

# 华宝行业精选混合型证券投资基金 招募说明书(更新)

2022 年定期更新

基金管理人：华宝基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

**【重要提示】**

本基金根据中国证券监督管理委员会《关于同意华宝行业精选股票型证券投资基金募集的批复》(证监基金字[2007]156号)的核准,进行募集。基金合同于2007年6月14日正式生效。

基金管理人保证《华宝行业精选混合型证券投资基金招募说明书》(以下简称“招募说明书”或“本招募说明书”)的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准,但中国证监会对本基金募集的核准,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。

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:因整体政治、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,等等。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投资风险,包括但不限于市场风险、流动性风险、信用风险、集中度风险、系统性风险、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。本基金可投资存托凭证,基金净值可能受到存托凭证的境外基础证券价格波动影响,存托凭证的境外基础证券的相关风险可能直接或间接成为本基金的风险。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》、《基金合同》及基金产品资料概要。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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,但不保证投资于本基金一定盈利,也不保证最低收益。

投资有风险,投资人申购本基金时应认真阅读本招募说明书。

本次更新招募说明书所载内容截止日为2022年3月31日;有关财务数据和净值表现截止日为2021年12月31日,数据未经审计。

原招募说明书与本次更新的招募说明书不一致的,以本次更新的招募说明书为准。

## 目 录

一、绪 言.....	1
二、释 义.....	2
三、基金管理人.....	6
四、基金托管人.....	13
五、相关服务机构.....	17
六、基金的募集.....	19
七、基金合同生效.....	20
八、基金份额的申购、赎回、非交易过户与转托管.....	21
九、与基金管理人管理的其他基金转换.....	30
十、基金的投资.....	33
十一、基金的业绩.....	40
十二、基金财产.....	45
十三、基金资产估值.....	46
十四、基金收益与分配.....	51
十五、基金的费用.....	53
十六、基金税收.....	55
十七、基金的会计与审计.....	56
十八、基金的信息披露.....	57
十九、风险揭示.....	62
二十、基金合同的变更、终止与基金财产清算.....	66
二十一、基金合同的内容摘要.....	69
二十二、基金托管协议内容摘要.....	82
二十三、对基金份额持有人的服务.....	91
二十四、其他应披露事项.....	93
二十五、招募说明书存放及查阅方式.....	94
二十六、备查文件.....	95



## 一、绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性规定》”)其他有关规定及《华宝行业精选混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)编写。

本招募说明书阐述了华宝行业精选混合型证券投资基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资人投资决策有关的必要事项,投资人在作出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

本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资料申请募集的。本招募说明书由本基金管理人解释。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息,或对本招募说明书作出任何解释或者说明。

本招募说明书根据基金合同编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

## 二、释 义

在本招募说明书中，除非文义另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

- 1、招募说明书：指《华宝行业精选混合型证券投资基金招募说明书》，招募说明书是基金向社会公开发售时对基金情况进行说明的法律文件
- 2、基金或本基金：指华宝行业精选混合型证券投资基金
- 3、基金管理人或本基金管理人：指华宝基金管理有限公司
- 4、基金托管人或本基金托管人：指中国建设银行股份有限公司
- 5、基金合同：指《华宝行业精选混合型证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充
- 6、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《华宝行业精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
- 7、基金份额发售公告：指《华宝兴业行业精选混合型证券投资基金份额发售公告》
- 8、法律法规：指中国现时有效并公布实施的法律、行政法规、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《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时作出的修订
- 10、《销售办法》：指《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 11、《信息披露办法》：指《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《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、《流动性规定》：指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10 月 1 日起实施的《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、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
- 15、中国证监会：指中国证券监督管理委员会
- 16、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会

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

18、**个人投资者**：指年满 18 周岁，合法持有现时有效的中华人民共和国居民身份证、军人证件等有效身份证件的中国公民，以及中国证监会批准的其他可以投资基金的自然人

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

20、**合格境外机构投资者**：指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》规定的条件，经中国证监会批准投资于中国证券市场，并取得国家外汇管理局额度批准的中国境外基金管理机构、保险公司、证券公司以及其他资产管理机构

21、**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

22、**基金份额持有人**：指依基金合同或招募说明书合法取得基金份额的投资人

23、**基金销售业务**：指基金的认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务

24、**销售机构**：指直销机构和代销机构

25、**直销机构**：指华宝基金管理有限公司

26、**代销机构**：指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金代销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

27、**基金销售网点**：指直销机构的直销中心及代销机构的代销网点

28、**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等

29、**登记机构**：指办理登记业务的机构。基金的登记机构为华宝基金管理有限公司或接受华宝基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构

30、**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

31、**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华宝行业精选混合型基金份额的变动及结余情况的账户

32、**基金合同生效日**：指 2007 年 6 月 14 日

33、**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，

清算组做出的清算报告报中国证监会备案并予以公告的日期

34、基金募集期限：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

35、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

36、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

37、T日：指本基金在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的日期

38、T+n日：指自T日起第n个工作日(不包含T日)

39、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

40、交易时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

41、业务规则：指《华宝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结算方面的业务规则，由基金管理人和投资人共同遵守

42、认购：指在基金募集期间，投资人申请购买基金份额的行为

43、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

44、赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同规定的条件要求基金管理人购回基金份额的行为

45、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、且由同一登记结算机构办理登记结算的其他基金基金份额的行为

46、转托管：指基金份额持有人在同一基金的不同销售机构之间实施的所持基金份额销售机构变更的操作

47、巨额赎回：指本基金单个开放日，基金净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过上一日基金总份额的10%

48、元：指人民币元

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

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

51、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值



52、**基金份额净值**：指计算日基金资产净值除以计算日发售在外的基金份额总数所得的基金份额的价值

53、**基金资产估值**：指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程

54、**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、**不可抗力**：指基金合同当事人无法预见、无法抗拒、无法避免且在基金合同由基金管理人、基金托管人签署之日后发生的，使基金合同当事人无法全部或部分履行基金合同的任何事件，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律法规变化、突发停电或其他突发事件、证券交易所非正常暂停或停止交易

56、**基金产品资料概要**：指《华宝行业精选混合型证券投资基金基金产品资料概要》及其更新

### 三、 基金管理人

#### （一）基金管理人概况

基金管理人：华宝基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼

法定代表人：XIAOYI HELEN HUANG（黄小薏）

总经理：XIAOYI HELEN HUANG（黄小薏）

成立日期：2003 年 3 月 7 日

注册资本：1.5 亿元

电话：021-38505888

联系人：章希

股权结构：中方股东华宝信托有限责任公司持有 51% 的股份，外方股东 Warburg Pincus Asset Management, L.P. 持有 49% 的股份。

#### （二）主要人员情况

##### 1、董事会信息

朱永红先生，董事长，博士。曾任武汉钢铁（集团）公司战略研究室主任、财务总监兼计划财务部部长、副总会计师、总会计师等职务。现任华宝基金管理有限公司董事长，中国宝武钢铁集团有限公司党委常委、总会计师兼董事会秘书，宝山钢铁股份有限公司监事会主席，中国太平洋保险（集团）股份有限公司监事会主席，宝武集团财务有限责任公司董事长。

XIAOYI HELEN HUANG（黄小薏）女士，董事，硕士。曾任加拿大 TD Securities 公司金融分析师，Acthop 投资公司财务总监。2003 年 5 月加入华宝基金管理有限公司，先后担任公司营运总监、董事会秘书、副总经理，现任华宝基金管理有限公司总经理。

魏臻先生，董事。曾任麦肯锡（上海）咨询公司分析师，摩根斯坦利亚洲公司分析师，香港人人媒体总监。现任华平投资集团董事总经理、神州租车控股公司董事、九月教育集团董事、中通快递董事。

周朗朗先生，董事，本科。曾任瑞士信贷第一波士顿（加拿大）分析师，花旗银行（香港）投资银行部分析师，现任美国华平集团中国金融行业负责人、董事总经理，华融资产管理股份有限公司董事，上海灿谷投资管理咨询服务股份有限公司董事。

胡光先生，独立董事，硕士。曾任美国俄亥俄州舒士克曼律师事务所律师，飞利浦电子

中国集团法律顾问，上海市邦信阳律师事务所合伙人，上海胡光律师事务所主任。现任上海市君悦律师事务所主任。

尉安宁先生，独立董事，博士。曾任宁夏广播电视大学讲师，中国社会科学院经济研究所助理研究员，世界银行农业经济学家，荷兰合作银行东北亚区食品农业研究主管，新希望集团常务副总裁，比利时富通银行中国区 CEO 兼上海分行行长，山东亚太中慧集团董事长。现任上海谷旺投资管理有限公司执行董事兼总经理，大成食品（亚洲）有限公司董事。

陈志宏先生，独立董事，硕士。曾任毕马威会计师事务所合伙人、普华永道会计师事务所合伙人，苏黎世金融服务集团亚太地区首席执行官。

## 2、监事会信息

朱莉丽女士，监事，硕士。曾就职于美林投资银行部、德意志银行投资银行部，现任美国华平集团执行董事。

黄洪永先生，监事，硕士。曾任宝钢集团规划部、管理创新部综合主管，宝钢工程党委组织部、人力资源部部长，广东钢铁集团规划部副部长，广东宝钢置业副总经理，宝钢集团人事效率总监、领导力发展总监，中国宝武集团领导力发展总监，中国宝武钢铁集团产业金融党工委副书记、纪工委书记；现任华宝投资有限公司党委副书记、纪委书记。

沈燕女士，监事，本科。曾任宝钢集团审计部主任审计师，宝钢欧洲有限责任公司财务总监，华宝证券有限责任公司稽核部高级经理。现任华宝基金管理有限公司合规审计部内审主管。

丁科先生，监事，硕士。曾任招银金融租赁业务研发部客户经理，平安国际融资租赁企划部经营分析经理，华宝投资投资银行部项目经理、华宝基金战略规划部战略规划主管。现任华宝基金管理有限公司华东机构销售部高级销售经理。

## 3、总经理及其他高级管理人员

朱永红先生，董事长，简历同上。

XIAOYI HELEN HUANG（黄小蕙）女士，总经理，简历同上。

刘欣先生，常务副总经理，本科。曾任中国国际金融有限公司投资银行部分析师、经理，美林（亚太）有限公司投资银行部经理、亚洲企业融资部副总裁/董事，瑞士信贷香港有限公司投资银行部副总裁，北京春雨天下软件有限公司首席财务官，亚投顾问有限公司高级顾问等职务。现任华宝基金管理有限公司常务副总经理。

向辉先生，副总经理，硕士。曾在武汉长江金融审计事务所任副所长、在长盛基金管理

有限公司市场部任职。2002年加入华宝基金公司参与公司的筹建工作，先后担任公司清算登记部总经理、营运副总监、营运总监，现任华宝基金管理有限公司副总经理。

周雷先生，督察长，硕士。曾任职于中国机械设备进出口总公司、北京证监局、中国证监会，曾任华宝证券有限责任公司首席风险官、合规总监。现任华宝基金管理有限公司督察长。

李孟恒先生，首席信息官，硕士。曾在 T.A. Consultant LTD. 从事开发及技术管理工作。2002年参与华宝基金管理有限公司筹备工作，后历任信息技术部资深系统工程师、部门副总经理，营运副总监兼信息技术部总经理，现任华宝基金管理有限公司首席信息官。

