记在登记结算系统</u> | 30、基金账户：指 <u>登记结算机构为投资者开立的、记录其持有的、基金管理人管理的基金份额余额及其变动情况的账户。其中场外A类基金份额记录在中国证券登记结算有限责任公司的开放式基金账户并登记在登记结算系统，C类基金份额记录在金鹰基金管理有限公司开立的基金账户并登记在金鹰基金管理有限公司注册登记系统</u> |
| 31、深圳证券账户：指在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开设的深圳证券交易所人民币普通股票账户（即A股账户）或证券投资基金账户， <u>记录在该账户下的基金份额登记在证券</u> | 31、深圳证券账户：指在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开设的深圳证券交易所人民币普通股票账户（即A股账户）或证券投资基金账户。 <u>其中，场内A类基金份额记录在该账户并登记在证券登记结</u> |

| | |
|--|---|
| 登记系统 | 算系统 |
| 32、基金交易账户：指销售机构为投资者开立的、记录投资者通过该销售机构办理 认购 、申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户 | 32、基金交易账户：指销售机构为投资者开立的、记录投资者通过该销售机构办理申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户 |
| 33、基金合同生效日：《金鹰 量化精选 股票型证券投资基金（LOF）基金合同》生效 起始 日，原《金鹰 中证500指数分级 证券投资基金基金合同》自同一日起失效 | 33、基金合同生效日： 指 《金鹰 先进制造 股票型证券投资基金（LOF）基金合同》生效日，原《金鹰 量化精选股票型 证券投资基金（LOF）基金合同》自同一日起失效 |
| 39、开放日：指为投资者办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日 | 39、开放日：指为投资者办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日 （若该工作日为非港股通交易日，则本基金可不开放申购、赎回及转换业务，具体以届时提前发布的公告为准） |
| 41、《业务规则》：指深圳证券交易所 发布实施的《深圳证券交易所证券投资基金交易和申购赎回实施细则》、《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》 ，中国证券登记结算有限责任公司 发布实施的《中国证券登记结算有限责任公司上市开放式基金登记结算业务实施细则》 及销售机构 业务规则 等相关业务规则 和实施细则 | 41、《业务规则》：指深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司、 金鹰基金管理有限公司 、基金销售机构的 相关业务规则及其不时做出的修订 |
| 44、上市交易：指基金 存续期间 ，投资者通过深圳证券交易所会员单位以集中竞价的方式买卖基金份额的行为 | 44、上市交易：指基金 合同生效后 ，投资者通过深圳证券交易所会员单位以集中竞价的方式买卖基金份额的行为 |
| | 48、场外份额：指登记在登记结算系统下的A类基金份额和登记在金鹰基金管理有限公司注册登记系统下的C类基金份额 49、场内份额：指登记在证券登记结算系统下的A类基金份额 |
| 46、转托管 ：指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基金份额销售机构的操作 | 51、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， A类基金份额转托管包括系统内转托管和跨系统转托管 |
| 47、系统内转托管 ：指基金份额持有人将持有的基金份额在登记结算系统内不同销售机构（网点）之间 或 证券登记系统内不同会员单位（交易单元）之间进行转托管的行为 | 52、系统内转托管 ：指基金份额持有人将持有的 A类 基金份额在登记结算系统内不同销售机构（网点）之间 进行转托管或在 证券登记系统内不同会员单位（交易单元）之间进行转托管的行为， 以及基金份额持有人将持有的C类基金份额在金鹰基金管理有限公司注册登记系统内不同销售机构之间进行转托管的行为 |
| | 55、基金份额折算 ：指基金管理人根据基金运作的需要，在基金资产净值不变的前提下，按照一定比例调整基金份额总额及基金份额净值 |
| 57、指定媒介 ：指中国证监会 指定的用以进行信息披露 的全国性报刊及 指定 互联网网站（包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介 | 63、规定媒介 ：指符合中国证监会 规定条件 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 |
| 58、不可抗力 ：指本合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件 | 64、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 |
| 59、《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 | 65、A类基金份额 ：指在投资者申购时收取申购费用， 而不计提销售服务费的基金份额 |
| 62、基金产品资料概要 ：《金鹰 量化精选股票型 证券投资基金（LOF）基金产品资料概要》及其 更新 | 66、C类基金份额 ：指在投资者申购时 不收取申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额 |
| | 69、内地与香港股票市场交易互联互通机制 ：指上海 证券交易所、深圳证券交易所 分别和香港 联合交易所有限公司 （以下简称“香港联合交易所”）建立 技术连接，使内地和香港投资者可以通过当地证券公司或经纪商买卖规定范围内的对方交易所上市的股票。内地与香港股票市场交易互联互通机制包括沪港股票市场交易互联互通机制（简称沪港通）和深港股票市场交易互联互通机制（简称深港通） |
| | 70、港股通 ：指内地投资者委托内地证券公司，经由 |

| | | |
|---|--|--|
| | | <p>内地证券交易所设立的证券交易服务公司，向香港联合交易所进行申报，买卖规定范围内的香港联合交易所上市的股票</p> <p>71、侧袋机制：指将基金投资组合中的特定资产从原有账户分离至一个专门账户进行处置清算，目的在于有效隔离并化解风险，确保投资者得到公平对待，属于流动性风险管理工具。侧袋机制实施期间，原有账户称为主袋账户，专门账户称为侧袋账户</p> <p>72、特定资产：包括：（1）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；（2）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；（3）其他资产价值存在重大不确定性的资产</p> <p>73、不可抗力：指本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</p> |
| <p>第三部分 基金的基本情况</p> | <p><u>五、基金的投资目标</u> 运用多种量化模型方法，精选股票进行投资，力争有效控制风险的基础上，实现基金资产的长期稳定增值。</p> <p><u>七、其他</u> 基金管理人可根据基金实际运作情况，在对基金份额持有人利益无实质不利影响的情况下，经与基金托管人协商一致，增加新的基金份额类别，或取消某基金份额类别，或对基金份额分类办法及规则进行调整并公告，不需召开基金份额持有人大会审议。</p> | <p><u>四、基金的投资目标</u> 本基金主要投资于推动制造业升级和新兴产业发展所需的行业，通过精选股票和严格的风险控制，力争实现超过业绩比较基准的长期回报。</p> <p><u>六、基金份额类别</u> 本基金根据销售费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。 在投资者申购时收取申购费用，且不计提销售服务费的，称为A类基金份额；在投资者申购时不收取申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为C类基金份额。 本基金A类、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。 投资者在申购基金份额时可自行选择基金份额类别。 本基金不同基金份额类别之间的转换规定请见招募说明书和相关公告。 在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，根据基金实际运作情况，基金管理人经与基金托管人协商一致并履行适当程序后，可增加基金份额类别、停止某类基金份额的销售、调整基金份额分类办法及规则等，并在实施之日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告，无需召开基金份额持有人大会。</p> |
| <p>第四部分 基金的历史沿革、 第五部分 基金的存续</p> | <p>第四部分 基金的历史沿革 金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）由<u>金鹰中证500指数分级证券投资基金</u>转型而来。 金鹰中证500指数分级证券投资基金经中国证监会证监许可[2012]247号文批准，基金管理人为金鹰基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。 <u>金鹰中证500指数分级证券投资基金自2012年4月23日至2012年5月29日公开募集，募集结束后基金管理人向中国证监会办理备案手续。</u> 经中国证监会书面确认，《金鹰中证500指数分级证券投资基金基金合同》于2012年6月5日生效。 <u>自2016年6月14日至2016年6月27日</u>，金鹰中证500指数分级证券投资基金基金份额持有人大会以通讯方式召开，大会审议并通过了《关于金鹰中证500指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》，内容包括金鹰中证500指数分级证券投资基金变更名称和基金类别、修改基金投资目标、投资范围、投资策略、估值、费用和修订基金合同等事项。持有人大会决议自通过之日起</p> | <p>第四部分 基金的历史沿革与存续</p> <p><u>一、本基金的历史沿革</u> 金鹰先进制造股票型证券投资基金（LOF）由<u>金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）</u>转型而来。金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）由原金鹰中证500指数分级证券投资基金变更而来，金鹰中证500指数分级证券投资基金经中国证监会证监许可[2012]247号文准予募集，基金管理人为金鹰基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。经中国证监会书面确认，《金鹰中证500指数分级证券投资基金基金合同》于2012年6月5日生效。 金鹰中证500指数分级证券投资基金自2016年6月14日至2016年6月27日以通讯方式召开基金份额持有人大会，大会表决通过了《关于金鹰中证500指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》，同意金鹰中证500指数分级证券投资基金转型为<u>金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）</u>，《金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）基金合同》自2016年8月25日起生效。 金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）于2021年XX月XX日至2021年XX月XX日以通讯方式召开基</p> |

