

# 天治转型升级混合型证券投资基金 更新的招募说明书

基金管理人：天治基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

二〇二一年十二月

### 重要提示

本基金经 2019 年 2 月 2 日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）下发的《关于准予天治转型升级混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2019]194 号文）准予募集注册。本基金基金合同于 2019 年 5 月 21 日正式生效。

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申请的注册，并不表明其对本基金的价值和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。

本基金为混合型基金，其长期平均风险和预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。

投资者在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：市场风险、管理风险、流动性风险、本基金的特定风险、信用风险、操作或技术风险、合规性风险、其他风险。

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

投资有风险，投资人在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同、基金产品资料概要等信息披露文件，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，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。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投资者的风险承受能力相适应。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，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亦不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。基金投资者有可能获得较高的收益，也有可能损失本金。

投资者应当通过基金管理人或具有基金销售业务资格的其他机构认/申购和赎回基金，基金销售机构名单详见本招募说明书以及相关公告。

本次更新的招募说明书已经本基金托管人复核。除特别说明外，本次更新的招募说明书所载内容截止日为 2021 年 11 月 15 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2021 年 9 月 30 日（财务数据未经审计）。

## 目 录

|                               |     |
|-------------------------------|-----|
| 第一部分 绪言.....                  | 1   |
| 第二部分 释义.....                  | 2   |
| 第三部分 基金管理人.....               | 7   |
| 第四部分 基金托管人.....               | 16  |
| 第五部分 相关服务机构.....              | 20  |
| 第六部分 基金的募集.....               | 32  |
| 第七部分 基金合同的生效.....             | 33  |
| 第八部分 基金份额的申购与赎回.....          | 34  |
| 第九部分 基金的投资.....               | 45  |
| 第十部分 基金的业绩.....               | 57  |
| 第十一部分 基金的财产.....              | 58  |
| 第十二部分 基金资产估值.....             | 59  |
| 第十三部分 基金的收益分配.....            | 64  |
| 第十四部分 基金费用与税收.....            | 66  |
| 第十五部分 基金的会计与审计.....           | 68  |
| 第十六部分 基金的信息披露.....            | 69  |
| 第十七部分 风险揭示.....               | 76  |
| 第十八部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算..... | 80  |
| 第十九部分 基金合同的内容摘要.....          | 82  |
| 第二十部分 基金托管协议的内容摘要.....        | 98  |
| 第二十一部分 对基金份额持有人的服务.....       | 118 |
| 第二十二部分 其他应披露事项.....           | 120 |
| 第二十三部分 招募说明书的存放及查阅方式.....     | 123 |
| 第二十四部分 备查文件.....              | 124 |

## 第一部分 绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）等有关法律法规及《天治转型升级混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”或“《基金合同》”）编写。

本招募说明书阐述了天治转型升级混合型证券投资基金（以下简称“本基金”或“基金”）的投资目标、策略、风险、费率等与投资人投资决策有关的全部必要事项，投资人在做出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

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

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，如本招募说明书内容与基金合同有冲突或不一致之处，均以基金合同为准。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，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

## 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：指天治转型升级混合型证券投资基金
- 2、基金管理人：指天治基金管理有限公司
- 3、基金托管人：指中国农业银行股份有限公司
- 4、基金合同：指《天治转型升级混合型证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充
- 5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《天治转型升级混合型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
- 6、招募说明书或本招募说明书：指《天治转型升级混合型证券投资基金招募说明书》及其更新
- 7、基金产品资料概要：指《天治转型升级混合型证券投资基金基金产品资料概要》及其更新
- 8、基金份额发售公告：指《天治转型升级混合型证券投资基金基金份额发售公告》
- 9、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等
- 10、《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，2012 年 12 月 28 日经第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订、自 2013 年 6 月 1 日起实施，并经 2015 年 4 月 24 日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修正的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 11、《销售办法》：指中国证监会 2013 年 3 月 15 日颁布、同年 6 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 12、《信息披露办法》：指中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

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

14、《流动性风险管理规定》：指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订

15、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

16、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

17、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

18、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

19、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

20、合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》（包括其不时修订）及相关法律法规规定可以投资于中国境内证券市场的中国境外的机构投资者

21、人民币合格境外机构投资者：指按照《人民币合格境外机构投资者境内证券投资试点办法》（包括其不时修订）及相关法律法规规定，运用来自境外的人民币资金进行境内证券投资的境外机构投资者

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

23、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

24、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

25、销售机构：指天治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

26、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

27、登记机构：指办理登记业务的机构。基金的登记机构为天治基金管理有限公司或接受天治基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构，本基金的登记机构为天治基金管理有限公司

28、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

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

30、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

31、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

32、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

33、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

34、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

35、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

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

37、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

38、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

39、《业务规则》：指《天治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

40、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

41、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

42、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

43、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

44、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

45、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、申购金额及扣款方式，由销售机构于每期约定申购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

46、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%

47、元：指人民币元

48、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。法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定

49、摆动定价机制：指当开放式基金遭遇大额申购赎回时，基金管理人可以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

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

## 本和费用的节约

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

52、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

53、基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

54、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

55、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

56、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

### 第三部分 基金管理人

#### （一）基金管理人概况

- 1、名称：天治基金管理有限公司
- 2、住所：上海市浦东新区莲振路 298 号 4 号楼 231 室
- 3、成立日期：2003 年 5 月 27 日
- 4、法定代表人：单宇
- 5、办公地址：上海市复兴西路 159 号
- 6、电话：021-60371155
- 7、联系人：赵正中
- 8、注册资本：1.6 亿元人民币
- 9、股权结构：吉林省信托有限责任公司出资 9800 万元，占注册资本的 61.25%；中国吉林森林工业集团有限责任公司出资 6200 万元，占注册资本的 38.75%。

#### （二）主要人员情况

##### 1、基金管理人董事、监事、经理层成员

单宇先生：董事长，硕士学历，曾任吉林省信托有限责任公司证券投资部经理，吉林省宝路达投资管理有限公司总经理、天治基金管理有限公司筹备组成员，天治基金管理有限公司副总经理、监事长，东北证券副总裁、副总裁兼合规总监，东方基金管理有限公司董事、总经理，东北证券党委副书记，东证融通投资管理有限公司董事长、副董事长，现任天治基金管理有限公司董事长。

徐克磊先生：董事，硕士学历，曾任泰达宏利基金管理有限公司（原湘财合丰基金管理有限公司、泰达荷银基金管理有限公司）IT 部总经理、综合管理部总经理、营销策划部总经理、公司总经理助理兼业务副总监、总经理助理兼新闻发言人，现任天治基金管理有限公司总经理。

张纪军先生：董事，硕士学历，曾任吉林省信托投资有限责任公司自营部业务员、研发部经理、深圳子公司总经理，吉林省亚东投资管理有限责任公司深圳子公司董事长、总公司总经理助理、副总经理，吉林森工集团有限责任公司副总经理、吉林森工集团财务有限责任公司董事长。

李巍先生：董事，中共党员，工程师职称。1996 年起加入吉林省信托有限

责任公司，历任项目经理、信托业务部副总经理、北京信托一部总经理，现任吉林省信托有限责任公司市场总监兼北京信托一部总经理、天治北部资产管理有限公司董事长。

武雷先生：独立董事，学士，曾任北京市政府对外服务办公室公务员、北京市金杜律师事务所律师、北京市金杜律师事务所上海分所合伙人，现任君合律师事务所上海分所合伙人。

王万军先生：独立董事，硕士研究生学历，曾任职于吉林省经济体制改革委员会股份制工作处，中国证监会吉林证监局，历任吉林证监局上市发行处副处长、机构监管处处长、上市公司监管处处长，现任恒泰长财证券有限责任公司合规总监，并获聘担任深圳证券交易所理事会行政复议委员会委员。

周鹏女士：独立董事，法学硕士，曾先后于中国环球律师事务所、金杜律师事务所、盛德国际律师事务所、北京宽信律师事务所担任律师和资深律师，2012年担任中国华安投资有限公司法律顾问，2016年担任中国信达（香港）控股有限公司风险总监兼法律顾问，现为上海耀良律师事务所合伙人，为英国特许会计师公会准会员。

侯丹宇女士：监事会主席（职工监事），学士，经济师职称。历任吉林省信托有限责任公司上海证券业务部营业部经理、东北证券有限责任公司上海洪山路证券营业部总经理、天治基金管理有限公司督察员、副总经理，现任天治基金管理有限公司监事会主席（职工监事）、公司工会主席。

牛葵女士：监事，本科学历，高级经济师职称。先后在吉林省信托有限公司星火项目部、证券部、计划财务部、投行部、信托资产管理部工作，曾任吉林省信托有限责任公司监察审计部总经理，现已退休。

米巍先生：监事，本科学历，中共党员。2008年起加入中国吉林森林工业集团有限责任公司，先后在吉林新合木业、金桥地板集团及吉林森工集团总部工作，现任中国吉林森林工业集团有限责任公司资本运营部副部长。

赵正中先生：职工监事，本科学历，1998年起就职于中国纺织大学，2000年起就职于广发证券股份有限公司，2003年加入天治基金管理有限公司，曾任信息技术部副总监、监察稽核部副总监，现任公司监察稽核部总监。

张健先生，职工监事，硕士研究生。2003年起加入天治基金管理有限公司，

先后担任综合管理部行政主管、副总监、总监，现任综合管理部总监、公司工会委员。

刘伟先生：督察长，学士，历任吉林省信托有限责任公司星火项目处项目负责人、自营基金业务部副经理、上海全路达创业投资公司董事长，现任天治基金管理有限公司督察长。

闫译文女士：副总经理，硕士研究生，中共党员，高级经济师职称。1996年至2009年在吉林省信托有限责任公司任职，先后担任团总支书记、自营业务部副经理、经理、证券部经理、市场研发部经理，2009年6月起加入天治基金管理有限公司，曾任公司财务总监、总经理助理、副总经理，现任天治基金管理有限公司副总经理、首席信息官。

## 2、基金经理

### （1）现任基金经理

TIAN HUAN 先生：硕士研究生，具有基金从业资格。1994年9月至2000年7月，在建设银行海口市分行担任分行营业部主任职务；2004年6月至2009年12月，在加拿大 Genus Capital Management 担任基金经理、研究总监和合伙人职务；2010年1月至2012年12月，在中银基金管理有限公司担任投资经理、产品研发副总裁职务；2013年2月至2018年2月，在景顺长城基金管理有限公司担任总经理助理、产品部总监、ETF销售总监职务；2018年6月起加入天治基金管理有限公司。现任公司量化投资部总监，2018年8月7日起任天治研究驱动灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2019年6月11日起任天治量化核心精选混合型证券投资基金的基金经理。2020年12月8日起任本基金基金经理。

### （2）历任基金经理

自2019年5月21日至2021年1月4日，胡耀文先生任基金经理。

## 3、投资决策委员会成员

天治基金管理有限公司总经理徐克磊先生，投资总监兼权益投资部总监许家涵先生，研究总监尹维国先生，投资副总监兼固定收益部总监王洋女士，量化投资部总监 TIAN HUAN 先生。

## 4、上述人员之间无亲属关系。

### 三、基金管理人职责

基金管理人应严格依法履行下列职责：

- 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，因向审计、法律等外部专业顾问提供的情况除外；
- 13、按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；
- 14、按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
- 15、依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

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

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

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

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

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

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

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

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

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

25、执行生效的基金份额持有人大会的决议；

26、建立并保存基金份额持有人名册；

27、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

#### 四、基金管理人承诺

1、基金管理人将遵守《基金法》、《中华人民共和国证券法》等法律法规的相关规定，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违法违规行的发生。

2、基金管理人不得从事下列行为：

（1）将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；

- (2) 不公平地对待其管理的不同基金财产;
- (3) 利用基金财产或者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、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。