#### 4、本基金基金经理

闫旭，硕士。曾在富国基金、华宝基金、纽银梅隆西部基金从事证券研究和投资管理工作。2014年3月再次加入华宝基金管理有限公司担任国内投资部总经理、投资副总监，现任均衡风格投资总监。2007年6月至2008年9月任华宝行业精选混合型证券投资基金基金经理，2008年4月至2010年7月任华宝宝康消费品证券投资基金基金经理，2014年7月起任华宝行业精选混合型证券投资基金基金经理，2015年2月至2019年7月任华宝收益增长混合型证券投资基金基金经理，2015年3月至2021年4月任华宝稳健回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017年5月至2018年8月任华宝智慧产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2021年4月起任华宝绿色主题混合型证券投资基金、华宝绿色领先股票型证券投资基金基金经理，2021年12月起任华宝先进成长混合型证券投资基金基金经理。

#### 5、权益投决会信息

蔡目荣先生，华宝基金管理有限公司权益投资总监、权益投资一部总经理、基金经理。  
闫旭女士，华宝基金管理有限公司均衡风格投资总监、可持续发展投资部总经理、基金经理。

钟奇先生，华宝基金管理有限公司研究总监、创新研究发展中心总经理、基金经理。

夏林锋先生，华宝基金管理有限公司基金经理。

贺喆先生，华宝基金管理有限公司基金经理。

#### 6、上述人员之间不存在近亲属关系。

#### (三) 基金管理人职责

基金管理人应严格依法履行下列职责：

1、依法募集本基金，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、 办理本基金备案手续；
- 3、 对所管理的不同基金财产分别管理、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、 办理与基金财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、 保存基金财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、 中国证监会规定的其他职责。

#### （四）基金管理人承诺

1、 基金管理人将遵守《基金法》、《证券法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》等法律法规的相关规定，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违法违规行为的发生。

#### 2、 基金管理人不得从事下列行为：

- （1）将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
- （2）不公平地对待其管理的不同基金财产；
- （3）利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；
- （4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- （5）依照法律、行政法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他行为。

#### 3、 基金经理承诺

（1）依照有关法律法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；

（2）不利用职务之便为自己、代理人、代表人、受雇人或任何其他第三人牟取不当利益；

（3）不泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；

（4）不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

#### （五）基金管理人内部控制制度

##### 1、风险管理体系

本基金在运作过程中面临的风险主要包括市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险、合规性风险、信誉风险和事件风险（如灾难）。

针对上述各种风险，本公司建立了一套完整的风险管理体系，具体包括以下内容：

（1）搭建风险管理环境。具体包括制定风险管理战略、目标，设置相应的组织机构，建立清晰的责任线路和报告渠道、配备适当的人力资源、开发适用的技术支持系统等内容。

（2）识别风险。辨识公司运作和基金管理中存在的风险。

（3）分析风险。检查存在的控制措施，分析风险发生的可能性及其引起的后果并将风险归类。

（4）度量风险。评估风险水平的高低，既有定性的度量手段，也有定量的度量手段。定性的度量是把风险水平划分为若干级别，每一种风险按其发生的可能性与后果的严重程度分别进入相应的级别。定量的方法则是设计一些风险指标，测量其数值的大小。

（5）处理风险。将风险水平与既定的标准相对比，对于那些级别较低、在公司所定标准范围以内的风险，控制相对宽松一点，但仍加以定期监控，以防其超过预定标准；而对较为严重的风险，则制定适当的控制措施；对于一些后果可能极其严重的风险，则除了严格控制以外，还准备了相应的应急处理措施。

（6）监视与检查。对已有的风险管理系统进行实时监视，并定期评价其管理绩效，在必要时结合新的需求加以改变。

（7）报告与咨询。建立风险管理的报告系统，使公司股东、公司董事会、公司高级管理人员及监管部门及时而有效地了解公司风险管理状况，并寻求咨询意见。

##### 2、内部控制制度

###### （1）内部风险控制原则

合规性原则。内部控制机制应符合法律和监管要求，规范和促使公司经营管理及公司员工执业行为符合法律法规、行业规范和自律规则，以及行业普遍遵守的职业道德和行为。

健全性原则。内部控制机制必须覆盖公司的各项业务、各个部门和各级岗位，并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个环节。

有效性原则。通过设置科学清晰的操作流程，结合程序控制，建立合理的内控程序，维护内部控制制度的有效执行。

独立性原则。公司必须在精简高效的基础上设立能充分满足公司经营运作需要的部门和岗位，各部门和岗位在职能上保持相对独立性；公司自有资产、各项受托资产分离运作，独立进行。

相互制约原则。部门和岗位的设置必须权责分明、相互制约，并通过切实可行的相互制衡措施来消除内部控制盲点。

防火墙原则。公司基金管理、交易、清算登记、信息技术、研究、市场营销等相关部门，应当在物理上和制度上适当隔离；对因业务需要必须知悉未公开信息或涉及多部门信息的人员，应制定严格的批准程序和监督防范措施。

成本效益原则。公司应当充分发挥各部门及员工的工作积极性，尽量降低经营运作成本，保证以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

合法合规性原则。公司内控制度应当符合国家法律法规、规章制度和各项规定，并在此基础上遵循国际和行业的惯例制订。

全面性原则。内部控制制度必须涵盖公司经营管理的各个环节，不留有制度上的空白或漏洞。

审慎性原则。公司内部控制的核心是风险控制，内部控制制度的制订要以审慎经营、防范和化解风险为出发点。

适时性原则。内部控制制度的制订应当具有前瞻性，并应随着公司经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律法规、政策制度等外部环境的改变，及时修改或完善。

实效性原则。内部控制制度应得到有效执行。公司应当树立和强化管理制度化、制度流程化、流程信息化的内控理念，通过强监管、严问责、加强信息化管理，严格落实各项规章制度。

## （2）内部风险控制的要求和内容

内部风险控制要求不相容职务分离、建立完善的岗位责任制和规范的岗位管理措施、建立完整的信息资料保全系统、建立授权控制制度、建立有效的风险防范系统和快速反应机制。

内部风险控制的内容包括投资管理业务控制、市场管理业务控制、信息披露控制、信息技术系统控制、会计系统控制、档案管理控制、合规和法务管理控制、风险管理控制、审计稽核控制，及反洗钱控制等。

## （3）督察长制度

公司设督察长，督察长由公司总经理提名，董事会聘任，并应当经全体独立董事同意。

督察长应当定期或者不定期向全体董事报送工作报告，并在董事会及董事会下设的相关专门委员会定期会议上报告基金及公司运作的合法合规情况及公司内部风险控制情况。督察长发现基金及公司运作中存在问题时，应当及时告知公司总经理和相关业务负责人，提出处理意见和整改建议，并监督整改措施的制定和落实；公司总经理对存在问题不整改或者整改未达到要求的，督察长应当向公司董事会、中国证监会及相关派出机构报告。

#### （4）监察稽核及风险管理制度

合规审计部和风险管理部依据公司的内部控制制度，在所赋予的权限内，按照所规定的程序和适当的方法，进行公正客观的检查和评价。

合规审计部和风险管理部负责调查评价公司内控制度的健全性、合理性；负责调查、评价公司有关部门执行公司各项规章制度的情况；评价各项内控制度执行的有效性，对内控制度的缺失提出补充建议；进行日常风险监控工作；协助评价基金财产风险状况；负责包括基金经理离任审查在内的各项内部审计事务等。

### 3、基金管理人关于内部控制制度的声明书

- （1）基金管理人承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确；
- （2）基金管理人承诺根据市场变化和公司发展不断完善内部合规控制制度。



## 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。

### （三）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在规定期限内改正，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）基金份额发售机构

#### 1、直销机构：

##### （1）直销柜台

本公司在上海开设直销柜台。

办公地址：上海市浦东新区浦电路 370 号宝钢大厦 905 室

邮政编码：200120

直销柜台电话：021-38505731、021-38505732

直销柜台传真：021-50499663、021-50988055

##### （2）直销 e 网金

投资者可以通过本公司直销 e 网金网上交易系统办理本基金的申购、赎回、转换等业务，具体交易细则请参阅本公司网站公告。直销 e 网金网址：[www.fsfund.com](http://www.fsfund.com)。

#### 2、代销机构

本基金的销售机构信息请详见基金管理人网站公示。基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构销售基金，并在基金管理人网站公示。

### （二）基金登记机构：华宝基金管理有限公司（同上）

### （三）律师事务所和经办律师

名称：通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：韩炯

联系电话：(86 21) 3135 8666

传真：(86 21) 3135 8600

联系人：黎明

经办律师：吕红、黎明

### （四）会计师事务所和经办注册会计师

名称：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

注册地址：中国上海市浦东新区陆家嘴环路 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

联系电话：(021) 23238888

传真：(021) 23238800

联系人：林佳璐

经办注册会计师：陈熹、林佳璐

## 六、 基金的募集

本基金经中国证监会证监基金字【2007】156号《关于同意华宝行业精选股票型证券投资基金募集的批复》核准，由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定募集，募集期从2007年6月11日起，至2007年6月12日止，共募集9,998,540,080.34份基金份额，有效认购户数为366,637户。

## 七、 基金合同生效

本基金基金合同于 2007 年 6 月 14 日生效。



## 八、 基金份额的申购、赎回、非交易过户与转托管

### （一）基金份额申购和赎回的场所

本基金的销售机构包括基金管理人和基金管理人委托的代销机构。具体销售网点将由基金管理人在基金份额发售公告或其他公告中列明。基金管理人可以根据情况变更或增减代销机构，并在基金管理人网站公示。

投资人可以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的申购与赎回。具体办法另行公告。

### （二）申购与赎回的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，基金管理人根据法律法规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，若出现新的证券交易市场、证券交易所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时间进行相应的调整并公告。

#### 2、申购、赎回开始日及业务办理时间

本基金的申购自基金合同生效日后不超过 90 天开始办理。本基金于 2007 年 7 月 16 日开始办理申购业务。

本基金的赎回自基金合同生效日后不超过 90 天开始办理。本基金于 2007 年 8 月 10 日开始办理赎回业务。

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、赎回或者转换申请的，其基金份额申购、赎回价格为下次办理基金份额申购、赎回时间所在开放日的价格。

### （三）申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即基金的申购与赎回价格以受理申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算；

2、基金采用金额申购和份额赎回的方式，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、基金份额持有人在赎回基金份额时，基金管理人按先进先出的原则，即对该基金份额持有人在销售机构的基金份额进行处理时，申购确认日期在前的基金份额先赎回，申购确认日期在后的基金份额后赎回，以确定所适用的赎回费率；

4、当日的申购与赎回申请可以在当日交易时间结束前撤销，在当日的交易时间结束后不得撤销；

5、基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可更改上述原则，但最迟应在新的原则实施前3个工作日予以公告。

#### （四）申购与赎回的程序

##### 1、申购和赎回的申请

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

投资人在提交申购申请时须按销售机构规定的方式备足申购资金，投资人在提交赎回申请时须持有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回申请不成立。

##### 2、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前收到申购和赎回申请的当日作为申购或赎回申请日（T日），并在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，投资人可在T+2日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。

##### 3、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的，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。若申购不成立或无效，基金管理人或基金管理人指定的代销机构将投资人已缴付的申购款项本金退还给投资人。

#### （五）申购与赎回的数额限制

##### 1、申请申购基金的金额

通过代销网点和直销e网金申购本基金单笔最低金额为1元人民币（含申购费）。通过直销柜台首次申购的最低金额为10万元人民币（含申购费），追加申购最低金额为1元人民币（含申购费）。已有认购本基金记录的投资人不受首次申购最低金额的限制，但受追加申购最低金额的限制。