| | | |
|------------------------------|---|--|
| | <p><u>生效，决议生效后，基金管理人实施基金转型。转型完成后，由《金鹰中证500指数分级证券投资基金基金合同》修订而成的《金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）基金合同》正式生效，原《金鹰中证500指数分级证券投资基金基金合同》自同日起失效。</u></p> <p>第五部分 基金的存续</p> <p>一、基金份额的变更登记</p> <p><u>自金鹰中证500指数分级证券投资基金基金合同失效且本基金基金合同生效后，本基金登记机构将办理基金份额的变更登记，对基金份额更名并进行必要的信息变更。</u></p> <p>二、基金存续期内的基金份额持有人数量和资金数额</p> <p><u>基金合同生效后，连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续六十个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。</u></p> <p><u>法律法规或监管机构另有规定时，从其规定。</u></p> | <p><u>基金份额持有人大会，会议表决通过了《关于金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）转型有关事项的议案》，同意金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）转型为金鹰先进制造股票型证券投资基金（LOF），并相应调整基金合同中投资目标、投资范围、投资策略、投资比例、基金份额类别等条款，上述基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。</u></p> <p><u>依据基金份额持有人大会决议，自2021年XX月XX日起，《金鹰先进制造股票型证券投资基金（LOF）基金合同》生效，原《金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）基金合同》同日起失效。</u></p> <p>二、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模</p> <p><u>《基金合同》生效后，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续60个工作日出现前述情形的，基金管理人应当在10个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并在6个月内召集基金份额持有人大会。</u></p> <p><u>法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。</u></p> |
| <p>第六部分 基金份额的上市交易</p> | <p>第六部分 基金份额的上市交易</p> <p>一、上市交易的基金份额</p> <p>基金合同生效后，在本基金符合法律法规和深圳证券交易所规定的上市条件的情况下，基金管理人将<u>根据有关规定</u>，申请本基金的基金份额上市交易。</p> <p>二、上市交易的地点</p> <p><u>深圳证券交易所。</u></p> <p>三、上市交易的时间</p> <p><u>基金合同生效后六个月内，本基金将申请在深圳证券交易所上市交易。</u></p> <p><u>在确定上市交易的时间后，基金管理人应依据法律法规规定在指定媒介上刊登上市交易公告书。</u></p> <p>四、上市交易的规则</p> <p>本基金上市交易遵循《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》、《深圳证券交易所交易规则》<u>及其他相关规定</u>。</p> <p>五、上市交易的费用</p> <p>本基金上市交易的费用按照深圳证券交易所<u>相关规则及</u>有关规定<u>执行</u>。</p> <p>六、上市交易的行情揭示</p> <p>本基金在深圳证券交易所挂牌交易，交易行情通过行情发布系统揭示。行情发布系统同时揭示<u>本基金</u>前一交易日的基金份额净值。</p> <p>七、上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市</p> <p>本基金的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市按照相关<u>法律法规、中国证监会及</u>深圳证券交易所的相关规定执行。</p> <p>八、其他事项</p> <p>相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所对基金上市交易的<u>规则等相关规定内容</u>进行调整的，本基金合同<u>相应予以修改，且</u>此项修改无须召开基金份额持有人大会，<u>并在本基金更新的招募说明书中列示。</u></p> | <p>第五部分 基金份额的上市交易</p> <p>一、基金份额的上市</p> <p><u>《基金合同》生效后，在本基金符合法律法规和深圳证券交易所规定的上市条件的情况下，基金管理人可以</u>申请本基金<u>A类</u>基金份额上市交易。</p> <p>三、上市交易的规则</p> <p>本基金<u>A类基金份额</u>在<u>深圳证券交易所</u>的上市交易<u>需</u>遵循《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》、《深圳证券交易所交易规则》<u>等</u>有关规定。</p> <p>四、上市交易的费用</p> <p>本基金上市交易的费用按照深圳证券交易所有关规定<u>办理</u>。</p> <p>五、上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市</p> <p>本基金<u>A类基金份额</u>的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市<u>等事项</u>按照<u>《基金法》</u>相关规定和深圳证券交易所的相关规定执行。<u>具体情况见基金管理人届时相关公告。</u></p> <p><u>当本基金发生深圳证券交易所相关业务规则所规定的因不再具备上市条件而被终止上市的情形时，本基金将变更为非上市基金，除此之外，本基金的基金费率、基金的投资范围和投资策略等均不变，无需召开基金份额持有人大会。基金终止上市后，对于本基金场内份额的处理规则由基金管理人提前制定并公告。</u></p> <p>六、上市交易的行情揭示</p> <p>本基金<u>A类基金份额</u>在深圳证券交易所挂牌交易，交易行情通过行情发布系统揭示。行情发布系统同时揭示<u>A类基金份额</u>前一交易日的份额净值。</p> <p>七、其他</p> <p><u>1、若</u>相关法律法规、<u>业务规则</u>、中国证监会及深圳证券交易所对基金上市交易的<u>相关规则</u>进行调整的，本基金<u>按修改以后的规定执行，而</u>无需召开基金份额持有人大会。</p> <p><u>2、若</u>深圳证券交易所、登记结算机构增加了基金上市</p> |

| | | |
|----------------------------|---|--|
| | <p><u>九、若深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司增加了基金上市交易的新功能，基金管理人可以在履行适当的程序后增加相应功能。</u></p> | <p>交易的新功能，<u>本基金在履行适当的程序后可以增加相应功能，无需召开基金份额持有人大会审议。</u></p> |
| 第七部分 基金份额的 申购与 赎回 | <p>第七部分 基金份额的申购与赎回</p> | <p>第六部分 基金份额的申购与赎回</p> <p><u>《基金合同》生效并开放申购与赎回后，投资者在本基金的开放日可通过场外或场内两种方式申购与赎回A类基金份额，通过场外方式申购与赎回C类基金份额。</u></p> |
| | <p>一、申购和赎回场所</p> <p>本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。<u>投资者可使用开放式基金账户，通过基金管理人的直销中心和其他场外销售机构，办理基金份额的场外申购与赎回业务。投资者也可使用深圳证券账户，通过深圳证券交易所系统办理基金份额的场内申购与赎回业务。场内申购和赎回业务的销售机构为具有基金销售业务资格、经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的深圳证券交易所会员单位。</u></p> <p>具体的销售网点将由基金管理人在招募说明书或其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并在基金管理人网站公示。</p> | <p>一、申购和赎回场所</p> <p>本基金的申购与赎回将通过销售机构进行，<u>其中，场外份额的申购和赎回场所为场外销售机构的销售网点；场内份额的申购和赎回场所为具有基金销售业务资格，且经深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司认可的深圳证券交易所会员单位。</u>具体的销售机构将由基金管理人在基金管理人网站或相关文件中列明。</p> <p>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。</p> |
| | <p>二、申购和赎回的开放日及时间</p> <p>1、开放日及开放时间</p> <p>投资者在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。</p> <p>基金合同生效后，若出现新的证券市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。</p> | <p>二、申购和赎回的开放日及时间</p> <p>1、开放日及开放时间</p> <p>投资者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（<u>若该工作日为非港股通交易日，则本基金可不开放申购、赎回及转换业务，具体以届时提前发布的公告为准</u>），但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。</p> <p>基金合同生效后，若出现新的证券/期货市场、证券/期货交易所交易时间变更、<u>港股通交易规则变更</u>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。</p> |
| | <p>2、申购、赎回开始日及业务办理时间</p> <p>基金管理人自基金合同生效之日起不超过三个月开始办理申购，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。</p> <p>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。投资者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。</p> | <p>2、申购、赎回开始日及业务办理时间</p> <p>基金管理人可根据实际情况依法决定本基金开始办理申购的具体日期，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。</p> <p>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。投资者在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记结算机构确认接受的，其基金份额申购、赎回或转换价格为下一开放日该类别基金份额申购、赎回或转换的价格。</p> |
| | <p>三、申购与赎回的原则</p> <p>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；</p> <p>5、<u>场内申购与赎回业务遵循深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司相关业务规定。</u>基金管理人可在法律法规允许的情况下，对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。</p> | <p>三、申购与赎回的原则</p> <p>1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的某一类别基金份额净值为基准进行计算；</p> <p>5、<u>投资者申购、赎回场内份额时，需遵守深圳证券交易所和登记结算机构的相关《业务规则》。若相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所或登记结算机构对申购、赎回业务等规则有新的规定，按新规定执行。</u></p> <p>6、<u>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。</u></p> <p><u>基金管理人可在法律法规允许的情况下，对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规开始实施前依照</u></p> |

| | |
|--|--|
| <p>四、申购与赎回的程序</p> <p>2、申购和赎回的款项支付</p> <p>投资者申购基金份额时，必须全额交付申购款项，投资者交付申购款项，申购成立；基金份额登记机构确认基金份额时，申购生效。</p> <p>基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；基金份额登记机构确认赎回时，赎回生效。</p> <p>投资者赎回申请成功后，基金管理人将在 T+7 日(包括该日)内支付赎回款项。在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照本基金合同有关条款处理。</p> | <p><u>《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。</u></p> <p>四、申购与赎回的程序</p> <p>2、申购和赎回的款项支付</p> <p>投资者申购基金份额时，必须全额交付申购款项，投资者全额交付申购款项，申购申请成立；基金份额登记结算机构确认基金份额时，申购生效。</p> <p>基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；基金份额登记结算机构确认赎回时，赎回生效。</p> <p>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。在发生巨额赎回或本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本基金合同有关条款处理。若遇证券/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、港股通交易系统或资金交收规则限制或其它非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程，赎回款项的支付时间可相应顺延。</p> |
| <p>3、申购和赎回申请的确认</p> <p><u>在法律法规允许的范围内，登记机构可根据《业务规则》，在不影响基金份额持有人利益的前提下，对上述业务办理时间进行调整，基金管理人将于开始实施前按照有关规定予以公告。</u></p> | <p>3、申购和赎回申请的确认</p> <p><u>基金管理人在不违反法律法规的前提下，可对上述程序规则进行调整。基金管理人应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。</u></p> |
| <p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>4、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。具体请参见相关公告。</p> <p>6、对于场内申购、赎回及持有场内份额的数量限制，深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则有规定的，从其最新规定办理。</p> | <p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>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。</p> |
| <p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>1、本基金份额净值的计算，保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。</p> | <p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>1、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。</p> |
| <p>2、申购份额的计算及余额的处理方式：本基金申购份额的计算详见《招募说明书》。本基金的申购费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。申购的有效份额为净申购金额除以当日的基金份额净值，有效份额单位为份。</p> | <p>2、申购份额的计算及余额的处理方式：本基金申购份额的计算详见招募说明书。本基金各类基金份额的申购费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。申购的有效份额为净申购金额除以当日某一类别的基金份额净值，有效份额单位为份，场内申购份额保留至整数位，不足1份对应的申购资金返还至投资者资金账户，若证券交易所或登记结算机构对申购份额的计算及余额的处理方式有新的规定，按新规定执行；场外申购份额按四舍五入方法，保留到小数点后2位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。</p> |
| <p>3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见《招募说明书》，赎回金额单位为元。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。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。</p> <p>5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。</p> | <p>3、赎回金额的计算及处理方式：本基金A类基金份额和C类基金份额赎回金额的计算详见招募说明书。本基金各类基金份额的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日某一类别基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。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。若证券交易所或登记结算机构对赎回金额的计算及处理方式有新的规定，按新规定执行。</p> |