### 3、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、代理人、代表人、受雇人或任何其他第三人牟取不当利益;
- (3) 不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) 不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

#### (五) 基金管理人的风险管理和内部控制制度

基金管理人的风险管理和内部控制制度包括内部控制大纲、基本管理制度、部门业务规章。其中内控大纲是对公司章程规定的内控原则的细化和展开, 对各项基本管理制度的总揽和指导, 内控大纲明确了内控目标、内控原则、内控环境、内控措施等内容。基本管理制度包括风险控制制度、投资管理制度、基金会计制度、信息披露制度、资料档案管理制度、技术保障制度、人力资源和业绩考核制度、监察稽核制度和灾难恢复制度。部门业务规章是在基本管理制度的基础上, 对各部门的主要职责、岗位设置、工作要求、业务流程等的具体说明。

#### 1、风险管理和内部控制的原则

- (1) 健全性原则。内部控制应当覆盖公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员, 并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个经营环节。
- (2) 有效性原则。内部控制应当科学、合理、有效, 公司全体职员必须竭

力维护内部控制制度的有效执行，任何职员不得拥有超越制度约束的权力。

(3) 独立性原则。公司应当在精简高效的基础上设立能充分满足公司经营运作需要的机构、部门和岗位，各机构、部门和岗位在职能上保持相对独立性。监察稽核部保持高度的独立性和权威性，协助和配合督察长负责对公司各部门内部风险管理工作进行稽核和检查。

(4) 相互制约原则。内部部门和岗位的设置应当权责分明、相互牵制，并通过切实可行的相互制衡措施来消除内部控制中的盲点。

(5) 防火墙原则。公司基金财产、固有财产和其他财产的运作应当分离，基金投资研究、决策、执行、清算、评估等部门和岗位应当在物理上和制度上适当隔离。

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

(7) 适时性原则。内部控制应具有前瞻性，公司将根据国家法律法规、政策制度等外部环境的改变和公司经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化及时对公司内部控制体系进行相应的修改和完善。

(8) 定性和定量相结合原则。在以上原则的基础上，建立定量的风险控制指标体系，使风险控制更具客观性和操作性。

## 2、风险管理和内部控制组织体系及职能

公司的内部控制组织体系是一个分工明确的组织结构。具体而言，包括如下组成部分：

(1) 董事会合规与风险控制委员会：作为董事会下设的专门委员会，其主要职能是：检查公司经理层遵守有关法律、法规和公司章程规定的情况；监督、控制公司在机构设置、管理制度、经营决策程序、内控体系等方面的合规合法性，发现问题及时向董事会汇报；研究拟订公司的风险管理战略和政策，报董事会批准；组织制订公司风险控制制度；检查公司风险控制制度的完善性；检查评估公司风险控制制度的执行情况；检查公司部门内部控制制度的制定、完善和执行；负责组织对公司存在的重大风险隐患或出现的重大风险事故进行内部调查，并将调查结果和处理意见报告董事会，由董事会决议做出处理。

(2) 督察长：督察长负责公司的督察稽核工作，对董事会负责，对公司的

各项制度、业务的合法合规性及公司内部控制制度的执行情况进行监察、稽核。

(3) 内部控制委员会：内部控制委员会是公司内部协助经营管理层进行风险控制与风险管理的非常设机构，负责公司内部控制层面的风险监控。

(4) 投资决策委员会：投资决策委员会是公司的最高投资决策机构，在内部控制组织体系中负责基金投资决策层面的风险管理。

(5) 监察稽核部：监察稽核部全面负责公司的监察稽核工作，对公司内部控制制度和风险管理政策的执行情况进行合规性监督检查，向公司管理层和有关机构提供独立、客观、公正的意见或建议。

(6) 各业务部门：风险控制是每一个业务部门和员工重要的责任。各部门的主管在权限范围内，对其负责的业务进行检查监督和风险控制。各个员工根据国家法律法规、公司规章制度、道德规范和行为准则、本人的岗位职责进行自律。

### 3、风险管理和内部控制基本制度

#### (1) 风险控制制度

内部风险控制制度由一系列的具体制度构成，具体包括法规遵循政策、员工行为准则、岗位分离制度、业务隔离制度、标准化作业流程制度、集中交易制度、权限管理制度、信息披露制度、独立的监察稽核制度等。公司根据自身经营特点设立顺序递进、权责统一、严密有效的四层监控防线：即一线岗位自控与互控为基础的第一层监控防线；部门内各子部门、部门和部门之间的自控和互控为基础的第二层防线；内部监察稽核部对各岗位、各部门、各项业务全面实施监督反馈的第三层监控防线；以内部控制委员会为主体的第四层防线，实施对公司各类业务和风险的总体控制。

#### (2) 监察稽核制度

公司设立独立的监察稽核部门。监察稽核部门的职责是依据国家的有关法律法规和公司内部控制制度，在所赋予的权限内，按照所规定的程序和适当的方法对监察稽核对象进行公正客观的检查和评价。

#### (3) 投资管理制度

本公司制定的基金投资管理制度和业务操作规程包括：基本管理制度、部门管理制度以及业务手册三个层次。①本公司制定的基金投资基本管理制度用以规范基金投资管理方面的工作，包括投资管理的基本原则、决策程序、组织架

构，以及投资管理过程中涉及的投资、研究、交易、投资表现评估、投资风险分析和风险控制等工作的基本规范、程序和职责等。②投资管理相关部门权益投资部、固定收益部、量化投资部、交易部和研究发展部等分别制定了部门管理制度，用以规范每个部门的岗位、职责、业务和人员等。③编制投资管理业务手册，包括《投资手册》、《交易手册》、《研究手册》等，作为基本管理制度和部门管理制度重要补充，用以保证投资管理相关工作规范、有序、优质、高效地进行。

#### （4）会计控制制度

公司通过严格执行国家有关法律法规、会计政策和制度，做好公司各项经营管理活动的会计核算和财务管理工作；并做好公司所管理的基金财产的会计核算工作，以如实反映和记录基金财产运作的情况。

公司确保基金财产与公司固有财产完全分开，分别设立账户进行管理，独立核算，公司股东和债权人不得对基金财产主张权利，公司会计核算与基金会计核算在业务规范人员岗位和办公区域上进行严格区分。公司对所管理的不同基金分别设立账户，分账管理，以确保每只基金和基金财产的完整和独立。

#### （5）技术系统控制制度

为担保技术系统的安全稳定运行，公司对硬件设备的安全运行、数据传输与网络安全管理、软硬件的维护、数据的备份、信息技术人员操作管理、危机处理等方面都制定了完善的制度。

### 4、基金管理人关于内部控制的声明

本公司确知建立、实施、维持和完善内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任。本公司特别声明以上关于内部控制的披露真实准确，并承诺将根据市场环境的变化和业务的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

#### 1、基本情况

名称：中国农业银行股份有限公司（简称中国农业银行）

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座

法定代表人：谷澍

成立日期：2009 年 1 月 15 日

批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复[2009]13 号

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]23 号

注册资本：34,998,303.4 万元人民币

存续期间：持续经营

联系电话：010-66060069

传真：010-68121816

联系人：秦一楠

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分,总行设在北京。经国务院批准,中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于 2009 年 1 月 15 日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡,成为国内网点最多、业务辐射范围最广,服务领域最广,服务对象最多,业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外,中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉,每年位居《财富》世界 500 强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、

功能齐备的大型国有商业银行，中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念，坚持审慎稳健经营、可持续发展，立足县域和城市两大市场，实施差异化竞争策略，着力打造“伴你成长”服务品牌，依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品，致力为广大客户提供优质的金融服务，与广大客户共创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行，经验丰富，服务优质，业绩突出，2004 年被英国《全球托管人》评为中国“最佳托管银行”。2007 年中国农业银行通过了美国 SAS70 内部控制审计，并获得无保留意见的 SAS70 审计报告。自 2010 年起中国农业银行连续通过托管业务国际内控标准(ISAIE3402)认证，表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设，品牌声誉进一步提升，在 2010 年首届“‘金牌理财’ TOP10 颁奖盛典”中成绩突出，获“最佳托管银行”奖。2010 年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的“最佳资产托管奖”。2012 年荣获第十届中国财经风云榜“最佳资产托管银行”称号；2013 年至 2017 年连续荣获上海清算所授予的“托管银行优秀奖”和中央国债登记结算有限责任公司授予的“优秀托管机构奖”称号；2015 年、2016 年荣获中国银行业协会授予的“养老金业务最佳发展奖”称号；2018 年荣获中国基金报授予的公募基金 20 年“最佳基金托管银行”奖；2019 年荣获证券时报授予的“2019 年度资产托管银行天玑奖”称号；2020 年被美国《环球金融》评为中国“最佳托管银行”。

中国农业银行证券投资基金托管部于 1998 年 5 月经中国证监会和中国人民银行批准成立，目前内设综合管理部、业务管理部、客户一部、客户二部、客户三部、客户四部、风险合规部、产品研发与信息技术部、营运一部、营运二部，拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

## 2、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工近 310 名，其中具有高级职称的专家 60 名，服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强，高级管理层均有 20 年以上金融从业经验和高级技术职称，精通国内外证券市场的运作。

### 3、基金托管业务经营情况

截止到 2021 年 9 月 30 日,中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共 654 只。

#### 二、基金托管人的内部控制制度

##### 1、内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定,守法经营、规范运作、严格监察,确保业务的稳健运行,保证基金财产的安全完整,确保有关信息的真实、准确、完整、及时,保护基金份额持有人的合法权益。

##### 2、内部控制组织结构

风险管理委员会总体负责中国农业银行的风险管理与内部控制工作,对托管业务风险管理和内部控制工作进行监督和评价。托管业务部专门设置了风险管理处,配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作,独立行使监督稽核职权。

##### 3、内部控制制度及措施

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

#### 三、托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

基金托管人通过参数设置将《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议规定的投资比例和禁止投资品种输入监控系统,每日登录监控系统监督基金管理人的投资运作,并通过基金资金账户、基金管理人的投资指令等监督基金管理人的其他行为。

当基金出现异常交易行为时,基金托管人应当针对不同情况进行以下方式的处理:

- 1、电话提示。对媒体和舆论反映集中的问题,电话提示基金管理人;
- 2、书面警示。对本基金投资比例接近超标、资金头寸不足等问题,以书面

方式对基金管理人进行提示；

3、书面报告。对投资比例超标、清算资金透支以及其他涉嫌违规交易等行为，书面提示有关基金管理人并报中国证监会。

## 第五部分 相关服务机构

### 一、基金份额销售机构

#### 1、直销机构

天治基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区莲振路 298 号 4 号楼 231 室

办公地址：上海市复兴西路 159 号

法定代表人：单宇

电话：021-60374900

传真：021-60374934

联系人：韩涵

客服电话：400-098-4800（免长途通话费用）、021-60374800

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

电子直销：天治基金网上交易平台“E 天网”

网址：<https://etrade.chinanature.com.cn/etrading/etrading.jsp>

#### 2、代销机构

##### （1）中国农业银行股份有限公司

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座

法定代表人：谷澍

联系电话：010-66060069

传真：010-68121816

联系人：贺倩

客户服务电话：95599

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

##### （2）交通银行股份有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号

法定代表人：任德奇

电话：021-58781234

传真：021-58408483

联系人：高天

客户服务电话：95559

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

（3）申万宏源证券有限公司

住所：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人：杨玉成

电话：021-33389888

传真：021-33388224

联系人：黄莹

客户服务电话：95523、4008895523

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

（4）金元证券股份有限公司

住所：海南省海口市南宝路 36 号证券大厦 4 层

办公地址：深圳市深南大道 4001 号时代金融中心 17 楼

法定代表人：王作义

电话：0755-83025022

传真：0755-83025625

联系人：刘萍

客户服务电话：95372

网址：[www.jyzq.cn](http://www.jyzq.cn)

