

## 上投摩根领先优选混合型证券投资基金

### 招募说明书（更新）

注册文号：中国证监会证监许可[2018] 2017 号文

注册日期：[2018 年 12 月 6 日 ]

基金管理人：上投摩根基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

#### 【重要提示】

本基金于【2018】年【12】月【6】日经中国证券监督管理委员会证监许可 2018[2017]号文注册。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。

本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

投资有风险，投资人认购（或申购）基金时应当认真阅读本招募说明书。

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

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，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特定风险等。

本基金可以参与中小企业私募债券的投资。中小企业私募债发行人为中小微、非上市企业，存在着公司治理结构相对薄弱、企业经营风险高、信息披露透明度不足等特点。投资中小企业私募债将存在违约风险和流动性不足的风险，这将在一定程度上增加基金的信用风险和流动性风险。

本基金参与内地与香港股票市场交易互联互通机制下港股通相关业务，基金资产投资于

港股，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险（港股市场实行 T+0 回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对基金的投资收益造成损失）、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险（在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险）等。

本基金可以参加科创板股票的投资。基金资产投资于科创板股票，会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于流动性风险、退市风险、投资集中度风险、市场风险、系统性风险、股价波动风险、政策风险等。基金可根据投资策略需要或市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于科创板股票或选择不将基金资产投资于科创板股票，基金资产并非必然投资于科创板股票。

本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股，基金资产并非必然投资港股。

本基金可以参与存托凭证的投资，除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与中国存托凭证发行机制相关的风险。

当本基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，基金管理人履行相应程序后，可以启动侧袋机制，具体详见基金合同和本招募说明书的相关章节。侧袋机制实施期间，基金管理人将对基金简称进行特殊标识，并不办理侧袋账户的申购赎回。请基金份额持有人仔细阅读相关内容并关注本基金启用侧袋机制时的特定风险。

本基金属于混合型基金产品，预期风险和收益水平高于债券型基金和货币市场基金。

投资者在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》、基金产品资料概要及《基金合同》。

请个人投资者阅读并充分了解《上投摩根基金用户隐私政策》（[https://www.cifm.com/service/ETguide/rules/201908/t20190822\\_144519.html](https://www.cifm.com/service/ETguide/rules/201908/t20190822_144519.html)），知晓并同意上投摩根就为您开立基金账户并提供相应基金业务活动之目的及法律法规和监管规定（如反洗钱、投资者适当性管理、实名制等）的要求，根据上述隐私政策和法律法规和监管规定收集、使用、存储或以其他方式处理您的个人信息，您的个人信息包括个人基本资料、个人身份信息、个人财产信息等信息，其中包括部分敏感个人信息。如果您不同意我们处理您的相关个人信息，我们将无法为您提供基金账户以及相应的基金业务相关的服务。

对于机构投资者，如涉及提供第三方个人信息的，应当确保个人信息来源合法并且确保管理人处理其个人信息不违反该第三方的授权同意。机构投资者请提醒该第三方阅读《上投摩根基金用户隐私政策》，特别地应当根据《个人信息保护法》相关规定告知管理人将如何处理其个人信息，并获得该第三方同意。

本招募说明书所载内容截止日为 2022 年 2 月 18 日，基金投资组合及基金业绩的数据截止日为 2021 年 12 月 31 日。

二〇二二年三月

## 上投摩根领先优选混合型证券投资基金招募说明书(更新)

### 目录

一、绪言.....	1
二、释义.....	1
三、基金管理人.....	5
四、基金托管人.....	14
五、相关服务机构.....	18
六、基金的募集及基金合同的生效.....	29
七、基金份额的申购、赎回和转换.....	30
八、基金的投资.....	38
九、基金的业绩.....	51
十、基金的财产.....	51
十一、基金资产的估值.....	52
十二、基金的收益与分配.....	57
十三、基金的费用与税收.....	58
十四、基金的会计与审计.....	60
十五、基金的信息披露.....	60
十六、侧袋机制.....	66
十七、风险揭示.....	70
十八、基金合同的变更、终止与基金财产的清算.....	76
十九、基金合同的内容摘要.....	78
二十、基金托管协议的内容摘要.....	102
二十一、对基金份额持有人的服务.....	120
二十二、招募说明书的存放及查阅方式.....	121
二十三、其他应披露事项.....	121
二十四、备查文件.....	121

---

## 一、绪言

招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）和其他有关法律法规的规定，以及《上投摩根领先优选混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“合同”或“基金合同”）编写。

本招募说明书阐述了上投摩根领先优选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，投资者在做出投资决策前应仔细阅读招募说明书。

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

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金根据招募说明书所载明资料发行。

本招募说明书依据基金合同编写，并经中国证监会注册。基金合同是约定基金当事人之间权利义务的法律文件。招募说明书主要向投资者披露与本基金相关事项的信息，是投资者据以选择及决定是否投资于本基金的要约邀请文件。基金投资者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对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、基金合同及其它有关规定享有权利，承担义务。

基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

## 二、释义

在招募说明书中，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：指上投摩根领先优选混合型证券投资基金
- 2、基金管理人：指上投摩根基金管理有限公司

- 
- 3、基金托管人：指中国建设银行股份有限公司
  - 4、基金合同：指《上投摩根领先优选混合型证券投资基金基金合同》及对该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《上投摩根领先优选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：指《上投摩根领先优选混合型证券投资基金招募说明书》及其更新
  - 7、基金份额发售公告：指《上投摩根领先优选混合型证券投资基金基金份额发售公告》
  - 8、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等
  - 9、《基金法》：指 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》修改的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
  - 10、《销售办法》：指中国证监会 2020 年 8 月 28 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
  - 11、《信息披露办法》：指中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1 日实施的，并经 2020 年 3 月 20 日中国证监会《关于修改部分证券期货规章的决定》修正的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
  - 12、《运作办法》：指中国证监会 2014 年 7 月 7 日颁布、同年 8 月 8 日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
  - 13、《流动性风险管理规定》：指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订
  - 14、中国证监会：指中国证券监督管理委员会
  - 15、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行保险监督管理委员会
  - 16、基金合同当事人：指受基金合同约束，根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人
  - 17、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人
  - 18、机构投资者：指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织

---

19、合格境外机构投资者：指符合相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者

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

21、基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人

22、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

23、销售机构：指上投摩根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代理协议，代为办理基金销售业务的机构

24、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

25、登记机构：指办理登记业务的机构。基金的登记机构为上投摩根基金管理有限公司或接受上投摩根基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构

26、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

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

28、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

29、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

30、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

31、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

32、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所及相关的期货交易所的正常交易日

33、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

34、T+n日：指自T日起第n个工作日(不包含T日)

35、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(若本基金参与

---

港股通交易且该工作日为非港股通交易日时，则基金管理人可根据实际情况决定本基金是否开放申购、赎回及转换业务，具体以届时提前发布的公告为准）

36、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

37、《业务规则》：指《上投摩根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

38、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

39、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

40、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

41、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

42、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

43、定期定额投资计划：指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期申购日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及受理基金申购申请的一种投资方式

44、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%

45、元：指人民币元

46、基金收益：指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约

47、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

48、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

49、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

50、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

51、港股通：指内地投资者委托内地证券公司，经由上海证券交易所/深圳证券交易所设立的证券交易服务公司，向香港联合交易所进行申报，买卖规定范围内的香港联合交易所上市的股票

52、摆动定价机制：指当遭遇大额申购或赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待

53、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

54、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

55、基金产品资料概要：指《上投摩根领先优选混合型证券投资基金基金产品资料概要》及其更新

56、侧袋机制：指将基金投资组合中的特定资产从原有账户分离至一个专门账户进行处置清算，目的在于有效隔离并化解风险，确保投资者得到公平对待，属于流动性风险管理工具。侧袋机制实施期间，原有账户称为主袋账户，专门账户称为侧袋账户

57、特定资产：包括：（1）无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性的资产；（2）按摊余成本计量且计提资产减值准备仍导致资产价值存在重大不确定性的资产；（3）其他资产价值存在重大不确定性的资产

58、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

### 三、基金管理人

#### 一、基金管理人概况

本基金的基金管理人为上投摩根基金管理有限公司，基本信息如下：

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富城路 99 号震旦国际大楼 25 层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区富城路 99 号震旦国际大楼 25 层

法定代表人：陈兵

---

总经理：王大智

成立日期：2004 年 5 月 12 日

实缴注册资本：贰亿伍仟万元人民币

股东名称、股权结构及持股比例：

上海国际信托有限公司 51%

JPMorgan Asset Management (UK) Limited 49%

上投摩根基金管理有限公司是经中国证监会证监基字[2004]56 号文批准，于 2004 年 5 月 12 日成立的合资基金管理公司。2005 年 8 月 12 日，基金管理人完成了股东之间的股权变更事项。公司注册资本保持不变，股东及出资比例分别由上海国际信托有限公司 67%和摩根资产管理（英国）有限公司 33%变更为目前的 51%和 49%。

2006 年 6 月 6 日，基金管理人的名称由“上投摩根富林明基金管理有限公司”变更为“上投摩根基金管理有限公司”，该更名申请于 2006 年 4 月 29 日获得中国证监会的批准，并于 2006 年 6 月 2 日在国家工商总局完成所有变更相关手续。

2009 年 3 月 31 日，基金管理人的注册资本金由一亿五千万人民币增加到二亿五千万人民币，公司股东的出资比例不变。该变更事项于 2009 年 3 月 31 日在国家工商总局完成所有变更相关手续。

基金管理人无任何受处罚记录。

## 二、主要人员情况

### 1. 董事会成员基本情况：

董事长：陈兵

博士研究生，高级经济师。

曾任上海浦东发展银行大连分行资金财务部总经理，上海浦东发展银行总行资金财务部总经理助理，上海浦东发展银行总行个人银行总部管理会计部、财富管理部总经理，上海国际信托有限公司副总经理兼董事会秘书，上海国际信托有限公司党委副书记、总经理。

现任上海国际信托有限公司党委书记、总经理；上投摩根基金管理有限公司董事长。

董事：Paul Bateman

大学本科学位。

曾任 Chase Fleming Asset Management Limited 全球总监、摩根资产管理全球投资管理业务行政总裁。

---

现任摩根资产管理全球主席、资产管理营运委员会成员及投资委员会成员。

**董事：Daniel J. Watkins**

学士学位。

曾任欧洲业务副首席执行官、摩根资产欧洲业务首席运营官、全球投资管理运营总监、欧洲运营总监、欧洲注册登记业务总监、卢森堡运营总监、欧洲注册登记业务及伦敦投资运营经理、富林明投资运营团队经理等职务。

现任摩根资产管理亚洲业务首席执行官、资产管理运营委员会成员、集团亚太管理团队成员。

**董事：Richard Titherington**

牛津大学政治、哲学和经济硕士学位。

曾任摩根资产管理环球新兴市场股票投资部总监。

现任摩根资产管理董事总经理、新兴市场及亚太股票组别投资总监。

**董事：王大智**

学士学位。

曾任摩根资产管理香港及中国基金业务总监、摩根投信董事长暨摩根资产管理集团台湾区负责人。

现任上投摩根基金管理有限公司总经理。

**董事：陈海宁**

研究生学历、经济师。

曾任上海浦东发展银行金融部总经理助理、公投总部贸易融资部总经理、武汉分行副行长、武汉分行党委书记、行长、总行资产负债管理部总经理。

现任上海浦东发展银行总行信息科技部总经理。

**董事：林仪桥**

硕士研究生、会计师、经济师。

曾任浦发银行总行资金总部投资组合业务部总经理助理，浦发银行总行金融市场部总经理助理，海口分行行长助理(挂职)，浦发银行总行金融机构部总经理助理，总行金融市场部（深圳）副总经理，总行金融机构部副总经理。

现任浦发银行总行公司业务板块合规官。

**董事：周晔**

硕士学位。

---

曾任浦发银行上海分行个人信贷部副科长，办公室副科长、科长，三林支行行长助理、副行长兼康桥工业园区支行行长，零售业务管理部副总经理（主持工作）、总经理兼财富管理部总经理，零售业务部总经理。

现任上海浦东发展银行总行零售业务部总经理助理。

独立董事：刘红忠

国际金融系经济学博士。

现任复旦大学经济学院教授，复旦大学金融研究中心副主任；同时兼任申银万国期货有限责任公司、东海期货有限责任公司、兴业证券股份有限公司、交银国际信托有限公司独立董事和锦江国际集团有限公司外部董事。

独立董事：汪棣

美国加州大学洛杉矶分校金融专业工商管理硕士学位，并先后获得美国加州注册会计师执照和中国注册会计师证书。

曾担任普华永道金融服务部合伙人及普华永道中国投资管理行业主管合伙人。

现担任招商证券股份有限公司、复星联合健康保险股份有限公司、亚太财产保险有限公司及 51 信用卡有限公司独立董事、中国台湾旭昶生物科技股份有限公司监事。

独立董事：曾翀

英国特许公认会计师公会资深会员。

曾任香港赛马会集团财务总监，香港证监会产品咨询委员会委员，协康会名誉司库和执行委员会和投资小组委员会成员，戴麟趾爵士康乐基金、警察子女教育信托基金和警察教育及福利信托基金投资咨询委员会主席，香港房屋协会资金管理特设委员会成员，以及另类投资管理协会（AIMA）全球投资者指导委员会成员。

现为独立顾问，宝积资本控股有限公司独立非执行董事以及安联环球投资香港有限公司兼职顾问。

独立董事：王学杰

华东政法大学法学学士、日本帝京大学民商法专业博士前期学位。

曾在日本 Sunroute 公司海外业务室专门从事有关亚太地区市场发展和设立企业的日常法律顾问工作。

现任上海市锦天城律师事务所高级合伙人、律师。

## 2. 监事会成员基本情况：

监事会主席：叶力俭

---

管理学硕士。

曾就职于上海市黄浦区国有资产总公司、海通证券投资银行部；入职上海国际信托有限公司后历任资金信托总部、资产管理总部、信托发展总部负责人。

现任上海国际信托有限公司副总经理、上信资产管理有限公司总经理，同时兼任上海市股份公司联合会副理事长。

监事：梁斌

学士学位。

曾在高伟绅律师事务所（香港）任职律师多年。

现任摩根大通集团中国法律总监。

监事：张军

曾任上投摩根基金管理有限公司交易部总监、基金经理、投资组合管理部总监、投资绩效评估总监、国际投资部总监、组合基金投资部总监。

现任上投摩根基金管理有限公司投资董事兼高级基金经理。

监事：万隽宸

曾任上海国际集团有限公司高级法务经理，上投摩根基金管理有限公司首席风险官，尚腾资本管理有限公司董事。

现任尚腾资本管理有限公司总经理。

### 3. 总经理基本情况：

王大智先生，总经理

学士学位。

曾任摩根资产管理香港及中国基金业务总监、摩根投信董事长暨摩根资产管理集团台湾地区负责人。

### 4. 其他高级管理人员情况：

杜猛先生，副总经理

毕业于南京大学，获经济学硕士学位。

历任天同证券、中原证券、国信证券、中银国际研究员；上投摩根基金管理有限公司行业专家、基金经理助理、基金经理、总经理助理/国内权益投资一部总监兼资深基金经理。

孙芳女士，副总经理

毕业于华东师范大学，获世界经济硕士学位。

历任华宝兴业基金研究员；上投摩根基金管理有限公司行业专家、基金经理助理、研究

---

部副总监、基金经理、总经理助理/国内权益投资二部总监兼资深基金经理。

郭鹏先生，副总经理

毕业于上海财经大学，获企业管理硕士学位。

历任上投摩根基金管理有限公司市场经理、市场部副总监，产品及客户营销部总监、市场部总监兼互联网金融部总监、总经理助理。

刘鲁旦先生，副总经理

博士研究生。

历任华夏基金管理有限公司固定收益总监、中国国际金融股份有限公司资产管理部固定收益总监/董事总经理。

邹树波先生，督察长

获管理学学士学位。

曾任天健会计师事务所高级项目经理，上海证监局主任科员，上投摩根基金管理有限公司监察稽核部副总监、监察稽核部总监。

卢蓉女士，首席信息官

硕士研究生。

曾任第一创业摩根大通证券有限责任公司（现更名为第一创业证券承销保荐有限责任公司）信息技术部负责人、嘉实基金管理有限公司投研体系首席信息官。

#### 5. 本基金基金经理

基金经理王丽军女士，硕士研究生，2000年7月至2003年9月在深圳永泰软件公司任项目实施专员；2006年2月至2007年1月在大公国际资信评估公司任行业评级部经理；2007年1月至2007年9月在东吴基金管理公司任行业研究员；2007年9月至2009年5月在申万巴黎基金管理公司任行业研究员；2009年10月起加入上投摩根基金管理有限公司，任我公司基金经理助理/行业专家、基金经理，自2016年11月起担任上投摩根中国世纪灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自2019年3月起同时担任上投摩根领先优选混合型证券投资基金基金经理，自2021年6月起同时担任上投摩根香港精选港股通混合型证券投资基金基金经理。