| | |
|---|--|
| <p>赎回费用归<u>于</u>基金财产的比例<u>详见</u>招募说明书，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。其中<u>对于</u>持续持有期少于7日的投资者收取不低于1.5%的赎回费并全额计入基金财产。</p> <p>7、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，<u>基金管理人可以按中国证监会</u>要求履行必要手续后，<u>对基金投资者</u>适当调整基金<u>申购费率、调低赎回费率</u>。</p> <p><u>8、办理基金份额的场内申购、赎回业务应遵守深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关业务规则。若相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对场内申购、赎回业务规则有新的规定，基金合同相应予以修改，并按照新规定执行，且此项修改无须召开基金份额持有人大会。</u></p> <p><u>9、本基金暂不采用摆动定价机制，基金管理人可结合基金实际运作情况，根据相关法律法规在履行适当程序并提前公告后增加摆动定价机制。</u></p> | <p>5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用归<u>入</u>基金财产的比例<u>依照相关法律法规设定，具体</u>见招募说明书<u>的规定</u>，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。其中，<u>对</u>持续持有期少于7日的投资者收取不低于1.5%的赎回费，<u>并</u>全额计入基金财产。</p> <p>7、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，<u>定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门</u>要求履行必要手续后，基金<u>管理人</u>可以适当调<u>低</u>基金<u>的</u>销售费率。</p> <p><u>8、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。</u></p> |
| <p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，<u>基金管理人可暂停接受投资者的申购申请。</u></p> | <p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时。</p> <p><u>5、因港股通交易当日额度使用完毕而暂停或停止接受买入申报，或者发生证券交易服务公司等机构认定的交易异常情况并决定暂停提供部分或者全部港股通服务，或者发生其他影响通过内地与香港股票市场交易互联互通机制进行正常交易的情形。</u></p> |
| <p>5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，<u>从而</u>损害现有基金份额持有人利益的情形。</p> | <p>6、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，<u>或发生基金管理人认定的其他</u>损害现有基金份额持有人利益的情形。</p> |
| <p>6、基金管理人、基金托管人、<u>基金销售机构或登记机构</u>的异常情况导致基金销售系统、基金<u>登记</u>系统<u>或</u>基金会计系统无法正常运行。</p> | <p>7、基金管理人、基金托管人、<u>登记结算机构</u>、销售机构、<u>支付结算机构</u>等因异常情况导致基金销售系统、基金<u>销售支付结算系统、基金登记结算系统、基金会计系统</u>等无法正常运行。</p> |
| <p><u>8、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</u>，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金申购申请。</p> <p>9、<u>申请超过基金管理人</u> <u>设定的</u>基金总规模、单日净申购比例<u>上限</u>、单一投资者单日或单笔申购金额上限的。</p> | <p><u>10、当特定资产占前一估值日基金资产净值50%以上时</u>，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金申购申请。</p> <p>9、<u>在基金管理人</u> <u>就本基金的</u>基金总规模、单日净申购比例、单一投资者单日<u>和/或</u>单笔申购金额<u>设置</u>上限的情况下，<u>接受某笔或某些申购申请超过前述某项或全部上限比例的。</u></p> |
| <p>发生上述第1、2、3、5、6、<u>8、10项</u>暂停申购情形之一<u>时</u>且基金管理人决定暂停申购<u>的</u>，基金管理人应当根据有关规定在<u>指定</u>媒介上<u>刊登</u>暂停<u>申购</u>公告。如果投资者的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资者。</p> | <p>发生上述第1、2、3、5、6、<u>7、10、11项</u>情形之一且基金管理人决定<u>拒绝或</u>暂停<u>接受投资者</u>申购<u>申请时</u>，基金管理人应当根据有关规定在<u>规定</u>媒介上<u>进行</u>公告。如果投资者的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项<u>本金</u>将退还给投资者。</p> |
| <p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，<u>基金管理人可暂停接受投资者的赎回申请或延缓支付赎回款项。</u></p> | <p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时。</p> |
| <p>5、<u>基金管理人认为</u>继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益<u>的情形时</u>。</p> | <p>5、继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益。</p> |
| <p>6、当前一估值日基金资产净值50%以上的<u>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</u>，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当<u>采取</u>延缓支付</p> | <p>6、当<u>特定资产占</u>前一估值日基金资产净值50%以上时，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。</p> <p>7、<u>基金管理人、基金托管人、登记结算机构、销售机</u></p> |

| | |
|---|---|
| <p>赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施。</p> | <p><u>构、支付结算机构等因异常情况导致基金销售系统、基金销售支付结算系统、基金登记结算系统、基金会计系统等无法正常运行。</u></p> |
| <p>发生上述情形之一且基金管理人决定暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项时，基金管理人应在<u>规定期限内</u>在<u>指定媒介上刊登公告</u>。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，<u>并以后续开放日的基金份额净值为依据计算赎回金额</u>。</p> | <p>发生上述情形之一且基金管理人决定暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项时，基金管理人应在<u>当日报中国证监会备案</u>。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。</p> |
| <p>九、巨额赎回的情形及处理方式 3、巨额赎回的公告 当发生上述<u>延期</u>赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在3个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，并在2日内在<u>指定媒介上刊登公告</u>。</p> | <p>九、巨额赎回的情形及处理方式 3、当出现巨额赎回时，场内赎回申请按照深圳证券交易所及登记结算机构相应规则进行处理。 4、巨额赎回的公告 当发生上述<u>巨额</u>赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在3个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，并在2日内在<u>规定媒介上刊登公告</u>。</p> |
| <p>十、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告 1、发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人应在<u>指定媒介上刊登暂停公告</u>。 2、<u>如发生暂停的时间为1日</u>，基金管理人应于重新开放日，在<u>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个开放日的基金份额净值</u>。 3、若发生暂停的时间超过1日，则基金管理人自行确定公告增加次数，并根据《信息披露管理办法》在指定媒介上刊登公告。</p> | <p>十、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告 1、发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人应<u>按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上刊登暂停公告</u>。 2、基金管理人<u>可以根据暂停申购或赎回的时间，依照《信息披露办法》的有关规定，最迟于重新开放日在指定媒介上刊登重新开放申购或赎回的公告；也可以根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间，届时不再另行发布重新开放的公告</u>。</p> |
| <p>十二、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。</p> | <p>十二、基金份额的转让 在法律法规允许且条件具备的情况下，<u>除A类基金份额上市交易外</u>，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<u>结算</u>机构办理基金份额的过户登记。</p> |
| <p>十四、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。本基金的转托管包括系统内转托管和跨系统转托管。 1、系统内转托管 (1) 系统内转托管是指<u>基金份额</u>持有人将持有的基金份额在登记结算系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记系统内不同会员单位（交易单元）之间进行转托管的行为。 (2) 基金份额登记在登记结算系统的基金份额持有人在变更办理基金份额赎回业务的销售机构（网点）时，须办理已持有基金份额的系统内转托管。 (3) 基金份额登记在证券登记系统的基金份额持有人在变更办理基金份额场内赎回或基金份额上市交易的会员单位（交易单元）时，须办理已持有基金份额的系统内转托管。 2、跨系统转托管 (1) 跨系统转托管是指基金份额持有人将持有的基金份额在登记结算系统和证券登记系统之间进行转托管的行为。 (2) 跨系统转托管的具体业务按照<u>中国证券登</u></p> | <p>十四、基金的转托管 1、A类基金份额系统内转托管 (1) 系统内转托管是指持有人将其持有的A类基金份额在登记结算系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记系统内不同会员单位（交易单元）之间进行转托管的行为。 (2) A类基金份额登记在证券登记系统的基金份额持有人在变更办理场内赎回或上市交易的会员单位时，须办理已持有A类基金份额的系统内转托管。 (3) A类基金份额登记在登记结算系统的基金份额持有人在变更办理基金份额赎回业务的销售机构（网点）时，须办理已持有A类基金份额的系统内转托管。 2、A类基金份额跨系统转托管 (1) 跨系统转托管是指基金份额持有人将持有的A类基金份额在登记结算系统和证券登记系统之间进行转托管的行为。 (2) <u>A类基金份额</u>跨系统转托管的具体业务按照深圳证券交易所、<u>登记结算机构及销售机构</u>的相关规定办理。 3、C类基金份额的转托管 本基金C类基金份额持有人可办理已持有基金份额在场外不同销售机构之间的转托管。 4、除非基金管理人另行公告，本基金不支持基金份额</p> |