代销网点的投资人欲转入直销柜台进行交易要受直销柜台最低金额的限制。基金管理人可根据市场情况，调整首次申购的最低金额。

投资人可多次申购，对单个投资人累计持有份额不设上限限制。法律法规、中国证监会另有规定的除外。

##### 2、申请赎回基金的份额

投资人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，单笔赎回份额不得低于 1 份。基金持有人赎回时或赎回后在销售机构（网点）保留的基金份额余额不足 1 份的，在赎回时需一次全部赎回。

3、基金管理人可以规定投资人每个交易账户的最低基金份额余额

基金管理人可以根据市场情况，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、单个投资者单日或单笔申购金额上限、本基金总规模限额和单日净申购比例上限等。基金管理人必须在调整前 3 个工作日在至少一种指定媒介上刊登公告。

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

(六) 申购和赎回的价格、费用及其用途

1、申购费和赎回费

(1) 投资人在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。本基金的申购费率表如下：

申购金额	申购费率
500 万（含）以上	每笔 1000 元
大于等于 200 万，小于 500 万	0.5%
大于等于 100 万，小于 200 万	1.0%
大于等于 50 万，小于 100 万	1.2%
50 万以下	1.5%

本基金的申购费用由申购人承担，主要用于市场推广、销售、登记等各项费用，不列入基金财产。

(2) 赎回费随基金持有时间的增加而递减，费率如下：

持有时间	费率
小于 7 日	1.50%
7 日-两年（含两年）	0.5%
两年-三年（含三年）	0.3%
三年以上	0%

本基金的赎回费用由赎回人承担，对于收取的持续持有期少于 7 日的投资者的赎回费，

基金管理人将其全额计入基金财产。对于收取的持续持有期长于等于7日的投资者的赎回费，其中25%的部分归入基金财产，其余部分用于支付登记费等相关手续费。

## 2、申购份额与赎回金额的计算方式

### （1）申购份额的计算

本基金将采用外扣法计算申购费用及申购份额。其中，

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} / [1 + \text{申购费率}]$$

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

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{申购当日基金份额净值}$$

申购费用、净申购金额的计算按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。申购份额的计算结果保留小数点后两位，两位以后舍去，舍去部分所代表的资产归基金财产所有。

例一：假定投资人申购本基金，T日的基金份额净值为1.2000元，申购金额为1,000元，那么申购负担的申购费用和获得的基金份额计算如下：

申购金额（元，A）	1,000
适用费率（B）	1.5%
净申购金额（ $C=A/[1+B]$ ）	985.22
申购费用（ $D=A-C$ ）	14.78
申购份额（ $=C/1.2000$ ）	821.02

### （2）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，

$$\text{赎回价格} = \text{赎回日基金份额净值}$$

$$\text{赎回总额} = \text{赎回份额} \times \text{赎回价格}$$

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

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

赎回总额为按实际确认的有效赎回份额乘以申请当日基金份额净值的金额，赎回金额为赎回总额扣除相应的费用。赎回总额、赎回金额的计算按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

例二：假定投资人赎回本基金，T日的基金份额净值为1.2000元，投资人赎回10,000份，投资人持有不到1年，则：

赎回份额（A）	10,000
赎回总额（ $B=A \times 1.2000$ ）	12,000
适用费率（C）	0.5%
赎回费用（ $D=B \times C$ ）	60
赎回金额（ $=B-D$ ）	11,940

3、T日的基金份额净值在当日收市后计算，并在T+1日公告，计算公式为计算日基金资产净值除以计算日发行在外的基金份额总额。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、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，由此产生的误差由基金财产承担。

5、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，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前3个工作日内在至少一种指定媒介公告。

#### （七）申购与赎回的登记

1、基金投资人提出的申购和赎回申请，在当日交易时间结束之前可以撤销。

2、投资人申购基金成功后，基金登记机构在T+1日为投资人增加权益并办理登记手续，投资人自T+2日起有权赎回该部分基金份额。

3、投资人赎回基金成功后，基金登记机构在T+1日为投资人扣除权益并办理相应的登记手续。

4、基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述登记办理时间进行调整，并最迟于开始实施前3个工作日在指定媒介予以公告。

#### （八）拒绝或暂停申购、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形及处理

1、在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

- （1）因不可抗力导致基金无法正常运作。
- （2）证券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。
- （3）发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况。但当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金申购申请。

（4）基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害其他基金份额持有人

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，从而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数的比例达到或者超过基金份额总数的 50%，或者变相规避 50%集中度的情形时。

（7）申请超过基金管理人设定的基金总规模、单日净申购比例上限、单一投资者单日或单笔申购金额上限的。

（8）法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述暂停申购情形时，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，被拒绝的申购款项将退划给投资人。

基金管理人拒绝或暂停接受申购的方式包括：

- （1）拒绝接受、暂停接受某笔或某数笔申购申请；
- （2）拒绝接受、暂停接受某个或某数个工作日的全部申购申请；
- （3）按比例拒绝接受、暂停接受某个或某数个工作日的申购申请。

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。

2、在如下情况下，基金管理人可以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无法正常运转。
- （2）证券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。
- （3）连续两个开放日发生巨额赎回。

（4）发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况。但当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金赎回申请或延缓支付赎回款项。

（5）法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已接受的赎回申请，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，延期支付最长不得超过支付时间 20 个工作日，并在指定媒介上公告。投资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予以公告。

3、暂停基金的申购、赎回，基金管理人应按规定公告并报中国证监会备案。

4、暂停期间结束，基金重新开放时，基金管理人应按规定公告并报中国证监会备案。

（1）如果发生暂停的时间为一天，基金管理人将于重新开放日，在指定媒介刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并公告最新的基金份额净值。

（2）如果发生暂停的时间超过一天但少于两周，暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人将提前 1 个工作日，在指定媒介刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最新的基金份额净值。

（3）如发生暂停的时间超过 2 周，暂停期间，基金管理人应每 2 周至少刊登暂停公告 1 次。暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 2 日在至少一种指定媒介上连续刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近 1 个开放日的基金份额净值。

#### （九）巨额赎回的认定及处理方式

##### 1、巨额赎回的认定

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）超过上一日基金总份额的 10% 时，为巨额赎回。

##### 2、巨额赎回的处理方式

出现巨额赎回时，基金管理人可以根据本基金当时的资产组合状况决定接受全额赎回或部分延期赎回。

（1）接受全额赎回：当基金管理人认为有能力兑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者的赎回申请有困难或认为因支付投资者的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一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。

在单个基金份额持有人超过基金总份额 20% 以上的赎回申请情形下，本基金将按照以下规则实施延期办理赎回申请：若发生巨额赎回，存在单个基金份额持有人超过基金总份额 20% 以上（“大额赎回申请人”）的赎回申请情形，基金管理人可以按照保护其他赎回申请人（“普通赎回申请人”）利益的原则，优先确认普通赎回申请人的赎回申请，在当日可接受赎回的范围内对普通赎回申请人的赎回申请予以全部确认或按单个账户赎回申请量占普通赎回申请人赎回申请总量的比例确认；在普通赎回申请人的赎回申请全部确认且当日接受赎

回比例不低于上一开放日基金总份额的 10%的前提下，在仍可接受赎回申请的范围内对大额赎回申请人的赎回申请按比例确认。

对于未能赎回部分，投资者在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资者在提交赎回申请时未作明确选择，投资者未能赎回部分作自动延期赎回处理。部分延期赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

（3）暂停赎回：连续 2 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，但不得超过支付时间 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时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，并在 2 日内在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

当发生巨额赎回并延期办理时，基金管理人应在 2 个工作日内通过指定媒介、基金管理人公司网站或代销机构的网点刊登公告，说明有关处理方法。

1、发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人当日应在规定期限内至少一种指定媒介上刊登暂停公告。

2、如发生暂停的时间为 1 日，第 2 个工作日基金管理人应在至少一种指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近 1 个开放日的基金份额净值。

3、如发生暂停的时间超过 1 日但少于 2 周，暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 2 个工作日在至少一种指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近 1 个开放日的基金份额净值。

4、如发生暂停的时间超过 2 周，暂停期间，基金管理人应每 2 周至少刊登暂停公告 1 次。暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 2 个工作日在至少一种指定媒介上连续刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近 1 个开放日的基金份额净值。

#### （十一）基金的非交易过户

指基金登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行而产生的非交易过户。无论在上述何种



情况下，接受划转的主体必须是合格的投资人。

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自申请受理日起2个月内办理，并按基金登记机构规定的标准收费。

#### （十二）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。

## 九、与基金管理人管理的其他基金转换

### （一）基金转换申请人的范围

本基金的持有人均可以按照基金合同的规定申请和办理本基金与基金管理人管理的其他基金的转换。

（二）基金转换受理场所基金转换业务的具体办理时间、流程以销售机构及其网点的安排和规定为准。

基金转换只能在同一销售机构进行，转换的两只基金必须都是该销售机构代理销售的本公司管理的基金。

### （三）基金转换受理时间

投资人可以在基金开放日的交易时间段申请办理基金转换业务，具体办理时间与基金申购、赎回业务办理时间一致。

### （四）基金转换费用

本基金与公司管理的其他基金间的转换，转换费用由二部分组成：转出基金赎回费和转入基金与转出基金的申购补差费。

**赎回费：**按转出基金正常赎回时的赎回费率收取费用。其中 25%归转出基金基金财产，其余作为登记费和相关的手续费。

**申购补差费：**按照转入基金与转出基金的申购费率的差额收取补差费。转出基金金额所对应的转出基金申购费率低于转入基金的申购费率的，补差费率为转入基金和转出基金的申购费率差额；转出基金金额所对应的转出基金申购费率高于转入基金的申购费率的，补差费为零。

### （五）基金转换公式

#### 1、基金转换公式为：

转出费用=转出份额×转出基金份额净值×转出基金赎回费率

转出总金额=转出份额×转出基金份额净值

净转出金额=转出总金额-转出费用

净转入金额=净转出金额/（1+补差费率）

（补差费率=转出基金申购费率与转入基金申购费率差）

转换补差费用=净转出金额-净转入金额

转入份额=净转入金额/转入基金份额净值

转入份额保留小数点后两位，小数点后两位以后的余额对应的部分计入基金财产。

2、基金管理人在不损害本基金份额持有人权益的情况下可更改上述公式，但应最迟在新的公式适用前 3 个工作日予以公告。

（六）不同基金之间的转换不影响投资者的持有基金时间的计算。

（七）基金转换的程序

1、基金转换的申请方式

基金份额持有人必须根据基金管理人和基金销售代理人规定的手续，在开放日的交易时间段内提出基金转换申请。

2、基金转换申请的确认

基金管理人以收到基金转换申请的当天作为基金转换申请日（T 日），并在 T+1 工作日对该交易的有效性进行确认。投资人可在 T+2 工作日及之后到其提出基金转换申请的网点进行成交查询。

基金份额持有人申请转换时，基金管理人按先进先出的原则对该持有人基金账户在该销售机构托管的基金份额进行处理，即先确认的份额先转换，后确认的份额后转换。

（八）基金转换的数额限制

基金份额持有人可将其全部或部分基金份额转换成已开通转换业务的另一只基金，本基金单笔转出申请不得少于 1 份（如该账户在该销售机构托管的该基金份额余额不足 1 份，则必须一次性赎回或转出该基金全部份额），因为转换等非赎回原因导致投资者在销售机构保留的基金份额余额少于该基金最低保留份额数量限制的，登记机构不作强制赎回处理。基金管理人可根据市场情况制定或调整上述基金转换的程序及有关限制，但应在调整生效前在至少一种中国证监会指定的媒体上予以公告。