#### 6. 基金管理人投资决策委员会成员的姓名和职务

杜猛，副总经理兼投资总监；孙芳，副总经理兼投资副总监；朱晓龙，研究部总监兼基金经理；张军，投资董事兼高级基金经理。

上述人员之间不存在近亲属关系。

---

### 三、基金管理人的职责

- 1、 依法募集资金，办理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、 对所管理的不同基金资产分别管理、分别记账，进行证券投资；
- 4、 按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；
- 5、 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- 6、 编制中期和年度基金报告；
- 7、 计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回价格；
- 8、 办理与基金资产管理业务活动有关的信息披露事项；
- 9、 召集基金份额持有人大会；
- 10、 保存基金资产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- 11、 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- 12、 法律法规和中国证监会规定的或《基金合同》约定的其他职责。

### 四、基金管理人承诺

- 1、 基金管理人将根据基金合同的规定，按照招募说明书列明的投资目标、策略及限制全权处理本基金的投资。
- 2、 基金管理人不得从事违反《中华人民共和国证券法》（以下简称：《证券法》）及其他有关法律法规的行为，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反《证券法》及其他有关法律法规行为的发生。
- 3、 基金管理人不得从事下列违反《基金法》的行为，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止法律法规规定的禁止行为的发生：
  - （1） 违反基金份额持有人的利益，将基金资产用于向第三人抵押、担保、资金拆借或者贷款，按照国家有关规定进行融资担保的除外；
  - （2） 从事有可能使基金承担无限责任的投资；
  - （3） 从事证券承销行为；
  - （4） 违反证券交易业务规则，操纵和扰乱市场价格；
  - （5） 违反法律法规而损害基金份额持有人利益的；

---

(6) 法律、法规及监管机关规定禁止从事的其它行为。

4、基金管理人将加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下行为：

- (1) 越权或违规经营；
- (2) 违反基金合同或基金托管协议；
- (3) 故意损害基金份额持有人或其它基金相关机构的合法利益；
- (4) 在向中国证监会报送的材料中弄虚作假；
- (5) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
- (6) 玩忽职守、滥用职权；
- (7) 泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；
- (8) 违反证券交易场所业务规则，扰乱市场秩序；
- (9) 在公开信息披露中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
- (10) 其它法律法规以及中国证监会禁止的行为。

5、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、受雇人或任何其它第三人谋取不当利益；
- (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；
- (4) 不以任何形式为其它组织或个人进行证券交易。

五、内部控制制度

1、内部控制的原则：

基金管理人内部控制遵循以下原则：

- (1) 健全性原则。内部控制应当包括基金管理人的各项业务、各个部门或机构和各级人员，并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个环节。
- (2) 有效性原则。通过科学的内控手段和方法，建立合理的内控程序，维护内控制度的有效执行。



---

(3) 独立性原则。基金管理人各机构、部门和岗位职责应当保持相对独立，基金管理人基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离。

(4) 相互制约原则。基金管理人内部部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡。

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

## 2、制订内部控制制度应当遵循以下原则：

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

(2) 全面性原则。内部控制制度应当涵盖基金管理人经营管理的各个环节，不得留有制度上的空白或漏洞。

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

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

## 3、基金管理人关于内部合规控制声明书：

(1) 基金管理人承诺以上关于内部控制的披露真实、准确；

(2) 基金管理人承诺根据市场的变化和基金管理人的发展不断完善内部合规控制。

## 4、风险管理体系：

(1) 董事会下设风险控制委员会，主要负责基金管理人风险管理战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。

(2) 董事会下设督察长，直接向董事会负责，对本公司及其工作人员的经营管理和执业行为的合规性进行审查、监督和检查。

(3) 经营管理层下设风险评估联席会议，协助管理层加强公司风险管理体系建设，推进风险管理文化的形成，在经营管理层授权范围内，定期审议公司各项风险管理重大事项对重大风险事项进行跨部门讨论、评估和决策，研究和部署重大风险的防范措施。

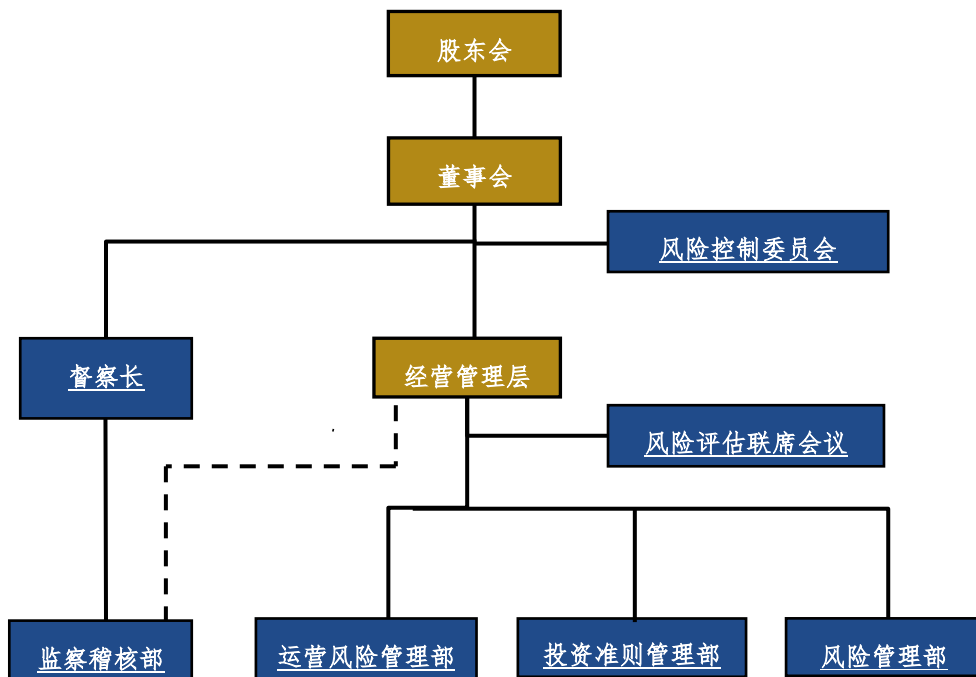
(4) 监察稽核部独立于公司各业务部门，对公司的合规运营承担独立审查、监控、检查和报告职责，对督察长负责。监察稽核部门对在监察稽核过程中发现的问题及时提出改进意见。

(5) 风险管理部负责公司投资风险、流动性风险、交易对手风险政策制定及框架管理工作，建立并完善公司投资风险、流动性风险、交易对手风险管理框架、明确以上风险识别、监测、评估和报告的工作要求。

(6) 运营风险管理部负责协助各业务部门执行内控要求，保障运营安全，根据法规、公司制度流程和相关业务特性，厘清各业务条线的风险点，评估其潜在影响，并结合公司内部控制体系的有效性和完整性进行梳理，找出弱点和问题，与业务部门确定改进方案并进行持续监控。

(7) 投资准则管理部负责执行和管控投资准则，通过设立投资准则、事前管控、事后管控，保障基金投资运作符合法规、合同及公司内部要求。

上投摩根基金管理有限公司风险管理架构图



#### 四、基金托管人

##### 一、基金托管人情况

###### (一) 基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：田国立

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

---

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12号

联系人：李申

联系电话：(021) 6063 7102

## （二）主要人员情况

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、全球托管处、养老金托管处、新兴业务处、运营管理处、跨境托管运营处、社保及大客户服务处、托管应用系统支持处、合规监督处等12个职能处室，在安徽合肥设有托管运营中心，在上海设有托管运营中心上海分中心，共有员工300余人。

## （三）基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、(R)QFII、(R)QDII、企业年金、职业年金、存托业务等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2021年三季度末，中国建设银行已托管1120只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。截至目前，中国建设银行先后多次被《全球托管人》、《财资》、《环球金融》杂志及《中国基金报》评选为“最佳托管银行”、连续多年荣获中央国债登记结算有限责任公司（中债）“优秀资产托管机构”、银行间市场清算所股份有限公司（上清所）“优秀托管银行”奖项、并在2017、2019、2020、2021年分别荣获《亚洲银行家》颁发的“最佳托管系统实施奖”、“中国年度托管业务科技实施奖”、“中国年度托管银行（大型银行）”以及“中国最佳数字化资产托管银行”奖项。

## 二、基金托管人的内部控制制度

### （一）内部控制目标

中国建设银行托管业务确保贯彻落实国家有关法律法规及监管规定，勤勉尽责，恪尽职守，保证托管资产的安全、完整，保障所托管基金的稳健运行，维护基金份额持有人利益；规范业务操作，严格按规程进行业务处理和操作，有效管控托管业务风险；确保所披露信息的完整、及时，保证客户信息不泄漏。

---

## （二）内部控制组织结构

中国建设银行设有风险管理与内控管理委员会，负责全行风险管理与内部控制的研究、议事和协调工作。内部控制管理部门是牵头内部控制管理的职能部门，牵头内部控制体系的统筹规划、组织落实和检查评价。资产托管业务部设置专门负责内部控制工作的处室，配备了专职内控合规人员负责托管业务的内控合规工作。

## （三）内部控制原则

中国建设银行托管业务内部控制遵循全面性、重要性、制衡性、适应性和独立性原则。

1. 全面性原则。内部控制贯穿和渗透于托管业务各项流程和各个环节，覆盖所有的机构、岗位，约束所有托管业务人员。

2. 重要性原则。内部控制在全面控制的基础上，关注重要的托管业务事项和高风险托管业务领域。

3. 制衡性原则。内部控制坚持风险为本、审慎经营的理念，设立托管机构和开办托管业务均坚持内控优先，在组织机构、权责分配、业务流程等方面形成相互制约、相互监督的机制。

4. 适应性原则。内部控制与托管业务管理模式、业务规模、产品复杂程度、风险状况等相匹配，并根据情况变化及时调整。

5. 独立性原则。保证客户资产与建设银行自有资产、托管的其他资产相互独立，对不同客户的资产分别设置账户、独立核算、分账管理。

## （四）内部控制措施

1. 托管资产保管控制。严格按照法律法规和合同约定履行托管人安全保管可控制账户内托管资产的职责，所托管资产与托管人自有资产、托管的其他资产严格分开，保证托管资产的安全、独立和完整。

2. 授权控制。托管业务纳入全行统一的授权管理体系，严格在授权范围内执行，严禁超范围经营。明确业务处理岗位权限，各级人员在授权范围内行使职权和承担责任。明确不相容岗位，实施相应的分离措施，形成各司其职、各负其责、相互制约的工作机制。

3. 规章制度控制。制定系统化、规范化的托管业务管理制度，并定期重检与修订，持续维持托管业务规章制度的适应性和有效性，严格保障托管业务规范运营。

4. 流程控制。严格指令接收、清算、核算、监督的流程化管理，控制关键风险点。

5. 信息系统控制。持续加强内控手段的新技术运用，提高内控自动化水平和有效性。

6. 业务连续性控制。建立托管业务应急响应及恢复机制，实现对运营中断事件的快速响

---

应和及时处置。组织开展应急演练，保障托管业务持续运营。

7. 运营环境控制。托管业务工作环境符合监管和控制要求，运营环境独立，录音、录像及门禁持续有效。系统实现独立与隔离，建立安全的数据传输通道和数据备份机制，保障数据传输和存储安全。

8. 员工行为管理控制。明确员工行为守则，规范员工日常行为，加强职业道德和员工操守教育，培育忠于所托、勤勉尽责的合规文化。

自 2007 年起，资产托管业务部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，均获无保留意见，并已经成为常规化的内控工作手段。

### 三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

#### （一）监督方法

依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金托管业务管理办法》及其配套法规和基金合同、托管协议的约定，监督所托管基金的投资运作，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

#### （二）监督流程

基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律法规及基金托管协议的规定，应当拒绝执行，及时提示基金管理人，并依照法律法规的规定及时向中国证监会报告。基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律法规、基金托管协议规定的，应当及时提示基金管理人规定期限内改正，并依照法律法规的规定及时向中国证监会报告。

每个工作日对基金投资运作比例等情况进行监督，如发现异常情况，向基金管理人进行风险提示，与基金管理人进行情况核实，督促其改正，并依照法律法规的规定及时向中国证监会报告。

基金管理人义务配合和协助基金托管人的监督和核查，对基金托管人发出的提示，应在规定时间内答复并改正；对基金托管人的合理疑义，应及时解释或举证；对基金托管人按照法律法规和托管协议的要求需向中国证监会报告的事项，应积极配合提供相关数据资料和制度等。

---

## 五、相关服务机构

### 一、基金销售机构：

1. 直销机构：上投摩根基金管理有限公司（同上）

### 2. 代销机构：

1 中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：田国立

客户服务电话：95533

网址：[www.ccb.com](http://www.ccb.com)

2 招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：缪建民

客户服务电话：95555

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

3 交通银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：任德奇

客户服务电话：95559

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

4 上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区浦东南路 500 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：郑杨

客户服务电话：95528

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

5 平安银行股份有限公司

---

注册地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号

办公地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号

法定代表人：谢永林

客户服务电话：95511 转 3

网址：www.bank.pingan.com

#### 6 申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人：杨玉成

客户服务电话：95523 或 400-889-5523

网址：www.swhysc.com

#### 7 申万宏源西部证券有限公司

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

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

法定代表人：王献军

客户服务电话：400-800-0562

网址：www.hysec.com

#### 8 上海证券有限责任公司

注册地址：上海市黄浦区四川中路 213 号久事商务大厦 7 楼

办公地址：上海市黄浦区四川中路 213 号久事商务大厦 7 楼

法定代表人：何伟

客户服务电话：021-962518

网址：www.shzq.com

#### 9 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

客户服务电话：95521 或 400-8888-666

网址：www.gtja.com

#### 10 光大证券股份有限公司

---

注册地址：上海市静安区新闸路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闸路 1508 号

法定代表人：刘秋明

客户服务电话：95525

网址：www.ebscn.com

11 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：北京市丰台区西营街 8 号院 1 号楼青海金融大厦

法定代表人：陈共炎

客户服务电话：4008-888-888 或 95551

网址：www.chinastock.com.cn

12 中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京东城区朝内大街 2 号 凯恒中心 B 座 10 层