| | | |
|----------------------|---|--|
| | <p><u>记结算有限责任公司及深圳证券交易所的相关规定办理。</u></p> | <p><u>持有人将持有的基金份额在中国证券登记结算有限责任公司的登记结算系统或证券登记系统与金鹰基金管理有限公司注册登记系统之间进行转托管。</u></p> |
| | <p>十六、基金的冻结和解冻 基金登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻，以及<u>注册</u>登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益一并冻结，被冻结部分份额仍然参与收益分配。法律法规或监管机构另有规定的除外。</p> | <p>十六、基金的冻结和解冻 基金登记<u>结算</u>机构只受理国家有权机关依法要求的基金<u>账户或基金</u>份额的冻结与解冻，以及登记<u>结算</u>机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。基金<u>账户或基金</u>份额被冻结的，被冻结部分产生的权益一并冻结，被冻结部分份额仍然参与收益分配。法律法规或监管机构另有规定的除外。</p> |
| | | <p>十七、基金份额折算 <u>在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人经与基金托管人协商一致，可对基金份额进行折算，不需召开基金份额持有人大会审议。</u></p> |
| | | <p>十八、实施侧袋机制期间本基金的申购与赎回 <u>本基金实施侧袋机制的，本基金的申购和赎回安排详见招募说明书或相关公告。</u></p> |
| | <p>十七、其他业务 在不违反相关法律法规、对基金份额持有人的权利无实质性不利影响的前提下，基金管理人可<u>办理份额的质押或其他基金业务，基金管理人可制定相应的业务规则，届时无需召开基金份额持有人大会审议但须报中国证监会核准或备案并提前公告。</u></p> | <p>十九、其他业务 在不违反相关法律法规、对基金份额持有人的权利无实质性不利影响的前提下，基金管理人可<u>根据具体情况对上述申购和赎回的安排进行补充和调整，或者安排本基金基金份额在证券交易所上市交易、申购和赎回，或者办理基金份额的过户、质押等业务，届时无需召开基金份额持有人大会审议，但应根据相关法规规定进行信息披露。</u></p> |
| 第八部分 基金合同当事人及权利义务 | <p>第八部分 基金合同当事人及权利义务 一、基金管理人 (一) 基金管理人简况 法定代表人：<u>刘志刚</u></p> | <p>第七部分 基金合同当事人及权利义务 一、基金管理人 (一) 基金管理人简况 法定代表人：<u>王铁</u></p> |
| | <p>(二) 基金管理人的权利与义务 1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于： (11) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购<u>与</u>赎回申请； (12) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使<u>股东与债权人</u>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、<u>融券</u>；</p> | <p>(二) 基金管理人的权利与义务 1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于： (11) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购、<u>赎回和转换</u>申请； (12) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使<u>相关</u>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；</p> |
| | <p>(15) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、<u>证券经纪商、期货经纪商</u>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<u>认购、</u>申购、赎回、转换<u>和</u>非交易过户<u>的</u>业务规则； (17) <u>在法律法规和基金合同规定的范围内决定除调高基金托管费、基金管理费之外的基金费率结构和收费方式；</u></p> | <p>(15) 选择、更换律师事务所、会计师事务所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申购、赎回、转换、<u>非交易过户、转托管和收益分配等</u>业务规则；</p> |
| | <p>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<u>发售</u>、申购、赎回和登记事宜；</p> | <p>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申购、赎回和登记事宜；</p> |
| | <p>(8) 采取适当合理的措施使计算基金份额<u>认购、</u>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；</p> | <p>(8) 采取适当合理的措施使计算基金份额申购、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；</p> |
| | <p>(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<u>15</u>年以上；</p> | <p>(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<u>20</u>年以上；</p> |
| | | |

| | | |
|-------------------|--|--|
| | <p><u>(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；</u></p> | |
| | <p>二、基金托管人 (一) 基金托管人简况 名称：交通银行股份有限公司 住所：上海市浦东新区银城中路188号 <u>(邮政编码：200120)</u> 法定代表人：<u>彭纯</u> 成立<u>时间</u>：1987年3月30日 批准设立机关和批准设立文号：国务院国发(1986)字第81号文和中国人民银行银发[1987]40号文 组织形式：股份有限公司 注册资本：742.62亿元人民币 存续期间：持续经营 <u>基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基金[1998]25号</u></p> | <p>二、基金托管人 (一) 基金托管人简况 名称：交通银行股份有限公司 住所：<u>中国(上海)自由贸易试验区</u>银城中路188号 邮政编码：200120 法定代表人：<u>任德奇</u> 成立<u>日期</u>：1987年3月30日 批准设立机关和批准设立文号：国务院国发(1986)字第81号文和中国人民银行银发[1987]40号文 组织形式：股份有限公司 注册资本：742.62亿元人民币 存续期间：持续经营</p> |
| | <p>(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： (4) 根据相关市场规则，为基金开设证券账户、资金账户 <u>和期货结算账户</u>等投资所需账户，为基金办理证券、期货交易资金清算。</p> | <p>(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： (4) 根据相关市场规则，为基金开设证券、<u>期货</u>账户、资金账户等投资所需账户，为基金办理证券、期货交易资金清算；</p> |
| | <p>(6) 按规定开设基金财产的资金账户 <u>和</u> 证券账户等投资所需的账户，按照《基金合同》、《托管协议》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；</p> | <p>(6) 按规定开设基金财产的资金账户、<u>证券/期货</u>账户等投资所需的账户，按照《基金合同》<u>及</u>《托管协议》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；</p> |
| | <p>(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 <u>15</u>年以上；</p> | <p>(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 <u>20</u>年以上；</p> |
| | <p>三、基金份额持有人 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： (3) 依法申请赎回 <u>或转让</u>其持有的基金份额；</p> | <p>三、基金份额持有人 <u>同一类别</u>每份基金份额具有同等的合法权益。<u>本基金A类基金份额与C类基金份额由于基金份额净值的不同，基金收益分配的金额以及参与清算后的剩余基金财产分配的数量将可能有所不同。</u></p> |
| | <p>(8) 对基金管理人、基金托管人、基金 <u>销售</u>机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；</p> | <p>(8) 对基金管理人、基金托管人、基金 <u>服务</u>机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；</p> |
| | <p>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： (4) 缴纳基金 <u>认购</u>、申购、<u>赎回</u>款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；</p> | <p>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： (4) 缴纳基金申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；</p> |
| 第九部分 基金份额持有人大会 | <p>第<u>九</u>部分 基金份额持有人大会 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（法律法规、中国证监会及基金合同另有规定的除外）： (5) 调整基金管理人、基金托管人的报酬标准，<u>但法律法规要求提高该等报酬标准除外</u>；</p> | <p>第<u>八</u>部分 基金份额持有人大会 本基金份额持有人大会不设日常机构。<u>若将来法律法规对基金份额持有人大会另有规定的，以届时有效的法律法规为准。</u> 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（法律法规、中国证监会及基金合同另有规定的除外）： (5) 调整基金管理人、基金托管人的报酬标准；</p> |
| | <p>(12) 对基金 <u>合同</u>当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；</p> | <p>(12) 对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；</p> |
| | <p>2、在法律法规规定的范围内且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的 <u>情况</u>下，以下情况可</p> | <p>2、在法律法规规定 <u>和《基金合同》约定</u>的范围内且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的 <u>前提下</u>，以</p> |

| | |
|--|---|
| <p>经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： (2) <u>在法律法规和《基金合同》规定的范围内</u>调整本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式；</p> | <p>下情况可经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： (2) 调整本基金的申购费率、调低赎回费率或销售服务费、调整收费方式；</p> |
| <p>(5) 基金管理人、<u>基金登记机构、基金销售机构</u>，在法律法规规定或中国证监会许可的范围内调整有关认购、申购、赎回、转换、基金交易、非交易过户、转托管、质押等业务规则；</p> | <p>(5) 基金管理人、销售机构、<u>登记结算机构</u>在法律法规规定或中国证监会许可的范围内调整有关申购、赎回、转换、基金交易、非交易过户、转托管、转让、质押等业务规则；</p> |
| <p>(7) <u>在对基金份额持有人利益无实质不利影响的情况下</u>，增加或减少份额类别，或调整基金份额分类办法及规则；</p> | <p>(7) 增加或减少份额类别，或调整基金份额分类办法及规则；</p> |
| <p>(9) <u>在对基金份额持有人利益无实质不利影响的情况下</u>，基金管理人经与基金托管人协商一致，调整基金收益的分配原则和支付方式； (10) <u>在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人经与基金托管人协商一致，对基金份额进行折算；</u></p> | <p>(9) 基金管理人经与基金托管人协商一致，调整基金收益的分配原则和支付方式；</p> |
| <p>二、会议召集人及召集方式 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，而基金份额持有人日常机构、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。</p> | <p>二、会议召集人及召集方式 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。</p> |
| <p>四、基金份额持有人出席会议的方式 基金份额持有人大会可通过现场开会方式或通讯开会方式以及法律法规或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，<u>基金管理人、基金托管人须为基金份额持有人行使投票权提供便利。</u></p> | <p>四、基金份额持有人出席会议的方式 基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式或法律法规、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。</p> |
| <p>(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）。<u>参加基金份额持有人大会的持有人的基金份额低于前款规定比例的</u>，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上基金份额的持有人参加，方可召开。</p> | <p>(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）；<u>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</u>，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会到会者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）。</p> |
| <p>2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式在表决截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进行表决。</p> | <p>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。</p> |
| <p>(3) 本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）；<u>参加基金份额持有人大会的持有人的基金份额低于前款规定比例的</u>，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上基金份额的持有人参加，方可召开。</p> | <p>(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）；<u>若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小于在权益登记日基金总份额的二分之一</u>，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； (5) <u>会议通知公告前报中国证监会备案。</u></p> |