（5）中泰证券有限责任公司

住所：山东省济南市经七路 86 号

办公地址：上海市花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 18 层

法定代表人：李玮

电话：021-20315290

传真：0531-68889752

联系人：秦雨晴

客户服务电话：95538

网址：www.zts.com.cn

（6）光大证券股份有限公司

住所：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：周健男

联系人：何耀

客户服务电话：95525

网址：www.ebscn.com

（7）长江证券股份有限公司

住所：武汉新华路特 8 号长江证券大厦

办公地址：武汉新华路特 8 号长江证券大厦

法人代表：李新华

电话：027-65799999

传真：027-85481900

联系人：奚博宇

客户服务电话：95579、4008888999

网址：www.95579.com

（8）申万宏源西部证券有限公司

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

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

法定代表人：李琦

电话：0991-2307105

传真：0991-2301927

联系人：王怀春

客户服务电话：4008000562

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

(9) 国联证券股份有限公司

住所: 无锡市县前东街 168 号

办公地址: 无锡市金融一街 8 号

法定代表人: 姚志勇

电话: 0510-82831662

传真: 0510-82830162

联系人: 祁昊

客户服务电话: 95570

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

(10) 平安证券有限责任公司

住所: 深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼

办公地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号平安金融大厦 26 楼

法定代表人: 何之江

传真: 0755-82400826

联系人: 石静武

客户服务电话: 95511

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

(11) 华安证券股份有限公司

住所: 安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

办公地址: 安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

法定代表人: 章宏韬

电话: 0551-65161821

传真: 0551-65161600

联系人: 范超

客户服务电话: 96518 (安徽)、4008096518 (全国)

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

(12) 中信建投证券股份有限公司

住所: 北京市安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市东城区朝内大街 188 号

法定代表人：王常青

电话：010-85156398

联系人：许梦园

客服电话：95587、4008-888-108

网址：www.csc108.com

（13）中山证券有限责任公司

注册地址：深圳市南山区创业路 1777 号海信南方大厦 21、22 层

办公地址：深圳市南山区创业路 1777 号海信南方大厦 21、22 层

法定代表人：吴小静

电话：0755-82943755

传真：0755-82960582

客户服务电话：95329

网址：www.zszq.com

（14）中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 35 号 2-6 层

办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：陈共炎

电 话：010-83574507

传 真：010-83574807

联系人：辛国政

客户电话：4008-888-888、95551

公司网站：www.chinastock.com.cn

（15）安信证券股份有限公司

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

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

法定代表人：王连志

电话：0755-82558305

传真：0755-82558355

联系人：陈剑虹

客户服务电话：4008001001

网址：www.essences.com.cn

（16）吉林银行股份有限公司

注册地址：吉林省长春市东南湖大路 1817 号

办公地址：吉林省长春市东南湖大路 1817 号

法定代表人：陈宇龙

联系人：孟明

电 话：0431-84992680

传 真：0431-84992649

客服电话：4008896666

网址：www.jlbank.com.cn

（17）国泰君安证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号

办公地址：上海市静安区南京西路 768 号国泰君安大厦

法定代表人：贺青

联系电话：021-38676666

传真：021-38670666

联系人：钟伟镇

网址：www.gtja.com

服务热线：95521 / 4008888666

（18）华龙证券有限责任公司

注册地址：兰州市城关区东岗西路 638 号兰州财富中心 21 楼

办公地址：兰州市城关区东岗西路 638 号兰州财富中心 21 楼

法定代表人：陈牧原

电话：0931-4890208

传真：0931-4890628

基金业务联系人：范坤

客户服务电话：95368

公司网址: [www.hlzq.com](http://www.hlzq.com)

(19) 上海好买基金销售有限公司

住所: 上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室

办公地址: 上海市浦东新区浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903-906 室

法定代表人: 杨文斌

电话: 021-36696312

传真: 021-68596916

联系人: 高源

客户服务电话: 4007009665

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

(20) 浙江同花顺基金销售有限公司

住所: 浙江省杭州市文二西路 1 号元茂大厦 903

办公地址: 浙江省杭州市西湖区翠柏路 7 号电子商务产业园 2 号楼 2 楼

法定代表人: 凌顺平

电话: 0571-88911818

传真: 0571-86800423

联系人: 李珍珍

客户服务电话: 4008-773-772

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

(21) 上海陆金所资产管理有限公司

住所: 上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

办公地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

法定代表人: 郭坚

电话: 021-20665952

传真: 021-22066653

联系人: 程晨

客户服务电话: 4008219031

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

(22) 上海联泰基金销售有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室

办公地址：上海市长宁区福泉北路 518 号 8 号楼 3 层

法定代表人：燕斌

联系人：陈东

电 话： 021-52822063

传 真： 021-52975270

客服电话：400-118-1188

网址：www.66zichan.com

（23）上海基煜基金销售有限公司

住所：上海市崇明县长兴镇潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室（上海泰和经济  
发展区）

办公地址：上海市昆明路 518 号北美广场 A1002 室

法定代表人：王翔

联系人：居晓菲

电 话： 021-65370077

传 真： 021-55085991

客服电话：400-820-5369

网址： www.jiyufund.com.cn

（24）上海天天基金销售有限公司

住所：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号 26 楼

法定代表人：其实

电话：021-54509988

传真：021-64385308

联系人：潘世友

客户服务电话：4001818188

网址：www.1234567.com.cn

（25）深圳众禄基金销售股份有限公司

住所：深圳市罗湖区笋岗街道梨园路物资控股置地大厦 8 楼 801

办公地址：深圳市罗湖区梨园路 Halo 广场 4 楼

法定代表人：薛峰

电话：0755-33227950

传真：0755-33227951

联系人：龚江江

客户服务电话：4006-788-887

网址：[www.zlfund.cn](http://www.zlfund.cn)、[www.jjmmw.com](http://www.jjmmw.com)

（26）上海钜派钰茂基金销售有限公司

住所：上海市浦东新区泥城镇新城路 2 号 24 幢 N3187 室

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 379 号 14 楼 C 座

法定代表人：杨雅琴

电话：021-68670358

联系人：洪思夷

客户服务电话：4006-889-967

网址：[www.jp-fund.com](http://www.jp-fund.com)

（27）济安财富（北京）基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区太阳宫中路 16 号院 1 号楼 3 层 307

办公地址：北京市朝阳区太阳宫中路 16 号院 1 号楼 3 层 307

法定代表人：杨健

电话：010-65309516

传真：010-65330699

联系人：李海燕

客户服务电话：4006-737-010

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

（28）上海利得基金销售有限公司

住所：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室

办公地址：上海市虹口区东大名路 1098 号浦江国际金融广场 18 层

法定代表人：李兴春

电 话：18918352892

传 真：021-61101630

联系人：徐亮

客户服务电话：95733

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

（29）珠海盈米基金销售有限公司

住所：珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔1201-1203室

法定代表人：肖雯

电 话：020-89629099

传 真：020-89629011

联系人：邱湘湘

客户服务电话：020-89629066

网址：<https://www.yingmi.cn/>

（30）喜鹊财富基金销售有限公司

住所：西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦1513室

办公地址：北京市朝阳区北苑路甲1号

法定代表人：王舰正

电 话：010-58349088

传 真：0891-6177483

联系人：张萌

客户服务电话：400-699-7719

网址：<http://www.xiquefund.com/>

（31）北京汇成基金销售有限公司

住所：北京市西城区西直门外大街1号院2号楼17层19C13

办公地址：北京市西城区西直门外大街1号院2号楼17层19C13

法定代表人：王伟刚

电话：010-62680527

传真：010-62680827

联系人：于伟伟

客服电话：400-619-9059

网址：www.hcfunds.com

（32）上海爱建基金销售有限公司

住所：上海市黄浦区西藏中路 336 号 1806-13 室

办公地址：上海市浦东新区民生路 1299 号丁香国际大厦西塔 19 层 02/03 室

法定代表人：马金

电话：02160608970

传真：021-60608950

联系人：沈雯斌

## 二、登记机构

名称：天治基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区莲振路 298 号 4 号楼 231 室

办公地址：上海市复兴西路 159 号

法定代表人：单宇

电话：021-60374960

传真：021-60374974

联系人：黄宇星

## 三、出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：俞卫锋

电话：021—31358666

传真：021—31358600

经办律师：安冬、丁媛

联系人：安冬

## 四、审计基金财产的会计师事务所

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 50 楼

执行事务合伙人：毛鞍宁

电话：021-22288888

传真：021-22280000

经办注册会计师：蒋燕华、沈熙苑

联系人：蒋燕华

## 第六部分 基金的募集

### 一、基金募集的依据

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他法律法规的有关规定，经 2019 年 2 月 2 日中国证监会证监许可[2019] 194 号文准予募集。

### 二、基金类及存续期

本基金的类别：混合型；

运作方式：契约型开放；

存续期：不定期。

### 三、募集信息

1.本基金经中国证监会 2019 年 2 月 2 日证监许可[2019] 194 号文准予募集，自 2019 年 4 月 15 日至 2019 年 5 月 17 日 向全社会公开募集。募集期募集的基金份额及利息转份额共计 319,165,433.44 份，募集户数为 1,988 户。

2、募集对象：依据中华人民共和国有关法律法规规定可以投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者。

3、募集场所：天治基金管理有限公司的直销网点、基金代销机构的营业网点及其他的合法发售场所，同时通过深圳证券交易所上网定价发售。上述销售机构办理开放式基金业务的城市(网点)的具体情况和联系方式，请参见本基金的发售公告。

## 第七部分 基金合同的生效

### 一、基金合同生效时间

本基金的基金合同于 2019 年 5 月 21 日生效。

### 二、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模限制

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

法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。

## 第八部分 基金份额的申购与赎回

### 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其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并在基金管理人网站公示。基金投资人应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。若基金管理人或其指定的销售机构开通电话、传真或网上等交易方式，投资人可以通过上述方式进行申购与赎回，具体参见各销售机构的相关公告。

### 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》的有关规定在指定媒介上公告。

#### 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。

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》的有关规定在指定媒介上公告申购与赎回的开始时间。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、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、赎回或转换价格为下一开放日基

金份额申购、赎回或转换的价格。

### 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。

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

### 四、申购与赎回的程序

#### 1、申购和赎回的申请方式

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

#### 2、申购和赎回的款项支付

投资人申购基金份额时，必须在规定的时间内全额交付申购款项，否则所提交的申购申请不成立。投资人在提交赎回申请时须持有足够的基金份额余额，否则所提交的赎回申请不成立。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。

投资人赎回生效后，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。如遇证券、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了业务流程，则赎回款项划付时间相应顺延。

#### 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、赎回申请的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况, 投资人应及时查询并妥善行使合法权利。

基金管理人可以在法律法规允许的范围内, 依法对上述申购和赎回申请的确认时间进行调整, 并必须在调整实施日前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。

## 五、申购和赎回的数量限制

1、投资者通过其他销售机构申购, 每个基金账户首次申购的最低金额为 100 元人民币(含申购费); 投资者追加申购时最低申购限额及投资金额级差详见各销售机构的相关公告。投资者通过网上直销首次申购的最低限额为 100 元人民币(含申购费), 追加申购的最低金额为 100 元人民币(含申购费); 通过直销柜台首次申购的最低限额为 1,000 元人民币(含申购费), 追加申购的最低金额为 1,000 元人民币(含申购费)。

2、基金份额持有人可将其全部或部分基金份额赎回, 每次赎回申请不得低于 100 份基金份额; 每个交易账户的最低基金份额余额不得低于 100 份, 基金份额持有人赎回时或赎回后将导致在销售机构保留的基金份额余额不足 100 份的, 需一次全部赎回。如因分红再投资、非交易过户等原因导致的账户余额少于 100 份之情况, 不受此限, 但再次赎回时必须一次性全部赎回。