法定代表人：王常青

客户服务电话：400-8888-108

网址：www.csc108.com

13 海通证券股份有限公司

注册地址：上海市广东路 689 号海通证券大厦

法定代表人：周杰

客户服务电话：95553 或 4008888001

网址：www.htsec.com

14 国都证券股份有限公司

注册地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

办公地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

法定代表人：翁振杰

客户服务电话：4008188118

网址：www.guodu.com

15 国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层



---

法定代表人:张纳沙

客户服务电话:95536

网址:www.guosen.com.cn

16 华泰证券股份有限公司

注册地址:江苏省南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场

法定代表人:张伟

客户服务电话:95597

网址:www.htsc.com.cn

17 中信证券股份有限公司

注册地址:广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场(二期)北座

办公地址:北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人:张佑君

客户服务电话:95548

网址:www.citics.com

18 中信证券(山东)有限责任公司

注册地址:山东省青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001

办公地址:青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座

法定代表人:冯恩新

客户服务电话:95548

网址:www.sd.citics.com

19 安信证券股份有限公司

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

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

法定代表人:黄炎勋

客户服务电话:95517

网址:www.essence.com.cn

20 长江证券股份有限公司

注册地址:武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

办公地址:武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人:李新华

---

客户服务电话：95579 或 4008-888-999

网址：www.95579.com

21 平安证券股份有限公司

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

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

法定代表人：何之江

客户服务电话：95511 转 8

网址：www.stock.pingan.com

22 诺亚正行基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

办公地址：上海市杨浦区长阳路 1687 号 2 号楼

法定代表人：汪静波

客户服务电话：400-821-5399

网址：www.noah-fund.com

23 上海长量基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

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

法定代表人：张跃伟

客户服务电话：400-820-2899

网址：www.erichfund.com

24 北京展恒基金销售股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安苑路 11 号西楼 6 层 604、607

办公地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号盘古大观 3205

法定代表人：闫振杰

客户服务电话：400-818-8000

网址：www.myfund.com

25 上海华夏财富投资管理有限公司

住所：上海市虹口区东大名路 687 号 1 幢 2 楼 268 室

办公地址：北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

法定代表人：毛淮平

---

客户服务电话：400-817-5666

26 上海万得基金销售有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

办公地址：上海市浦东新区浦明路 1500 号万得大厦 11 楼

法定代表人：黄祎

客户服务电话：400-799-1888

网址：www.520fund.com.cn

27 上海基煜基金销售有限公司

办公地址：上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 1503 室

法定代表人：王翔

客户服务电话：400-820-5369

网址：www.jiyufund.com.cn

28 嘉实财富管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心办公楼二期 27 层 2716 单元

办公地址：北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 11 层

法定代表人：张峰

电话：010-65215588

传真：010-85097308

联系人：李雯

客户服务电话：400-021-8850

网址：www.harvestwm.cn

29 国金证券股份有限公司

注册地址：成都市青羊区东城根上街 95 号

办公地址：成都市青羊区东城根上街 95 号

法定代表人：冉云

客户服务电话：95310

网址：www.gjzq.com.cn

30 中信期货有限公司

注册地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层

---

1301-1305 室、14 层

办公地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层

1301-1305 室、14 层

法定代表人：张皓

客户服务电话：400-990-8826

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

31 中国人寿保险股份有限公司

办公地址：中国北京市西城区金融大街 16 号

法定代表人：王滨

客户服务电话：95519

网址：[www.e-chinalife.com](http://www.e-chinalife.com)

32 中信证券华南股份有限公司

注册地址：广州市天河区珠江西路 5 号 501 房

办公地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 5 层

法定代表人：胡伏云

客户服务电话：95396

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

33 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室

办公地址：上海浦东新区张扬路 500 号华润时代广场 10F

法定代表人：杨文斌

客户服务电话：400-700-9665

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

34 深圳众禄基金销售股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

办公地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

法定代表人：薛峰

客户服务电话：4006-788-887

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

35 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

---

注册地址：浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路 969 号 3 幢 5 层 599 室

办公地址：杭州市西湖区万塘路 18 号黄龙时代广场 B 座 6 楼

法定代表人：祖国明

客户服务电话：95188-8

网址：www.fund123.cn

36 上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号东方财富大厦

法定代表人：其实

客户服务电话：400-1818-188

网址：www.1234567.com.cn

37 浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903

办公地址：浙江省杭州市翠柏路 7 号杭州电子商务产业园 2 楼

法定代表人：吴强

客户服务电话：952555

网址：www.5ifund.com

38 上海陆金所基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

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：胡学勤

客户服务电话：400-821-9031

网址：www.lufunds.com

39 北京虹点基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区东三环北路 17 号 10 层 1015 室

办公地址：北京市朝阳区东三环北路 17 号 10 层 1015 室

法定代表人：何静

客户服务电话：400-618-0707

网址：www.hongdianfund.com

40 珠海盈米财富管理有限公司

---

注册地址：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 12 楼

法定代表人：肖雯

客户服务电话：020-89629066

网址：www.yingmi.cn

41 北京新浪仓石基金销售有限公司

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

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

法定代表人：穆飞虎

客户服务电话：010-62675369

网址：fund.sina.com.cn/fund/web/index

42 北京肯特瑞基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区西三旗建材城中路 12 号 17 号平房 157

办公地址：北京市通州亦庄经济开发区科创十一街 18 号院京东集团总部 A 座 15 层

法定代表人：王苏宁

客户服务电话：95118

网址：kenterui.jd.com

43 中证金牛（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市丰台区东管头 1 号 2 号楼 2-45 室

办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲 1 号环球财讯中心 A 座 5 层

法定代表人：钱昊旻

客户服务电话：4008-909-998

网址：www.jnlc.com

44 奕丰基金销售有限公司

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

办公地址：深圳市南山区海德三道航天科技广场 A 座 17 楼 1704 室

法定代表人：TEO WEE HOWE

---

客户服务电话：400-684-0500

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

45 腾安基金销售（深圳）有限公司

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

办公地址：深圳市南山区海天二路33号腾讯滨海大厦15层

法定代表人：刘明军

客户服务电话：4000-890-555

网址：[www.tenganxinxi.com](http://www.tenganxinxi.com) /[www.txfund.com](http://www.txfund.com)

46 北京度小满基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区西北旺东路10号院西区4号楼1层103室

办公地址：北京市海淀区西北旺东路10号院西区4号楼

法定代表人：葛新

客户服务电话：95055-4

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

47 上海联泰基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路277号3层310室

办公地址：上海市长宁区福泉北路518号8座3层

法定代表人：尹彬彬

客户服务电话：400-118-1188

网址：<http://www.66liantai.com/>

48 上海利得基金销售有限公司

注册地址：上海市宝山区月浦镇塘南街57号6幢221室

办公地址：上海市虹口区东大名路1098号浦江国际金融广场53层

法定代表人：李兴春

客户服务电话：400-032-5885

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

49 宜信普泽（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区光华路7号20层20A1、20A2单元

办公地址：北京市朝阳区光华路7号20层20A1、20A2单元

---

法定代表人：才殿阳

客户服务电话：400-6099-200

网址：www.yixinfund.com

50 东方财富证券股份有限公司

注册地址：西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城 10 栋楼

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号金座东方财富大厦

法定代表人：戴彦

客户服务电话：95357

网址：www.18.cn

51 北京中植基金销售有限公司

注册地址：北京市北京经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室

办公地址：北京市朝阳区东三环北路甲 19 号 SOHO 嘉盛中心 30 层

法定代表人：武建华

客户服务电话：400-8980-618

网址：www.chtfund.com

52 大连网金基金销售有限公司

注册地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号诺德大厦 2 层 202 室

办公地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号诺德大厦 2 层 202 室

客户服务电话：4000-899-100

网址：www.yibaijin.com

53 北京创金启富基金销售有限公司

注册地址：北京市西城区白纸坊东街 2 号院 6 号楼 712 室

办公地址：北京市西城区白纸坊东街 2 号院 6 号楼 712 室

客户服务电话：010-66154828

网址：www.5irich.com

54 华瑞保险销售有限公司

注册地址：上海市嘉定区南翔镇众仁路 399 号运通星财富广场 1 号楼 B 座 13、14 层

办公地址：上海市浦东区向城路 288 号 8 楼

客服电话：952303

网站：www.huaruisales.com



---

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其它符合要求的机构代理销售本基金，并在基金管理人网站公示。

二、基金登记机构：

上投摩根基金管理有限公司（同上）

三、律师事务所与经办律师：

名称：上海源泰律师事务所

注册地址：上海市浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼

负责人：廖海

联系电话：021-5115 0298

传真：021-5115 0398

经办律师：刘佳、姜亚萍

四、审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 507 单元 01 室

办公地址：中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼

执行事务合伙人：李丹

电话：(021) 23238888

传真：(021) 23238800

联系人：金诗涛

经办注册会计师：陈熹、金诗涛

## 六、基金的募集及基金合同的生效

本基金根据中国证监会证监许可[2018]2017 号文《关于准予上投摩根领先优选混合型证券投资基金注册的批复》，自 2019 年 2 月 18 日起向全社会公开募集，并于 2019 年 3 月 15 日募集工作顺利结束。

经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）验资，本次募集的有效净认购金额为 900,548,144.88 元人民币，折合基金份额 900,548,144.88 份；认购款项在基金验资确认日之前产生的银行利息共计 281,484.87 元人民币，折合基金份额 281,484.87 份。

经中国证监会备案，本基金的基金合同于 2019 年 3 月 20 日生效。本基金为契约型开放

---

式混合型基金，存续期限为不定期。

## 七、基金份额的申购、赎回和转换

### 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。具体的销售机构将见本招募说明书或其他相关公告。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并在基金管理人网站公示。基金投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。

### 二、申购和赎回的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

投资人在开放日（若本基金参与港股通交易且该工作日为非港股通交易日时，则基金管理人可根据实际情况决定本基金是否开放申购、赎回及转换业务，具体以届时提前发布的公告为准）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、深圳证券交易所以及相关期货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，必须全额交付申购款项。投资人交付申购款项，申购成立；登  
记机构确认基金份额时，申购生效。

基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；登记机构确认赎回时，赎回生效。投资人赎  
回申请成功后，基金管理人将在 T+7 日(包括该日)内支付赎回款项。遇证券交易所或交易  
市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其它非基金管理人及基金托管  
人所能控制的因素影响业务处理流程时，赎回款项顺延至前述因素消失日的下一个工作日划  
出。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。

##### 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，则申购款项本金退还给投资人。基金管理人可  
以在法律法规允许的范围内，对上述业务办理时间进行调整，并提前公告。

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

#### 五、申购和赎回的金额

1. 首次申购的单笔最低金额为 1 元人民币(含申购费,下同)、追加申购的单笔最低金额为 1 元人民币。基金投资者将当期分配的基金收益转购基金份额时,不受最低申购金额的限制。

基金投资者可多次申购,法律法规、中国证监会另有规定的除外。

2. 基金投资者可将其全部或部分基金份额赎回。本基金按照份额进行赎回,申请赎回份额精确到小数点后两位,每次赎回份额不得低于 1 份,基金账户余额不得低于 1 份,如进行一次赎回后基金账户中基金份额余额将低于 1 份,应一次性赎回。如因分红再投资、非交易过户、转托管、巨额赎回、基金转换等原因导致的账户余额少于 1 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。具体规定请参见更新的招募说明书或相关公告。

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。

## 六、申购和赎回的价格、费用及其用途

### 1、基金申购份额的计算

申购费用 = (申购金额×申购费率) / (1+申购费率), 或申购费用=固定申购费金额

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

申购费率如下表所示:

申购金额区间	费率
人民币 100 万以下	1.5%
人民币 100 万以上(含), 500 万以下	1.0%
人民币 500 万以上(含)	每笔人民币 1,000 元

### 2、基金赎回金额的计算

本基金的赎回金额为赎回总额扣减赎回费用。其中，

赎回总额=赎回份数×T日基金份额净值

赎回费用=赎回总额×赎回费率

赎回金额=赎回总额-赎回费用

赎回费率如下表所示：

持有期限	费率
7日以内	1.5%
7日以上(含), 30日以内	0.75%
30日以上(含), 一年以内	0.50%
一年以上(含), 两年以内	0.35%
两年以上(含), 三年以内	0.2%
三年以上(含)	0%

3、本基金份额净值的计算，保留到小数点后4位，小数点后第5位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T日的基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

4、申购份额的计算及余额的处理方式：申购的有效份额为净申购金额除以当日的基金份额净值，有效份额单位为份，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。

5、赎回金额的计算及处理方式：赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后2位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

6、申购费用由投资人承担，不列入基金财产。

7、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。对持续持有期少于30日的基金份额持有人收取的赎回费全额计入基金财产；对持续持有期不少于30日但少于3个月的基金份额持有人收取的赎回费，将赎回费总额的75%计入基金财产；对持续持有期不少于3个月但少于6个月的基金份额持有人收取的赎回费，将赎回费总额的50%计入基金财产；对持续持有期不少于6个月的基金份额持有人收取的赎回费，将赎回费总额的25%计入基金财产；其余用于支付登记费和其他必要的手续费。

---

8、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。

9、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，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的销售费率。

10、为了促进基金管理人的从业人员与投资人利益一致，基金管理人鼓励其从业人员申购本基金，并视情况给予一定申购费优惠。

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

#### 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；
- 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、基金管理人接受某笔或某些申购申请损害现有基金份额持有人利益时；
- 5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或发生其他损害现有基金份额持有人利益的情形；
- 6、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过 50%，或者变相规避 50%集中度的情形时；
- 7、当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上的，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施；
- 8、基金管理人接受某些投资人的申购申请会因该等投资人违反其所适用的法律、法规或规则等，从而可能损害本基金或基金份额持有人利益的情形；
- 9、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第 1、2、3、5、7、9 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停基金投资者的申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项本金将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

#### 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投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

- 
- 1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项；
  - 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时；
  - 3、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、接受某笔或某些赎回申请损害现有基金份额持有人利益时；
  - 6、当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上的，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施；
  - 7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停接受基金投资者的赎回申请时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付，并以后续开放日的基金份额净值为依据计算赎回金额。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准计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

(3) 若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额的 20%，基金管理人有权先行对该单个基金份额持有人超出 20% 以上的部分赎回申请实施延期办理，基金管理人只接受其基金总份额 20% 部分作为当日有效赎回申请，而对该单个基金份额持有人 20% 以内（含 20%）的赎回申请与当日其他投资者的赎回申请按前述“(1) 全额赎回”或“(2) 部分延期赎回”条款处理，对单个基金份额持有人超过基金总份额 20% 以上的赎回申请延期赎回。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准计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。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。

(4) 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

当发生上述延期赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个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、基金管理人可以根据暂停申购或赎回的时间，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，或者按照相关法律法规或国家有权机关要求的方式进行处理的行为。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扣款金额，每期扣款金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。

## 十五、基金份额的冻结、解冻与质押

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。基金账户或基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益一并冻结，被冻结部分份额仍然参与收益分配与支付，法律法规另有规定的除外。

如相关法律法规允许基金管理人办理基金份额的质押业务或其他基金业务，基金管理人将制定和实施相应的业务规则。

十六、在不违反相关法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人可根据具体情况对上述申购和赎回以及相关业务的安排进行补充和调整并提前公告，无需召开基金份额持有人大会审议。