（九）基金转换的登记

1、基金投资人提出的基金转换申请，在当日交易时间内可以撤销，交易时间结束后不得撤销。

2、基金登记机构在 T+1 日内对基金份额持有人基金转换申请进行确认，确认成功后为基金份额持有人办理相关的登记手续。

3、基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述登记办理时间进行调整，并最迟于开始实施前 3 个工作日予以公告。

（十）拒绝或暂停基金转换的情形及处理方式

1、除非出现如下情形，基金管理人不得拒绝或暂停接受基金份额持有人的基金转换申

请：

- （1） 不可抗力；
- （2） 货币市场工具主要交易场所在交易时间非正常停市；
- （3） 基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔转换；
- （4） 暂停估值；
- （5） 法律、法规规定或中国证监会认定的其他情形。

如果基金份额持有人的基金转换申请被拒绝，基金份额持有人持有的原基金份额不变。

2、发生上述情形之一的，基金管理人应在当日立即向中国证监会备案。

3、发生基金合同或招募说明书中未予载明的事项，但基金管理人认为有正当理由认为需要拒绝或暂停接受基金转换申请的，应当报中国证监会备案。

4、暂停基金转换，基金管理人应立即在至少一种指定媒介上公告。

5、暂停期结束，基金管理人应当公告最新的基金收益和转份额的情况。

如果发生暂停的时间为1日，基金管理人应于重新开放日在至少一种指定信息披露媒介上刊登基金重新开放基金转换的公告，并公告最新的基金收益情况。

如果发生暂停的时间超过1日但少于两周，暂停结束，重新开放基金转换时，基金管理人应提前1个工作日在至少一种指定媒介刊登基金重新开放基金转换的公告，并在重新开放基金转换日公告最新的基金收益情况。

如果发生暂停的时间超过两周，暂停期间，基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次；当连续暂停时间超过两个月时，可对重复刊登暂停公告的频率进行调整。暂停结束，重新开放基金转换时，基金管理人应提前3个工作日在至少一种指定媒介上连续刊登基金重新开放基金转换的公告，并在重新开放基金转换日公告最新的基金收益的情况。

## 十、基金的投资

(一) 本基金投资目标、范围、策略、业绩比较基准和风险收益特征

### 1、投资目标

把握行业发展趋势和市场运行趋势，精选增长前景良好或周期复苏的行业和企业，在控制风险的前提下，追求基金净值的稳定增长和基金资产的长期增值。

### 2、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，主要包括国内依法发行、上市的股票（包括存托凭证）、债券以及经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具，如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

### 3、投资策略

#### (1) 资产配置策略

本基金采取积极的资产配置策略，通过宏观策略研究，结合公司自行开发的数量化辅助模型，对相关资产类别的预期收益进行动态跟踪，决定大类资产配置比例。本基金的投资比例范围为：股票占基金资产总值的 60%—95%，权证占 0%—3%，资产支持证券占 0%—20%，债券占 5%—40%（其中，现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年内的政府债券比例在 5%以上）。

#### (2) 股票投资策略

##### 1) 行业配置策略

###### a. 行业精选依据

通过研究，本公司发现，有些长期增长前景良好的行业在股票市场持续表现良好，还有部分行业则由于周期性复苏等原因在某些特定阶段表现良好。

本公司旨在抓住长期向好行业并利用行业表现阶段性现象，精选出增长前景良好或周期复苏的行业，进行集中投资，为持有人创造长期的超额回报。

###### b. 行业精选方法

本基金将采用的行业精选的投资思路主要是通过分析宏观经济、产业政策和行业景气程度，精选发展前景良好或景气程度向好的行业，通过行业估值模型与波特五力分析，加强对有吸引力行业的配置。

###### ➤ 行业精选

本基金通过分析宏观经济、产业政策和行业景气程度，精选增长前景持续向好或宏观经济周期影响下行业景气复苏或上升的行业。

增长前景持续向好的行业包括：

- 处于生命周期的快速增长阶段的行业
- 受外部因素影响、前景看好的行业
  - 国家政策鼓励的行业
  - 经济发展趋势中受益的行业
  - 符合社会发展趋势的行业
  - 得益于科技发展及技术进步的行业

不同行业在经济周期的不同阶段表现有明显差异，而股票市场通常是实体经济的提前反映。通过以上对行业所处生命周期、影响行业发展的因素及宏观经济周期进行分析，可了解行业的周期性特征和未来的发展潜力，本管理人将据此精选出经济周期影响下的景气程度恢复或上升的行业做为本基金的一个行业投资方向。

#### ➤ 辅助判断

行业估值模型由本公司自行开发。经过历史数据的验证，该模型具备较高的预测准确性和稳定性。而波特五力分析(Porter's five forces)是对行业吸引力、竞争力和企业战略分析的经典模型。波特认为，任何产业的竞争规律都将体现在五种竞争作用力当中：新的竞争对手入侵、替代品的威胁、客户的议价能力、供应商的议价能力和现有竞争对手之间的竞争。这五种竞争作用力影响着价格、成本和企业所需的投资，因此综合起来决定着某行业的吸引力和行业中企业的盈利能力。

通过以上的行业精选和辅助判断，本基金将选择增长前景持续向好、经济周期影响下的行业景气恢复或上升的行业，并加强对有吸引力行业的配置，最终决定本基金的行业配置比例。

#### 2) 个股精选策略

在行业配置比例确定后，本基金将在公司股票库中使用定量和定性相结合的方法精选个股并进行定期调整。

本基金首先将对公司股票库相关精选行业的股票运用定量指标筛选排名靠前的股票作为本基金的备选库。定量分析使用的指标包括成长指标、价值指标和盈利指标，并且针对不同行业采取相应的估值方法。

- a. 成长指标：过去三年平均主营业务收入增长率、过去三年平均息税折旧前利润

（EBITA）增长率、未来一年预测每股收益（EPS）增长率

b. 价值指标：预测动态市盈率、市净率

c. 盈利指标：过去三年平均净资产收益率（ROE）、过去三年平均投资回报率（ROIC）

然后，本基金将对排名靠前的上市公司进行进一步案头研究和实地调研，运用 SWOT 分析对个股的基本面做定性的分析，判断企业是否具备以下特征：

a. 行业地位突出、有市场定价能力

b. 主营业务鲜明且具备核心竞争力

c. 公司治理结构规范，管理能力强

d. 具备长远规划

e. 注重股东回报和投资者关系

f. 有自主品牌和创新能力

最后精选个股形成投资组合。

### （3）债券投资策略

本基金将通过大资产配置、分类资产配置和个券选择三个层次自上而下进行债券投资管理，以追求稳定收益和充分流动性的投资目标。

大资产配置主要是通过对宏观经济趋势、金融货币政策和利率趋势的判断对货币资产和债券类资产进行选择配置，同时也在银行间市场、交易所债券市场进行选择配置。

分类资产配置主要通过分析债券市场变化、投资人行为、品种间相对价值变化、债券供求关系变化和信用分析进行分类品种配置。可选择配置的品种范围有国债、金融债、企业债、央票、短期融资券。

品种选择上，主要通过利率趋势分析、投资人偏好分析、对收益率曲线形态变化的预期、信用评估、市场收益率定价、流动性分析，筛选出流动性良好，成交活跃、符合目标久期、到期收益率有优势且信用风险较低的券种。

主要采用的投资策略包括：

1) 久期灵活管理：在对宏观经济趋势、金融货币政策和利率趋势的判断基础上，确定债券组合久期目标范围，在可接受范围内可以按照市场实际变化灵活管理久期长短，以获取市场超额收益。

2) 曲线合理定价：按照市场各品种实际成交情况，得出合理收益率曲线，使用该曲线对备选品种进行合理定价，确定其公允价格，在此基础上筛选出价格低于其合理价值的品种。

3) 曲线下滑策略: 对收益率曲线形态进行分析, 并预测其未来形态变化, 选择收益率曲线段上斜率最高区间进行下滑操作, 买入曲线上端品种, 等待其剩余年期缩短而自然形成收益率下滑, 从而得到超额下滑利润。

#### (4) 存托凭证投资策略

对于存托凭证投资, 本基金将在深入研究的基础上, 通过定性分析和定量分析相结合的方式, 精选出具有比较优势的存托凭证。

#### (5) 其他品种投资策略

本基金将根据市场的实际情况及基金的申购赎回状况, 将部分资产投资于中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具, 包括但不限于可转换债券、央行票据, 捕捉市场机会, 提高基金资产的使用效率。央行票据的投资策略见债券投资策略, 可转换债券采用自上而下的两层次配置策略, 在对宏观经济、行业分析的基础上, 选择有成长性、前景看好的行业进行配置。最后落实到个股分析、转债具体条款分析、股性、债性分析上。利用转债的债性规避股市系统性风险和个股风险、追求投资组合的安全和稳定收益, 并利用其股性在股市上涨中分享到行业和公司成长带来的收益。

另外, 本基金具备投资权证的条件。本基金在权证投资中将对权证标的证券的基本面进行研究, 结合期权定价模型和我国证券市场的交易制度估计权证价值, 主要考虑运用的策略包括: 杠杆策略、价值挖掘策略、获利保护策略、价差策略、双向权证策略、卖空有保护的认购权证策略、买入保护性的认沽权证策略等。

### 4、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数收益率。

沪深 300 指数是第一个覆盖了沪深两市的交易所权威指数, 具有市值覆盖率高、行业代表性强、流动性好等特点。

当市场出现更合适、更权威的比较基准时, 经基金托管人同意, 本基金管理人履行适当程序后, 可选用新的比较基准, 并将及时公告。

### 5、风险—收益特征

本基金是一只主动投资的混合型基金, 其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金, 高于债券型基金、货币市场基金。

## (二) 投资程序

### 1、投资决策委员会负责投资决策



投资决策委员会定期和不定期召开会议，负责就基金重大战略和资产配置做出决策。

## 2、研究部负责投资研究和分析

宏观研究人员通过研究其他证券公司和基金管理公司的报告，通过走访政府决策部门和研究部门，研究经济形势、经济政策（货币政策、财政政策、区域政策、产业政策等）、重大技术发明等，撰写宏观研究报告，就基金的股票、债券、现金比例提出建议。

行业研究人员对各行业进行深入细致的分析，精选增长前景良好或周期复苏的行业，并考察上市公司的核心业务竞争力、经营能力和公司治理结构等，预测上市公司未来2—3年的经营情况，选择重点上市公司进行调研，撰写行业和子行业研究报告及上市公司调研报告，对个股买卖提出具体建议。

## 3、基金经理小组负责投资执行

基金经理小组根据宏观经济和行业发展，结合量化分析等工具对股市做出判断，提出投资组合的资产配置比例和行业配置比例建议，同时结合数量分析模型的股票排序和研究员的报告，形成投资计划提交投资决策委员会，并根据投资决策委员会的决策，具体实施投资计划。

经投资决策委员会和总经理审核投资组合方案后，基金经理向交易部下达具体的投资指令，交易员根据投资决定书执行指令。

## 4、绩效评估

主要包括四项核心功能：风格检验、风险评估、投资绩效的风险调整和业绩贡献，由绩效评估人员利用相关工具评估。

## 5、内部控制

内部控制委员会、督察长、内控审计风险管理部负责内控制度的制定，并检查执行情况。

### (三) 投资限制与禁止行为

#### 1、组合限制

本基金在投资策略上兼顾投资原则以及开放式基金的固有特点，通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。基金的投资组合将遵循以下限制：