| | | |
|--|--|---|
| | | <p><u>九、实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定</u> <u>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；</u> <u>1、基金份额持有人行使提议权、召集权、提名权所需单独或合计代表相关基金份额10%以上（含10%）；</u> <u>2、现场开会的到会者在权益登记日代表的基金份额不少于本基金在权益登记日相关基金份额的二分之一（含二分之一）；</u> <u>3、通讯开会的直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所持有的基金份额不少于在权益登记日相关基金份额的二分之一（含二分之一）；</u> <u>4、在参与基金份额持有人大会投票的基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日相关基金份额的二分之一、召集人在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内就原定审议事项重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）相关基金份额的持有人参与或授权他人参与基金份额持有人大会投票；</u> <u>5、现场开会由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的50%以上（含50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人；</u> <u>6、一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过；</u> <u>7、特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过。</u> <u>同一主侧袋账户内的每份基金份额具有平等的表决权。</u></p> |
| | <p>九、本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人提前公告后，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。</p> | <p><u>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或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人<u>与基金托管人协商一致</u>并提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。</u></p> |
| <p>第十部分 基金管理人、基金托管人的更换条件和程序</p> | <p>二、基金管理人和基金托管人的更换程序 （一）基金管理人的更换程序 6、交接：基金管理人职责终止的，基金管理人应妥善保管基金管理业务资料，及时向临时基金管理人或新任基金管理人办理基金管理业务的移交手续，临时基金管理人或新任基金管理人应及时接收。新任基金管理人应与基金托管人核对基金资产总值； （二）基金托管人的更换程序 6、交接：基金托管人职责终止的，应当妥善保管基金财产和基金托管业务资料，及时办理基金财产和基金托管业务的移交手续，新任基金托管人或者临时基金托管人应当及时接收。新任基金托管人与基金管理人核对基金资产总值；</p> | <p>二、基金管理人和基金托管人的更换程序 （一）基金管理人的更换程序 6、交接：基金管理人职责终止的，基金管理人应妥善保管基金管理业务资料，及时向临时基金管理人或新任基金管理人办理基金管理业务的移交手续，临时基金管理人或新任基金管理人应及时接收。<u>临时基金管理人或新任基金管理人应与基金托管人核对基金资产总值和净值；</u> （二）基金托管人的更换程序 6、交接：基金托管人职责终止的，应当妥善保管基金财产和基金托管业务资料，及时办理基金财产和基金托管业务的移交手续，新任基金托管人或者临时基金托管人应当及时接收。新任基金托管人<u>或者临时基金托管人</u>应与基金管理人核对基金资产总值<u>和净值；</u></p> |
| <p>第十二部分 基金份额的登</p> | <p>第十二部分 基金份额的登记 一、基金的份额登记业务本基金的登记业务本基金的登记业务指本基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资者基金账户的建</p> | <p>第十一部分 基金份额的登记 一、基金的份额登记业务 本基金的登记业务指本基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资者基金账户<u>及深圳证</u></p> |

| | | |
|-------------|---|--|
| 记 | <p>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。</p> <p>二、基金登记业务办理机构 本基金的登记业务由基金管理人或基金管理人委托的其他符合条件的机构办理，但基金管理人依法应当承担的责任不因委托而免除。</p> <p>三、基金登记机构的权利 基金登记机构享有以下权利： 2、建立和管理投资者基金账户；</p> <p>4、对基金份额持有人的基金账户信息负有保密义务，因违反该保密义务对投资者或基金带来的损失，须承担相应的赔偿责任，但司法强制检查情形及法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他情形除外；</p> | <p>券账户的建立和管理、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。</p> <p>二、基金登记业务办理机构 本基金的登记业务由基金管理人或基金管理人委托的其他符合条件的机构办理。 本基金A类基金份额的登记结算机构为中国证券登记结算有限责任公司，C类基金份额的登记结算机构为金鹰基金管理有限公司。基金管理人也可以自行或委托其他机构担任登记结算机构。 本基金的基金份额采用分系统登记的原则。场外A类基金份额登记在登记结算系统基金份额持有人开放式基金账户下；场内A类基金份额登记在证券登记系统基金份额持有人深圳证券账户下。C类基金份额登记在金鹰基金管理有限公司注册登记系统基金账户下。</p> <p>三、基金登记结算机构的权利 基金登记结算机构享有以下权利： 2、建立和管理投资者基金账户及深圳证券账户；</p> <p>4、对基金份额持有人的基金账户及深圳证券账户信息负有保密义务，因违反该保密义务对投资者或基金带来的损失，须承担相应的赔偿责任，但司法强制检查情形及法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他情形除外；</p> |
| 第十三部分 基金的投资 | <p>第十三部分 基金的投资</p> <p>一、投资目标 运用多种量化模型方法，精选股票进行投资，力争有效控制风险的基础上，实现基金资产的长期稳定增值。</p> <p>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、中小板以及其他经中国证监会批准上市的股票）、债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、中小企业私募债等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、权证、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金投资组合中股票资产占基金资产的80%-95%；权证投资占基金资产净值的比例不高于3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；股指期货及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。 当法律法规的相关规定变更时，基金管理人在履行适当程序后可对上述资产配置比例进行适当调整。</p> <p>三、投资策略 (一) 资产配置策略 本基金投资组合中股票资产占基金资产的比例不低于80%，大类资产配置不作为本基金的核心</p> | <p>第十二部分 基金的投资</p> <p>一、投资目标 本基金主要投资于推动制造业升级和新兴产业发展所需的行业，通过精选股票和严格的风险控制，力争实现超过业绩比较基准的长期回报。</p> <p>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（包括主板、创业板、存托凭证及其他中国证监会允许基金投资的股票）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、政府支持机构债、金融债、企业债、公司债、次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（含协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。 本基金可根据法律法规的规定参与融资业务。</p> <p>本基金股票资产占基金资产的比例为80%-95%（其中，投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的50%），投资于本基金界定的“先进制造”主题相关证券资产的比例不低于非现金基金资产的80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%；其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。 如法律法规或监管机构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调整上述投资品种的投资比例。</p> <p>三、投资策略 (一) 资产配置策略 本基金为股票型基金，股票资产占基金资产的比例超过80%，基金管理人将综合考虑对宏观经济走势、政策</p> |

| | |
|--|--|
| <p>策略。一般情况下将保持各类资产配置的基本稳定。在综合考量宏观面、政策面、基本面、资金面、系统性风险、各类资产收益风险比值、股票资产估值、流动性要求、申购赎回以及分红等因素后，对基金资产配置做出合适调整。</p> | <p>走势、证券市场环境等因素，确定投资组合中各类资产的具体配置比例。</p> |
| <p>(二) 股票投资策略</p> <p>本基金主要采用多种量化模型进行股票的选择。基于模型结果，基金管理人结合市场环境和股票特性，精选个股构建投资组合，以追求超越业绩比较基准表现的业绩水平。在实际运行过程中，将定期或不定期地进行修正，优化股票投资组合。本基金采用的量化投资策略主要有：</p> <p>(1) 多因子选股模型</p> <p>多因子选股模型由本基金管理人根据中国资本市场的实际情况开发的具有针对性和实用性的数量化选股模型。模型首先综合考虑经济因素、流动性因素、行业发展轨迹等大的市场环境，其次细致评估个股的估值情况、成长情况、动量情况、交易行为情况等，进行多维度的筛选。模型按照多维因子，并经过数量化模型进行筛选，选出符合模型的个股组成一篮子投资组合，并定期更新投资组合。</p> <p>(2) 事件驱动模型</p> <p>通过研究发现，有较多事件驱动策略在中国A股市场有效或阶段性有效。如一致预期变动策略、上市公司业绩超预期策略、管理层增持策略、大股东减持策略、指数成份股调整策略等。我们将在适当的时机选用合适的策略，用于捕捉阶段性的超额收益或绝对收益。</p> <p>(3) 行业轮动模型</p> <p>本基金通过把握经济周期变化，依据对宏观经济、产业政策、行业景气度及市场波动、市场情绪轮动等因素的综合判断，识别出当阶段影响行业股价收益率的关键因素，判断行业是否在估值修复、触底回升等阶段，并计算各行业的绝对、相对上涨趋势强度，以实现各行业的合理和优化的配置。</p> <p>(4) 评级反转策略</p> <p>评级反转策略综合利用证券分析师提供的研究报告信息、以及股票的市场交易信息进行选股。该策略倾向于选择具有以下特征的股票：在一段时期内，某个股票的多个研究报告均给出较正面的信息，即大部分的证券分析师看好该股的后市走势，然而在二级市场上，该股票的表现却滞后于行业指数的表现。当分析师已获取的信息和预测被市场进一步验证时，该类股票有望获得超额收益。</p> | <p>(二) 股票投资策略</p> <p>1、先进制造主题界定</p> <p>本基金指的“先进制造”主题相关行业是指推动制造业升级和新兴产业发展所需的行业，具有技术先进、知识密集、信息密集等特征，具备较高技术附加值、能够引领产业发展方向的企业。“先进制造”主题涉及的行业主要包括新能源、新材料、汽车、国防军工、交通运输、机械设备、电气设备、医药制造业、化工、食品制造业、轻工制造、电子、通讯、计算机、传媒等行业。</p> <p>本基金所指的“先进制造”主题相关公司主要包括以下两类公司：</p> <p>(1) 主营业务所属行业为上述定义范围，且产品或服务具有较高技术含量、较高附加值等特点，具有较强的行业竞争力、抗风险能力的公司；</p> <p>(2) 对于当前未被归入前述行业，但后续通过引入技术创新、变革运营模式、实施资产并购或重组以及其他途径实现业务转型，使其转型后提供的产品或服务隶属于上述行业，且这些产品或服务具有较高技术含量、较高附加值等特点，未来有望成为主要收入或利润来源的公司。</p> <p>未来由于市场需求变化、经济增长方式转变、产业结构升级等因素，“先进制造”主题涉及的行业外延可能相应扩大或改变，基金管理人在履行适当程序后，可对上述界定进行调整。</p> <p>2、个股投资策略</p> <p>本基金在主要投向于“先进制造”主题公司的前提下，通过定量与定性相结合的方法精选具有核心竞争力、未来成长空间大、持续经营能力强的优质个股。在定性分析方面，深入研究上市公司所处产业链位置、商业模式、核心竞争力、公司治理结构、管理团队、创新能力、长期发展前景等；定量分析方面，将对反映上市公司质量和增长潜力的成长性指标、财务指标、估值指标等进行定量分析，以挑选具有成长优势、财务优势和估值优势的个股。成长性指标包括营业利润增长率、净利润增长率和收入增长率等；财务指标包括毛利率、营业利润率、净资产收益率、净利率、经营活动净收益/利润总额等；估值指标包括市盈率(P/E)、市净率(P/B)、市盈率相对盈利增长比率(PEG)、市销率(PS)和总市值等。</p> |
| <p>(三) 债券投资策略</p> <p>基金管理人将秉承稳健优先的原则，在保证投资低风险的基础上谨慎投资债券市场，力图获得良好的收益。本基金以经济基本面变化趋势分析为基础，结合货币、财政宏观政策，以及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素，判断利率和债券市场走势；运用久期调整策略、收益率曲线配置策略、债券类属配置策略等多种积极管理策略，深入研究挖掘价值被低估的债券和市场投资机会，构建收益稳定、流动性良好的债券组合。</p> | <p>(五) 债券投资策略</p> <p>基金管理人将秉承稳健优先的原则，在保证投资低风险的基础上谨慎投资债券市场，力图获得良好的收益。</p> <p>本基金以长期利率趋势分析为基础，结合经济变化趋势、货币政策、投资主题及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素，运用久期调整策略、收益率曲线配置策略、债券类属配置策略等多种积极管理策略，深入研究挖掘价值被低估的债券和市场投资机会，构建收益稳定、流动性良好的债券组合。</p> |
| <p>(四) 中小企业私募债券投资策略</p> | <p>(三) 港股投资策略</p> |