## 十七、实施侧袋机制期间本基金的申购与赎回

本基金实施侧袋机制的，本基金的申购和赎回安排详见本招募说明书“侧袋机制”章节或届时发布的相关公告。

---

## 八、基金的投资

### 一、投资目标

本基金采用定量及定性研究方法,自上而下进行资产配置并优选在中国境内及香港市场上市的公司,通过严格的风险控制,力争实现基金资产的长期增值。

### 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(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(以下简称“港股通标的股票”)、存托凭证、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、短期融资券、超短期融资券、中小企业私募债、证券公司短期公司债)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、权证、股指期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(须符合中国证监会相关规定)。

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

基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的50%-95%,其中投资于港股通标的股票不超过股票资产的50%。权证投资占基金资产净值的0-3%;每个交易日日终在扣除股指期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后,保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

### 三、投资策略

本基金的投资区域主要覆盖中国内地和香港市场,通过自上而下的区域配置和行业配置以及自下而上的个股选择挖掘投资机会。本基金主要投资于“领先”及“优选”类上市公司。具体而言,本基金将根据宏观环境、产业政策、行业景气度等优选成长空间较大且具有领先优势的行业,并通过自下而上的方式挖掘具有清晰商业模式、基本面良好、且具有持续竞争能力的优质公司。本基金还将考虑组合品种的估值风险和大类资产的系统风险,通过品种和仓位的动态调整降低资产波动的风险。

#### 1、跨市场资产配置策略

---

本基金综合考虑境内及香港市场的宏观经济环境、增长和通胀背景、跨市场的估值水平和流动性因素、相关公司所处的发展阶段、盈利前景和竞争环境以及其他影响投资组合回报及风险的重要要素将基金资产在中国境内及香港市场之间进行配置。另外，本基金将根据各类证券的风险收益特征的相对变化，适度的调整确定基金资产在股票、债券及现金等类别资产间的分配比例，动态优化投资组合。

## 2、股票投资策略

### (1) 中国境内市场投资策略

本基金将专注投资于影响国民经济的龙头行业、经济转型和产业升级过程中的重点行业和具备成长潜力的新兴行业。本基金将对精选行业的发展进行密切跟踪，充分把握经济发展和转型过程中的投资机会，发掘优质上市公司，分享企业成长及变革带来的资本增值。

#### 1) 行业配置

本基金通过对宏观经济运行趋势、产业环境、产业政策和行业竞争格局等多因素的分析 and 预测，确定宏观及行业经济变量的变动对不同行业的潜在影响，得出各行业的相对投资价值与投资时机。本基金将动态跟踪行业景气度和估值水平，确定或调整行业配置比例，构建组合。

具体操作中，本基金从经济周期因素评估、行业政策因素评估和行业基本面指标评估(包括行业生命周期、行业发展趋势和发展空间、行业内竞争态势、行业收入及利润增长情况等)三个方面评估各行业。本基金重点关注的行业包括：影响国民经济的龙头行业、经济转型和产业升级过程中的重点行业和具备成长潜力的新兴行业。

#### 2) 个股选择

本基金采取自下而上的个股精选策略，通过对企业基本面的分析和研究，挖掘具有较强竞争力和持续成长能力的上市公司，主要评估因素包括：

**定性分析：**主要从公司所在行业的发展特点及公司的行业地位、公司的核心竞争力、公司的经营能力和治理结构等方面进行分析。

**定量分析：**主要从公司的盈利能力、增长能力、偿债能力、营运能力以及估值水平等方面进行分析。

### (2) 港股投资策略

本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场。对于港股投资，本基金将结合宏观基本面，包含资金流向等对香港上市公司进行初步判断，并结合产业趋势以及公司发展前景自下而上进行布局，从公司商业模式、产品创新及竞争力、主营业务

---

收入来源和区域分布等多维度进行考量，挖掘优质企业。

本基金将自上而下地甄选行业，通过对行业政策、景气度、估值吸引力比较、市场预期、行业动量指标等标准确定行业配置方案，并通过自下而上方法分析个股，结合各项定量和定性指标挑选出最具上涨潜力的标的。

### 3、固定收益类投资策略

对于固定收益类资产的选择，本基金将以价值分析为主线，在综合研究的基础上实施积极主动的组合管理，自上而下进行组合构建，自下而上进行个券选择。

在组合构建上，结合对宏观经济、市场利率、债券供求等因素的综合分析，根据交易所市场与银行间市场类属资产的风险收益特征，对收益率曲线进行预测，对投资组合进行久期管理和信用管理，并定期对类属资产进行优化配置和调整，确定类属资产的最优权重。

在个券选择上，本基金以中长期利率趋势分析为基础，结合经济趋势、货币政策及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素，对目标个券进行内部评级，重点选择那些流动性较好、风险水平合理、到期收益率与信用质量相对较高的债券品种。具体策略有：

(1) 利率预期策略：本基金首先根据对国内外经济形势的预测，分析市场投资环境的变化趋势，重点关注利率趋势变化。通过全面分析宏观经济、货币政策与财政政策、物价水平变化趋势等因素，对利率走势形成合理预期。

(2) 估值策略：建立不同品种的收益率曲线预测模型，并利用这些模型进行估值，确定价格中枢的变动趋势。根据收益率、流动性、风险匹配原则以及债券的估值原则构建投资组合，合理选择不同市场中有投资价值的券种。

(3) 久期管理：本基金努力把握久期与债券价格波动之间的量化关系，根据未来利率变化预期，以久期和收益率变化评估为核心，通过久期管理，合理配置投资品种。

### 4、可转换债券投资策略

可转换债券（含交易分离可转债）兼具权益类证券与固定收益类证券的特性，具有抵御下行风险、分享股票价格上涨收益的特点。可转债的选择结合其债性和股性特征，在对公司基本面和转债条款深入研究的基础上进行估值分析，投资于公司基本面优良、具有较高安全边际和良好流动性的可转换债券，获取稳健的投资回报。

### 5、中小企业私募债投资策略

基金投资中小企业私募债券，基金管理人将根据审慎原则，制定严格的投资决策流程、风险控制制度和信用风险、流动性风险处置预案，其中，投资决策流程和风险控制制度需经董事会批准，以防范信用风险、流动性风险等各种风险。本基金对中小企业私募债的投资主

---

要从自上而下判断景气周期和自下而上精选标的两个角度出发,结合信用分析和信用评估进行,同时通过有纪律的风险监控实现对投资组合风险的有效管理。

#### 6、股指期货投资策略

本基金在进行股指期货投资时,将根据风险管理的原则,以套期保值为主要目的,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与股指期货的投资,以管理投资组合的系统性风险,改善组合的风险收益特性。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金在进行股指期货投资时,将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组,授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项,同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。

#### 7、股票期权投资策略

本基金将按照风险管理的原则,以套期保值为主要目的,参与股票期权的投资。本基金将在有效控制风险的前提下,选择流动性好、交易活跃的期权合约进行投资。本基金将基于对证券市场的预判,并结合股指期权定价模型,选择估值合理的期权合约。

基金管理人将根据审慎原则,建立股票期权交易决策部门或小组,按照有关要求做好人员培训工作,确保投资、风控等核心岗位人员具备股票期权业务知识和相应的专业能力,同时授权特定的管理人员负责股票期权的投资审批事项,以防范期权投资的风险。

#### 8、资产支持证券投资策略

本基金综合考虑市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量等因素,主要从资产池信用状况、违约相关性、历史违约记录和损失比例、证券的信用增强方式、利差补偿程度等方面对资产支持证券的风险与收益状况进行评估,在严格控制风险的情况下,确定资产合理配置比例,在保证资产安全性的前提条件下,以期获得长期稳定收益。

#### 9、证券公司短期公司债券投资策略

本基金通过对证券公司短期公司债券发行人基本面的深入调研分析,结合发行人资产负债状况、盈利能力、现金流、经营稳定性以及债券流动性、信用利差、信用评级、违约风险等的综合评估结果,选取具有价格优势和套利机会的优质信用债券进行投资。

#### 10、权证投资策略

本基金将权证的投资作为提高基金投资组合收益的辅助手段,通过对权证标的证券基本面的研究,估算权证合理价值,并充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征,谨慎

---

进行投资。

#### 11、存托凭证投资策略

本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。

### 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) 股票资产占基金资产的 50%-95%，其中投资于港股通标的股票不超过股票资产的 50%；

(2) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；

(3) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；

(4) 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%；

(5) 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%；

(6) 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%；

(7) 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%；

(8) 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%；

(9) 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%；

(10) 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%；

(11) 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；

(12) 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；

(13) 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；

---

(14) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的 15%。基金管理人应制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险；

因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(15) 本基金参与股指期货交易，需遵守下列投资比例限制：

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

2) 本基金在任何交易日日终，持有的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基金持有的股票总市值的 20%；

本基金管理人应当按照中国金融期货交易所要求的内容、格式与时限向交易所报告所交易和持有的卖出期货合约情况、交易目的及对应的证券资产情况等；

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）占基金资产的 50%-95%；

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

(16) 本基金参与股票期权交易，需遵守下列投资比例限制：

1) 本基金因未平仓的期权合约支付和收取的权利金总额不得超过基金资产净值的 10%；

2) 本基金开仓卖出认购期权的，应持有足额标的证券；开仓卖出认沽期权的，应持有合约行权所需的全额现金或交易所规则认可的可冲抵期权保证金的现金等价物；

3) 本基金未平仓的期权合约面值不得超过基金资产净值的 20%。其中，合约面值按照行权价乘以合约乘数计算；

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

本基金在开始进行股指期货或股票期权投资之前，应与基金托管人就股指期货或股票期权开户、清算、估值、交收等事宜另行具体协商；

---

(18) 本基金持有的全部中小企业私募债券，其市值不超过基金资产净值的 10%；本基金持有一家企业发行的中小企业私募债，不得超过该债券的 10%；

(19) 本基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

(20) 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；

(21) 本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%。

(22) 本基金投资流通受限证券，基金管理人应事先根据中国证监会相关规定，与基金托管人在本基金托管协议中明确基金投资流通受限证券的比例，根据比例进行投资。基金管理人应制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险；

(23) 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，并与境内上市交易的股票合并计算，法律法规或监管机构另有规定的从其规定；

(24) 法律法规和《基金合同》约定的其他投资比例限制。

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不符合上述规定投资比例的，除上述第（11）、（14）、（17）、（20）项外，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。期间，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。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。

如果法律法规对基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制，不需要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) 向基金管理人、基金托管人出资；



---

(5) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

(6) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

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

法律、行政法规或监管部门取消或调整上述禁止性规定，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制或依变更后的规定执行。

#### 五、业绩比较基准

沪深 300 指数收益率\*40%+中证港股通综合指数收益率\*30%+中债总指数收益率\*30%

沪深 300 指数由上海和深圳证券交易所中市值大、流动性好的 300 只股票组成，综合反映中国 A 股市场上市股票价格的整体表现。中证港股通综合指数选取符合港股通资格的普通股作为样本股，采用自由流通市值加权计算，以反映港股通范围内上市公司的整体状况和走势，二者的结合适合作为本基金股票投资的比较基准。中债总指数是由中央国债登记结算有限公司编制的具有代表性的债券市场指数。根据本基金的投资范围和投资比例，选用上述业绩比较基准能够客观、合理地反映本基金的风险收益特征。

如果上述基准指数停止计算编制或更改名称，或者今后法律法规发生变化，或者是市场中出现更具有代表性的业绩比较基准，或者更科学的复合指数权重比例，本基金将根据实际情况在与基金托管人协商一致的情况下对业绩比较基准予以调整。业绩比较基准的变更应履行适当的程序，报中国证监会备案，并予以公告，无需召开基金份额持有人大会审议。

#### 六、风险收益特征

本基金属于混合型基金产品，预期风险和预期收益水平高于债券型基金和货币市场基金。

本基金除了投资 A 股外，还可根据法律法规规定投资香港联合交易所上市的股票。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

#### 七、基金管理人代表基金行使相关权利的处理原则及方法

1. 基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使相关权利,保护基金份额持有人的利益;

2. 有利于基金财产的安全与增值;

3. 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;

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

#### 八、侧袋机制的实施和投资运作安排

当基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时,根据最大限度保护基金份额持有人利益的原则,基金管理人经与基金托管人协商一致,并咨询会计师事务所意见后,可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制,无需召开基金份额持有人大会审议。

侧袋机制实施期间,本部分约定的投资组合比例、投资策略、组合限制、业绩比较基准、风险收益特征等约定仅适用于主袋账户。

侧袋账户的实施条件、实施程序、运作安排、投资安排、特定资产的处置变现和支付等对投资者权益有重大影响的事项详见本招募说明书“侧袋机制”章节的规定。

基金托管人依照相关法律法规的规定和基金合同的约定,对侧袋机制启用、特定资产处置和信息披露等方面进行复核和监督。

#### 九、基金的投资组合报告

##### 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	41,617,325.43	85.84
	其中:股票	41,617,325.43	85.84
2	固定收益投资	176,000.00	0.36
	其中:债券	176,000.00	0.36
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-

	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	6,664,939.64	13.75
7	其他各项资产	25,472.85	0.05
8	合计	48,483,737.92	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币2051431.98元，占期末净值比例为4.33%。

## 2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 2.1 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	34,479,407.45	72.86
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	526,952.00	1.11
J	金融业	4,559,534.00	9.63
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-

合计	39,565,893.45	83.61
----	---------------	-------

## 2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
A 基础材料	-	-
B 消费者非必需品	-	-
C 消费者常用品	-	-
D 能源	-	-
E 金融	140,627.20	0.30
F 医疗保健	-	-
G 工业	922,866.00	1.95
H 信息技术	987,938.78	2.09
I 电信服务	-	-
J 公用事业	-	-
K 房地产	-	-
合计	2,051,431.98	4.33

## 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	300274	阳光电源	21,376.00	3,116,620.80	6.59
2	300750	宁德时代	3,603.00	2,118,564.00	4.48
3	000733	振华科技	15,163.00	1,884,457.64	3.98
4	002049	紫光国微	7,963.00	1,791,675.00	3.79
5	300059	东方财富	45,400.00	1,684,794.00	3.56
6	600438	通威股份	35,302.00	1,587,177.92	3.35
7	603707	健友股份	35,610.00	1,495,620.00	3.16
8	601377	兴业证券	149,900.00	1,481,012.00	3.13
9	601012	隆基股份	17,034.00	1,468,330.80	3.10
10	600422	昆药集团	130,800.00	1,445,340.00	3.05

#### 4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	176,000.00	0.37
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	176,000.00	0.37

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113052	兴业转债	1,760	176,000.00	0.37

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

## 9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

## 10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 11. 投资组合报告附注

### (一)

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

(二) 报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

### (三) 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	22,888.40
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	693.44
5	应收申购款	1,891.01
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	25,472.85

### (四) 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。

### (五) 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。

### (六) 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入的原因，投资组合报告中分项之和与合计数可能存在尾差。

## 九、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。

阶段	净值增长	净值增长率	业绩比较基准	业绩比较基准收	①-③	②-④
	率①	标准差②	收益率③	益率标准差④		
基金合同生效日至 2019年12月31日	13.40%	0.66%	3.43%	0.64%	9.97%	0.02%
2020年1月1日至 2020年12月31日	53.66%	1.56%	12.62%	0.93%	41.04%	0.63%
2021年1月1日至 2021年12月31日	-7.32%	1.72%	-5.83%	0.78%	-1.49%	0.94%

注：本基金合同生效日为2019年3月20日。

## 十、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有价证券、银行存款本息、基金应收款项以及其他资产的价值总和。

### 二、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### 三、基金财产的账户

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

### 四、基金财产的保管和处分

---

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

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

## 十一、基金资产的估值

### 一、估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券/期货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、权证、债券和银行存款本息、应收款项、股指期货、股票期权、其它投资等资产及负债。