- (1) 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%；
- (2) 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%；
- (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%；
- (5) 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%；

(6)本基金的投资比例范围为：股票占基金资产总值的 60%—95%，权证占 0%—3%，资产支持证券占 0%—20%，债券占 5%—40%（其中，现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年内的政府债券比例在 5%以上）；

(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)本基金投资的资产支持证券必须在全国银行间债券交易市场或证券交易所交易；

(12)本基金投资的资产支持证券须具有评级资质的资信评级机构进行持续信用评级。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，在持有期间如果其信用等级下降、不再符合投资标准，本基金应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

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

(14)本基金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%；

(15)保持不低于基金资产净值百分之五的现金或者到期日在一年以内的政府债券；

(16)本基金资产总值不超过本基金资产净值的 140%；

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

(18) 本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；

(19)本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

(20) 本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行，与境内上市交易的股票合并计算；

(21)法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定的投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

## 2、禁止行为

本基金禁止从事下列行为：

- (1) 承销证券；
- (2) 向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但是法律法规另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- (6) 买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；
- (7) 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；
- (8) 依照法律、行政法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

## (四) 基金的融资、融券

本基金可以按照国家的有关规定进行融资、融券。

## (五) 基金管理人代表基金行使股东权利的原则及方法

- 1、不谋求对上市公司的控股，不参与上市公司的经营管理；
- 2、有利于基金财产的安全与增值；
- 3、独立行使股东权利，保护基金投资人的利益；
- 4、基金管理人按照有关规定代表基金出席上市公司股东大会，行使股东权利，履行股东义务。

## (六) 基金的投资组合报告

本基金投资组合报告所载数据截至 2021 年 12 月 31 日，本报告中所列财务数据未经审计。

#### 1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,821,591,786.76	87.57
	其中：股票	1,821,591,786.76	87.57
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	234,165,723.95	11.26
	-	-	-
8	其他资产	24,337,033.56	1.17
9	合计	2,080,094,544.27	100.00

#### 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

##### (1) 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,101,976,794.23	53.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	400,946,359.89	19.60
E	建筑业	50,202,350.03	2.45
F	批发和零售业	46,295.34	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	4,608.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	128,309,935.64	6.27
J	金融业	102,836,830.61	5.03
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	49,630.82	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	29,758,645.98	1.45
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-

Q	卫生和社会工作	18,161.78	0.00
R	文化、体育和娱乐业	7,442,174.44	0.36
S	综合	-	-
	合计	1,821,591,786.76	89.04

(2) 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002241	歌尔股份	1,908,800	103,266,080.00	5.05
2	600905	三峡能源	13,518,200	101,521,682.00	4.96
3	688598	金博股份	250,188	88,826,747.52	4.34
4	002475	立讯精密	1,670,875	82,207,050.00	4.02
5	300274	阳光电源	509,318	74,258,564.40	3.63
6	600406	国电南瑞	1,802,600	72,158,078.00	3.53
7	600483	福能股份	3,748,025	61,017,847.00	2.98
8	601012	隆基股份	707,091	60,951,244.20	2.98
9	601615	明阳智能	2,078,272	54,242,899.20	2.65
10	601669	中国电建	6,210,275	50,179,022.00	2.45

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(1) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金未投资股指期货。

(2) 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(1) 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

(2) 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金未投资国债期货。

(3) 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

11、投资组合报告附注

(1) 基金管理人没有发现本基金投资的前十名证券的发行主体在报告期内被监管部门立案调查，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚，无证券投资决策程序需特别说明。

(2) 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

(3) 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	573,646.37
2	应收证券清算款	23,629,797.33
3	应收股利	-
4	应收利息	23,900.61
5	应收申购款	109,689.25
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	24,337,033.56

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

(6) 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，合计数可能不等于分项之和。

## 十一、基金的业绩

基金业绩截止日为 2021 年 12 月 31 日。基金过往业绩不代表未来表现，本报告中所列数据未经审计。净值增长率与同期比较基准收益率比较如下：

阶段	净值增长率 ①	净值增长率标准差 ②	业绩比较基准收益率 ③	业绩比较基准收益率标准差 ④	①-③	②-④
2007/06/14-2007/12/31	31.80%	1.49%	29.62%	2.13%	2.18%	-0.64%
2008/01/01-2008/12/31	-54.20%	2.38%	-65.95%	3.05%	11.75%	-0.67%
2009/01/01-2009/12/31	81.48%	1.58%	96.71%	2.06%	-15.23%	-0.48%
2010/01/01-2010/12/31	-9.04%	1.37%	-12.51%	1.58%	3.47%	-0.21%
2011/01/01-2011/12/31	-21.00%	1.07%	-25.01%	1.30%	4.01%	-0.23%
2012/01/01-2012/12/31	12.67%	1.16%	7.55%	1.28%	5.12%	-0.12%
2013/01/01-2013/12/31	18.64%	1.38%	-7.65%	1.39%	26.29%	-0.01%
2014/01/01-2014/12/31	17.35%	1.28%	51.66%	1.21%	-34.31%	0.07%
2015/01/01-2015/12/31	35.49%	2.61%	5.58%	2.48%	29.91%	0.13%
2016/01/01-2016/12/31	-18.62%	1.74%	-11.28%	1.40%	-7.34%	0.34%
2017/01/01-2017/12/31	6.96%	0.82%	21.78%	0.64%	-14.82%	0.18%
2018/01/01-2018/12/31	-32.34%	1.42%	-25.31%	1.34%	-7.03%	0.08%
2019/01/01-2019/12/31	24.87%	1.31%	36.07%	1.25%	-11.20%	0.06%

2020/01/01-2020/12/31	41.24%	1.68%	27.21%	1.43%	14.03%	0.25%
2021/01/01-2021/12/31	31.42%	1.40%	-5.20%	1.17%	36.62%	0.23%
2007/06/14-2021/12/31	128.36%	1.58%	19.96%	1.68%	108.40%	-0.10%



## 十二、基金财产

### （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、基金应收申购款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负债后的价值。

### （三）基金财产的账户

本基金财产以基金名义开立银行存款账户，以基金托管人的名义开立证券交易清算资金的结算备付金账户，以基金托管人和本基金联名的方式开立基金证券账户，以本基金的名义开立银行间债券托管账户。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）基金财产的处分

基金财产独立于基金管理人、基金托管人和代销机构的固有财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益归入基金财产。基金管理人、基金托管人可以按基金合同的约定收取管理费、托管费以及其他基金合同约定的费用。基金管理人、基金托管人以其自有财产承担法律责任，其债权人不得对基金财产行使请求冻结、扣押和其他权利。

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。

除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定处分外，基金财产不得被处分。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

## 十三、基金资产估值

### （一）估值日

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

### （二）估值方法

#### 1、股票估值方法：

（1）上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。

#### （2）未上市股票的估值：

1）首次发行未上市的股票，按成本计量；

2）送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价估值；

3）首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的市价估值；

4）非公开发行有明确锁定期的流通受限股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值；

（3）在任何情况下，基金管理人如采用本项第（1）—（2）小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第（1）—（2）小项规定的方法对基金资产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，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值；

（4）国家有最新规定的，按其规定进行估值。

#### 2、债券估值方法：

（1）证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，按最近交易日的收盘价估值；

（2）证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的应收利息（自债券计息起始日或上一起息日至估值当日的利息）得到的净价进行估值，估值日没有交易的，以最近交易日的收盘净价估值；

（3）发行未上市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，按成本进行后续计量；

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

(5)同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值；

(6)在任何情况下，基金管理人如采用本项第(1)－(5)小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第(1)－(5)小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上形成的债券估值，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；

(7)国家有最新规定的，按其规定进行估值。

### 3、权证估值方法：

(1)基金持有的权证，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，按最近交易日的收盘价估值；未上市交易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，按成本计量；

(2)在任何情况下，基金管理人如采用本项第(1)小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第(1)小项规定的方法对基金资产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，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值；

(3)国家有最新规定的，按其规定进行估值。

4、本基金投资存托凭证的估值核算，依照境内上市交易的股票执行。

5、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。

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

### (三)估值对象

基金所拥有的股票、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产。

### (四)估值程序

1、基金份额净值是按照每个开放日闭市后，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。

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。基金管理人每个开放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。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

#### （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）发生差错时，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、差错类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或登记结算机构、或代销机构、或投资人自身的过错造成差错，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该差错遭受损失的当事人（“受损方”）按下述“差错处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

上述差错的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等；对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平不能预见、不能避免、不能克服，则属不可抗力，按照下述规定执行。

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

#### 2、差错处理原则

(1) 差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已产生的差错，给当事人造成损失的，由差错责任方承担赔偿责任；若差错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。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正。

(2) 差错的责任方对可能导致有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对差错的有关直接当事人负责，不对第三方负责。

(3) 因差错而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但差错责任方仍应对差错负责。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”），则差错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差错责任方。

(4) 差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式。

(5) 差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人过错造成基金财产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人过错造成基金财产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。基金管理人、基金托管人及基金销售机构之外的第三方造成基金财产的损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错方追偿；追偿过程中产生的有关费用，应列入基金费用，从基金资产中支付。

(6) 如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿，并且依据法律法规、基金合同或其他规定，基金管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任，则基金管理人有权向出现过错的当事人进行追索，并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失。

(7) 按法律法规规定的其他原则处理差错。

### 3、差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

(1) 查明差错发生的原因，列明所有的当事人，并根据差错发生的原因确定差错的责任方；

(2) 根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；

(3) 根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失；

(4) 根据差错处理的方法，需要修改基金登记结算机构交易数据的，由基金登记结算机构进行更正，并就差错的更正向有关当事人进行确认。

### 4、基金份额净值差错处理的原则和方法如下：

(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) 因基金份额净值计算错误，给基金或基金份额持有人造成损失的，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。

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

(5)前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

#### (六) 暂停估值的情形

- 1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 2、因不可抗力或其它情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；
- 3、如出现基金管理人认为属于紧急事故的任何情况，会导致基金管理人不能出售或评估基金资产的；

4. 当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，应当暂停基金估值；

- 5、中国证监会认定的其它情形。

#### (七) 基金净值的确认

用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的基金资产净值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) 特殊情况的处理

1、基金管理人或基金托管人按股票估值方法的第(3)项、债券估值方法的第(6)项或权证估值方法的第(2)项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

2、由于不可抗力原因，或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等，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。但基金管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

## 十四、基金收益与分配

### （一）基金收益的构成

- 1、买卖证券差价；
- 2、基金投资所得红利、股息、债券利息；
- 3、银行存款利息；
- 4、已实现的其他合法收入；
- 5、持有期间产生的公允价值变动。

因运用基金财产带来的成本或费用的节约应计入收益。

### （二）基金净收益

基金净收益为基金收益扣除按国家有关规定可以在基金收益中扣除的费用后的余额。

### （三）收益分配原则

本基金收益分配应遵循下列原则：

- 1、本基金的每份基金份额享有同等分配权；
- 2、基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值；
- 3、收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将投资人的现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额；
- 4、本基金收益每年最多分配6次，每次基金收益分配比例不低于可分配收益的25%；
- 5、本基金收益分配方式
  - （1）基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式（将现金红利按除息日的该基金份额净值自动转为基金份额的方式），基金份额持有人可自行选择收益分配方式；基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金红利；
  - （2）分红方式的设置与变更投资人可在销售机构处对托管在该处的基金通过基金分红方式的设置和变更进行分红方式的选择，基金分红方式变更确认后对该销售机构账户内托管的该基金品种全部份额有效。投资人既未作账户分红方式选择也未作基金分红方式选择的情况下，分红方式根据本条第（1）项所述的默认分红方式确定，否则不再适用本条第（1）项所述的默认分红方式规则；
- 6、基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；
- 7、基金当年收益应先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配；