3、基金管理人可以规定单个投资人累计持有的基金份额上限, 具体规定请参见定期更新的招募说明书或相关公告。

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

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》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。

## 六、申购和赎回的价格、费用及其用途

1、本基金基金份额净值的计算，均保留到小数点后4位，小数点后第5位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T日的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，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

### 2、申购费用

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

本基金的申购费率如下表所示：

| 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 | 0.70%   |
| M≥500万元       | 每笔1000元 |

### 3、申购份额的计算

基金申购采用金额申购的方式。

申购费用适用比例费率的情形下：

净申购金额=申购金额/（1+申购费率）

申购费用=申购金额-净申购金额

申购份额=净申购金额/T日基金份额净值

申购费用适用固定金额的情形下：

申购费用=固定金额

净申购金额=申购金额-申购费用

申购份额=净申购金额/T日基金份额净值

例：某投资人投资10,000.00元申购本基金基金份额，假设申购当日基金份

额净值为 1.04 元，申购费率为 1.50%，则该投资人可得到的基金份额为：

申购金额=10,000.00 元

净申购金额=10,000.00/（1+1.50%）=9,852.22 元

申购费用=10,000.00-9,852.22=147.78 元

申购份额=9,852.22/1.04=9,473.29 份

即：投资人投资 10,000.00 元申购本基金基金份额，假设申购当日基金份额净值为 1.04 元，则其可得到 9,473.29 份基金份额。

#### 4、赎回费用

本基金基金份额的赎回费率随基金份额持有人申请份额持有时间的增加而递减。

本基金基金份额的赎回费率如下表：

| 累计持有期间（Y）     | 赎回费率  |
|---------------|-------|
| Y<7 日         | 1.50% |
| 7 日≤Y<30 日    | 0.75% |
| 30 日≤Y<365 日  | 0.50% |
| 365 日≤Y<730 日 | 0.30% |
| Y≥730 日       | 0     |

本基金对持续持有期少于 30 日的基金份额持有人收取的赎回费，将全额计入基金财产；对持续持有期长于或等于 30 日但少于 90 日的基金份额持有人收取的赎回费，将不低于赎回费总额的 75% 计入基金财产；对持续持有期长于或等于 90 日但少于 180 日的基金份额持有人收取的赎回费，将不低于赎回费总额的 50% 计入基金财产；对持续持有期长于或等于 180 日的基金份额持有人收取的赎回费，将不低于赎回费总额的 25% 计入基金财产；赎回费中未归入基金财产的部分用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

#### 5、赎回金额的计算

采用“份额赎回”方式，赎回价格以 T 日基金份额净值为基准进行计算，赎回金额计算方法如下：

赎回总金额=赎回份额×T 日基金份额净值

赎回费用=赎回总金额×赎回费率

净赎回金额=赎回总金额-赎回费用

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。

例：某基金份额持有人赎回 10,000 份基金份额，持有时间为 20 日，对应的赎回费率为 0.75%，假设赎回当日基金份额净值是 1.0500 元，则其可获得的赎回金额为：

赎回总金额=10,000×1.0500=10,500 元

赎回费用=10,500×0.75%=78.75 元

净赎回金额=10,500－78.75=10,421.25 元

即：基金份额持有人赎回本基金 10,000 份基金份额，持有时间为 20 日，假设赎回当日基金份额净值是 1.0500 元，则其可得到的赎回金额为 10,421.25 元。

6、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》的有关规定在指定媒介上公告。

7、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。

8、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持续营销计划，针对投资人定期或不定期地开展基金持续营销活动。在基金持续营销活动期间，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销售费用。

## 七、拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

1、因不可抗力导致基金无法正常运转。

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

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

5、基金管理人、基金托管人、基金销售机构或登记机构因技术故障或异常情况导致基金销售系统、基金登记系统、基金会计系统或证券登记结算系统无法正常运行。

6、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。

7、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过基金份额总数的 50%，或者有可能导致投资者变相规避前述 50%比例要求的情形。

8、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第 1、2、3、4、5、8 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。当发生上述第 7 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拒绝，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。

#### 八、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基金份额持有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基金份额持有人的赎回申请或延缓支付赎回款项。当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金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、继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时，基金管理人可暂停接受基金份额持有人的赎回申请。

6、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停接受基金份额持有人的赎回申请或者延缓支付赎回款项，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。

## 九、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的10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日

未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理,无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额,以此类推,直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择,投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

当基金发生巨额赎回,在单个基金份额持有人超过基金总份额 20%以上的赎回申请情形下,对于其超过基金总份额 20%以上的部分,基金管理人可以延期办理赎回申请;对于该基金份额持有人当日赎回申请未超过 20%的部分,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;基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时,基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的 10%的前提下,可对当日的其余赎回申请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,基金管理人可对其赎回申请进行延期办理,延期的赎回申请转入下一个开放日继续赎回,直到全部赎回为止。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理,无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额,以此类推,直到全部赎回为止。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;延期部分如选择取消赎回的,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。

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

### 3、巨额赎回的公告

当发生上述巨额赎回并延期办理时,基金管理人应当通过邮寄、传真或者基金管理人官方网站、短信、电子邮件或由基金销售机构通知等方式在 3 个工作日内通知基金份额持有人,说明有关处理方法,并在 2 日内在指定媒介上刊登公告。

## 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,基金管理人应在规定期限内指定媒

介上刊登暂停公告。

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

3、如发生暂停的时间超过 1 日，基金管理人可以根据暂停申购或赎回的时间，依照《信息披露办法》的有关规定，最迟于重新开放日在指定媒介上刊登重新开放申购或赎回的公告；也可以根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间，届时不再另行发布重新开放的公告。

### 十一、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。

### 十二、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。

### 十三、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。

#### 十四、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申购金额，每期申购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。

#### 十五、基金份额的冻结和解冻

基金登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻，以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。基金份额的冻结手续、冻结方式按照登记机构的相关规定办理。基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益按照我国法律法规、监管规章及国家有权机关的要求以及登记机构业务规定来处理。

#### 十六、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。

#### 十七、其他业务

在相关法律法规允许的条件下，基金登记机构可依据其业务规则，受理基金份额质押等业务，并收取一定的手续费用。

## 第九部分 基金的投资

### 一、投资目标

本基金主要投资于转型升级主题相关股票,通过精选个股和严格的风险控制,力争为基金份额持有人获得超越业绩比较基准的收益。

### 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(包括主板、中小板、创业板以及其他经中国证监会核准上市的股票)、存托凭证、债券(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(含分离交易可转债)、央行票据、中期票据、短期融资券(含超短期融资券)、可交换债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括定期存款、协议存款、通知存款等)、同业存单、货币市场工具、衍生工具(权证、股指期货等)以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

基金的投资组合比例为:股票及存托凭证投资占基金资产的比例为60%-95%,其中投资于转型升级主题相关的股票不低于非现金基金资产的80%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,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%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或变更投资比例限制,基金管理人可在履行适当程序后,可以相应调整本基金的投资范围和投资比例规定。

### 三、投资策略

#### 1、资产配置策略

本基金采取“自上而下”的方式进行大类资产配置,通过定性与定量相结合的方法,综合考虑宏观经济、市场面、政策面等因素,确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例。

#### 2、股票投资策略

### 1) 转型升级主题的界定

本基金的转型升级主题指的是在国家经济结构转型、经济体制转型及产业升级的大趋势中所不断涌现出的行业投资机会。

该类公司主要通过以下定量分析和定性分析相结合的方式筛选：

**I.定量角度：**受益于转型升级的公司，往往表现为净资产收益率的提高，或是跨周期性地维持较高的净资产收益率，或是盈利能力相对较强。本基金主要从以下三个方面进行筛选，在任一方面满足下列筛选条件的既被视作转型升级主题公司：**a.资本回报的改善。**本基金所选的受益于转型升级的公司其资本回报趋势性向好，表现为净资产收益率较上一年度报告有所提高；**b.较好的增长持续性。**本基金所选的受益于转型升级的公司市场竞争优势明显，持续增长能力较强，表现为过去连续两年净资产收益率等指标不低于行业平均水平；**c.较强的盈利能力。**本基金所选的受益于转型升级的公司盈利性相对较好，表现为公司的销售毛利率、营业利润率等指标不低于行业平均水平。

#### **II.定性角度：**

本基金将根据我国不同行业所处的发展阶段以及国家相关产业政策，借鉴其他国家在经济转型升级过程中产业变迁的经验，选择具备快速发展潜力的优势行业进行重点投资，具体包括：

①受益于国家经济产业升级和优化迭代的行业和上市公司，主要包括传统产业结构的改善和产业素质与效率的提高。现代服务业依靠高新技术和现代管理方法、经营方式来改造传统服务业，创造需求，引导消费，向社会提供高附加值、高层次、知识型的生产服务和生活服务，具有智力要素密集度高、产出附加值高、资源消耗少、环境污染少等特点。虽然表现形式仍为传统产业，但已发生本质差别，包括但不限于共享经济、移动支付、智能物流、跨境电商等产业；

②受益于国家经济结构转型大背景下所引发的产业结构、技术结构等方面变化或受益于国家相关经济调整政策的行业和上市公司，经济结构转型所涉及的方面具体包括但不限于产业结构调整、技术结构调整、产品结构调整和区域布局结构调整等，战略性新兴产业是国家经济转型期重点投资的领域，包括但不限于节能环保、新一代信息技术、生物、高端装备制造、新能源、新材料、新能源汽车等产业；

③受益于国家经济体制转型的行业和上市公司,包括但不限于引入国有企业改革混合所有制等改革政策背景下为某些行业和上市公司所带来投资机遇。在供给侧改革的大背景下,大量的传统行业和国有企业转变思想,优化产能,强强联合,通过引入民营机制调动企业积极性,包括但不限于国企改革、传统行业转型升级等产业;

④受益于企业内部积极进行技术创新、流程重组以提升企业生产效率和企业的价值,以及在行业内为寻求资源有效利用而进行主动转产、资产重组等的上市公司。

## 2) 行业配置策略

在行业配置层面,本基金将运用“自上而下”的行业配置方法,通过对国内外宏观经济走势、经济结构转型的方向、国家经济与产业政策导向和经济周期调整的深入研究,采用价值理念与成长理念相结合的方法来对行业进行筛选。

## 3) 个股投资策略

本基金将主要采用“自下而上”的个股选择方法,在拟配置的行业内部通过定量与定性相结合的分析方法选筛选个股。

定量的方法主要是通过公司自有个股分析模型,通过对价值指标、成长指标、盈利指标等公开数据的细致分析,考察上市公司的盈利能力、盈利质量、成长能力、运营能力以及负债水平等方面,初步筛选出财务健康、成长性良好的优质股票。

定性的方法主要是在定量分析的基础上,由公司的研究人员采用案头研究和实地调研相结合的办法对拟投资公司的投资价值、核心竞争力、主营业务成长性、公司治理结构、经营管理能力、商业模式等进行定性分析以确定最终的投资目标。

## 3、债券投资策略

在选择债券品种时,首先根据宏观经济、资金面动向、发行人情况和投资人行为等方面的分析判断未来利率期限结构变化,并充分考虑组合的流动性管理的实际情况,配置债券组合的久期;其次,结合信用分析、流动性分析、税收分析等确定债券组合的类属配置;再次,在上述基础上利用债券定价技术选择个券,选择被价格低估的债券进行投资。

## 4、权证投资策略

本基金在进行权证投资时,将通过对权证标的证券基本面的研究,并结合权证定价模型寻求其合理估值水平,并充分考虑权证资产的收益性、流动性、风险性特征,主要考虑运用的策略包括:价值挖掘策略、获利保护策略、杠杆策略、双向权证策略、价差策略、买入保护性的认沽权证策略、卖空保护性的认购权证策略等。