### 三、估值方法

本基金所持有的投资品种，按如下原则进行估值：

#### (1) 证券交易所上市的有价证券的估值

①交易所上市的有价证券（包括股票等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且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在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（另有规定的除外），选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。

③对在交易所市场上市交易的可转换债券，按照每日收盘价作为估值全价。

④对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募证券，估值日不存在活跃市场时采用估值技术确定其公允价值进行估值。如成本能够近似体现公允价值，应持续评估上述做法的适当性，并在情况发生改变时做出适当调整。



---

⑤本基金投资存托凭证的估值核算，依照境内上市的股票执行。

(2) 处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

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

③对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为计量日的公允价值进行估值；对于活跃市场报价未能代表计量日公允价值的情况下，按成本应对市场报价进行调整，确认计量日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，则采用估值技术确定公允价值。

④在发行时明确一定期限限售期的股票，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) 对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种，回售登记截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异，未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。

(4) 存款的估值方法

持有的银行定期存款或通知存款以本金列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入。

(5) 投资证券衍生品的估值方法

①从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的权证按估值日在证券交易所挂牌的该权证的收盘价估值；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，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考监管机构或行业协会有关规定，或者类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

②首次发行未上市的权证，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因持有股票而享有的配股权，以及停止交易但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值进行估值。在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行估值。

(6) 本基金可以采用第三方估值机构按照上述公允价值确定原则提供的估值价格数据。

(7) 中小企业私募债券按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

(8) 本基金投资股指期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价

---

的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

(9) 本基金投资股票期权合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。如有相关法律法规以及监管部门相关规定，按其规定内容进行估值。

(10) 本基金投资港股通标的股票，港股通投资上市流通的股票按估值日在港交所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。港股通投资上市流通的衍生品按估值日在港交所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。

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

(11) 本基金外币资产价值计算中，涉及港币对人民币汇率的，应当以基金估值日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价为准。

若本基金现行估值汇率不再发布或发生重大变更，或市场上出现更为公允、更适合本基金的估值汇率时，基金管理人与基金托管人协商一致后可根据实际情况调整本基金的估值汇率，并及时报中国证监会备案，无需召开基金份额持有人大会。

若无法取得上述汇率价格信息时，以基金托管人所提供的合理公开外汇市场交易价格为准。

(12) 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。

(13) 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。

(14) 相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

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

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致意见的，基金管理人向基金托管人出具加盖公章

---

的书面说明后，按照基金管理人对基金净值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，小数点后第五位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，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。

##### 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。

(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、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时;

3、当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上的,经与基金托管人协商一致的;

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

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净值予以公布。

#### 八、实施侧袋机制期间的基金资产估值

本基金实施侧袋机制的，应根据本部分的约定对主袋账户资产进行估值并披露主袋账户的基金净值信息，暂停披露侧袋账户基金份额净值。

#### 九、特殊情况的处理

1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第（12）项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

2、由于不可抗力，或证券交易所、期货公司及其登记结算公司发送的数据错误等原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

## 十二、基金的收益与分配

### 一、基金利润的构成

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

### 二、基金可供分配利润

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

### 三、基金收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最低为一次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利按除权日除权后的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

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、每一基金份额享有同等分配权；
  - 5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 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，按照《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者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。

#### 七、实施侧袋机制期间的收益分配

本基金实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配，详见本招募说明书“侧袋机制”章节的规定。

### 十三、基金的费用与税收

#### 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，但法律法规、中国证监会另有规定的除外；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券、期货交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、账户开户费用、账户维护费用；

---

9、因投资港股通标的股票而产生的各项合理费用；

10、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

## 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5%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，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

### 2、基金托管人的托管费

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

## 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协商酌情调整基金管理费和基金托管费，此项调整需要基金份额持有人大会决议通过。基金管理人必须最迟于新的费率实施日 2 日前在指定媒介上刊登

---

公告。

#### 五、实施侧袋机制期间的基金费用

本基金实施侧袋机制的，与侧袋账户有关的费用可以从侧袋账户中列支，但应待侧袋账户资产变现后方可列支，有关费用可酌情收取或减免，但不得收取管理费，详见本招募说明书“侧袋机制”章节或相关公告。

#### 六、基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

### 十四、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；
- 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。

### 十五、基金的信息披露

- 一、本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《基金合同》



---

及其他有关规定。相关法律法规关于信息披露的规定发生变化时，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”）和指定互联网网站（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、法人或者非法人组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；
- 6、中国证监会禁止的其他行为。

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

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

## 五、公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

（一）基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议、基金产品资料概要

1、《基金合同》是界定《基金合同》当事人的各项权利、义务关系，明确基金份额持有人大会召开的规则及具体程序，说明基金产品的特性等涉及基金投资者重大利益的事项的法律文件。

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

#### （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的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者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，将年度报告登载于指定网站上，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。

---

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

报告期内出现单一投资者持有基金份额比例超过 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产品的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

#### （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按规定编制临时报告书，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、基金管理公司变更持有百分之五以上股权的股东、变更公司的实际控制人；
- 8、基金募集期延长；
- 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者仲裁；
- 12、基金管理人及其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；
- 13、基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易事项，中国证监会另有规定的情形除外；
- 14、基金收益分配事项；
- 15、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、基金份额净值估值错误达基金份额净值百分之零点五；
  - 17、本基金开始办理申购、赎回；
  - 18、本基金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、本基金发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项；
  - 22、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；
  - 23、本基金推出新业务或新服务；

24、基金信息披露义务人认为可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的其他事项或中国证监会或本基金合同规定的其他事项。

#### （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的，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

基金合同出现终止情形的，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）投资中小企业私募债信息披露

基金管理人应在基金招募说明书的显著位置披露投资中小企业私募债券的流动性风险和信用风险，说明投资中小企业私募债券对基金总体风险的影响。

基金管理人在本基金投资中小企业私募债券后两个交易日内，在中国证监会指定媒介披露所投资中小企业私募债券的名称、数量、期限、收益率等信息。

本基金应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露中小企业私募债券的投资情况。

#### （十二）投资股指期货信息披露

基金管理人在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露股指期货交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示股指期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标等。

#### （十三）投资股票期权信息披露

基金管理人应在定期信息披露文件中披露参与股票期权交易的有关情况，包括投资政

---

策、持仓情况、损益情况、风险指标、估值方法等，并充分揭示股票期权交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标。

#### （十四）投资资产支持证券的信息披露

基金管理人在基金年报及中期报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细。基金管理人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。

#### （十五）投资港股通标的股票的信息披露

基金管理人在基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露本基金投资港股通标的股票的相关情况。若中国证监会对公募基金通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资香港股票市场的信息披露另有规定的，从其规定。

#### （十六）投资证券公司短期公司债券的信息披露

本基金投资证券公司短期公司债券后两个交易日内，基金管理人应在中国证监会指定媒介披露所投资证券公司短期公司债券的名称、数量等信息，并在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露证券公司短期公司债券的投资情况。

#### （十七）实施侧袋机制期间的信息披露

本基金实施侧袋机制的，相关信息披露义务人应当根据法律法规、基金合同和招募说明书的规定进行信息披露，详见本招募说明书“侧袋机制”章节的规定。

#### （十八）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。

基金管理人、基金托管人及相关从业人员不得泄露未公开披露的基金信息。

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

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

基金管理人、基金托管人应当在指定报刊中选择一家报刊披露本基金信息。

---

基金管理人、基金托管人应当向中国证监会基金电子披露网站报送拟披露的基金信息，并保证相关报送信息的真实、准确、完整、及时。

为强化投资者保护，提升信息披露服务质量，基金管理人应当自中国证监会规定之日起，按照中国证监会规定向投资者及时提供对其投资决策有重大影响的信息。

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

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

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。

#### 七、信息披露文件的存放与查阅

依法必须披露的信息发布后，基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于公司住所，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相关信息：

- (1) 不可抗力；
- (2) 基金投资所涉及的证券市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- (3) 出现基金管理人认为属于会导致基金管理人不能出售或评估基金资产的紧急事故的任何情况；
- (4) 法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的情况。

## 十六、侧袋机制

### 一、侧袋机制的实施条件、实施程序和特定资产范围

当基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，根据最大限度保护基金份额持有人利益的原则，基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制，无需召开基金份额持有人大会。基金管理人应当在启用侧袋机制当日报中国证监会及公司所在地中国证监会派出机构备案。

特定资产包括：(1) 无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大

---

不确定性的资产；（2）按摊余成本计量且计提资产减值准备仍导致资产价值存在重大不确定性的资产；（3）其他资产价值存在重大不确定性的资产。

## 二、侧袋机制实施期间的基金运作安排

### （一）基金份额的申购与赎回

#### 1、侧袋账户

侧袋机制实施期间，基金管理人不办理侧袋账户的申购、赎回和转换。基金份额持有人申请申购、赎回或转换侧袋账户基金份额的，该申购、赎回或转换申请将被拒绝。

#### 2、主袋账户

基金管理人将依法保障主袋账户份额持有人享有基金合同约定的赎回权利，并根据主袋账户运作情况合理确定申购事项，具体事项届时将由基金管理人在相关公告中规定。

3、当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上的，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停基金估值，并暂停接受基金申购赎回申请或延缓支付赎回款项。

对于启用侧袋机制当日收到的赎回申请，基金管理人仅办理主袋账户的赎回申请并支付赎回款项。在启用侧袋机制当日收到的申购申请，视为投资者对侧袋机制启用后的主袋账户提交的申购申请。

### （二）基金份额的登记

侧袋机制实施期间，基金管理人应对侧袋账户份额实行独立管理，主袋账户沿用原基金代码，侧袋账户使用独立的基金代码。侧袋账户份额的名称以“基金简称+侧袋标识 S+侧袋账户建立日期”格式设定，同时主袋账户份额的名称增加大写字母 M 标识作为后缀。基金所有侧袋账户注销后，将取消主袋账户份额名称中的 M 标识。

启用侧袋机制当日，基金管理人和基金登记机构应以基金份额持有人的原有账户份额为基础，确认相应侧袋账户持有人名册和份额。

侧袋账户资产完全清算后，基金管理人将注销侧袋账户。

### （三）基金的投资及业绩

侧袋机制实施期间，本基金的各项投资运作指标和基金业绩指标应当以主袋账户资产为基准。基金管理人不得在侧袋账户中进行除特定资产处置变现以外的其他投资操作。

基金管理人、相关服务机构在展示基金业绩时，应当就前述情况进行充分的解释说明，避免引起投资者误解。

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

---

#### （四）基金的估值

侧袋机制启用当日，基金管理人以完成日终估值后的基金净资产为基数对主袋账户和侧袋账户的资产进行分割，与特定资产可明确对应的资产类科目余额、除应交税费外的负债类科目余额一并纳入侧袋账户。基金管理人应将特定资产作为一个整体，不能仅分割其公允价值无法确定的部分。

侧袋机制实施期间，基金管理人将对侧袋账户单独设置账套，实行独立核算。如果本基金同时存在多个侧袋账户，不同侧袋账户分开进行核算。侧袋账户的会计核算应符合《企业会计准则》的相关要求。

#### （五）基金的费用

侧袋机制实施期间，侧袋账户资产不收取管理费。因启用侧袋机制产生的咨询、审计费用等由基金管理人承担。

基金管理人可以待侧袋账户资产变现后将与处置侧袋账户资产相关的费用从侧袋账户中列支。

#### （六）基金的收益分配

侧袋机制实施期间，在主袋账户份额满足基金合同收益分配条件的情形下，基金管理人可对主袋账户份额进行收益分配。侧袋账户不进行收益分配。

#### （七）基金的信息披露

##### 1、基金净值信息

侧袋机制实施期间，基金管理人应当暂停披露侧袋账户的基金份额净值和基金份额累计净值。

##### 2、定期报告

侧袋机制实施期间，基金定期报告中的基金会计报表仅需针对主袋账户进行编制。侧袋账户相关信息在定期报告中单独进行披露，包括但不限于：

- （1）侧袋账户的基金代码、基金名称、侧袋账户成立日期等基本信息；
- （2）侧袋账户的初始资产、初始负债；
- （3）特定资产的名称、代码、发行人等基本信息；
- （4）报告期内的特定资产处置进展情况、与处置特定资产相关的费用情况及其他与特定资产状况相关的信息；
- （5）可根据特定资产处置进展情况披露特定资产的可变现净值或净值参考区间，该净值或净值区间并不代表特定资产最终的变现价格，不作为基金管理人对特定资产最终变现价



---

格的承诺；

(6) 可能对投资者利益存在重大影响的其他情况及相关风险提示。

### 3、临时报告

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

启用侧袋机制的临时公告内容应当包括启用原因及程序、特定资产流动性和估值情况、对投资者申购赎回的影响、风险提示等重要信息。

处置特定资产的临时公告内容应当包括特定资产处置价格和时间、向侧袋账户份额持有人支付的款项、相关费用发生情况等重要信息。侧袋机制实施期间，若侧袋账户资产无法一次性完成处置变现，基金管理人在每次处置变现后均应按规定及时发布临时公告。

#### (八) 特定资产处置清算

基金管理人将按照基金份额持有人利益最大化原则制定变现方案，将侧袋资产处置变现。无论侧袋账户资产是否全部完成变现，基金管理人都应及时向侧袋账户对应的基金份额持有人支付已变现部分对应款项。

#### (九) 侧袋的审计

基金管理人应当在启用侧袋机制和终止侧袋机制后，及时聘请符合《证券法》规定的会计师事务所进行审计并披露专项审计意见，具体如下：

基金管理人应当在启用侧袋机制时，就特定资产认定的相关事宜取得符合《证券法》规定的会计师事务所的专业意见。

基金管理人应当在启用侧袋机制后五个工作日内，聘请于侧袋机制启用日发表意见的会计师事务所针对侧袋机制启用日本基金持有的特定资产情况出具专项审计意见，内容应包含侧袋账户的初始资产、份额、净资产等信息。

会计师事务所对基金年度报告进行审计时，应对报告期间基金侧袋机制运行相关的会计核算和年报披露，执行适当程序并发表审计意见。

当侧袋账户资产全部完成变现后，基金管理人应参照基金清算报告的相关要求，聘请符合《证券法》规定的会计师事务所对侧袋账户进行审计并披露专项审计意见。

三、本部分关于侧袋机制的相关规定，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，基金管理人经与基金托管人协商一致并履行适当程序后，在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，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。

---

## 十七、风险揭示

### 一、投资本基金的风险

#### 1、市场风险

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

(1) 政策风险。因财政政策、货币政策、产业政策、地区发展政策等国家宏观政策发生变化，导致市场价格波动，影响基金收益而产生风险。

(2) 经济周期风险。证券市场是国民经济的晴雨表，随着经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化，基金投资的收益水平也会随之变化，从而产生风险。

(3) 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。利率直接影响着债券的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。基金投资于债券和股票，其收益水平可能会受到利率变化的影响。

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

(5) 购买力风险。基金份额持有人收益将主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀因素而使其购买力下降，从而使基金的实际收益下降。

#### 2、管理风险

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

(2) 基金管理人和基金托管人的管理手段和管理技术等因素的变化也会影响基金收益水平。

#### 3、流动性风险

基金的流动性风险主要表现在两方面：一是基金管理人建仓时或为实现投资收益而进行组合调整时，可能会由于个股的市场流动性相对不足而无法按预期的价格将股票或债券买进或卖出；二是为应付投资者的赎回，当个股的流动性较差时，基金管理人被迫在不适当的价格大量抛售股票或债券。两者均可能使基金净值受到不利影响。