8、法律法规或监管机构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基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式、支付方式等内容。

(五)收益分配的时间和程序

1、基金收益分配方案由基金管理人拟订，由基金托管人复核，依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告；

2、在收益分配方案公布后，基金管理人依据具体方案的规定就支付的现金红利向基金托管人发送划款指令，基金托管人按照基金管理人的指令及时进行分红资金的划付。



## 十五、基金的费用

### （一）与基金运作有关的费用

#### 1、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）基金财产划拨支付的银行费用；
- （4）基金合同生效后的信息披露费用；
- （5）基金份额持有人大会费用；
- （6）基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
- （7）基金的证券交易费用；

（8）在中国证监会规定允许的前提下，本基金可以从基金财产中计提销售服务费，具体计提方法、计提标准在相关公告中载明；

- （9）依法可以在基金财产中列支的其他费用。

2、上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内按照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

#### 3、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

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日或不可抗力，支付日期顺延。

##### （2）基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日或不可抗力，支付日期顺延。

(3) 上述“1、基金费用的种类”中(3)到(9)项费用由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

#### 4、不列入基金费用的项目

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，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

5、基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。降低基金管理费率和基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会，但应报中国证监会批准。基金管理人必须最迟于新的费率实施 2 日前在至少一种指定媒介上刊登公告。

#### (二)与基金销售有关的费用

本基金的申购费、赎回费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式请详见本招募说明书“八、基金份额的申购、赎回、非交易过户与转托管”中的“(六)申购和赎回的价格、费用及用途”中的相关规定。

本基金与其他基金间的转换费的费率水平和计算方式请详见本招募说明书“九、与基金管理人管理的其他基金转换”一章中的相关规定。

## 十六、基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

## 十七、基金的会计与审计

### （一）基金的会计政策

- 1、基金管理人为本基金的会计责任方；
- 2、本基金的会计年度为公历每年的1月1日至12月31日，如果基金首次募集的会计年度，基金合同生效少于2个月，可以并入下一个会计年度；
- 3、本基金的会计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的会计制度；
- 5、本基金独立建账、独立核算；
- 6、基金管理人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、基金托管人定期与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并书面确认。

### （二）基金的审计

- 1、基金管理人聘请具有从事证券、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年度财务报表及其他规定事项进行审计。会计师事务所及其注册会计师与基金管理人、基金托管人相互独立。
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师时，应事先征得基金管理人同意。
- 3、基金管理人(或基金托管人)认为有充足理由更换会计师事务所，经基金托管人(或基金管理人)同意后可以更换。就更换会计师事务所，基金管理人应当依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

## 十八、基金的信息披露

一、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。

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

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

基金管理人、基金托管人和其他基金信息披露义务人应按规定将应予披露的基金信息披露事项在规定时间内通过中国证监会指定的全国性报刊（以下简称“指定报刊”）及指定互联网网站（以下简称“指定网站”）等媒介披露。

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份额发售机构；
5. 登载任何自然人、法人和非法人组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；
6. 中国证监会禁止的其他行为。

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

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

五、公开披露的基金信息包括：

### （一）招募说明书

招募说明书是基金向社会公开发售时对基金情况进行说明的法律文件。

基金管理人按照《基金法》、《信息披露办法》、基金合同编制并在基金份额发售的3日前，将基金招募说明书登载在指定报刊和网站上。《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。

## （二）基金合同、托管协议

基金管理人应在基金份额发售的3日前，将基金合同摘要登载在指定报刊和网站上；基金管理人、基金托管人应将基金合同、托管协议登载在各自网站上。

## （三）基金产品资料概要

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。

## （四）基金份额发售公告

基金管理人将按照《基金法》、《信息披露办法》的有关规定，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报刊和网站上。

## （五）基金合同生效公告

基金管理人将在基金合同生效的次日在指定报刊和网站上登载基金合同生效公告。基金合同生效公告中将说明基金募集情况。

## （六）基金净值信息

1、《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。

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

3、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。

## （七）基金份额申购、赎回价格

基金管理人应当在本基金的基金合同、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，并保证投资人能够在基金销售机构网站或营业网点查阅或者复制前述信息资料。

## （八）基金年度报告、基金中期报告、基金季度报告

1. 基金管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载在指定网站上，并将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计。

2. 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。

3. 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。

4. 基金合同生效不足 2 个月的，本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。

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

6. 本基金持续运作过程中，应当在基金年度报告和中期报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。

#### （九）临时报告与公告

在基金运作过程中发生如下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事件时，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，并登载在指定报刊和指定网站上：

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

12、基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；

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

14、基金收益分配事项；

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

16、基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；

17、本基金开始办理申购、赎回；

18、本基金发生巨额赎回并延期办理；

19、本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；

20、本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；

21、发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；

22、基金推出新业务或服务；

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

#### (十)澄清公告

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

#### (十一)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。

#### (十二)清算报告

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

#### (十三)中国证监会规定的其他信息

### 六、信息披露事务管理

基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度，指定专门部门及高级管理人



员负责管理信息披露事务。

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

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

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

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

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

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

#### 七、信息披露文件的存放与查阅

依法必须披露的信息发布后，基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于各自住所，供社会公众查阅、复制。投资人在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。

投资人也可在基金管理人指定的网站上进行查阅。

八、本基金信息披露事项以法律法规规定及本章节约定的内容为准。

## 十九、风险揭示

### （一）投资于本基金的风险

#### 1、市场风险

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

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

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

（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。利率直接影响着国债的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。基金投资于国债和股票，其收益水平会受到利率变化的影响。

#### 2、流动性风险

本基金属于开放式基金，基金管理人 有义务接受投资人的申购和赎回。不断变化的申购和赎回，尤其是发生大额申购和赎回时，即使市场行情没有发生显著变化的趋势，本基金也要进行股票买卖。然而，市场的流动性是变化的，不同时间段、不同的股票，其流动性都各不相同。一般来说，股市上涨期，市场流动性较高；股市下跌期，市场流动性低；大盘蓝筹股流动性高，小盘垃圾股流动性较低。如果市场流动性较差，导致本基金无法顺利买进或卖出股票，或者必须付出较高成本才能买进或卖出股票，这样，就在两个方面产生了风险：

（1）当发生巨额申购时，本基金由于不能顺利买进股票，使得本基金的持仓比例被动地发生变化，可能导致行情上涨时不能实现预期的投资收益目标，影响本基金的最终投资业绩；

（2）当发生巨额赎回时，如果市场流动性较差，本基金为了兑现持有人的赎回，必须以较高的代价卖出股票，从而影响本基金的投资业绩。

#### 3、本基金的特有风险

本基金作为混合型基金，在投资管理中会至少维持 60%的股票投资比例，具有对股票市场的系统性风险，不能完全规避市场下跌的风险和个股风险，在市场大幅上涨时也不能保证

基金净值能够完全跟随或超越市场上涨幅度。

同时，本基金的重点投资对象是增长前景持续向好、经济周期影响下的行业景气恢复或上升的行业内的股票。集中投资于几个有限的行业，风险较大。另外，除了对发展前景良好行业的投资，本基金还会关注景气恢复、具有阶段性表现的行业。如果基金管理人对其对行业景气程度、经济周期把握不当，或不具备明显的行业选择能力，可能会使其对阶段性表现的行业做出错误的判断，从而导致基金持有人的收益受到影响。基金管理人对其对行业的选时能力同样也可能影响基金的业绩表现，使基金表现在特定时期落后于大市或其它混合型基金。

另外，本基金可以投资权证，权证是金融衍生品的一种，具有高杠杆、高风险、高收益的特征，风险较大。

#### 4、本基金投资科创板股票存在的风险

##### ①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。

##### ②流动性风险

科创板整体投资门槛较高，个人投资者必须满足交易满两年并且资金在 50 万以上才可参与，二级市场上个人投资者参与度相对较低，机构持有个股大量流通盘导致个股流动性较差，基金组合存在无法及时变现及其他相关流动性风险。

##### ③退市风险

科创板退市制度较主板更为严格，退市时间更短，退市速度更快，退市情形更多，新增市值低于规定标准、上市公司信息披露或者规范运作存在重大缺陷导致退市的情形，执行标准更严，明显丧失持续经营能力，仅依赖与主业无关的贸易或者不具备商业实质的关联交易维持收入的上市公司可能会被退市；且不再设置暂停上市、恢复上市和重新上市环节，上市公司退市风险更大。

##### ④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。

#### 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。

#### 5、存托凭证的投资风险

本基金可投资存托凭证，基金净值可能受到存托凭证的境外基础证券价格波动影响，存托凭证的境外基础证券的相关风险可能直接或间接成为本基金的风险。

#### 6、管理风险

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

#### 7、操作或技术风险

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

#### 8、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。

9、本基金法律文件中涉及基金风险特征的表述与销售机构对基金的风险评级可能不一致的风险

本基金基金合同、招募说明书等法律文件中涉及基金风险收益特征或风险状况的表述仅为主要基于基金投资方向与策略特点的概括性表述，而本基金各销售机构依据中国证券投资基金业协会发布的《基金募集机构投资者适当性管理实施指引（试行）》及内部评级标准，将基金产品按照风险由低到高顺序进行风险级别评定划分，其风险评级结果所依据的评价要素可能更多、范围更广，与本基金法律文件中的风险收益特征或风险状况表述并不必然一致或存在对应关系。同时，不同销售机构因其采取的具体评价标准和方法的差异，对同一产品风险级别的评定也可能各有不同，销售机构还可能根据监管要求、市场变化及基金实际运作

情况等适时调整对本基金的风险评级。敬请投资人知悉，在购买本基金时按照销售机构的要求完成风险承受能力与产品风险之间的匹配检验，并须及时关注销售机构对于本基金风险评级的调整情况，谨慎作出投资决策。

#### 10、其他风险

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

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

#### （二）声明

1、本基金未经任何一级政府、机构及部门担保。投资人自愿投资于本基金，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，本基金还通过代销机构代理销售，但是，基金并不是代销机构的存款或负债，也没有经代销机构担保或者背书，代销机构并不能保证其收益或本金安全。

## 二十、基金合同的变更、终止与基金财产清算

### （一）基金合同的变更

1、基金合同变更内容对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的，应召开基金份额持有人大会，基金合同变更的内容应经基金份额持有人大会决议同意。

- (1) 终止基金合同；
- (2) 转换基金运作方式；
- (3) 变更基金类别；
- (4) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略；
- (5) 变更基金份额持有人大会程序；
- (6) 更换基金管理人、基金托管人；
- (7) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准。但根据适用的相关规定提高该等报酬标准的除外；
- (8) 本基金与其他基金的合并；
- (9) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；
- (10) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

但出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会决议，由基金管理人和基金托管人同意变更后公布，并报中国证监会备案：

- (1) 调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；
- (2) 在法律法规和基金合同规定的范围内变更基金的申购费率、赎回费率或收费方式；
- (3) 因相应的法律法规发生变动必须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) 基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；
- (6) 按照法律法规或基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

2、关于变更基金合同的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，并自生效之日起2日内在至少一种指定媒介公告。

### （二）基金合同的终止

有下列情形之一的，基金合同将终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在6

个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务；

3、基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而在 6 个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务；