#### 5、资产支持证券投资策略

资产支持证券投资关键在于对基础资产质量及未来现金流的分析,本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下,采用基本面分析和数量化模型相结合,对个券进行风险分析和价值评估后进行投资。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。

#### 6、股指期货投资策略

本基金在进行股指期货投资时,采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,结合股指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或期限套利等操作。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。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,本基金将在履行适当程序后,将其纳入投资范围以丰富组合投资策略。

#### 7. 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。

### 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) 本基金股票及存托凭证资产投资占基金资产的比例为 60%-95%,其中投资于转型升级主题相关的股票不低于非现金基金资产的 80%;

(2) 每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例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;

- (3) 本基金持有一家公司发行的证券,其市值不超过基金资产净值的 10%;
- (4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券,不超过该证券的 10%;
- (5) 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%;
- (6) 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%;
- (7) 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%;
- (8) 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%;
- (9) 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%;
- (10) 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%;
- (11) 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%;
- (12) 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%;
- (13) 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;
- (14) 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;
- (15) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%;本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年,债券回购到期后不得展期;
- (16) 本基金参与股指期货交易,应当遵守下列要求:
  - 1) 本基金在任何交易日日终,持有的买入股指期货合约价值,不得超过基

金资产净值的 10%;

2) 本基金在任何交易日日终,持有的买入股指期货合约价值与有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的 95%;其中,有价证券指股票、债券(不含到期日在一年以内的政府债券)、权证、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等;

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

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

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

(17) 本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%;

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

(19) 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;

(20) 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;

(21) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述第(2)、(13)、(18)、(19)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取消或调整上述投资组合比例限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，可按照取消或调整后的规定修改基金合同，无需经基金份额持有人大会审议。

## 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，但是法律法规或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其他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。

如法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，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：沪深 300 指数收益率 $\times$ 80%+1 年期定期存款利率（税后） $\times$ 20%。

沪深 300 指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所共同开发的中国 A 股市场指数，它是中国第一支由权威机构编制、发布的全市场指数，流动性高，可投资性强，综合反映了中国证券市场最具市场影响力的一批优质大盘企业的整体

状况，其中包括的上市公司对中国经济的发展具有举足轻重的作用，是衡量本基金股票投资业绩的理想基准。本基金以 1 年期定期存款利率作为现金部分的业绩比较标准。

如果今后法律法规发生变化，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，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩比较基准的指数时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，与基金托管人协商一致并按监管部门要求履行适当程序后变更业绩比较基准并及时公告，无需召集基金份额持有人大会。如果本基金业绩比较基准所参照的指数在未来不再发布时，基金管理人可以与基金托管人协商一致并按相关监管部门要求履行相关手续后，依据维护基金份额持有人合法权益的原则，选取相似的或可替代的指数作为业绩比较基准的参照指数，而无需召开基金份额持有人大会。

## 六、风险收益特征

本基金为混合型基金，其长期平均风险和预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。

## 七、基金管理人代表基金行使权利的处理原则及方法

- 1、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；
- 2、有利于基金资产的安全与增值；
- 3、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东、债权人权利，保护基金份额持有人的利益。

## 八、基金投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据基金合同规定，复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至 2021 年 9 月 30 日。所列财务数据未经审计。

## 1、报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额（元）        | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|--------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 5,988,759.00 | 93.81        |
|    | 其中：股票             | 5,988,759.00 | 93.81        |
| 2  | 基金投资              | -            | -            |
| 3  | 固定收益投资            | -            | -            |
|    | 其中：债券             | -            | -            |
|    | 资产支持证券            | -            | -            |
| 4  | 贵金属投资             | -            | -            |
| 5  | 金融衍生品投资           | -            | -            |
| 6  | 买入返售金融资产          | -            | -            |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -            | -            |
| 7  | 银行存款和结算备付金合计      | 353,125.63   | 5.53         |
| 8  | 其他资产              | 41,772.23    | 0.65         |
| 9  | 合计                | 6,383,656.86 | 100.00       |

## 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

## (1) 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|--------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -            | -            |
| B  | 采矿业              | -            | -            |
| C  | 制造业              | 3,540,470.00 | 55.78        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -            | -            |
| E  | 建筑业              | -            | -            |
| F  | 批发和零售业           | -            | -            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | -            | -            |
| H  | 住宿和餐饮业           | -            | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 249,303.00   | 3.93         |
| J  | 金融业              | 120,295.00   | 1.90         |
| K  | 房地产业             | -            | -            |

|   |               |              |       |
|---|---------------|--------------|-------|
| L | 租赁和商务服务业      | 572,000.00   | 9.01  |
| M | 科学研究和技术服务业    | 1,426,591.00 | 22.48 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | -            | -     |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | -            | -     |
| P | 教育            | -            | -     |
| Q | 卫生和社会工作       | 80,100.00    | 1.26  |
| R | 文化、体育和娱乐业     | -            | -     |
| S | 综合            | -            | -     |
|   | 合计            | 5,988,759.00 | 94.36 |

(2) 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明

细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量(股)  | 公允价值(元)    | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|--------|------------|--------------|
| 1  | 300347 | 泰格医药 | 3,500  | 609,000.00 | 9.60         |
| 2  | 603259 | 药明康德 | 3,800  | 580,640.00 | 9.15         |
| 3  | 601888 | 中国中免 | 2,200  | 572,000.00 | 9.01         |
| 4  | 600519 | 贵州茅台 | 300    | 549,000.00 | 8.65         |
| 5  | 000858 | 五粮液  | 2,500  | 548,475.00 | 8.64         |
| 6  | 002271 | 东方雨虹 | 11,800 | 522,976.00 | 8.24         |
| 7  | 000661 | 长春高新 | 1,500  | 411,990.00 | 6.49         |
| 8  | 300760 | 迈瑞医疗 | 1,000  | 385,420.00 | 6.07         |
| 9  | 002311 | 海大集团 | 5,000  | 337,000.00 | 5.31         |
| 10 | 300759 | 康龙化成 | 1,100  | 236,951.00 | 3.73         |

#### 4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### （1）报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

##### （2）本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

#### 10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### （1）本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

##### （2）报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

##### （3）本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 11、投资组合报告附注

##### （1）本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

(2) 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

(3) 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额(元)     |
|----|---------|-----------|
| 1  | 存出保证金   | 853.84    |
| 2  | 应收证券清算款 | 30,402.88 |
| 3  | 应收股利    | -         |
| 4  | 应收利息    | 79.08     |
| 5  | 应收申购款   | 10,436.43 |
| 6  | 其他应收款   | -         |
| 7  | 待摊费用    | -         |
| 8  | 其他      | -         |
| 9  | 合计      | 41,772.23 |

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

(6) 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因, 分项之和与合计项可能存在尾差。

## 第十部分 基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。基金的业绩数据截止到 2021 年 9 月 30 日。所列财务数据未经审计。基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率比较表：

| 阶段                                        | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③    | ②—④    |
|-------------------------------------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 2019 年 5 月 21 日（基金合同生效日）-2019 年 12 月 31 日 | 13.46% | 0.64%     | 10.77%     | 0.73%         | 2.69%  | -0.09% |
| 2020 年 1 月 1 日-2020 年 12 月 31 日           | 80.29% | 1.65%     | 22.09%     | 1.15%         | 58.20% | 0.50%  |
| 2021 年 1 月 1 日-2021 年 9 月 30 日            | -8.53% | 2.01%     | -4.89%     | 1.02%         | -3.64  | 0.99%  |

## 第十一部分 基金的财产

### 一、基金资产总值

基金资产总值是指基金拥有的各类证券及票据价值、银行存款本息和基金应收款项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。除依法律法规和《基金合同》的规定处分外，基金财产不得被处分。

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

## 第十二部分 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、存托凭证、债券、衍生工具和其它投资等资产及负债。

### 三、估值方法

#### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

(1) 交易所上市的有价证券（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；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) 交易所上市实行净价交易的固定收益品种（基金合同另有规定的除外）按估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值，具体估值机构由基金管理人与基金托管人另行协商约定；

(3) 交易所上市的可转换债券按估值日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；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去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；

(4) 交易所上市的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

#### 2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

(1) 送股、转增股、配股和公开增发的股票，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或未挂牌转让的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

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

3、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

4、同一证券同时在两个或两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。

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

6、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。

7、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。

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

9、相关法律法规以及监管部门、自律规则另有规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

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

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

#### 四、估值程序

1、基金份额净值是按照每个工作日闭市后，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。

基金管理人于每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值，但基金管理人根据法律法规或基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将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。

#### 五、估值错误的处理

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

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。对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平不能预见、不能避免、不能克服，则属不可抗力，按照下述规定执行。

由于不可抗力原因造成投资人的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

##### 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。

## 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;

2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时;

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

4、法律法规、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

## 七、基金净值的确认

用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算, 基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的基金资产净值和基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人, 由基金管理人对基金份额净值予以公布。

## 八、特殊情况的处理

1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 7 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, 或由于证券交易所、期货交易所及登记结算公司发送的数据错误, 基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查, 但未能发现错误的, 由此造成的基金资产估值错误, 基金管理人和基金托管人免除赔偿责任, 但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

## 第十三部分 基金的收益分配

### 一、基金利润的构成

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

### 二、基金可供分配利润

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

### 三、基金收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人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；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

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

4、本基金每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

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不利影响的前提下，基金管理人可在与基金托管人协商一致并按照监管部门要求履行适当程序后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，但应于调整实施日前在指定媒介公告。

### 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，依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

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

#### 六、基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人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，依照登记机构相关业务规则执行。

## 第十四部分 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、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、审计费、诉讼费和仲裁费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券、期货交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、基金相关账户的开户及维护费用；
- 9、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

### 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

#### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25%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，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类”中第 3—9 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、费用调整

基金管理人和基金托管人可根据基金规模等因素协商一致，调整基金管理人费率、托管费率。调整基金管理人费率、托管费率需经基金份额持有人大会决议通过。基金管理人必须于新的费率实施日前在指定媒介上公告。

### 五、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## 第十五部分 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具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。

2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意。

3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所需按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

## 第十六部分 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。相关法律法规关于信息披露的披露方式、披露内容、登载媒介、报备方式等规定发生变化时，本基金从其最新规定。

### 二、信息披露义务人

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

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

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

三、本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

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

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

本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

## 五、公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

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

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

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

基金募集申请经中国证监会注册后，基金管理人在基金份额发售的3日前，将基金招募说明书、《基金合同》摘要登载在指定媒介上；基金管理人、基金托管人应当将《基金合同》、基金托管协议登载在各自网站上。

### （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指定媒介上。

### （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指定媒介上登载《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指定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，通过指定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在指定网站披露半年度和年度最后一日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，将年度报告登载在指定网站上，并将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计。

基金管理人应当在上半年结束之日起两个月内，编制完成基金中期报告，将中期报告登载在指定网站上，并将中期报告提示性公告登载在指定报刊上。

基金管理人应当在季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，将季度报告登载在指定网站上，并将季度报告提示性公告登载在指定报刊上。

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

基金运作期间，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基金定期报

告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本基金的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

基金持续运作过程中，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，并登载在指定报刊和指定网站上。

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

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

业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；

13、基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易事项，但中国证监会另有规定的除外；

14、基金收益分配事项；

15、基金管理费、基金托管费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；

16、基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；

17、本基金开始办理申购、赎回；

18、本基金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、在发生涉及基金申购、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、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，并将有关情况立即报告中国证监会。

#### （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）清算报告

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

#### （十一）投资资产支持证券信息披露

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。

#### （十二）投资股指期货信息披露

本基金在季度报告、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。

#### （十三）投资流通受限证券相关公告

本基金投资非公开发行股票后两个交易日内，应当在中国证监会指定媒介披露所投资非公开发行股票的名称、数量、总成本、账面价值，以及总成本和账面价值占基金资产净值的比例、锁定期等信息。