本基金主要的流动性风险管理方法说明

##### (1) 基金申购、赎回安排

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、赎回，开放日为上海证券交易所、深圳证券交易所以及相关期货交易所的正常交易日，具体办理时间为上海证券

---

交易所、深圳证券交易所以及相关期货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。若本基金参与港股通交易且该交易日为非港股通交易日时，则基金管理人可根据实际情况决定本基金是否开放申购、赎回及转换业务，具体安排以届时公告为准。根据法规，当极端情况下需要暂定基金资产估值等情况时，基金公司可拒绝或暂停接受投资人的申购、赎回申请。所以投资者可能面临基金暂停申购及赎回的风险。此外，在本基金发生巨额赎回情形时，基金持有人还可能面临延期赎回或暂停赎回的风险。

#### (2) 投资市场、行业及资产的流动性风险评估

本基金的投资市场主要为证券交易所、全国银行间债券市场等流动性较好的规范型交易场所，主要投资对象为具有良好流动性的金融工具，主要包括国内依法发行上市的股票、港股通标的股票、固定收益证券品种等，投资比例限制采用分散投资原则，股票市场、债券市场容量都较大，能够满足本基金日常运作要求，不会对市场造成冲击。股票的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，债券的市场价格受到宏观环境、资金面、信用资质、特定条款、监管政策等因素影响，虽然投资组合不能完全规避系统性流动性风险，但可以通过多样化投资来分散非系统风险，另外本基金在投资运作过程中的行业配置较为灵活，不以投资于某单一行业为投资目标，不会受到单一行业流动性风险的影响。综合评估在正常市场环境下本基金的流动性风险适中。

#### (3) 巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

基金出现巨额赎回情形下，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况或巨额赎回份额占比情况决定全部赎回或部分延期赎回。同时，如本基金单个基金份额持有人在单个开放日申请赎回基金份额超过基金总份额一定比例以上的，基金管理人有权对其赎回申请实施部分延期办理。

#### (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

在市场大幅波动、流动性枯竭等极端情况下发生无法应对投资者巨额赎回的情形时，基金管理人将以保障投资者合法权益为前提，严格按照法律法规及基金合同的规定，谨慎选取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、启用侧袋机制等流动性风险管理工具作为辅助措施。对于各类流动性风险管理工具的使用，基金管理人将依照严格审批、审慎决策的原则，及时有效地对风险进行监测和评估，使用前经过内部审批程序并与基金托管人协商一致。在实际运用各类流动性风险管理工具时，投资者的赎回申请、赎回款项支付等可能受到相应影响，基金管理人将严格依照法律法规及基金合同的约定进行操作，全面保障投资者的合法权益。

#### 4、启用侧袋机制的风险

当本基金启用侧袋机制时，实施侧袋机制期间，侧袋账户份额将停止披露基金份额净值，并不得办理申购、赎回和转换。因特定资产的变现时间具有不确定性，最终变现价格也具有

---

不确定性并且有可能大幅低于启用侧袋机制时的特定资产的估值，基金份额持有人可能因此面临损失。

#### 5、特定风险

本基金的股票资产（含国内股票及港股通标的股票）占基金资产的 50%-95%，存在基金经理的预判与市场实际表现存在较大差异，导致资产配置不合理，进而影响基金收益的风险。

本基金若参与港股通标的股票的投资，还需承担汇率风险以及境外市场的风险。

##### （1）汇率风险

本基金以人民币募集和计价，但本基金通过港股通投资香港证券市场，可投资的港股通标的股票以港币计价。由于人民币汇率在未来存在不确定性，存在因汇率变动而蒙受损失的可能性，因此，投资本基金存在一定的汇率风险。

##### （2）香港市场的风险

1) 与内地 A 股市场相比，港股市场上外汇资金流动更为自由，海外资金的流动对港股价格的影响巨大，因此，受到全球宏观经济和货币政策变动等因素所导致的系统性风险影响更大。

2) 香港市场交易规则有别于内地 A 股市场规则，参与香港股票投资还将面临包括但不限于如下特殊风险：

a. 香港市场证券交易价格并无涨跌幅上下限的规定，因此每日涨跌幅空间相对较大。

b. 只有内地与香港两地均为交易日且能够满足结算安排的交易日才为港股通交易日。

c. 香港出现台风、黑色暴雨或者联交所规定的其他情形时，联交所将可能停市，投资者将面临在停市期间无法进行交易的风险；出现境内证券交易服务公司认定的交易异常情况时，境内证券交易服务公司将可能暂停提供部分或者全部港股通服务，投资者将面临在暂停服务期间无法进行港股通交易的风险。

d. 由于香港市场实行 T+2 日（T 日买卖股票，资金和股票在 T+2 日才进行交收）的交收安排，本基金在 T 日（港股通交易日）卖出股票，T+2 日（港股通交易日，即为卖出当日之后第二个港股通交易日）在香港市场完成清算交收，卖出的资金在 T+3 日才能回到人民币资金账户。因此交收制度的不同以及港股通交易日的设定原因，本基金可能面临卖出港股后资金不能及时到账，造成支付赎回款日期比正常情况延后的风险。

3) 本基金的港股投资通过港股通进行，面临着港股通制度及其调整的风险：

a. 根据现行的港股通规则，本基金因所持港股通股票权益分派、转换、上市公司被收购等情形或者其他异常情况，所取得的港股通股票以外的香港联交所上市证券，只能通过港股通卖出，但不得买入；因港股通股票权益分派或者转换等情形取得的香港联交所上市股票的认购权利在联交所上市的，可以通过港股通卖出，但不得行权；因港股通股票权益分派、转换或者上市公司被收购等所取得的非联交所上市证券，可以享有相关权益，但不得通过港股通买入或卖出。

---

b. 本基金将仅通过沪港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场,不使用合格境内机构投资者(QDII)境外投资额度进行境外投资。在香港联合交易所有限公司开市前阶段,当日额度使用完毕的,新增的买单申报将面临失败的风险;在联交所持续交易时段,当日额度使用完毕的,当日本基金将面临不能通过港股通进行买入交易的风险。

c. 现行的港股通规则,对港股通下可投资的港股范围进行了限制,并定期或不定期根据范围限制规则对具体的可投资标的进行调整,对于调出在投资范围的港股,只能卖出不能买入;本基金可能因为港股通可投资标的范围的调整而不能及时买入看好的投资标的,而错失投资机会的风险。

#### 6、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。

#### 7、股指期货投资风险

本基金投资于股指期货,因此存在因投资股指期货而带来的风险:

- (1) 市场风险: 由于标的价格变动而产生的衍生品的价格波动。
- (2) 市场流动性风险: 当基金交易量大于市场可报价的交易量而产生的风险。
- (3) 结算流动性风险: 基金保证金不足而无法交易衍生品,或因指数波动导致保证金低于维持保证金而必须追缴保证金的风险。
- (4) 基差风险: 期货市场价格与标的价格不一致所产生的风险。
- (5) 信用风险: 交易对手不愿或无法履行契约的风险。
- (6) 作业风险: 因交易过程、交易系统、人员疏失、或其他不可预期时间所导致的损失。

#### 8、股票期权投资风险

本基金投资于股票期权,因此存在因投资股票期权而带来的风险:

- (1) 市场风险: 由于标的价格变动而产生的衍生品的价格波动。
- (2) 流动性风险: 当基金交易量大于市场可报价的交易量而产生的风险。
- (3) 保证金风险: 由于无法及时筹措资金满足建立或者维持衍生品合约头寸所要求的保证金而带来的风险。
- (4) 基差风险: 指衍生品合约价格和标的指数价格之间的价格差的波动所造成的风险,

---

以及不同衍生品合约价格之间价格差的波动所造成的期现价差风险。

(5) 信用风险：交易对手不愿或无法履行契约的风险。

(6) 操作风险：因交易过程、交易系统、人员疏失、或其他不可预期时间所导致的损失。

#### 9、中小企业私募债投资风险

中小企业私募债发行人为中小微、非上市企业，存在着公司治理结构相对薄弱、企业经营风险高、信息披露透明度不足等特点。基金管理人将通过建立并严格执行特定的信用分析制度，对持有的中小企业私募债投资进行信用风险管理。但如果发行人未真实披露其财务及经营管理信息，或基金管理人对其信用风险判断有误，中小企业私募债投资将存在违约风险，极端情况下，存在债券投资本金完全无法回收的风险。

同时，中小企业私募债交易平台为上交所与深交所的特定平台或通过证券公司进行转让，可能存在流动性不足的风险。如果基金管理人持有的中小企业私募债投资未能持有到期，将可能在二级市场交易时承担相当幅度的流动性折价，从而影响基金的收益水平。因此，投资中小企业私募债将在一定程度上增加基金的信用风险和流动性风险。

#### 10、资产支持证券的投资风险

本基金投资资产支持证券，资产支持证券具有一定的价格波动风险、流动性风险、信用风险等风险。价格波动风险指的是市场利率波动会导致资产支持证券的收益率和价格波动。流动性风险指的是受资产支持证券市场规模及交易活跃程度的影响，资产支持证券可能无法在同一价格水平上进行较大数量的买入或卖出，存在一定的流动性风险。信用风险指的基金所投资的资产支持证券之债务人出现违约，或在交易过程中发生交收违约，或由于资产支持证券信用质量降低导致证券价格下降，造成基金财产损失。

#### 11、证券公司短期公司债的投资风险

本基金可投资于证券公司短期公司债，由于证券公司短期公司债非公开发行和交易，且限制投资者数量上限，潜在流动性风险相对较大。若发行主体信用质

量恶化或投资者大量赎回需要变现资产时，受流动性所限，本基金可能无法卖出所持有的证券公司短期公司债，由此可能给基金净值带来不利影响或损失。

#### 12、科创板股票投资风险

##### (1) 科创板股票的流动性风险

科创板投资门槛高，个人投资者需要满足一定条件才可参与科创板股票投资，科创板股票流动性可能弱于其他市场板块，若机构投资者对个股形成一致性预期，存在股票无法成交的风险。

##### (2) 科创板企业退市风险

科创板有更为严格的退市标准，且不设暂停上市、恢复上市和重新上市制度，科创板上

---

市企业退市风险更大，可能给本基金带来不利影响。

### （3）投资集中度风险

科创板为新设板块，初期可投标的较少，投资者容易集中投资于少量个股，市场可能存在高集中度状况，整体存在集中度风险。

### （4）市场风险

科创板个股集中来自新一代信息技术、高端装备、新材料、新能源、节能环保及生物医药等高新技术和战略新兴产业领域。大多数企业为初创型公司，企业未来盈利、现金流、估值均存在不确定性，与传统二级市场投资存在差异，整体投资难度加大，个股市场风险加大。

科创板个股上市前五日无涨跌幅限制，第六日开始涨跌幅限制在正负20%以内，个股波动幅度较其他股票加大，市场风险随之上升。

### （5）系统性风险

科创板企业均为市场认可度较高的科技创新企业，在企业经营及盈利模式上存在趋同，所以科创板个股相关性较高，市场表现不佳时，系统性风险将更为显著。

### （6）股价波动风险

科创板新股发行价格、规模、节奏等坚持市场化导向，询价、定价、配售等环节由机构投资者主导。科创板新股发行全部采用询价定价方式，询价对象限定在证券公司等七类专业机构投资者，而个人投资者无法直接参与发行定价。同时，因科创板企业普遍具有技术新、前景不确定、业绩波动大、风险高等特征，市场可比公司较少，传统估值方法可能不适用，发行定价难度较大，科创板股票上市后可能存在股价波动的风险。

### （7）政策风险

国家对高新技术产业扶持力度及重视程度的变化会对科创板企业带来较大影响，国际经济形势变化对战略新兴产业及科创板个股也会带来政策影响。

## 13、操作或技术风险

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

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基金份额持有人的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理公司、登记机构、代销机构、证券交易所、证券登记结算机构等等。

## 14、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规及基金

---

合同有关规定的风险。

#### 15、其他风险

- (1) 因技术因素而产生的风险，如电脑系统不可靠产生的风险；
- (2) 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；
- (3) 因人为因素而产生的风险，如内幕交易、欺诈等行为产生的风险；
- (4) 对主要业务人员如基金经理的依赖而可能产生的风险；
- (5) 因战争、自然灾害等不可抗力导致的基金管理人、基金代销机构等机构无法正常工作，从而影响基金的申购、赎回按正常时限完成的风险。

#### 二、声明

1、本基金未经任何一级政府、机构及部门担保。基金投资者自愿投资于本基金，须自行承担投资风险。

2、除基金管理人直接办理本基金的销售外，本基金还通过基金代销机构代理销售，但是，基金资产并不是代销机构的存款或负债，也没有经基金代销机构担保收益，代销机构并不能保证其收益或本金安全。

## 十八、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报中国证监会备案，自决议生效后按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

### 二、《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：

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

3、《基金合同》约定的其他情形；



---

4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### 三、基金财产的清算

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

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券、期货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。

## 十九、基金合同的内容摘要

### 一、基金的基本情况

基金名称：上投摩根领先优选混合型证券投资基金

基金的类别：混合型证券投资基金

基金的运作方式：契约型开放式

注册文号：中国证监会证监许可[2018]2017 号

基金管理人：上投摩根基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

### 二、基金份额持有人、基金管理人及基金托管人的权利义务

#### （一）基金份额持有人的权利义务

基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受，基金投资者自依据《基金合同》取得基金份额，即成为本基金份额持有人和《基金合同》的当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为《基金合同》当事人并不以在《基金合同》上书面签章或签字为必要条件。

除法律法规另有规定或本基金合同另有约定外，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) 基金管理人的权利义务

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

- (1) 依法募集资金；
- (2) 自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
- (3) 依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- (4) 销售基金份额；
- (5) 按照规定召集基金份额持有人大会；
- (6) 依据《基金合同》及有关法律、法规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律、法规规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- (7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- (8) 选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；
- (9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；
- (10) 依据《基金合同》及有关法律、法规规定决定基金收益的分配方案；

- 
- (11) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购、赎回及转换申请；
  - (12) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
  - (13) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；
  - (14) 以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
  - (15) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商、期货经纪机构或其他为基金提供服务的外部机构；
  - (16) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换和非交易过户等业务规则；
  - (17) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。
- 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：
- (1) 依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
  - (2) 办理基金备案手续；
  - (3) 自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；
  - (4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；
  - (5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；
  - (6) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；
  - (7) 依法接受基金托管人的监督；
  - (8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回的价格；
  - (9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
  - (10) 编制季度报告、中期报告和年度报告；
  - (11) 严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

---

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

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

(14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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

(16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 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前提下得到有关资料的复印件；

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

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

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

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

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

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

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

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(26) 建立并保存基金份额持有人名册；

(27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

---

### （三） 基金托管人的权利义务

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

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

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

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

（4）根据相关市场规则，为基金开设证券账户、为基金办理证券、期货交易资金清算；

（5）提议召开或召集基金份额持有人大会；

（6）在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

（7）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

（1）以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

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

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

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

（5）保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

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

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

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

---

(9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

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

(11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；

(12) 建立并保存基金份额持有人名册；

(13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

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

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

(16) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；

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

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

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

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

(21) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(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。除法律法规另有规定或本基金合同另有约定外，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立日常机构。在本基金存续期内，根据本基金的运作需要，基金份额持有人大会可以设立日常机构，日常机构的设立与运作应当根据相关法律法规和中国证监会的规定进行。