| | |
|---|---|
| <p>本基金将运用基本面研究结合公司财务分析方法，对债券发行人信用风险进行分析和度量，选择风险与收益相匹配的更优品种进行投资。深入研究债券发行人基本面信息，分析企业的长期运作风险，对债券发行人进行财务风险评估；利用历史数据、市场价格以及资产质量等信息，估算私募债券发行人的违约率及违约损失率并考察债券发行人的增信措施。综合上述分析结果，确定信用利差的合理水平，利用市场的相对失衡，确定具有投资价值的债券品种。</p> <p>（五）衍生品投资策略 本基金的衍生品投资将严格遵守证监会及相关法律法规的约束，在充分评估衍生产品的风险和收益的基础上，谨慎地进行投资。本基金将合理利用股指期货、权证等衍生工具发掘可能的投资机会，稳健投资，实现基金资产的保值增值。</p> | <p>本基金所投资香港市场股票标的除适用上述股票投资策略外，还将关注：</p> <p>1、香港股票市场制度与大陆股票市场存在的差异对股票投资价值的影响，比如行业分布、交易制度、市场流动性、投资者结构、市场波动性、涨跌停限制、估值与盈利回报等方面；</p> <p>2、港股通每日额度应用情况；</p> <p>3、人民币与港币之间的汇兑比率变化情况。</p> <p>（四）存托凭证投资策略 本基金投资存托凭证的策略依照上述境内上市交易的股票投资策略执行，选择投资价值高的存托凭证进行投资。</p> <p>（六）可转换债券、可交换债券投资策略 可转换债券和可交换债券的价值主要取决于其股权价值、债券价值和内嵌期权价值，本基金将在对发债公司基本面进行深入分析的基础上，对可转换债券和可交换债券的价值进行评估，选择具有较高投资价值的可转换债券、可交换债券进行投资。此外，本基金还将根据新发可转换债券、可交换债券的预计中签率、模型定价结果，积极参与可转换债券、可交换债券新券的申购。</p> |
| <p>（六）资产支持证券投资策略 本基金将分析资产支持证券的资产特征，估计违约率和提前偿付比率，并利用收益率曲线和期权定价模型，对资产支持证券进行估值。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。</p> | <p>（七）资产支持证券投资策略 本基金将综合运用资产配置、久期管理、收益率曲线、信用管理和个券α策略等策略积极主动进行资产支持证券投资。本基金管理人将坚持风险调整后收益最大化的原则，通过信用资质研究和流动性管理，遵守法律法规和基金合同的约定，严格控制投资风险，确保本金相对安全和基金资产具有良好流动性，以期获得长期稳定收益。</p> |
| | <p>（八）股指期货投资策略 本基金参与股指期货交易，将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，采用流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金参与股指期货投资时机和数量的决策建立在对证券市场总体行情的判断和组合风险收益分析的基础上。基金管理人将根据宏观经济因素、政策及法规因素和资本市场因素，结合定性和定量方法，确定投资时机。基金管理人将结合股票投资的总体规模，以及中国证监会的相关限定和要求，确定参与股指期货交易的投资比例。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。</p> |
| | <p>（九）参与融资融券业务的投资策略 为了更好地实现投资目标，在综合考虑预期风险、收益、流动性等因素的基础上，本基金可参与融资融券业务。</p> |
| <p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>基金的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>（1）本基金投资组合中股票资产占基金资产净值的比例为80%-95%；</p> <p>（3）本基金持有一家公司的证券，其市值不超过基金资产净值的10%；</p> <p>（4）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的10%；</p> <p>（8）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的3%；</p> | <p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>基金的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>（1）本基金股票资产占基金资产的比例为80%-95%，（其中，投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的50%），投资于本基金界定的“先进制造”主题相关证券资产的比例不低于非现金基金资产的80%；</p> <p>（3）本基金持有一家公司发行的证券（同一家公司在境内和香港同时上市的A+H股合计计算），其市值不超过基金资产净值的10%；</p> <p>（4）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发</p> |

| | |
|---|---|
| <p>(9) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证, 不得超过该权证的10%;</p> <p>(10) 本基金在任何交易日买入权证的总金额, 不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%;</p> <p>(18) 基金总资产不得超过基金净资产的百分之一百四十;</p> <p>(19) 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%;</p> <p>(20) 本基金在任何交易日日终, 持有的买入股指期货合约价值与有价证券市值之和, 不得超过基金资产净值的95%, 其中, 有价证券指股票、债券(不含到期日在一年以内的政府债券)、权证、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等;</p> <p>(21) 本基金在任何交易日日终, 持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%; 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个交易日基金资产净值的20%;</p> <p>(22) 本基金所持有的股票市值、买入、卖出股指期货合约价值, 合计(轧差计算)占基金资产净值的比例为80%-95%;</p> <p>(23) 本基金持有单只中小企业私募债券, 其市值不得超过本基金资产净值的10%;</p> <p>基金管理人运用基金财产投资证券衍生品种的, 应当根据风险管理的原则, 并制定严格的授权管理制度和投资决策流程。基金管理人运用基金财产投资证券衍生品种的具体比例, 应当符合中国证监会的有关规定。</p> <p>因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的, 基金管理人应当在10个交易日内进行调整(除(2)、(7)、(15)、(24)外), 但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的, 从其规定。</p> <p>基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。期间, 基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。</p> <p>法律法规或监管部门取消上述限制, 如适用于本基金, 基金管理人应当在履行适当程序后, 则本基金投资不再受相关限制, 但须提前公告。</p> | <p>行的证券(同一家公司在境内和香港同时上市的A+H股合计计算), 不超过该证券的10%;</p> <p>(12) 本基金资产总值不得超过基金资产净值的140%;</p> <p>(17) 本基金参与股指期货交易, 应当遵守下列要求:</p> <p>1) 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%;</p> <p>2) 在任何交易日日终, 持有的买入股指期货合约价值与有价证券市值之和, 不得超过基金资产净值的95%, 其中, 有价证券指股票、债券(不含到期日在一年以内的政府债券)、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等;</p> <p>3) 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%;</p> <p>4) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值, 合计(轧差计算)应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定;</p> <p>5) 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个交易日基金资产净值的20%;</p> <p>(18) 本基金参与融资业务后, 在任何交易日日终, 持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和, 不得超过基金资产净值的95%;</p> <p>(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, 与境内上市交易的股票合并计算;</p> <p>因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的, 除上述第(2)、(9)、(15)、(16)项规定的情况外, 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。期间, 本基金的投资范围、投资策略应当符合本基金的约定。</p> <p>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, 基金管理人应当在履行适当程序后, 则本基金投资不再受相关限制或按调整后的规定执行。</p> |
| <p>2、禁止行为</p> <p>(4) 买卖其他基金份额, 但是国务院证券监督管理机构另有规定的除外;</p> <p>如法律法规或监管部门取消上述限制, 如适用于本基金, 基金管理人应当在履行适当程序后, 则本基金投资不再受相关限制。</p> | <p>2、禁止行为</p> <p>(4) 买卖其他基金份额, 但是中国证监会另有规定的除外;</p> <p>法律、行政法规或监管部门取消或变更上述禁止性规定, 如适用于本基金, 基金管理人应当在履行适当程序后, 则本基金投资不再受相关限制或按变更后的规定执行。</p> |
| <p>五、业绩比较基准</p> <p>沪深300指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%</p> <p>沪深300指数对A股市场总体走势具有较强代表性, 适合作为本基金股票部分的业绩比较基准。中证全债指数能够反映债券市场总体走势, 适合作为本基金固定收益部分的业绩比较基准。此外, 本基金还参考预期的大类资产配置比例设置了业绩比较基准的权重。</p> | <p>五、业绩比较基准</p> <p>中证高端装备制造指数收益率×60%+中证港股通综合指数收益率×20%+中债总财富(总值)指数收益率×20%</p> <p>中证高端装备制造指数从通信设备, 电气部件与设备, 重型电气设备, 工业机械, 建筑、航空航天与国防等行业的公司中选取代表性的200只股票构成样本股, 能够反映上市公司中高端装备制造产业股票的走势, 本基金的投资主题与该产业密切相关, 因此, 该指数适宜作为本基金A股投资的业绩比较基准。中证</p> |

| | | |
|--------------|---|--|
| | | <p><u>港股通综合指数由中证指数有限公司发布的指数，选取符合港股通资格的普通股作为样本股，采用自由流通市值加权计算，是反映港股通范围内上市公司的整体状况和走势的一种股价指数。中债总财富（总值）指数收益率是反映境内利率类债券整体价格走势情况的分类指数，是债券组合投资管理业绩评估的有效工具。采用上述业绩基准可以较好地反映本基金的业绩走势。</u></p> |
| | <p>六、风险收益特征 本基金为股票型基金，<u>属于证券投资基金中较高预期收益、较高预期风险的品种，其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。</u></p> | <p>六、风险收益特征 本基金为股票型<u>证券投资基金</u>，其预期收益及风险水平高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。 本基金资产投资于港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险（港股市场实行T+0回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比A股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对基金的投资收益造成损失）、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险（在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险）等。</p> |
| | | <p>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。</p> |
| | | <p>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重大赎回申请时，<u>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，无需召开基金份额持有人大会审议。</u> 侧袋机制实施期间，本部分约定的投资组合比例、投资策略、组合限制、业绩比较基准、风险收益特征等约定仅适用于主袋账户。 侧袋账户的实施条件、实施程序、运作安排、投资安排、特定资产的处置变现和支付等对投资者权益有重大影响的事项详见招募说明书的规定。</p> |
| 第十四部分 基金的财产 | <p>第十四部分 基金的财产 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、<u>期货结算账户</u>以及投资所需的其他专用账户。 ……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。</p> | <p>第十三部分 基金的财产 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。 ……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。<u>非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。</u></p> |
| 第十五部分 基金资产估值 | <p>第十五部分 基金资产估值 二、估值对象 基金所拥有的股票、<u>权证</u>、债券和银行存款本息、应收款项、<u>股指期货合约</u>、其它投资等资产及负债。</p> | <p>第十四部分 基金资产估值 二、估值对象 基金所拥有的股票、债券、<u>资产支持证券</u>、<u>股指期货合约</u>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 <u>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</u></p> |