#### （十四）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律法规的规定。

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告、更新的招募说明书、基金产品资料概要、基金清算报告等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人进行书面或电子确认。

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

基金管理人、基金托管人除依法在指定媒介上披露信息外，还可以根据需要

在其他公共媒介披露信息，但是其他公共媒介不得早于指定媒介披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

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、暂停或延迟信息披露的情形

当出现下述情况时，基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金信息：

- 1、不可抗力；
- 2、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；
- 3、法律法规规定、中国证监会或《基金合同》认定的其他情形。

九、本基金信息披露事项以法律法规规定及本章节约定的内容为准。

## 第十七部分 风险揭示

本基金投资运作过程中面临的主要风险有：市场风险、管理风险、流动性风险、本基金特有的风险、信用风险、操作或技术风险、合规风险、其他风险。

### 一、市场风险

证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响，导致基金收益水平变化，产生风险，主要包括：

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

**经济周期风险：**随经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化。基金投资于国债与上市公司的股票，收益水平也会随之变化，从而产生风险。

**利率风险：**金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着国债的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。基金投资于国债和股票，其收益水平会受到利率变化的影响。

### 二、管理风险

在基金管理运作过程中，基金管理人的研究水平、投资管理水平直接影响基金收益水平，如果基金管理人面对经济形势和证券市场判断不准确、获取的信息不全、投资决策操作出现失误，都会影响基金的收益水平。

### 三、流动性风险

#### 1、基金申购、赎回安排

本基金的申购、赎回安排参见本招募说明书“第八部分 基金份额的申购与赎回”的约定。

#### 2、拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

（1）本基金为混合型基金。股票投资占基金资产的比例为 60%-95%，其中投资于转型升级主题相关的股票不低于非现金基金资产的 80%。由于证券交易所和银行间市场具有交易对手活跃、投资品种丰富、交易规则明确等优势，相关上市交易品种具有较高的流动性及较强的变现能力，资金调用的灵活程度较高。因此，本基金可根据市场情况及时将申购资金进行投资，也可根据赎回资金需求及

时变现及调整组合资产，从而能最大限度地提高组合投资效率，平衡投资者的申购及赎回需求。

(2) 股指期货合约存在无法及时变现带来的流动性风险。

(3) 资产支持证券，只能通过特定的渠道进行转让交易，存在市场交易不活跃导致的流动性风险。

基金管理人将密切关注各类资产及投资标的的交易活跃程度与价格的连续性情况，评估各类资产及投资标的占基金资产的比例并进行动态调整，以满足基金运作过程中的流动性要求，应对流动性风险。

### 3、巨额赎回下的流动性风险管理措施

详见“第八部分 基金份额的申购与赎回”之“九、巨额赎回的情形及处理方式”。

### 4、实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响

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

实施备用流动性风险管理工具的决策程序依照基金管理人流动性风险管理制度的规定办理。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，确保公平对待投资者，将对投资者可能出现的潜在影响降至最低。

特别提示，当管理人采取以上措施时，投资者可能面临赎回款项被迫延迟支付、因估值方式变动或市场波动造成赎回财产损失等风险。

## 四、本基金的特定风险

### 1、股指期货投资风险

本基金可投资于股指期货，股指期货作为一种金融衍生品，具备一些特有的风险点。投资股指期货所面临的风险主要是市场风险、流动性风险、基差风险、保证金风险等。具体为：

(1) 市场风险是指由于股指期货价格变动而给投资者带来的风险。市场风险是股指期货投资中最主要的风险。

(2) 流动性风险是指由于市场流动性差或合约交易活跃性差，交易参与者

少，买卖意愿不高，期货交易难以迅速、及时、方便的成交所产生的风险。

(3) 基差风险是指股指期货合约价格和指数价格之间的价格差的波动所造成的风险，以及不同股指期货合约价格之间价格差的波动所造成的期现价差风险。

(4) 保证金风险是指由于保证金交易的杠杆性，当出现不利行情时，股价指数微小的变动就可能会使投资者权益遭受较大损失。而且股指期货采用每日无负债结算制度，如果没有在规定的时间内补足保证金，按规定将被强制平仓，可能给投资带来重大损失。

## 2、资产支持证券投资风险

本基金可投资资产支持证券，主要存在以下风险：1) 特定原始权益人破产风险、现金流预测风险等与基础资产相关的风险；2) 资产支持证券信用增级措施相关风险、资产支持证券的利率风险、评级风险等与资产支持证券相关的风险；3) 管理人违约违规风险、托管人违约违规风险、专项计划账户管理风险、资产服务机构违规风险等与专项计划管理相关的风险；4) 政策风险、税收风险、发生不可抗力事件的风险、技术风险和操作风险等其他风险。

## 3、投资于存托凭证的风险

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

## 五、信用风险

信用风险是指债券发行人是否能够实现发行时的承诺，按时足额还本付息的风险。一般认为：国债的信用风险可以视为零，而其它债券的信用风险可按专业机构的信用评级确定，信用等级变化或市场对某一信用等级水平下债券率的变化都会迅速的改变债券的价格，从而影响到基金资产。

## 六、操作或技术风险

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

## 七、合规性风险

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

## 八、其他风险

- 1、因基金业务快速发展而在制度建设、人员配备、内控制度建立等方面不完善而产生的风险;
- 2、对主要业务人员如基金经理的依赖而可能产生的风险;
- 3、因业务竞争压力可能产生的风险;
- 4、战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金资产的损失,影响基金收益水平,从而带来风险;
- 5、其他意外导致的风险。

## 第十八部分 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方可执行，并自决议生效后 2 日内在指定媒介公告。

### 二、《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

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

### 三、基金财产的清算

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

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

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

#### 4、基金财产清算程序：

- (1)《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；

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

5、基金财产清算的期限为 6 个月。

#### 四、清算费用

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

#### 五、基金财产清算剩余资产的分配

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

#### 六、基金财产清算的公告

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

#### 七、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上，法律法规另有规定的从其规定。

## 第十九部分 基金合同的内容摘要

### 一、基金管理人、基金托管人和基金份额持有人的权利、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与赎回申请；

（12）依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

（13）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；

（14）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；

(15) 在符合有关法律、法规的前提下,制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户和定期定额投资等业务规则;

(16) 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,但向审计、法律等外部专业顾问提供的除外;

(13) 按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案,及时向基金份额持有

人分配基金收益；

（14）按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

（25）执行生效的基金份额持有人大会的决议；

（26）建立并保存基金份额持有人名册；

（27）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

（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人的利益；

（4）根据相关市场规则，为基金开设证券账户、资金账户等投资所需账户，为基金办理证券、期货等交易资金清算；

（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，但向审计、法律等外部专业顾问提供的除外；

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

（9）办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

（10）对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行；如果基金管理人未执行《基金合同》规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

（11）保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料15年以上；

（12）建立并保存基金份额持有人名册；

（13）按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

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

（15）依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、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、《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业监督管理机构，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与义务

基金投资人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，基金投资人自依据《基金合同》取得基金份额，即成为本基金基金份额持有人和《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。

每份基金份额具有同等的合法权益。

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：

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

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

- (1) 认真阅读并遵守《基金合同》、招募说明书等信息披露文件；
- (2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；
- (3) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；
- (4) 缴纳基金认购、申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；
- (5) 在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；
- (6) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；
- (7) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

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

## 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、中国证监会另有规定的除外：

- (1) 终止《基金合同》；
- (2) 更换基金管理人；
- (3) 更换基金托管人；
- (4) 转换基金运作方式；
- (5) 调整基金管理人、基金托管人的报酬标准；
- (6) 变更基金类别；
- (7) 本基金与其他基金的合并；
- (8) 变更基金投资目标、范围或策略；
- (9) 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) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率或在对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下变更收费方式；
- (3) 调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则；
- (4) 调整基金份额类别设置及对基金份额分类办法、规则进行调整；
- (5) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；
- (6) 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；
- (7) 按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

## (二) 会议召集人及召集方式

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

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。

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

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

持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开并告知基金管理人，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，在指定媒介公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

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

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、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、通讯开会方式或法律法规和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召集人通知的非现场方式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址或系统。通讯开会应以召集人通知的非现场方式进行表决。

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表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取表决意见的，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)项中直接出具表决意见的基金份额持有人或受托代表他人出具表决意见的代理人, 同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具表决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、在不与法律法规冲突的前提下, 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或代理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。除法律法规、中国证监会另有规定外，转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》、本基金与其他基金合并以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时监督员及公证机关均认为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人身份文件的表决视为

有效出席的投资人，表面符合会议通知规定的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，但应当计入出具表决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。

在上述规则的前提下，具体规则以召集人发布的基金份额持有人大会通知为准。

### （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和代理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日内在指定媒介上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

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

（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，基金管理人与基金托管人协商一致并提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

## 三、基金合同解除和终止的事由和程序

### （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方可执行，并自决议生效后2日内在指定媒介公告。

### （二）《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在6个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；

- 3、《基金合同》约定的其他情形；
- 4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### （三）基金财产的清算

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

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

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

#### 4、基金财产清算程序：

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

### （四）清算费用

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

### （五）基金财产清算剩余资产的分配

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

### （六）基金财产清算的公告

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

#### （七）基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上，法律法规另有规定的从其规定。

### 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，如经友好协商未能解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。除非仲裁裁决另有决定，仲裁费用由败诉方承担。

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》受中国法律管辖。

### 五、基金合同存放地和投资人取得合同的方式

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

## 第二十部分 基金托管协议的内容摘要

### 一、基金托管协议当事人

#### （一）基金管理人

名称：天治基金管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区莲振路 298 号 4 号楼 231 室

办公地址：上海市复兴西路 159 号

邮政编码：200031

法定代表人：单宇

成立日期：2003 年 5 月 27 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2003]73 号

组织形式：其他有限责任公司

注册资本：1.6 亿元人民币

存续期间：持续经营

经营范围：基金管理业务、发起设立基金及中国证券监督管理委员会批准的其他业务。

#### （二）基金托管人

名称：中国农业银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座九层

邮政编码：100031

法定代表人：谷澍

成立时间：2009 年 1 月 15 日

基金托管资格批准文号：中国证监会证监基字[1998]23 号

批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复[2009]13 号

注册资本：34,998,303.4 万元人民币

存续期间：持续经营

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买

卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；结汇、售汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；代理资金清算；各类汇兑业务；代理政策性银行、外国政府和国际金融机构贷款业务；贷款承诺；组织或参加银团贷款；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇借款；发行、代理发行、买卖或代理买卖股票以外的外币有价证券；外汇票据承兑和贴现；自营、代客外汇买卖；外币兑换；外汇担保；资信调查、咨询、见证业务；企业、个人财务顾问服务；证券公司客户交易结算资金存管业务；证券投资基金托管业务；企业年金托管业务；产业投资基金托管业务；合格境外机构投资者境内证券投资托管业务；代理开放式基金业务；电话银行、手机银行、网上银行业务；金融衍生产品交易业务；经国务院银行业监督管理机构等监管部门批准的其他业务。

## 二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

（一）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、投资限制进行监督。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种池和交易对手库，以便基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。

本基金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、中小板、创业板以及其他经中国证监会核准上市的股票)、存托凭证、债券(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(含分离交易可转债)、央行票据、中期票据、短期融资券(含超短期融资券)、可交换债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括定期存款、协议存款、通知存款等)、同业存单、货币市场工具、衍生工具(权证、股指期货等)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)。

本基金的投资组合比例为：股票及存托凭证投资占基金资产的比例为60%-95%，其中投资于转型升级主题相关的股票不低于非现金基金资产的80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或变更投资比例限制，基金管理人可在履行适当程序后，可以相应调整本基金的投资范围和投资比例规定。

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

(1) 本基金股票及存托凭证资产投资占基金资产的比例为 60%-95%，其中投资于转型升级主题相关的股票不低于非现金基金资产的 80%；

(2) 每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例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；