4、中国证监会允许的其他情况。

### (三) 基金财产的清算

#### 1、基金财产清算组

(1) 基金合同终止时，成立基金财产清算组，基金财产清算组在中国证监会的监督下进行基金清算。

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

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

#### 2、基金财产清算程序

基金合同终止后，发布基金财产清算公告。

(1) 基金合同终止时，由基金财产清算组统一接管基金财产；

(2) 对基金财产进行清理和确认；

(3) 对基金财产进行估价和变现；

(4) 聘请律师事务所出具法律意见书；

(5) 聘请会计师事务所对清算报告进行审计；

(6) 将基金财产清算结果报告中国证监会；

(7) 参加与基金财产有关的民事诉讼；

(8) 公布基金财产清算结果；

(9) 对基金剩余财产进行分配。

#### 3、清算费用

清算费用是指基金财产清算组在进行基金财产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组优先从基金财产中支付。

#### 4、基金财产按下列顺序清偿：

(1) 支付清算费用；

(2) 交纳所欠税款；

(3) 清偿基金债务；

(4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款(1)–(3)项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

#### 5、基金财产清算的公告

基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算组公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算结果经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，由基金财产清算组报中国证监会备案并公告。

#### 6、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。



## 二十一、基金合同的内容摘要

### （一）基金合同当事人及权利义务

#### 1、基金管理人的权利与义务

##### （1）基金管理人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的权利为：

- 1) 自基金合同生效之日起，依照有关法律法规和基金合同的规定独立运用基金财产；
- 2) 依照基金合同获得基金认购和申购费用、基金赎回手续费用和管理费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；
- 3) 发售基金份额；
- 4) 依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- 5) 在符合有关法律法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则；
- 6) 根据基金合同及有关规定监督基金托管人，对于基金托管人违反了基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；
- 7) 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购、赎回和转换申请；
- 8) 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、融券；
- 9) 自行担任或选择、更换登记结算机构，获取基金份额持有人名册，并对登记结算机构的代理行为进行必要的监督和检查；
- 10) 选择、更换代销机构，并依据销售代理协议和有关法律法规，对其行为进行必要的监督和检查；
- 11) 选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；
- 12) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- 13) 依法召集基金份额持有人大会；
- 14) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

##### （2）基金管理人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的义务为：

- 1) 依法募集基金，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、勤勉尽责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) 计算并公告基金净值信息, 确定基金份额申购、赎回价格;
- 9) 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;
- 10) 按规定受理申购和赎回申请, 及时、足额支付赎回款项;
- 11) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;
- 12) 编制季度报告、中期报告和年度报告;
- 13) 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;
- 14) 保守基金商业秘密, 不得泄露基金投资计划、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, 不得向他人泄露;
- 15) 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;
- 16) 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;
- 17) 保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料;
- 18) 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;
- 19) 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;
- 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, 应当承担赔偿责任, 其赔偿责任不因其退任而免除;
- 21) 基金托管人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托管人追偿;
- 22) 按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料;

23) 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；

24) 执行生效的基金份额持有人大会决议；

25) 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

26) 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，不谋求对上市公司的控股和直接管理；

27) 法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

## 2、基金托管人的权利与义务

### （1）基金托管人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的权利为：

1) 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收入；

2) 监督基金管理人对本基金的投资运作；

3) 自基金合同生效之日起，依法保管基金资产；

4) 在基金管理人更换时，提名新任基金管理人；

5) 根据基金合同及有关规定监督基金管理人，对于基金管理人违反基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；

6) 依法召集基金份额持有人大会；

7) 按规定取得基金份额持有人名册资料；

8) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

### （2）基金托管人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的义务为：

1) 安全保管基金财产；

2) 设立专门的基金托管部，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) 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；

4) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得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和证券账户；

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应予保密，不得向他人泄露；

8) 对基金财务会计报告、中期和年度基金报告出具意见，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；

9) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

10) 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；

11) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

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

13) 按照规定监督基金管理人的投资运作；

14) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

15) 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；

16) 按照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自行召集基金份额持有人大会；

17) 因违反基金合同导致基金财产损失，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

18) 基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿；

19) 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；

20) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行业监督管理机构，并通知基金管理人；

21) 执行生效的基金份额持有人大会决议；

22) 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

23) 建立并保存基金份额持有人名册；

24) 法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

### 3、基金份额持有人的权利与义务

#### (1) 基金份额持有人权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的权利为：

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；
- 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、基金份额销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；
- 9) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

每份基金份额具有同等的合法权益。

#### （2）基金份额持有人义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的义务为：

- 1) 遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；
- 2) 交纳基金认购、申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用；
- 3) 在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；
- 4) 不从事任何有损基金及其它基金份额持有人合法权益的活动；
- 5) 执行生效的基金份额持有人大会决议；
- 6) 返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人及基金管理人的代理人、基金托管人、代销机构、其他基金份额持有人处获得的不当得利；
- 7) 法律法规和基金合同规定的其他义务。

#### （二）基金份额持有人大会

1、 基金份额持有人大会由基金份额持有人或其合法的代理人共同组成。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

##### 2、 召开事由

（1）当出现或需要决定下列事由之一的，经基金管理人、基金托管人或持有基金份额 10% 以上(含 10%，下同)的基金份额持有人(以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同)提议时，应当召开基金份额持有人大会：

- 1) 终止基金合同；
- 2) 转换基金运作方式；
- 3) 变更基金类别；

- 4) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略；
- 5) 变更基金份额持有人大会程序；
- 6) 更换基金管理人、基金托管人；
- 7) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准。但根据适用的相关规定提高该等报酬标准的除外；

- 8) 本基金与其他基金的合并；
- 9) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；
- 10) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

(2) 出现以下情形之一的，可由基金管理人和基金托管人协商后修改基金合同，不需召开基金份额持有人大会：

- 1) 调低基金管理费、基金托管费、其他应由基金承担的费用；
- 2) 在法律法规和基金合同规定的范围内变更基金的申购费率、赎回费率或收费方式；
- 3) 因相应的法律法规发生变动必须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) 基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；
- 6) 按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

### 3、 召集人和召集方式

(1) 除法律法规或本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，开会时间、地点、方式和权益登记日由基金管理人选择确定。基金管理人未按规定召集或者不能召集时，由基金托管人召集。

(2) 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，应当自行召集并确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

(3) 代表基金份额 10%以上的基金份额持有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。

（4）代表基金份额 10%以上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，代表基金份额 10%以上的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会，但应当至少提前 30 日向中国证监会备案。

（5）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。

#### 4、 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）基金份额持有人大会的召集人(以下简称“召集人”)负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。召开基金份额持有人大会，召集人必须于会议召开日前 30 天在指定媒介公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容：

- 1) 会议召开的时间、地点和出席方式；
- 2) 会议拟审议的主要事项；
- 3) 会议形式；
- 4) 议事程序；
- 5) 有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人权益登记日；
- 6) 代理投票的授权委托书的内容要求(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；
- 7) 表决方式；
- 8) 会务常设联系人姓名、电话；
- 9) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- 10) 召集人需要通知的其他事项。

（2）采用通讯方式开会并进行表决的情况下，由召集人决定通讯方式和书面表决方式，并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、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式、投票表决的截止日以及表决票的送达地址等内容。

（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书面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书面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书面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

表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

#### 5、 基金份额持有人出席会议的方式

##### （1）会议方式

1) 基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会。

2) 现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席，如基金管理人或基金托管人拒不派代表出席的，不影响表决效力。

3) 通讯方式开会指按照本基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。

4) 会议的召开方式由召集人确定，但决定转换基金运作方式、基金管理人更换或基金托管人更换、终止基金合同的事宜必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

##### （2）召开基金份额持有人大会的条件

##### 1) 现场开会方式

在同时符合以下条件时，现场会议方可举行：

a) 对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示，全部有效凭证所对应的基金份额应占权益登记日基金总份额的二分之一以上(含二分之一，下同)；

b) 到会的基金份额持有人身份证明及持有基金份额的凭证、代理人身份证明、委托人持有基金份额的凭证及授权委托书代理手续完备，到会者出具的相关文件符合有关法律法规和基金合同及会议通知的规定，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) 通讯开会方式

在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

a) 召集人按基金合同规定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告；

b) 召集人按基金合同规定通知基金托管人或/和基金管理人(分别或共同称为“监督人”)

到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；

c) 召集人在监督人和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的书面表决意见，如基金管理人或基金托管人经通知拒不到场监督的，不影响表决效力；

d) 本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的二分之一以上；

e) 直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证、授权委托书



书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与登记结算机构记录相符。

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，否则表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入基金份额持有人所代表的基金份额总数。

## 6、 议事内容与程序

### (1) 议事内容及提案权

1) 议事内容为本基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容。

2) 基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日本基金总份额 10%以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前就召开事由向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案。

3) 对于基金份额持有人提交的提案，大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

关联性。大会召集人对于基金份额持有人提案涉及事项与基金有直接关系，并且不超出法律法规和基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的，应提交大会审议；对于不符合上述要求的，不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会上解释和说明。

程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题做出决定。如将其提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会做出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

4) 单独或合并持有权利登记日基金总份额 10%以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于 6 个月。法律法规另有规定的除外。

5) 基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后，如果需要对原有提案进行修改，应当在基金份额持有人大会召开前及时公告。

### (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规定程序宣布会议议事程序及注意事项，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，经合法执业的律师见证后形成大会决议。

大会由召集人授权代表主持。基金管理人为召集人的，其授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权代表主持；基金托管人为召集人的，其授权代表未能主持大会的情况下，由基金管理人授权代表主持；如果基金管理人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以所代表的基金份额二分之一以上（含二分之一）多数选举产生一名代表作为该次基金份额持有人大会的主持人。

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)、身份证号码、住所、持有或代表有表决权的基金份额数量、委托人姓名(或单位名称)等事项。

## 2) 通讯方式开会

在通讯表决开会的方式下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后第 2 个工作日统计全部有效表决，在公证机关及监督人的监督下形成决议。如监督人经通知但拒绝到场监督，则在公正机关监督下形成的决议有效。

(3) 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。

## 7、 决议形成的条件、表决方式、程序

(1) 基金份额持有人所持每一基金份额享有平等的表决权。

(2) 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

一般决议须经出席会议的基金份额持有人（或其代理人）所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过方为有效，除下列 2) 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

特别决议须经出席会议的基金份额持有人(或其代理人)所持表决权的三分之二以上(含三分之二)通过方为有效；涉及更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式、终止基金合同、与其他基金合并必须以特别决议通过方为有效。

(3) 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。

(4) 基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

(5) 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。

## 8、 计票

### (1) 现场开会

1) 如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，则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推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，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推举两名基金份额持有人代表与基金管理人、基金托管人授权的一名监督员共同担任监票人；但如果基金管理人和基金托管人的授权代表未出席，则大会主持人可自行选举三名基金份额持有人代表担任监票人。

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

3) 如大会主持人对于提交的表决结果有异议，可以对投票数进行重新清点；如大会主持人未进行重新清点，而出席大会的基金份额持有人或代理人对大会主持人宣布的表决结果有异议，其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点，大会主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

## （2）通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监票人在监督人派出的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；如监督人经通知但拒绝到场监督，则大会召集人可自行授权 3 名监票人进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

## 9、 生效与公告

（1）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。

（2）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。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决议。

（3）基金份额持有人大会决议应自生效之日起 2 日内在至少一种指定媒介公告。

（4）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、公证机关、公证员姓名等一同公告。

10、法律法规或监管部门对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

## （三）基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同经中国证监会核准后将终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在 6