| | | |
|---|--|--|
| | | <p>定。</p> <p><u>(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。</u></p> <p><u>与上述投资品种形同,但具有不同特征的,应以相同资产或负债的公允价值为基础,并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等,如果该限制是针对资产持有者的,那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外,基金管理人不应考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。</u></p> <p><u>(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。</u></p> <p><u>(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。</u></p> |
| <p>三、估值方法</p> <p>1、证券交易所上市的有价证券的估值</p> <p>交易所上市的有价证券(包括股票、权证等),以其估值日在证券交易所挂牌的市价(收盘价)估值;……</p> | | <p>四、估值方法</p> <p>1、证券交易所上市的有价证券的估值</p> <p><u>(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;……</u></p> |
| <p>2、<u>证券交易所市场的固定收益品种的估值</u></p> <p><u>(1)对在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(另有规定的除外),选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值;</u></p> <p><u>(2)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;</u></p> <p><u>(3)对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募债券,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值。</u></p> <p><u>(4)对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的固定收益品种,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;</u></p> | | <p><u>(2)交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种(另有规定的除外),选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值。</u></p> <p><u>(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。</u></p> <p><u>(4)交易所市场上市交易的可转换债券,实行全价交易的,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;实行净价交易的,按估值日收盘价进行估值。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或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,实行全价交易的,按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值;实行净价交易的,按最近交易日债券收盘价进行估值;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,确定公允价值。</u></p> <p><u>(5)交易所市场挂牌转让的资产支持证券,选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值;第三方估值机构未提供估值价的,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。</u></p> <p><u>(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。</u></p> <p><u>(7)交易所市场发行未上市或未挂牌转让的固定收益品种,对于存在活跃市场的情况下,应以活跃市场</u></p> |

| | |
|--|--|
| | <p><u>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，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。</u></p> |
| <p>3、银行间市场的固定收益品种的估值 <u>(1) 银行间市场交易的固定收益品种，选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值。</u> <u>(2) 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固定收益品种，按成本估值。</u> 4、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。</p> | <p>3、<u>对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资者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。</u>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。</p> |
| <p>5、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理： (2) 首次公开发行未上市的股票和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。</p> | <p>2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理： (2) 首次公开发行未上市的股票和债券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；</p> |
| <p>(3) <u>首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</u></p> | <p>(3) <u>在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</u></p> |
| <p>6、<u>本基金投资的股指期货合约，一般以估值当日股指期货的结算价进行估值，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。当日结算价及结算规则以《中国金融期货交易所结算细则》为准。</u></p> | <p>5、<u>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。</u> 6、股指期货合约以估值当日的结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日结算价估值。 7、<u>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。</u></p> |
| | <p>8、<u>估值计算中涉及港币对人民币汇率的，应当以基金估值日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价为准。若本基金现行估值汇率不再发布或发生重大变更，或市场上出现更为公允、更适合本基金的估值汇率时，基金管理人与基金托管人协商一致后可根据实际情况调整本基金的估值汇率，并及时报中国证监会备案，无需召开基金份额持有人大会。</u></p> |
| <p>7、<u>如有确凿证据</u>表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值。</p> | <p>9、<u>如有充分理由</u>表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值。</p> |
| <p>8、……本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对于基金资产净值的计算结果对外予以公布，<u>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。</u></p> | <p>10、……本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对于基金资产净值的计算结果对外予以公布。</p> |
| <p>四、估值程序 1、基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到0.0001元，小数点后第5位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。</p> | <p>五、估值程序 1、基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到0.0001元，小数点后第5位四舍五入。<u>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。</u>国家</p> |

| | | |
|-----------------------------|---|--|
| | <p>基金管理人每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。</p> | <p>另有规定的，从其规定。基金管理人每个工作日计算基金资产净值及各类基金份额净值，并按规定公告。</p> |
| | <p>2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或本基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。</p> | <p>2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或本基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将各类基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。</p> |
| | <p>五、估值错误的处理 4、基金份额净值估值错误处理的方法如下： (2) 错误偏差达到基金资产净值的0.25%时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到基金资产净值的0.5%时，基金管理人应当公告。 (3) 前述内容如法律法规或者监管部门另有规定的，从其规定。如果行业另有通行做法，双方当事人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商。</p> | <p>六、估值错误的处理 4、基金份额净值估值错误处理的方法如下： (2) 错误偏差达到基金份额净值的0.25%时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到基金份额净值的0.5%时，基金管理人应当公告，并报中国证监会备案。 (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、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。</p> |
| | <p>六、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；</p> | <p>七、暂停估值的情形 1、基金投资所涉及的证券市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；</p> |
| | <p>3、当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停基金估值；</p> | <p>3、当特定资产占前一估值日基金资产净值50%以上的，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停估值；</p> |
| | <p>七、基金净值的确认 基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的基金净值信息并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对外公布。</p> | <p>八、基金净值的确认 用于基金信息披露的基金资产净值和各类基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的基金资产净值和基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对外公布。</p> |
| | | <p>九、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，暂停披露侧袋账户的基金净值信息。</p> |
| | <p>八、特殊情况的处理 1、基金管理人或基金托管人按按本部分第三条有关估值方法规定的第7项条款进行估值时，所造成的误差不得作为基金资产估值错误处理。 2、由于不可抗力，或证券交易所、期货交易所、登记结算机构及存款银行等第三方机构发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等非基金管理人或基金托管人原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。</p> | <p>十、特殊情况的处理 1、基金管理人或基金托管人按本部分第四条有关估值方法规定的第9项进行估值时，所造成的误差不得作为基金资产估值错误处理。 2、由于不可抗力原因，或证券/期货交易所、登记结算机构、期货经纪商、存款银行等第三方机构发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等非基金管理人或基金托管人原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。</p> |
| <p>第十六部分 基金费用与税收</p> | <p>第十六部分 基金费用与税收 一、基金费用的种类 6、基金的相关账户的开户费用、账户维护费用； 9、基金上市费及年费； 10、基金注册登记TA服务费； 2、基金托管人的托管费 基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无</p> | <p>第十五部分 基金费用与税收 一、基金费用的种类 3、C类基金份额的销售服务费； 4、基金上市费用； 10、基金的开户费用、账户维护费用； 11、因投资港股通标的股票而产生的各项合理费用； 2、基金托管人的托管费 基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基</p> |

| | | |
|---|---|---|
| | <p>误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前<u>2</u>个工作日内从基金财产中一次性支取。</p> | <p>金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前<u>5</u>个工作日内从基金财产中一次性支取。</p> |
| | | <p>3、销售服务费 <u>本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额收取销售服务费。</u> <u>本基金的销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值的0.40%的年费率计提。销售服务费的计算方法如下：</u> $H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$ <u>H为C类基金份额每日应计提的基金销售服务费</u> <u>E为C类基金份额前一日基金资产净值</u> <u>基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给登记结算机构，由登记结算机构代收后支付给销售机构。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。</u></p> |
| | <p>上述“一、基金费用的种类中第<u>3-1I</u>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。</p> | <p>上述“一、基金费用的种类”中第<u>4-12</u>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。</p> |
| | <p>三、不列入基金费用的项目 3、《基金合同》生效前的相关费用；</p> | <p>三、不列入基金费用的项目</p> |
| | | <p>四、实施侧袋机制期间的基金费用 <u>本基金实施侧袋机制的，与侧袋账户有关的费用可以从侧袋账户中列支，但应待侧袋账户资产变现后方可列支，有关费用可酌情收取或减免，但不得收取管理费，详见招募说明书的规定。</u></p> |
| <p>第十七部分 基金的收益与分配 三、基金收益分配原则 1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为12次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的10%，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。登记在证券登记系统基金份额持有人深圳证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式，具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定； 4、每一基金份额享有同等分配权；</p> | <p>第十七部分 基金的收益与分配 三、基金收益分配原则 1、由于本基金各类基金份额在费用收取上不同，其对应的可供分配利润将有所不同，本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；</p> | <p>第十六部分 基金的收益与分配 三、基金收益分配原则 1、由于本基金各类基金份额在费用收取上不同，其对应的可供分配利润将有所不同，本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；</p> |
| <p>2、本基金场外份额的收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金场外份额默认的收益分配方式是现金分红；本基金场内份额的收益分配方式仅能为现金分红；</p> | <p>2、本基金场外份额的收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；</p> | <p>2、本基金场外份额的收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；</p> |
| <p>3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；</p> | <p>3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；</p> | <p>3、基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；</p> |
| <p>5、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定</p> | <p>5、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定</p> | <p>5、基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；</p> |
| <p>五、收益分配方案的确定、公告与实施 本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。 <u>基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过15个工作</u></p> | <p>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。</p> | <p>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。</p> <p>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。对于场外份额，当投资者的现金</p> |