(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、且由本基金托管人托管的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；

(5) 基金管理人管理的、且由本基金托管人托管的全部开放式基金(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、且由本基金托管人托管的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；

(6) 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%；

(7) 本基金管理人管理的、且由本基金托管人托管的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

(8) 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%；

(9) 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%；

(10) 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%；

(11) 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%；

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

(13) 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；

(14) 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；

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

(16) 本基金参与股指期货交易，应当遵守下列要求：

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

2) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

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

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

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

(17) 本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

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

(19) 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；

(20) 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；

(21) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述第(2)、(13)、(18)、(19)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的投资比例的，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、投资策略应符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，本基金投资可不受上述规定限制或以变更后的规定为准，无需经基金份额持有人大会审议。

(三) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对本协议第十五条第十一项基金投资禁止行为进行监督。

根据法律法规有关基金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其他重大利害关系的公司名单及其更新，并以双方约定的方式提交，确保所提供的关联交易名单的真实性、完整性、全面性。基金管理人有责任保管真实、完整、全面的关联交易名单，并负责及时更新该名单。名单变更后基金管理人应及时发送基金托管人，基金托管人应及时确认已知名单的变更。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关联交易，并造成基金资产损失的，由基金管理人承担责任，基金托管人有权向中国证监会报告。

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其他重大利害关系的公司发行的证券或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。

（四）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供经慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手名单，并约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金托管人监督基金管理人是否按事前提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易。基金管理人可以每半年对银行间债券市场交易对手名单进行更新，如基金管理人根据市场情况需要临时调整银行间债券市场交易对手名单，应向基金托管人说明理由，在与交易对手发生交易前3个工作日内与基金托管人协商解决。基金管理人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，仍应按照协议进行结算。基金管理人负责对交易对手的资信控制，按银行间债券市场的交易规则进行交易，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，但不承担交易对手不履行合同造成的损失。如基金托管人事后发现基金管理人没有按照事先约定的交易对手或交易方式进行交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人，基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任。

（五）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人投资银行存款进行监督。

基金投资银行存款的，基金管理人应根据法律法规的规定及基金合同的约定，建立投资制度、审慎选择存款银行，做好风险控制；并按照基金托管人的要求配合基金托管人完成相关业务办理。

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

如果基金管理人未经基金托管人的审核擅自将不实的业绩表现数据印制在宣传推介材料上，则基金托管人对此不承担任何责任，并将在发现后立即报告中

国证监会。

(七) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定, 对基金投资流通受限证券进行监督。

1、基金投资流通受限证券, 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。

2、流通受限证券, 包括由《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。

3、在首次投资流通受限证券之前, 基金管理人应当制定相关投资决策流程、风险控制制度、流动性风险控制预案等规章制度。基金管理人应当根据基金流动性的需要合理安排流通受限证券的投资比例, 并在风险控制制度中明确具体比例, 避免基金出现流动性风险。上述规章制度须经基金管理人董事会批准。上述规章制度经董事会通过之后, 基金管理人应当将上述规章制度以及董事会批准上述规章制度的决议提交给基金托管人。

4. 在投资流通受限证券之前, 基金管理人应至少提前一个交易日向基金托管人提供有关流通受限证券的相关信息, 具体应当包括但不限于如下文件(如有):

拟发行数量、定价依据、监管机构的批准证明文件复印件、基金管理人与承销商签订的销售协议复印件、缴款通知书、基金拟认购的数量、价格、总成本、划款账号、划款金额、划款时间文件等。基金管理人应保证上述信息的真实、完整。

5. 基金托管人在监督基金管理人投资流通受限证券的过程中, 如认为因市场出现剧烈变化导致基金管理人的具体投资行为可能对基金财产造成较大风险, 基金托管人有权要求基金管理人对该风险的消除或防范措施进行补充和整改, 并做出书面说明。否则, 基金托管人经事先书面告知基金管理人, 有权拒绝执行其有关指令。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。

6. 基金管理人应保证基金投资的流通受限证券登记存管在本基金名下, 并保证基金托管人能够正常查询。因基金管理人原因产生的流通受限证券登记存管

问题，造成基金财产的损失或基金托管人无法安全保管基金财产的责任与损失，由基金管理人承担。

7.如果基金管理人未按照本协议的约定向基金托管人报送相关数据或者报送了虚假的数据，导致基金托管人不能履行托管人职责的，基金管理人应依法承担相应法律后果。除基金托管人未能依据基金合同及本协议履行职责外，因投资流通受限证券产生的损失，基金托管人按照本协议履行监督职责后不承担上述损失。

（八）基金托管人发现基金管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作中违反法律法规和基金合同的规定，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函，就基金托管人的疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。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，并报告中国证监会。

（九）基金管理人应义务配合和协助基金托管人依照法律法规、基金合同和本托管协议对基金业务执行核查。对基金托管人发出的书面提示，基金管理人应在规定时间内答复并改正，或就基金托管人的疑义进行解释或举证；对基金托管人按照法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

（十）基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的，基金托管人应报告中国证监会。

### 三、基金管理人应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, 核查事项包括基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户、证券账户等投资所需账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

(二) 基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、基金合同、本协议及其他有关规定时, 应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正。基金托管人收到通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金管理人发出回函, 说明违规原因及纠正期限, 并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内, 基金管理人有权随时对通知事项进行复查, 督促基金托管人改正。基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为, 包括但不限于: 提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性, 在规定时间内答复基金管理人并改正。

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

#### 四、基金财产的保管

##### (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。未经基金管理人依据合法程序作出的合法合规指令, 基金托管人不得自行运用、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、证券账户等投资所需账户。
- 4、基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户, 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、对于因为基金投资产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金账户的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金财产造成损失的，基金托管人对此不承担任何责任。

7、除依据法律法规和基金合同的规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

## （二）基金募集期间及募集资金的验资

1、基金募集期间的资金应存于基金管理人在具有托管资格的商业银行开设的基金认购专户。该账户由基金管理人开立并管理。

2、基金募集期满或基金停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，基金管理人应将属于基金财产的全部资金划入基金托管人开立的基金托管资金账户，同时在规定时间内，聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的 2 名或 2 名以上中国注册会计师签字方为有效。

3、若基金募集期限届满，未能达到基金备案的条件，由基金管理人按规定办理退款等事宜，基金托管人应提供充分协助。

## （三）基金资金账户的开立和管理

1、基金托管人应负责本基金的资金账户的开设和管理。

2、基金托管人可以本基金的名义在其营业机构开设本基金的资金账户，并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。本基金的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益、收取申购款，均需通过本基金的资金账户进行。

3、基金托管资金账户的开立和使用，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。

4、基金托管资金账户的开立和管理应符合相关法律法规的有关规定。

5、在符合法律法规规定的条件下，基金托管人可以通过基金托管人专用账

户办理基金资产的支付。

#### （四）基金证券账户的开立和管理

1、基金托管人在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司为基金开立基金托管人与基金联名的证券账户。

2、基金证券账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借或未经对方同意擅自转让基金的任何证券账户，亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

3、基金托管人以自身法人名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户，并代表所托管的基金完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级法人清算工作，基金管理人应予以积极协助。结算备付金的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

4、基金证券账户的开立和证券账户卡的保管由基金托管人负责，账户资产的管理和运用由基金管理人负责。

5、在本托管协议生效日之后，本基金被允许从事其他投资品种的投资业务，涉及相关账户的开设、使用的，按有关规定开设、使用并管理；若无相关规定，则基金托管人应当比照并遵守上述关于账户开设、使用的规定。

#### （五）债券托管专户的开设和管理

基金合同生效后，基金托管人根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司、银行间市场清算所股份有限公司的有关规定，以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司、银行间市场清算所股份有限公司开立债券托管与结算账户，并代表基金进行银行间市场债券的结算。基金管理人和基金托管人同时代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议。

#### （六）其他账户的开立和管理

1、因业务发展需要而开立的其他账户，可以根据法律法规和基金合同的规定，在基金管理人和基金托管人商议后开立。新账户按有关规则使用并管理。

2、法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

#### （七）基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的有关实物证券、银行定期存款存单等有价凭证由基金托管人

负责妥善保管，保管凭证由基金托管人持有。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。属于基金托管人实际有效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。托管人对托管人以外机构实际有效控制的证券不承担保管责任。

#### （八）与基金财产有关的重大合同的保管

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由基金管理人、基金托管人保管。除协议另有规定外，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，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。重大合同的保管期限为基金合同终止后 15 年。

### 五、基金资产净值计算和会计核算

#### （一）基金资产净值的计算及复核程序

##### 1、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的净资产值。

基金份额净值是指基金资产净值除以基金份额总数后得到的基金份额的净值。基金份额净值的计算，精确到 0.0001 元，小数点后第五位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人于每工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

##### 2、复核程序

基金管理人每工作日对基金资产进行估值后（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），将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人依据基金合同和相关法律法规的规定对外公布。

#### （二）基金资产估值方法和特殊情形的处理

##### 1、估值对象

基金所拥有的股票、存托凭证、债券、衍生工具和其它投资等资产及负债。

##### 2、估值方法

###### （1）证券交易所上市的有价证券的估值

1) 交易所上市的有价证券（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；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) 交易所上市实行净价交易的固定收益品种（基金合同另有规定的除外）按估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值，具体估值机构由基金管理人与基金托管人另行协商约定；

3) 交易所上市的可转换债券按估值日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；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去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；

4) 交易所上市的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(2) 处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

1) 送股、转增股、配股和公开增发的股票，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或未挂牌转让的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

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

(3) 全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

(4) 同一证券同时在两个或两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。

(5) 本基金投资股指期货合约，按估值当日结算价进行估值，估值当日无

结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

(6) 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。

(7) 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。

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

(9) 相关法律法规以及监管部门、自律规则另有规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

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

### 3、特殊情形的处理

基金管理人、基金托管人按估值方法的第(7)项进行估值时，所造成的误差不得作为基金份额净值错误处理。

#### (三) 基金份额净值错误的处理方式

(1) 当基金份额净值小数点后4位以内(含第4位)发生估值错误时，视为基金份额净值错误；基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；错误偏差达到基金份额净值的0.25%时，基金管理公司应当及时通知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0.50%时，基金管理人应当公告、通报基金托管人并报中国证监会备案；当发生净值计算错误时，由基金管理人负责处理，由此给基金份额持有人和基金造成损失的，应由基金管理人先行赔付，基金管理人按差错情形，有权向其他当事人追偿。

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

①本基金的基金会计责任方由基金管理人担任。与本基金有关的会计问题，

如经双方在平等基础上充分讨论后,尚不能达成一致时,按基金会计责任方的建议执行,由此给基金份额持有人和基金造成的损失,由基金管理人负责赔付。

②若基金管理人计算的基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告,而且基金托管人未对计算过程提出疑义或要求基金管理人书面说明,基金份额净值出错且造成基金份额持有人损失的,应根据法律法规的规定对基金份额持有人或基金支付赔偿金,就实际向基金份额持有人或基金支付的赔偿金额,其中基金管理人承担 50%,基金托管人承担 50%。

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

④由于基金管理人提供的信息错误(包括但不限于基金申购或赎回金额等),基金托管人在履行正常复核程序后仍不能发现该错误,进而导致基金份额净值计算错误而引起的基金份额持有人和基金财产的损失,由基金管理人负责赔付。

(3) 由于证券交易所、期货交易所、登记结算公司发送的数据错误,或由于其他不可抗力原因,基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查,但是未能发现该错误而造成的基金份额净值计算错误,基金管理人、基金托管人免除赔偿责任,但基金管理人、基金托管人应积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

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

(5) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的,从其规定处理。如果行业有通行做法,双方当事人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商。

#### (四) 暂停估值的情形

(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;

(2) 因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时;