#### (一) 召开事由

---

1、除法律法规、中国证监会另有规定外，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：

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

- (1) 法律法规要求增加的基金费用的收取；
- (2) 调整本基金的申购费率、调低赎回费率或调整收费方式，或调整基金份额类别设置；
- (3) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；
- (4) 对《基金合同》的修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生变化；
- (5) 基金管理人、销售机构、登记机构在法律法规规定的范围内调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则；
- (6) 基金在法律法规或中国证监会允许的范围内推出新业务或服务；
- (7) 按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。



---

## （二）会议召集人及召集方式

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

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。

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

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

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

## （三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

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

---

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

(5) 会务常设联系人姓名及联系电话；

(6) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；

(7) 召集人需要通知的其他事项。

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、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、通讯开会方式及法律法规、中国证监会允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

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

(1) 亲自出席会议者持有基金份额的凭证、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 50%（含 50%）。

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

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) 本人直接出具书面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）；

(4) 上述第(3)项中直接出具书面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、重新召集基金份额持有人大会的条件

若到会者在权益登记日所持有的有效基金份额低于第1条第(2)款、第2条第(3)款规定比例的，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会，到会者所持有的有效基金份额应不小于在权益登记日基金总份额的三分之一（含三分之一）。

4、在法律法规或监管机构允许的前提下，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、电话或其他方式进行表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

5、基金份额持有人授权他人代为出席会议并表决的，在法律法规或监管机构允许的前提下授权方式可以采用书面、网络、电话或其他方式，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 50%以上（含 50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。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 50%以上（含 50%）通过方为有效；除下列第 2 项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

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

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的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。

## （七）计票

---

## 1、现场开会

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

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

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

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

## 2、通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对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按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。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) 实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定

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

---

持有人分别持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例,但若相关基金份额持有人大会召集和审议事项不涉及侧袋账户的,则仅指主袋份额持有人持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例:

1、基金份额持有人行使提议权、召集权、提名权所需单独或合计代表相关基金份额 10% 以上(含 10%);

2、现场开会的到会者在权益登记日代表的基金份额不少于本基金在权益登记日相关基金份额的二分之一(含二分之一);

3、通讯开会的直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日相关基金份额的二分之一(含二分之一);

4、当参与基金份额持有人大会投票的基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日相关基金份额的二分之一,召集人在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内就原定审议事项重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上(含三分之一)相关基金份额的持有人参与或授权他人参与基金份额持有人大会投票;

5、现场开会由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的 50% 以上(含 50%) 选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人;

6、一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上(含二分之一)通过;

7、特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上(含三分之二)通过。

侧袋机制实施期间,基金份额持有人大会审议事项涉及主袋账户和侧袋账户的,应分别由主袋账户、侧袋账户的基金份额持有人进行表决,同一主侧袋账户内的每份基金份额具有平等的表决权。表决事项未涉及侧袋账户的,侧袋账户份额无表决权。

侧袋机制实施期间,关于基金份额持有人大会的相关规定以本节特殊约定内容为准,本节没有规定的适用上文相关约定。

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

#### 四、基金收益分配原则、执行方式

---

### （一）基金收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最低为一次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利按除权日除权后的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

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、每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

### （二）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。

### （三）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，按照《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。

### （四）基金收益分配中发生的费用

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

### （五）实施侧袋机制期间的收益分配

本基金实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配，详见招募说明书的规定。

## 五、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

### （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，但法律法规、中国证监会另有规定的除外；

4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费；

5、基金份额持有人大会费用；

6、基金的证券、期货交易费用；

7、基金的银行汇划费用；

8、账户开户费用、账户维护费用；

9、因投资港股通标的股票而产生的各项合理费用；

10、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

## (二)基金费用计提方法、计提标准和支付方式

### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5%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，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

### 2、基金托管人的托管费

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

## (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协商酌情调整基金管理费和基金托管费，此项调整需要基金份额持有人大会决议通过。基金管理人必须最迟于新的费率实施日 2 日前在指定媒介上刊登公告。

#### (五) 实施侧袋机制期间的基金费用

本基金实施侧袋机制的，与侧袋账户有关的费用可以从侧袋账户中列支，但应待侧袋账户资产变现后方可列支，有关费用可酌情收取或减免，但不得收取管理费，详见招募说明书的规定。

#### (六) 基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## 六、基金财产的投资方向和投资限制

### (一) 投资目标

本基金采用定量及定性研究方法，自上而下进行资产配置并优选在中国境内及香港市场上市的公司，通过严格的风险控制，力争实现基金资产的长期增值。

### (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（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、存托凭证、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、短期融资券、超短期融资券、中小企业私募债、证券公司短期公司债）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、权证、股指期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（须符合中国证监会相关规定）。

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

---

基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 50%-95%，其中投资于港股通标的股票不超过股票资产的 50%。权证投资占基金资产净值的 0-3%；每个交易日日终在扣除股指期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

### （三）投资限制

#### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）股票资产占基金资产的 50%-95%，其中投资于港股通标的股票不超过股票资产的 50%；

（2）本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；

（3）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；

（4）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%；

（5）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%；

（6）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%；

（7）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%；

（8）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%；

（9）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%；

（10）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%；

（11）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；

（12）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；

（13）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；

---

(14) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的 15%。基金管理人应制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险；

因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(15) 本基金参与股指期货交易，需遵守下列投资比例限制：

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

2) 本基金在任何交易日日终，持有的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基金持有的股票总市值的 20%；

本基金管理人应当按照中国金融期货交易所要求的内容、格式与时限向交易所报告所交易和持有的卖出期货合约情况、交易目的及对应的证券资产情况等；

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）占基金资产的 50%-95%；

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

(16) 本基金参与股票期权交易，需遵守下列投资比例限制：

1) 本基金因未平仓的期权合约支付和收取的权利金总额不得超过基金资产净值的 10%；

2) 本基金开仓卖出认购期权的，应持有足额标的证券；开仓卖出认沽期权的，应持有合约行权所需的全额现金或交易所规则认可的可冲抵期权保证金的现金等价物；

3) 本基金未平仓的期权合约面值不得超过基金资产净值的 20%。其中，合约面值按照行权价乘以合约乘数计算；

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

本基金在开始进行股指期货或股票期权投资之前，应与基金托管人就股指期货或股票期权开户、清算、估值、交收等事宜另行具体协商；

---

(18) 本基金持有的全部中小企业私募债券，其市值不超过基金资产净值的 10%；本基金持有一家企业发行的中小企业私募债，不得超过该债券的 10%；

(19) 本基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

(20) 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；

(21) 本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%。

(22) 本基金投资流通受限证券，基金管理人应事先根据中国证监会相关规定，与基金托管人在本基金托管协议中明确基金投资流通受限证券的比例，根据比例进行投资。基金管理人应制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险；

(23) 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，并与境内上市交易的股票合并计算，法律法规或监管机构另有规定的从其规定；

(24) 法律法规和《基金合同》约定的其他投资比例限制。

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不符合上述规定投资比例的，除上述第 (11)、(14)、(17)、(20) 项外，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。期间，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。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。

如果法律法规对基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制，不需要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) 向基金管理人、基金托管人出资；

---

(5) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

(6) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

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

法律、行政法规或监管部门取消或调整上述禁止性规定，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制或依变更后的规定执行。

## 七、基金净值信息的计算方法和公告方式

### (一) 估值方法

本基金所持有的投资品种，按如下原则进行估值：

#### (1) 证券交易所上市的有价证券的估值

①交易所上市的有价证券（包括股票等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且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在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（另有规定的除外），选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。

③对在交易所市场上市交易的可转换债券，按照每日收盘价作为估值全价。

④对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募证券，估值日不存在活跃市场时采用估值技术确定其公允价值进行估值。如成本能够近似体现公允价值，应持续评估上述做法的适当性，并在情况发生改变时做出适当调整。

⑤本基金投资存托凭证的估值核算，依照境内上市的股票执行。

#### (2) 处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

②首次公开发行未上市的股票、债券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可

---

靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

③对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为计量日的公允价值进行估值；对于活跃市场报价未能代表计量日公允价值的情况下，按成本应对市场报价进行调整，确认计量日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，则采用估值技术确定公允价值。

④在发行时明确一定期限限售期的股票，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）对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种，回售登记截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异，未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。

#### （4）存款的估值方法

持有的银行定期存款或通知存款以本金列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入。

#### （5）投资证券衍生品的估值方法

①从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的权证按估值日在证券交易所挂牌的该权证的收盘价估值；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，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考监管机构或行业协会有关规定，或者类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

②首次发行未上市的权证，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因持有股票而享有的配股权，以及停止交易但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值进行估值。在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行估值。

（6）本基金可以采用第三方估值机构按照上述公允价值确定原则提供的估值价格数据。

（7）中小企业私募债券按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

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

（9）本基金投资股票期权合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。如有相关法律法规以及监管部门相关规定，按其规定内容进行估值。

---

(10) 本基金投资港股通标的股票，港股通投资上市流通的股票按估值日在港交所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。港股通投资上市流通的衍生品按估值日在港交所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。

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

(11) 本基金外币资产价值计算中，涉及港币对人民币汇率的，应当以基金估值日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价为准。

若本基金现行估值汇率不再发布或发生重大变更，或市场上出现更为公允、更适合本基金的估值汇率时，基金管理人与基金托管人协商一致后可根据实际情况调整本基金的估值汇率，并及时报中国证监会备案，无需召开基金份额持有人大会。

若无法取得上述汇率价格信息时，以基金托管人所提供的合理公开外汇市场交易价格为准。

(12) 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。

(13) 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。

(14) 相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

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

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致意见的，基金管理人向基金托管人出具加盖公章的书面说明后，按照基金管理人对基金净值的计算结果对外予以公布。

## (二) 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，小数点后第五位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，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。

### （三）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的基金份额净值和基金份额累计净值。

## 八、基金合同的终止事由、程序与基金资产的清算

### （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报中国证监会备案，自决议生效后按照《信息披露办法》的有关规定指定媒介公告。

### （二）《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：

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



---

### (三)基金财产的清算

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

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券、期货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。

## 九、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，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会，仲裁地点为北京市，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力，仲裁费用及律师费用由败诉方承担。

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。

## 十、基金合同的存放地及投资者取得方式

1、《基金合同》正本一式六份，除上报有关监管机构一式二份外，基金管理人、基金托管人各持有二份，每份具有同等的法律效力。

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

## 二十、基金托管协议的内容摘要

### 一、托管协议当事人

1、基金管理人：上投摩根基金管理有限公司（具体信息见本招募说明书第三章）

2、基金托管人：中国建设银行股份有限公司

名称：中国建设银行股份有限公司（简称：中国建设银行）

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

邮政编码：100033

法定代表人：田国立

成立日期：2004 年 09 月 17 日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

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

---

从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；经中国银行业监督管理委员会等监管部门批准的其他业务。

## 二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

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

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、存托凭证、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、短期融资券、超短期融资券、中小企业私募债、证券公司短期公司债）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、权证、股指期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（须符合中国证监会相关规定）。

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

基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 50%-95%，其中投资于港股通标的股票不超过股票资产的 50%。权证投资占基金资产净值的 0-3%；每个交易日日终在扣除股指期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

（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：

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）股票资产占基金资产的 50%-95%，其中投资于港股通标的股票不超过股票资产的 50%；

（2）本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；

- 
- (3) 本基金管理人管理且由本基金托管人托管的全部基金持有一家发行的证券，不超过该证券的 10%；
- (4) 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%；
- (5) 本基金管理人管理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%；
- (6) 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%；
- (7) 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%；
- (8) 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%；
- (9) 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%；
- (10) 本基金管理人管理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%；
- (11) 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；
- (12) 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；
- (13) 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；
- (14) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的 15%。基金管理人应制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险；
- 因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；
- (15) 本基金参与股指期货交易，需遵守下列投资比例限制：
- 1) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；

---

2) 本基金在任何交易日日终, 持有的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基金持有的股票总市值的 20%;

本基金管理人应当按照中国金融期货交易所要求的内容、格式与时限向交易所报告所交易和持有的卖出期货合约情况、交易目的及对应的证券资产情况等;

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)占基金资产的 50%-95%;

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

(16) 本基金参与股票期权交易, 需遵守下列投资比例限制:

1) 本基金因未平仓的期权合约支付和收取的权利金总额不得超过基金资产净值的 10%;

2) 本基金开仓卖出认购期权的, 应持有足额标的证券; 开仓卖出认沽期权的, 应持有合约行权所需的全额现金或交易所规则认可的可冲抵期权保证金的现金等价物;

3) 本基金未平仓的期权合约面值不得超过基金资产净值的 20%。其中, 合约面值按照行权价乘以合约乘数计算;

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

本基金在开始进行股指期货投资之前, 应与基金托管人就股指期货开户、清算、估值、交收等事宜另行具体协商;

(18) 本基金持有的全部中小企业私募债券, 其市值不超过基金资产净值的 10%; 本基金持有一家企业发行的中小企业私募债, 不得超过该债券的 10%;

(19) 本基金总资产不得超过基金净资产的 140%;

(20) 本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%。

(21) 本基金持有的所有流通受限证券, 其公允价值不得超过本基金资产净值的 10%;

---

本基金持有的同一流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的 2%。基金管理人应制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险；

(22) 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，并与境内上市交易的股票合并计算，法律法规或监管机构另有规定的从其规定；

(23) 法律法规和《基金合同》约定的其他投资比例限制。

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不符合上述规定投资比例的，除上述第(11)、(14)、(17)项外，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。期间，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。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。

如果法律法规对基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制，不需要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，对本托管协议第十五条第(九)款基金投资禁止行为通过事后监督方式进行监督。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先的原则，防范利益冲突，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，并履行信息披露义务。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符合法律法规及行业标准的、经慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手名单，并约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金管理人应严格按照交易对手名单的范围在银行间债券市场选择交易对手。基金托管人监督基金管理人是否按事前提提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易。基金管理人可以每半年对银行间债券市场交易对手名单及结算方式进行更新，

---

新名单确定前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。如基金管理人根据市场情况需要临时调整银行间债券市场交易对手名单及结算方式的，应向基金托管人说明理由，并在与交易对手发生交易前3个工作日内与基金托管人协商解决。

基金管理人负责对交易对手的资信控制，按银行间债券市场的交易规则进行交易，并负责解决因交易对手不履行合同而造成的纠纷及损失，基金托管人不承担由此造成的任何法律责任及损失。若未履约的交易对手在基金托管人与基金管理人确定的时间前仍未承担违约责任及其他相关法律责任的，基金管理人可以对相应损失先行予以承担，然后再向相关交易对手追偿。基金托管人则根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督。如基金托管人事后发现基金管理人没有按照事先约定的交易对手或交易方式进行交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人，基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任。

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

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

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

本基金投资的流通受限证券限于可由中国证券登记结算有限责任公司或中央国债登记结算有限责任公司负责登记和存管，并可在证券交易所或全国银行间债券市场交易的证券。

本基金投资的流通受限证券应保证登记存管在本基金名下，基金管理人负责相关工作的落实和协调，并确保基金托管人能够正常查询。因基金管理人原因产生的流通受限证券登记存管问题，造成基金托管人无法安全保管本基金资产的责任与损失，及因流通受限证券存管直接影响本基金安全的责任及损失，由基金管理人承担。

本基金投资流通受限证券，不得预付任何形式的保证金。

2. 基金管理人投资非公开发行股票，应制订流动性风险处置预案并经其董事会批准。风险处置预案应包括但不限于因投资流通受限证券需要解决的基金投资比例限制失调、基金流动性困难以及相关损失的应对解决措施，以及有关异常情况的处置。基金管理人应在首次投