| | | |
|----------------|--|--|
| | <p><u>日。</u></p> <p>六、基金收益分配中发生的费用</p> <p>基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。</p> | <p>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<u>结算</u>机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为<u>对应类别</u>的基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。<u>对于场内份额，则遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定。</u></p> <p><u>七、实施侧袋机制期间的收益分配</u></p> <p><u>本基金实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配，详见招募说明书的规定。</u></p> |
| 第十八部分 基金的会计与审计 | <p>第十八部分 基金的会计与审计</p> <p>一、基金会计政策</p> <p>2、基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日；<u>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；</u></p> | <p>第十七部分 基金的会计与审计</p> <p>一、基金会计政策</p> <p>2、基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日；</p> |
| | <p>二、基金的年度审计</p> <p>1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的<u>具有证券、期货相关业务资格</u>的会计师事务所及其注册会计师对本基金<u>的年度财务报表</u>进行审计。</p> <p>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<u>按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。</u></p> | <p>二、基金的年度审计</p> <p>1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的<u>符合《证券法》规定</u>的会计师事务所及其注册会计师对本基金<u>年度报告中的财务会计报告</u>进行审计。</p> <p>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<u>在2日内</u>在规定媒介公告。</p> |
| 第十九部分 基金的信息披露 | <p>第十九部分 基金的信息披露</p> <p>一、本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《基金合同》及其他有关规定。相关法律法规关于信息披露的规定发生变化时，本基金从其最新规定。</p> | <p>第十八部分 基金的信息披露</p> <p>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》、<u>《流动性风险管理规定》</u>、《基金合同》及其他有关规定。相关法律法规关于信息披露的规定发生变化时，本基金从其最新规定。</p> |
| | <p>二、信息披露义务人</p> <p>本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会<u>指定</u>的全国性报刊（以下简称“<u>指定报刊</u>”）及<u>指定</u>互联网网站（以下简称“<u>指定网站</u>”）等媒介披露，并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。</p> | <p>二、信息披露义务人</p> <p>本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过<u>符合</u>中国证监会<u>规定条件</u>的全国性报刊（以下简称“<u>规定报刊</u>”）及<u>《信息披露办法》规定</u>的互联网网站（以下简称“<u>规定网站</u>”）等媒介披露，并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。</p> |
| | <p>五、公开披露的基金信息</p> <p>（二）上市交易公告书</p> <p>本基金获准在<u>深圳</u>证券交易所上市交易的，基金管理人应当在基金份额上市交易<u>前至少3</u>个工作日，将上市交易公告书登载在指定<u>媒介</u>上。</p> | <p>五、公开披露的基金信息</p> <p>（二）<u>基金份额</u>上市交易公告书</p> <p>基金<u>份额</u>获准在证券交易所上市交易的，基金管理人应当在基金份额上市交易<u>的三个工作日</u>前，将<u>基金份额</u>上市交易公告书登载在指定<u>网站</u>上，并将<u>上市交易公告书提示性公告</u>登载在<u>指定报刊</u>上。</p> <p>（三）<u>《基金合同》生效公告</u></p> <p><u>基金管理人应当在《基金合同》生效的次日</u>在<u>规定媒介</u>上登载<u>《基金合同》生效公告</u>。</p> |
| | <p>（三）基金净值信息</p> <p>《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周在<u>指定</u>网站披露一次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<u>指定</u>网站、基金销售机构网站或者营业网点，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在<u>指定</u>网站披露半年度和年度最后一日的基金份额净值和基金份额累计净值。</p> | <p>（四）基金净值信息</p> <p>《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周在<u>规定</u>网站披露一次<u>各类</u>基金份额净值和<u>各类</u>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<u>规定</u>网站、基金销售机构网站或者营业网点，披露开放日的<u>各类</u>基金份额净值和<u>各类</u>基金份额累计净值。基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在<u>规定</u>网站披露半年度和年度最后一日的<u>各类</u>基金份额净值和<u>各类</u>基金份额累计净值。</p> |
| | <p>（五）基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告</p> <p>基金年度报告中的财务会计报告应当经过<u>具有</u></p> | <p>（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</p> <p>基金年度报告中的财务会计报告应当经过<u>符合《证券</u></p> |

| | | |
|-------------------------|---|---|
| | <p><u>证券、期货相关业务资格</u>的会计师事务所审计。</p> <p>(六) 临时报告</p> <p>8、基金募集期延长或提前结束募集；</p> <p>15、管理费、托管费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；</p> <p>21、本基金停牌、暂停上市、恢复上市；</p> <p>(九) 清算报告</p> | <p><u>法》</u>规定的会计师事务所审计。</p> <p>(七) 临时报告</p> <p>14、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；</p> <p>20、基金管理人采用摆动定价机制进行估值时；</p> |
| | <p>(十一) 投资资产支持证券信息披露</p> <p>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。</p> <p>(十二) 投资中小企业私募债券的信息披露</p> <p>基金管理人应当在基金投资中小企业私募债券后两日内，在中国证监会指定媒介披露所投资中小企业私募债券的名称、数量、期限、收益率等信息。</p> <p>基金管理人应当在基金的季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书(更新)等文件中披露中小企业私募债券的投资情况。</p> <p>若中国证监会或其他相关监管机构出台新规定，则按新规定执行。</p> | <p>(十) 清算报告</p> <p>清算报告应当经过符合《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。</p> <p>(十一) 实施侧袋机制期间的信息披露</p> <p>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，详见招募说明书的规定。</p> <p>(十二) 投资资产支持证券的信息披露</p> <p>若本基金投资资产支持证券，基金管理人应在基金年度报告及中期报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金资产净值的比例和报告期内所有的资产支持证券明细。</p> <p>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资产净值的比例和报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前10名资产支持证券明细。</p> <p>(十四) 参与融资业务的信息披露</p> <p>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)等文件中披露参与融资交易的情况，包括投资策略、业务开展情况、损益情况、风险及管理情况。</p> <p>(十五) 投资港股通标的股票的信息披露</p> <p>基金管理人应当在基金季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书(更新)等文件中披露港股通标的股票的投资情况，包括报告期末本基金在香港地区证券市场的权益投资分布情况及按相关法律法规及中国证监会要求披露港股通标的股票的投资明细等内容。若中国证监会对公开募集证券投资基金通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资香港股票市场的信息披露另有规定的，从其规定。</p> <p>(十六) 本基金投资存托凭证的信息披露依照境内上市交易的股票执行。</p> |
| | <p>六、暂停或延迟信息披露的情形</p> <p>1、基金投资所涉及的证券/期货交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；</p> <p>3、当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停基金估值的；</p> | <p>六、暂停或延迟信息披露的情形</p> <p>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相关信息：</p> <p>1、基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；</p> <p>3、当特定资产占前一估值日基金资产净值50%以上，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停估值的；</p> |
| 第二十分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算 | <p>第二十分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算</p> <p>一、《基金合同》的变更</p> <p>1、变更基金合同涉及法律法规规定或本合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。</p> <p>六、基金财产清算的公告</p> <p>清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见</p> | <p>第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算</p> <p>一、《基金合同》的变更</p> <p>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。</p> <p>六、基金财产清算的公告</p> <p>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《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</p> |

| | | |
|--------------------|--|---|
| | 书后报中国证监会备案并公告。 | 并公告。 |
| | 七、基金财产清算账册及文件的保存 基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 <u>15</u> 年以上。 | 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 <u>20</u> 年以上。 |
| 第二十一部分 违约责任 | 第二十一部分 违约责任 二、由于基金合同当事人违反基金合同，给其他基金合同当事人造成损失的，应当承担赔偿责任。发生下列情况 <u>的</u> ，当事人可以免责： <u>1、不可抗力；</u> <u>2、基金管理人<u>和</u>或基金托管人按照当时有效的法律法规<u>或中国证监会的规定</u>作为或不作为而造成的损失等；</u> <u>3、基金管理人由于按照基金合同规定的投资原则行使或不行使其投资权<u>而</u>造成的损失等。</u> | 第二十部分 违约责任 二、由于基金合同当事人违反基金合同，给其他基金合同当事人造成损失的，应当承担赔偿责任。 <u>当</u> 发生下列情况 <u>时</u> ，当事人可以免责： <u>(1) 基金管理人<u>及</u>或基金托管人按照当时有效的法律法规、<u>市场交易规则</u>作为或不作为而造成的损失等；</u> <u>(2) 基金管理人由于按照<u>本</u>基金合同规定的投资原则行使或不行使其投资权<u>所</u>造成的损失等；</u> <u>(3) 不可抗力；</u> |
| 第二十二部分 争议的处理和适用的法律 | 第二十二部分 争议的处理和适用的法律 各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，任何一方均有权将争议提交 <u>中国</u> 国际经济贸易仲裁委员会， <u>按照中国国际经济贸易仲裁委员会<u>届</u>时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为上海市。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。除非仲裁裁决另有决定</u> ，仲裁费用由败诉方承担。 | 第二十二部分 争议的处理和适用的法律 各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，任何一方 <u>当事人</u> 均有权将争议提交 <u>上海</u> 国际经济贸易仲裁委员会。 <u>根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点在上海市，仲裁裁决是终局性的，并对相关各方均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。</u> |
| 第二十三部分 基金合同的效力 | 第二十三部分 基金合同的效力 《基金合同》是约定基金当事人之间、基金与基金当事人之间权利义务关系的法律文件。 1、 <u>本基金合同由《金鹰中证500指数分级证券投资基金基金合同》修订而来。《基金合同》经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字或盖章，且经2016年6月28日金鹰中证500指数分级证券投资基金基金份额持有人大会决议通过，并报中国证监会备案。持有人大会决议自通过之日起生效，决议生效后，基金管理人实施基金转型。转型完成后，《金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）基金合同》正式生效，原《金鹰中证500指数分级证券投资基金基金合同》自同一起失效。</u> | 第二十二部分 基金合同的效力 《基金合同》是约定基金 <u>合同</u> 当事人之间、基金与基金 <u>合同</u> 当事人之间权利义务关系的法律文件。 1、《基金合同》经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字或 <u>签章并在募集结束后经基金管理人向中国证监会办理基金备案手续，并经中国证监会书面确认后生效。</u> |