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

(4) 法律法规、中国证监会和基金合同认定的其他情形。

(五) 基金会计制度

按国家有关部门规定的会计制度执行。

(六) 基金账册的建立

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

(七) 基金财务报表与报告的编制和复核

#### 1、财务报表的编制

基金管理人应当及时编制并对外提供真实、完整的基金财务会计报告。月度报表的编制，基金管理人应于每月终了后 5 个工作日内完成；基金合同生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在指定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。季度报告应在季度结束之日起 15 个工作日内编制完毕并将季度报告登载在指定网站上，并将季度报告提示性公告登载在指定报刊上；中期报告在会计年度半年终了后两个月内编制完毕并将中期报告登载在指定网站上，并将中期报告提示性公告登载在指定报刊上；年度报告在会计年度结束后三个月内编制完毕并将年度报告登载在指定网站上，并将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。基金合同生效不足 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。

#### 2、报表复核

基金管理人应当在月度报表完成当日，将报表盖章后提供给基金托管人复核；基金托管人在收到后应在 3 日内进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人应当在季度报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人

应在收到后 7 个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在中期报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后 30 日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在年度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人应在收到后 45 日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人和基金托管人之间的上述文件往来均以传真的方式或双方商定的其他方式进行。

基金托管人在复核过程中，发现双方的报表存在不符时，基金管理人和基金托管人应共同查明原因，进行调整，调整以双方认可的账务处理方式为准；若双方无法达成一致，以基金管理人的账务处理为准。核对无误后，基金托管人在基金管理人提供的报告上加盖托管业务专用章或者出具加盖托管业务专用章的复核意见书，双方各自留存一份。如果基金管理人与基金托管人不能于应当发布公告之日之前就相关报表达成一致，基金管理人有权按照其编制的报表对外发布公告，基金托管人有权就相关情况报中国证监会备案。

(八)基金管理人应每季向基金托管人提供基金业绩比较基准的基础数据和编制结果。

## 六、基金份额持有人名册的登记与保管

本基金的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，包括基金合同生效日、基金合同终止日、基金权益登记日、基金份额持有人大会权益登记日、每年 6 月 30 日、12 月 31 日的基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容至少应包括持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册由注册登记机构编制，由基金管理人审核并提交基金托管人保管。基金托管人有权要求基金管理人提供任意一个交易日或全部交易日的基金份额持有人名册，基金管理人应及时提供，不得拖延或拒绝提供。

基金管理人应及时向基金托管人提交基金份额持有人名册。每年 6 月 30 日和 12 月 31 日的基金份额持有人名册应于下月前十个工作日内提交；基金合同生效日、基金合同终止日等涉及到基金重要事项日期的基金份额持有人名册应于发生后十个工作日内提交。

基金管理人和基金托管人应妥善保管基金份额持有人名册，保存期限为 15

年。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、争议解决方式

因本协议产生或与之相关的争议，双方当事人应通过协商、调解解决，协商、调解不能解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，仲裁地点为北京市，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。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，双方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责，各自继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和本托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本协议适用中华人民共和国法律并从其解释。

## 八、基金托管协议的变更、终止与基金财产的清算

### （一）托管协议的变更程序

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

### （二）基金托管协议终止的情形

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

### （三）基金财产的清算

#### 1、基金财产清算小组

(1) 自出现《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内，成立基金财产清算小组，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)基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

(3)在基金财产清算过程中，基金管理人和基金托管人应各自履行职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和本托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

(4)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。

## 2、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财产；

(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)编制清算报告；

(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。

基金财产清算的期限为6个月。

## 3、清算费用

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

## 4、基金财产按下列顺序清偿：

(1)支付清算费用；

(2)交纳所欠税款；

(3)清偿基金债务；

(4)按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款(1)－(3)项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

## 5、基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计，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。

#### 6、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上，法律法规另有规定的从其规定。

## 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一系列的服务。基金管理人根据基金份额持有人的需要和市场的变化,有权增加或变更服务项目。主要服务内容如下:

### (一) 基金份额持有人登记与过户登记服务

基金管理人设立注册登记中心,配备安全、完善的电脑系统及通讯系统,准确、及时地为投资者办理基金账户的开立、变更、注销等业务;为投资者登记存管认购、申购、赎回等业务所发生的基金份额;为投资者提供基金账户和基金交易的资料查询。

### (二) 资料寄送服务

#### (1) 账户确认短信

客户提交开立开放式基金账户申请的,我司将为客户发送开放式基金账户开立申请确认结果通知短信。

#### (2) 对账单

我司将每个月向投资者寄送对账单,对账单的内容包括当月交易明细及持有人所持有基金份额、账户市值、单位净值、分红方式等。对账单的寄送方式默认为电子邮件方式。如投资者需要对账单个性化寄送或者查询交易明细,请致电基金管理人客服中心或登陆基金管理人网站。

#### (3) 其他相关的信息资料

介绍公司最新动态、投资运作、新产品、国内外金融市场动态和投资机会等。

### (三) 网络在线服务与网上交易服务

通过本基金管理人网站的留言板和客户服务信箱,投资者可以实现在线咨询、投诉、建议和寻求各种帮助。

基金管理人网站提供了基金公告、投资资讯、理财刊物、基金常识等各种信息,投资者可以根据各自的使用习惯非常方便的自行查询或信息定制。

基金管理人网站为投资者提供基金账户开户、网上交易、帐户查询、电子对帐单申请、修改密码等多种服务。

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

电子信箱: [marketing@chinanature.com.cn](mailto:marketing@chinanature.com.cn)

#### （四）信息定制服务

在技术条件成熟时，基金管理人还可为基金投资者提供通过基金管理人网站、客户服务中心提交信息定制申请，基金管理人通过手机短讯、E-MAIL 定期为客户发送所定制的信息，内容包括：每笔交易确认查询、公司最新公告等。

#### （五）客户服务中心（CALL-CENTER）电话服务

呼叫中心自动语音系统提供 7×24 小时交易情况、基金账户余额、基金产品与服务等信息查询。

呼叫中心人工座席每个交易日 8：30-11:30,1:00-17：00 为投资者提供服务，投资者可以通过该热线获得业务咨询，信息查询，服务投诉，信息定制，资料修改等专项服务。

客服电话：400-098-4800（免长途通话费用）、021-60374800

传真：021-60374934

#### （六）投诉受理

投资者可以拨打天治基金管理有限公司客户服务中心电话或以书信、电子邮件等方式，对基金管理人和销售网点所提供的服务进行投诉。

对于工作日期间受理的投诉，以“及时回复”为处理原则，对于不能及时回复的投诉，基金管理人承诺在 2 个工作日之内对投资者的投诉做出回复。对于非工作日提出的投诉，基金管理人将在顺延的工作日当日进行回复。

（七）如本招募说明书存在任何您/贵机构无法理解的内容，请通过上述方式联系基金管理人。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

自 2020 年 11 月 1 日至 2021 年 11 月 15 日期间，与本基金和本基金管理人有关的公告如下：

1、2020 年 11 月 3 日，在指定媒介上刊登了《天治基金管理有限公司关于终止大泰金石基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告》。

2、2020 年 11 月 12 日，在指定媒介上刊登了《天治基金管理有限公司关于增加珠海盈米基金销售有限公司为代销机构的公告》。

3、2020 年 11 月 19 日，在指定媒介上刊登了《天治基金管理有限公司旗下基金业务开通并参加盈米基金费率优惠活动的公告》。

4、2020 年 12 月 8 日，在指定媒介上刊登了《天治转型升级混合型证券投资基金基金经理变更公告》。

5、2020 年 12 月 10 日，在指定媒介上刊登了《天治基金管理有限公司旗下基金增加喜鹊基金为代销机构、开通定期定额投资、基金转换业务并参加费率优惠活动的公告》。

6、2020 年 12 月 10 日，在指定媒介上刊登了《天治基金管理有限公司关于旗下九只基金就参与存托凭证投资事宜修订相关法律文件的公告》。

7、2020 年 12 月 10 日，在指定媒介上刊登了《天治转型升级混合型证券投资基金基金合同》、《天治转型升级混合型证券投资基金托管协议》和《天治转型升级混合型证券投资基金更新的招募说明书（2020 年 12 月）》。

8、2020 年 12 月 15 日，在指定媒介上刊登了《天治转型升级混合型证券投资基金基金产品资料概要》。

9、2020 年 12 月 24 日，在指定媒介上刊登了《天治转型升级混合型证券投资基金更新的招募说明书》。

10、2020 年 12 月 24 日，在指定媒介上刊登了《天治转型升级混合型证券投资基金基金产品资料概要》。

11、2020 年 12 月 25 日，在指定媒介上刊登了《天治基金管理有限公司关于旗下部分基金在直销柜台渠道开展申购费率优惠活动的公告》。

12、2020 年 12 月 30 日，在指定媒介上刊登了《天治基金管理有限公司旗下开放式基金参加交通银行基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告》。

13、2021 年 1 月 4 日，在指定媒介上刊登了《天治转型升级混合型证券投资基金基金经理变更公告》。

14、2021 年 1 月 5 日，在指定媒介上刊登了《天治转型升级混合型证券投资基金更新的招募说明书》。

15、2021 年 1 月 5 日，在指定媒介上刊登了《天治转型升级混合型证券投资基金基金产品资料概要更新》。

16、2021 年 1 月 22 日，在指定媒介上刊登了《天治旗下十四只基金 2020 年第 4 季度报告汇总》。

17、2021 年 2 月 23 日，在指定媒介上刊登了《天治基金管理有限公司关于调整旗下部分基金在盈米基金最低申购金额、最低赎回、转换、持有份额的公告》。

18、2021 年 3 月 4 日，在指定媒介上刊登了《天治基金管理有限公司旗下基金增加汇成基金为代销机构、开通定期定额投资、基金转换业务并参加费率优惠活动的公告》。

19、2021 年 3 月 30 日，在指定媒介上刊登了《天治旗下十四只基金 2020 年年度报告汇总》。

20、2021 年 4 月 21 日，在指定媒介上刊登了《天治旗下十四只基金 2021 年第 1 季度报告汇总》。

21、2021 年 5 月 28 日，在指定媒介上刊登了《天治基金管理有限公司旗下开放式基金参加吉林银行基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告》。

22、2021 年 6 月 24 日，在指定媒介上刊登了《天治基金管理有限公司关于旗下开放式基金参加上海基煜基金销售有限公司费率优惠活动的公告》。

23、2021 年 6 月 24 日，在指定媒介上刊登了《天治基金管理有限公司旗下部分基金增加爱建基金为代销机构、开通基金转换业务并参加费率优惠活动的公告》。

24、2021 年 6 月 30 日，在指定媒介上刊登了《天治基金管理有限公司旗下开放式基金参加交通银行手机银行基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告》。

25、2021 年 7 月 31 日，在指定媒介上刊登了《天治基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加浦发银行基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告》。

26、2021 年 8 月 7 日，在指定媒介上刊登了《天治基金管理有限公司旗下部分基金增加华龙证券股份有限公司为代销机构的公告》。

27、2021 年 8 月 27 日，在指定媒介上刊登了《天治旗下十四只基金 2021 年中期报告汇总》。

28、2021 年 10 月 26 日，在指定媒介上刊登了《天治旗下十五只基金 2021 年第 3 季度报告汇总》

## 第二十三部分 招募说明书的存放及查阅方式

本招募说明书公布后，分别置备于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的住所，供公众查阅、复制。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与公告的内容完全一致。

## 第二十四部分 备查文件

备查文件包括：

- 1、中国证监会准予天治转型升级混合型证券投资基金募集注册的文件
- 2、《天治转型升级混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《天治转型升级混合型证券投资基金托管协议》
- 4、法律意见书
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照
- 7、中国证监会规定的其他文件

投资人可以通过基金管理人网站，查阅或下载基金合同、招募说明书、托管协议及基金的各种定期和临时公告。

天治基金管理有限公司

2021 年 12 月 10 日