个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务；

3、基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而在 6 个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务；

4、中国证监会允许的其他情况。

#### （四）基金财产的清算

##### 1、基金财产清算组

(1)基金合同终止时，成立基金财产清算组，基金财产清算组在中国证监会的监督下进行基金清算。

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

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

##### 2、基金财产清算程序

基金合同终止后，发布基金财产清算公告；

(1)基金合同终止时，由基金财产清算组统一接管基金财产；

(2)对基金财产进行清理和确认；

(3)对基金财产进行估价和变现；

(4)聘请律师事务所出具法律意见书；

(5)聘请会计师事务所对清算报告进行审计；

(6)将基金财产清算结果报告中国证监会；

(7)参加与基金财产有关的民事诉讼；

(8)公布基金财产清算结果；

(9)对基金剩余财产进行分配。

##### 3、清算费用

清算费用是指基金财产清算组在进行基金财产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组优先从基金财产中支付。

##### 4、基金财产按下列顺序清偿：

(1)支付清算费用；

(2)交纳所欠税款；

(3)清偿基金债务；

(4)按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款(1)–(3)项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

#### 5、基金财产清算的公告

基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算组公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算结果经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，由基金财产清算组报中国证监会备案并公告。

#### 6、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

#### （五）争议解决方式

对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

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

本基金合同受中国法律管辖。

#### （六）基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

基金管理人应在基金份额发售的 3 日前，将基金合同摘要登载在指定报刊和网站上；基金管理人、基金托管人应将基金合同、托管协议登载在各自网站上。

基金合同可印制成册，供基金投资人在基金管理人、基金托管人、代销机构和登记机构办公场所查阅，投资人在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件，但其效力应以基金合同正本为准。

## 二十二、基金托管协议内容摘要

### （一）托管协议当事人

#### 1、基金管理人

名称：华宝基金管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼

邮政编码：200120

法定代表人：孔祥清

成立日期：2003 年 3 月 7 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2003]19 号

组织形式：中外合资经营

注册资本：1.5 亿元人民币

存续期间：持续经营

经营范围：基金管理业务、发起设立基金及中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）批准的其他业务

#### 2、基金托管人

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

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

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）基金托管人与基金管理人之间的业务监督、核查

### 1、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

（1）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和交易对手库，以便基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，主要包括国内依法发行、上市的股票（包括存托凭证）、债券以及经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具，如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资比例范围为：股票占基金资产总值的60%—95%，权证占0%—3%，资产支持证券占0%—20%，债券占5%—40%（其中，现金或者到期日在一年内的政府债券比例在5%以上）。

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

- 1) 本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的10%；
- 2) 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%；
- 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%；
- 5) 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%；
- 6) 基金股票、权证、债券、现金的投资比例范围为：股票占基金资产总值的60%—95%，权证占0%—3%，资产支持证券占0%—20%，债券及现金占5%—40%（其中，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于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) 本基金投资的资产支持证券必须在全国银行间债券交易市场或证券交易所交易；

12) 本基金投资的资产支持证券须具有评级资质的资信评级机构进行持续信用评级。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，在持有期间如果其信用等级下降、不再符合投资标准，本基金应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出；

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

14) 本基金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%；

15) 保持不低于基金资产净值百分之五的现金或者到期日在一年以内的政府债券；

16) 本基金资产总值不超过本基金资产净值的140%；

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

18) 本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%；

19) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

20) 本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行，与境内上市交易的股票合并计算；

21) 法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整。

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。

(3) 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进行监督。基金托管人通过事后监督方式对基金管理人基金投资禁止行为和关联交易进行监督。根据法律法规有关基金禁止从事关联交易的规定，基金管理人和基金托管人应事先相互提供与本机构有控股关系的股东、与本机构有其他重大利害关系的公



司名单及有关关联方交易证券名单。基金管理人和基金托管人均有责任确保关联交易名单的真实性、准确性、完整性，并负责及时将更新后的名单发送对方。

若基金托管人发现基金管理人与关联交易名单中列示的关联方进行法律法规禁止基金从事的关联交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人采取必要措施阻止该关联交易的发生，如基金托管人采取必要措施后仍无法阻止关联交易发生时，基金托管人有权向中国证监会报告。对于基金管理人已成交的关联交易，基金托管人事前无法阻止该关联交易的发生，只能进行事后结算，基金托管人不承担由此造成的损失，并向中国证监会报告。

(4) 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交易市场选择交易对手。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，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。因交易对手不履行合同造成的基金财产损失，基金托管人不承担任何损失或责任，并向中国证监会报告。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。

(5) 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，与基金托管人就相关事项签订补充协议，明确基金投资流通受限证券的比例。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。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。

(6) 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。

(7) 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和基金合同的规定，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函，就基金托管人的疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期

限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对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。

(8) 基金管理人有关义务配合和协助基金托管人依照法律法规、基金合同和本托管协议对基金业务执行核查。对基金托管人发出的书面提示，基金管理人应在规定时间内答复并改正，或就基金托管人的疑义进行解释或举证；对基金托管人按照法律法规、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。

(9) 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。

(10) 基金托管人发现基金管理人有关重大违规行为，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。

## 2、基金管理人有关基金托管人的业务核查

(1) 基金管理人有关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、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。

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

(3) 基金管理人发现基金托管人有关重大违规行为，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。

### （三）基金财产的保管

#### 1、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。

（4）基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立。

（5）基金托管人根据基金管理人的指令，按照基金合同和本协议的约定保管基金财产，如有特殊情况双方可另行协商解决。

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

#### 2、基金募集期间及募集资金的验资

（1）基金募集期间的资金应存于基金管理人在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。

#### 3、基金资金账户的开立和管理

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

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

（3）基金资金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。

#### 4、基金证券账户的开立和管理

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

（2）基金证券账户的开立和使用，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。

（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、结算互保基金、交收价差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执行。

（5）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，则基金托管人比照并遵守上述关于账户开立、使用的规定。

#### 5、债券托管专户的开设和管理

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

#### 6、其他账户的开立和管理

（1）因业务发展需要而开立的其他账户，可以根据法律法规和基金合同的规定，由基金托管人负责开立。新账户按有关规则使用并管理。

（2）法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

#### 7、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、银行存款定期存单等有价凭证由基金托管人存放于托管银行的保管库，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、银行存款定期存单等有价凭证的购买和转让，由基金管理人和基金托管人共同办理。基金托管人对由基金托管人以外机构实际有效控制的证券不承担保管责任。

#### 8、与基金财产有关的重大合同的保管

基金合同和托管协议由基金管理人和基金托管人各自保管原件。在基金运作中签订的重大合同由基金管理人保管。上述重大合同的保管期限为基金合同终止后 15 年。

#### （四）基金资产净值计算和会计复核

##### 1、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的金额。基金份额净值是指基金资产净值除以基金份额总数，基金份额净值的计算，精确到0.0001元，小数点后第五位四舍五入，国家另有规定的，从其规定。每工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

##### 2、复核程序

基金管理人每工作日对基金资产进行估值后，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。

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

#### （五）基金份额持有人名册的保管

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登记结算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。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，并保证其的真实性、准确性和完整性。

#### （六）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。

#### （七）托管协议的修改与终止

##### 1、托管协议的变更程序

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

##### 2、基金托管协议终止出现的情形：

- （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。

## 二十三、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。基金管理人有权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及内容。主要服务内容如下：

### （一）资料寄送

投资人更改个人信息资料，请及时到原开立华宝基金账户的销售网点更改。

在从销售机构获取准确的客户地址和邮编的前提下，基金管理人将负责寄送以下资料：

#### 1、基金投资人对账单

基金管理人将在每月度结束后的3个工作日内，向已经定制了电子对账单服务的基金份额持有人提供电子对账单。如基金持有人因特殊原因需要获取指定期间的纸质对账单，可拨打我公司客服电话400-700-5588（免长途话费）、400-820-5050（免长途话费），按“0”转人工服务，提供姓名、开户证件号码或基金账号、邮寄地址、邮政编码、联系电话，客服人员核对信息无误后，为基金持有人免费邮寄纸质对账单。

#### 2、其他相关的信息资料

### （二）红利再投资

本基金收益分配时，基金份额持有人可以选择将所获红利再投资于本基金，登记注册机构将其所获红利按分红实施日前一日的基金份额净值自动转为基金份额。红利再投资免收申购费用。

### （三）定期定额投资计划

本基金可通过销售机构为投资人提供定期定额投资的服务，即投资人可通过固定的渠道，采用定期定额的方式申购基金份额。定期定额投资不受最低申购金额限制，具体内容请查询相关公告。投资者可与各代销机构约定每月固定扣款金额，最低扣款金额应遵循各代销机构的规定。投资者通过本公司直销e网金办理本业务时，每期扣款金额最低不少于人民币1元（含申购费）。

### （四）电话查询及交易服务

华宝自动电话语音查询系统为客户提供安全高效的电话查询服务。

### （五）在线服务

基金管理人利用自己的网站（[www.fsfund.com](http://www.fsfund.com)）为基金投资人提供网上查询、网上资讯服务。

## （六）资讯服务

1、投资人如果了解申购与赎回的交易情况、基金账户份额、基金产品与服务等信息，可拨打华宝基金管理有限公司如下电话：

电话呼叫中心：4007005588、4008205050。

直销柜台电话：021-38505731、021-38505732

直销柜台传真：021-50499663、021-50988055

## 2、互联网站

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

电子信箱：[fsf@fsfund.com](mailto:fsf@fsfund.com)

## （七）客户投诉和建议处理

投资人可以通过基金管理人提供的呼叫中心人工座席、书信、电子邮件、传真等渠道对基金管理人和销售机构所提供的服务进行投诉或提出建议。投资人还可以通过代销机构的服务电话对该代销机构提供的服务进行投诉。



## 二十四、其他应披露事项

本报告期内，本基金在指定媒介刊登的公告如下：

公告日期	公告名称
2022/03/31	华宝行业精选混合型证券投资基金 2021 年年度报告
2022/01/24	华宝行业精选混合型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告
2021/12/23	华宝基金关于旗下部分基金新增宁波银行股份有限公司为代销机构的公告
2021/11/18	华宝基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加华夏银行申购及定投申购费率调整活动的公告
2021/11/09	华宝基金关于旗下部分开放式基金新增华金证券为代销机构的公告
2021/10/30	华宝行业精选混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）
2021/10/30	华宝行业精选混合型证券投资基金招募说明书(更新)
2021/10/27	华宝行业精选混合型证券投资基金 2021 年第 3 季度报告

## 二十五、招募说明书存放及查阅方式

本招募说明书存放在基金管理人和代销机构的办公场所和营业场所。投资人可免费查阅，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。

基金管理人保证文本的内容与公告的内容完全一致。

## 二十六、备查文件

备查文件包括：

- （一）中国证监会核准华宝行业精选混合型证券投资基金募集的文件
- （二）《华宝行业精选混合型证券投资基金基金合同》
- （三）《华宝行业精选混合型证券投资基金托管协议》
- （四）《华宝兴业基金管理有限公司开放式基金业务规则》
- （五）法律意见书
- （六）基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- （七）基金托管人业务资格批件和营业执照
- （八）中国证监会要求的其他文件

其中，基金合同和托管协议存放在基金管理人和基金托管人处；其余备查文件存放在基金管理人处。投资人可在营业时间免费到存放地点查阅，也可按工本费购买复印件。

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

华宝基金管理有限公司

2022年4月27日