---

资流通受限证券前向基金托管人提供基金投资非公开发行股票相关流动性风险处置预案。

基金管理人对本基金投资流通受限证券的流动性风险负责,确保对相关风险采取积极有效的措施,在合理的时间内有效解决基金运作的流动性问题。如因基金巨额赎回或市场发生剧烈变动等原因而导致基金现金周转困难时,基金管理人应保证提供足额现金确保基金的支付结算,并承担所有损失。对本基金因投资流通受限证券导致的流动性风险,基金托管人不不承担任何责任。如因基金管理人原因导致本基金出现损失致使基金托管人承担连带赔偿责任的,基金管理人应赔偿基金托管人由此遭受的损失。

3. 本基金投资非公开发行股票,基金管理人应至少于投资前三个工作日向基金托管人提交有关书面资料,并保证向基金托管人提供的有关资料真实、准确、完整。有关资料如有调整,基金管理人应及时提供调整后的资料。上述书面资料包括但不限于:

(1) 中国证监会批准发行非公开发行股票的批准文件。

(2) 非公开发行股票有关发行数量、发行价格、锁定期等发行资料。

(3) 非公开发行股票发行人与中国证券登记结算有限责任公司或中央国债登记结算有限责任公司签订的证券登记及服务协议。

(4) 基金拟认购的数量、价格、总成本、账面价值。

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

本基金有关投资流通受限证券比例如违反有关限制规定,在合理期限内未能进行及时调整,基金管理人应按规定编制临时报告书,予以公告。

5. 基金托管人根据有关规定有权对基金管理人进行以下事项监督:

(1) 本基金投资流通受限证券时的法律法规遵守情况。

(2) 在基金投资流通受限证券管理工作方面有关制度、流动性风险处置预案的建立与完善情况。

(3) 有关比例限制的执行情况。

(4) 信息披露情况。

6. 相关法律法规对基金投资流通受限证券有新规定的,从其规定。

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



---

基金托管人对基金投资中小企业私募债券是否符合比例限制进行事后监督,如发现异常情况,应及时以书面形式通知基金管理人。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金因投资中小企业私募债券导致的信用风险、流动性风险,基金托管人不承担任何责任。如因基金管理人原因导致基金出现损失致使基金托管人承担连带赔偿责任的,基金管理人应赔偿基金托管人由此遭受的损失。

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

(八)基金托管人发现基金管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作违反法律法规、《基金合同》和本托管协议的规定,应及时以电话提醒或书面提示等方式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到书面通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函,就基金托管人的疑义进行解释或举证,说明违规原因及纠正期限,并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内,基金托管人有权随时对通知事项进行复查,督促基金管理人改正。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的,基金托管人应报告中国证监会。

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

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

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

(十二)当基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时,根据最大限度保护基金份额持有人利益的原则,基金管理人经与基金托管人协商一致,并咨询会计师事务所意见后,可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制,无需召开基金份额持有人大会审议。

---

侧袋机制实施期间的具体规则依照相关法律法规的规定和基金合同的约定执行。

### 三、基金管理人 对基金托管人的业务核查

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

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

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

### 四、基金财产的保管

#### (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。
3. 基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户及投资所需的其他账户。
4. 基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户, 确保基金财产的完整与独立。
5. 基金托管人按照《基金合同》和本协议的约定保管基金财产, 如有特殊情况双方可另行协商解决。基金托管人未经基金管理人的指令, 不得自行运用、处分、分配本基金的任何资产(不包含基金托管人依据中国证券登记结算有限责任公司结算数据完成场内交易交收、开户银行或交易/登记结算机构扣收交易费、结算费和账户维护费等费用)。

---

6. 对于因为基金投资产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金账户的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金财产造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金财产的损失，基金托管人对此不承担任何责任。

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

#### （二）基金募集期间及募集资金的验资

1. 基金募集期间募集的资金应存于基金管理人在基金托管人的营业机构开立的“基金募集专户”。该账户由基金管理人开立并管理。

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

3. 若基金募集期限届满，未能达到《基金合同》生效的条件，由基金管理人按规定办理退款等事宜。

#### （三）基金银行账户的开立和管理

1. 基金托管人可以基金的名义在其营业机构开立基金的银行账户，并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。

2. 基金银行账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立任何其他银行账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

3. 基金银行账户的开立和管理应符合银行业监督管理机构的有关规定。

4. 在符合法律法规规定的条件下，基金托管人可以通过基金托管人专用账户办理基金资产的支付。

#### （四）基金证券账户和结算备付金账户的开立和管理

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

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

---

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

证券账户开户费由基金管理人先行垫付, 待托管产品启始运营后, 基金管理人可向基金托管人发送划款指令, 将代垫开户费从本基金托管资金账户中扣还基金管理人。

4. 基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户, 并代表所托管的基金完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级法人清算工作, 基金管理人应予以积极协助。结算备付金、结算保证金、交收资金等的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定以及基金管理人与基金托管人签署的《托管银行证券资金结算协议》执行。

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

6. 若中国证监会或其他监管机构在本托管协议订立日之后允许基金从事其他投资品种的投资业务, 涉及相关账户的开立、使用的, 若无相关规定, 则基金托管人比照上述关于账户开立、使用的规定执行。

#### (五) 债券托管专户的开设和管理

《基金合同》生效后, 基金管理人负责以基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格, 并代表基金进行交易; 基金托管人根据中国人民银行、银行间市场登记结算机构的有关规定, 在银行间市场登记结算机构开立债券托管账户, 持有人账户和资金结算账户, 并代表基金进行银行间市场债券的结算。基金管理人和基金托管人共同代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议。

#### (六) 其他账户的开立和管理

1. 在本托管协议订立日之后, 本基金被允许从事符合法律法规规定和《基金合同》约定的其他投资品种的投资业务时, 如果涉及相关账户的开设和使用, 由基金管理人协助托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定, 开立有关账户。该账户按有关规则使用并管理。

2. 法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的, 从其规定办理。

#### (七) 基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的有关实物证券、银行存款开户证实书等有价凭证由基金托管人存放于基金托管人的保管库, 也可存入中央国债登记结算有限责任公司、中国证券登记结算有限责任

---

公司上海分公司/深圳分公司/北京分公司、银行间市场清算所股份有限公司或票据营业中心的代保管库，保管凭证由基金托管人持有。实物证券、银行定期存款证实书等有价凭证的购买和转让，按基金管理人和基金托管人双方约定办理。基金托管人对由基金托管人以外机构实际有效控制或保管的资产不承担任何责任。

#### （八）与基金财产有关的重大合同的保管

与基金财产有关的重大合同的签署，由基金管理人负责。由基金管理人代表基金签署的、与基金财产有关的重大合同的原件分别由基金管理人、基金托管人保管。除本协议另有规定外，基金管理人代表基金签署的与基金财产有关的重大合同包括但不限于基金年度审计合同、基金信息披露协议及基金投资业务中产生的重大合同，基金管理人应保证基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人应在重大合同签署后及时以加密方式将重大合同传真给基金托管人，并在三十个工作日内将正本送达基金托管人处。重大合同的保管期限为《基金合同》终止后 15 年。法律法规或监管规则另有规定的从其规定。

### 五、基金资产净值计算和会计核算

#### （一）基金资产净值的计算、复核与完成的时间及程序

1. 基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的金额。基金份额净值是按照每个工作日闭市后，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，小数点后第五位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，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。

#### （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、权证、债券和银行存款本息、应收款项、股指期货、股票期权、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且证券发行机构未发

---

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在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（另有规定的除外），选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。

③对在交易所市场上市交易的可转换债券，按照每日收盘价作为估值全价。

④对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募证券，估值日不存在活跃市场时采用估值技术确定其公允价值进行估值。如成本能够近似体现公允价值，应持续评估上述做法的适当性，并在情况发生改变时做出适当调整。

⑤本基金投资存托凭证的估值核算，依照境内上市执行的股票执行。

（2）处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

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

③对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为计量日的公允价值进行估值；对于活跃市场报价未能代表计量日公允价值的情况下，按成本应对市场报价进行调整，确认计量日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，则采用估值技术确定公允价值。

④在发行时明确一定期限限售期的股票，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）对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种，回售登记截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异，未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。

（4）存款的估值方法

持有的银行定期存款或通知存款以本金列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入。

---

(5) 投资证券衍生品的估值方法

①从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的权证按估值日在证券交易所挂牌的该权证的收盘价估值；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，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考监管机构或行业协会有关规定，或者类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

②首次发行未上市的权证，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因持有股票而享有的配股权，以及停止交易但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值进行估值。在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行估值。

(6)本基金可以采用第三方估值机构按照上述公允价值确定原则提供的估值价格数据。

(7) 中小企业私募债券按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

(8) 本基金投资股票期权合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。如有相关法律法规以及监管部门相关规定，按其规定内容进行估值。

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

(10) 本基金投资港股通标的股票，港股通投资上市流通的股票按估值日在港交所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。港股通投资上市流通的衍生品按估值日在港交所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。

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

(11) 本基金外币资产价值计算中，涉及港币对人民币汇率的，应当以基金估值日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价为准。

若本基金现行估值汇率不再发布或发生重大变更，或市场上出现更为公允、更适合本基金的估值汇率时，基金管理人与基金托管人协商一致后可根据实际情况调整本基金的估值汇率，并及时报中国证监会备案，无需召开基金份额持有人大会。

若无法取得上述汇率价格信息时，以基金托管人所提供的合理公开外汇市场交易价格为

---

准。

(12) 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。

(13) 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。

(14) 相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

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

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致意见的，基金管理人向基金托管人出具加盖公章的书面说明后，按照基金管理人对基金净值的计算结果对外予以公布。

### 3. 特殊情形的处理

基金管理人、基金托管人按估值方法的第(12)项进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

#### (三) 基金份额净值错误的处理方式

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

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

(1) 本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，与本基金有关的会计问题，如经双方在平等基础上充分讨论后，尚不能达成一致时，按基金管理人的建议执行，由此给基金份额持有人和基金财产造成的损失，由基金管理人负责赔付。

(2) 若基金管理人计算的基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告，而且基金托管



---

人未对计算过程提出疑义或要求基金管理人书面说明，基金份额净值出错且造成基金份额持有人损失的，应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金，就实际向投资者或基金支付的赔偿金额，基金管理人与基金托管人按照管理费和托管费的比例各自承担相应的责任。

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

(4)由于基金管理人提供的信息错误（包括但不限于基金申购或赎回金额等），进而导致基金份额净值计算错误而引起的基金份额持有人和基金财产的损失，由基金管理人负责赔付。

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

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

5. 前述内容如法律法规或者监管部门另有规定的，从其规定。如果行业另有通行做法，双方当事人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商。

#### （四）暂停估值与公告基金份额净值的情形

1. 基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
2. 因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；
3. 当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上的，经与基金托管人协商一致的；
4. 中国证监会和《基金合同》认定的其他情形。

#### （五）实施侧袋机制期间的基金资产估值

本基金实施侧袋机制的，应根据本部分的约定对主袋账户资产进行估值并披露主袋账户的基金净值信息，暂停披露侧袋账户份额净值。

#### （六）基金会计制度

按国家有关部门规定的会计制度执行。

#### （七）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净值的计算和公告的，以基金管理人的账册为准。

#### （八）基金财务报表与报告的编制和复核

##### 1. 财务报表的编制

基金财务报表由基金管理人编制，基金托管人复核。

##### 2. 报表复核

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

##### 3. 财务报表的编制与复核时间安排

###### （1）报表的编制

基金管理人应当在每月结束后 5 个工作日内完成月度报表的编制；在每个季度结束之日起 15 个工作日内完成基金季度报告的编制；在上半年结束之日起两个月内完成基金中期报告的编制；在每年结束之日起三个月内完成基金年度报告的编制。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。基金合同生效不足两个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。

###### （2）报表的复核

基金管理人应及时完成报表编制，将有关报表提供基金托管人复核；基金托管人在复核过程中，发现双方的报表存在不符时，基金管理人和基金托管人应共同查明原因，进行调整，调整以国家有关规定为准。

基金管理人应留足充分的时间，便于基金托管人复核相关报表及报告。

（九）基金管理人应在编制季度报告、中期报告或者年度报告之前及时向基金托管人提供基金业绩比较基准的基础数据和编制结果。

#### 六、基金份额持有人名册的登记与保管

基金份额持有人名册至少应包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。基金份额持有人名册由基金注册登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，基金管理人和基金托管人应分别保管基金份额持有人名册，保存期不少于 15 年，法律法规另有规定或监管机关另有要求的除外。如不能妥善保管，则按相关法规承担责任。

在基金托管人要求或编制中期报告和年报前，基金管理人应将有关资料送交基金托管人，不得无故拒绝或延误提供，并保证其真实性、准确性和完整性。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。

---

## 七、争议解决方式

因本协议产生或与之相关的争议，双方当事人应通过协商、调解解决，协商、调解不能解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，仲裁地点为北京市，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力，仲裁费用及律师费用由败诉方承担。

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

本协议受中国法律管辖。

## 八、基金托管协议的变更、终止

### （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须报中国证监会备案。

### （二）托管协议终止的情形

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

### （三）基金财产的清算

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

2. 基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券、期货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，但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的情形除外。

#### 6. 清算费用

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

#### 7. 基金财产清算剩余资产的分配：

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

#### 8. 基金财产清算的公告

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

#### 9. 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存至少15年。

## 二十一、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。基金管理人将根据基金份额持有人的需要和市场的变化，增加或变更服务项目。主要服务内容如下：

### （一）资料寄送

#### 1、基金投资者对账单：

基金管理人将向发生交易的基金份额持有人以书面或电子文件形式定期或不定期寄送对账单。

#### 2、其他相关的信息资料。

---

## （二）多种收费方式选择

基金管理人在合适时机将为基金投资者提供多种收费方式购买本基金，满足基金投资者多样化的投资需求，具体实施办法见有关公告。

## （三）基金电子交易服务

基金管理人为基金投资者提供基金电子交易服务。投资人可登录基金管理人的网站(www.cifm.com)查询详情。

## （四）联系方式

上投摩根基金管理有限公司

咨询电话：400 889 4888

网址：www.cifm.com

## 二十二、招募说明书的存放及查阅方式

本招募说明书存放在基金管理人和基金代销机构的办公场所和营业场所，基金投资者可免费查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

## 二十三、其他应披露事项

- 1、2021年3月10日，关于降低上投摩根旗下部分基金单笔最低交易限额的公告；
- 2、2021年8月12日，上投摩根基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告；
- 3、2021年9月4日，上投摩根基金管理有限公司关于注销厦门分公司的公告；
- 4、2021年9月17日，关于降低上投摩根旗下部分基金最低赎回及转换转出份额和持有份额的公告；
- 5、2022年1月5日，上投摩根基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告；
- 6、2022年1月17日，上投摩根领先优选混合型证券投资基金分红公告；

上述公告均依法通过中国证监会指定的媒介进行披露。

## 二十四、备查文件

- （一）中国证监会准予上投摩根领先优选混合型证券投资基金募集注册的文件

---

(二) 上投摩根领先优选混合型证券投资基金基金合同

(三) 上投摩根领先优选混合型证券投资基金托管协议

(四) 法律意见书

(五) 基金管理人业务资格批件、营业执照

(六) 基金托管人业务资格批件、营业执照

(七) 上投摩根基金管理有限公司开放式基金业务规则

(八) 中国证监会要求的其他文件

上述备查文件存放在基金管理人和基金代销机构的办公场所和营业场所，基金投资者可免费查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

上投摩根基金管理有限公司

2022年3月