

信澳转型创新股票型证券投资基金招募 说明书（更新）

基金管理人：信达澳亚基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

二〇二二年六月

重要提示

信达澳银转型创新股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会2015年1月23日证监许可【2015】119号文准予注册募集。根据相关法律法规，本基金基金合同已于2015年4月15日生效，基金管理人于该日起正式开始对基金财产进行运作管理。2022年3月21日，基金管理人公司名称变更为“信达澳亚基金管理有限公司”。2022年06月01日，本基金名称变更为“信澳转型创新股票型证券投资基金”。

基金管理人保证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做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

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

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，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，获得基金投资收益，亦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。

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

本基金投资中小企业私募债券，中小企业私募债是根据相关法律法规由非上市中小企业采用非公开方式发行的债券。由于不能公开交易，一般情况下，交易不活跃，潜在较大流动性风险。当发债主体信用质量恶化时，受市场流动性所限，本基金可能无法卖出所持有的中小企业私募债，由此可能给基金净值带来更大的负面影

响和损失。

本基金为股票型基金，长期预期风险与收益高于混合型基金、债券基金、货币市场基金，属于风险较高、收益较高的证券投资基金产品。投资有风险，投资者认（申）购基金份额时应认真阅读本招募说明书及基金合同，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策。

投资者应当通过本基金管理人或代销机构购买和赎回基金。本基金在募集期内按 1.00 元面值发售并不改变基金的风险收益特征。投资者按 1.00 元面值购买基金份额以后，有可能面临基金份额净值跌破 1.00 元、从而遭受损失的风险。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人承诺以恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不向投资者保证基金一定盈利，也不向投资者保证最低收益。

本基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。

本次更新的招募说明书主要对本基金基金名称、增加 C 类基金份额的相关信息进行了修订，并依据中国证监会 2018 年 6 月 6 日颁布并实施的《存托凭证发行与交易管理办法（试行）》及基金合同、托管协议的修订所作出相应更新，更新内容截止日为 2022 年 6 月 1 日。除非另有说明，本招募说明书(更新)其他所载内容截止日为 2022 年 3 月 24 日，所载财务数据和净值表现截至 2021 年 3 月 31 日（财务数据未经审计）。

目 录

一、绪言	1
二、释义	2
三、基金管理人	6
四、基金托管人	22
五、相关服务机构	24
六、基金的募集	36
七、基金备案与基金合同的生效	37
八、基金份额的申购与赎回	37
九、基金的投资	48
十、基金的业绩	61
十一、基金的财产	63
十二、基金资产的估值	64
十三、基金收益与分配	70
十四、基金的费用与税收	71
十五、基金的会计与审计	73
十六、基金的信息披露	74
十七、风险揭示	80
十八、基金合同的变更、终止与基金财产的清算	83
十九、基金合同的内容摘要	85
二十、基金托管协议的内容摘要	101
二十一、对基金份额持有人的服务	120
二十二、其他应披露事项	121
二十三、招募说明书的存放及查阅方式	125
二十四、备查文件	125

一、绪言

本招募说明书根据《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“《流动性风险规定》”)及其他有关规定以及《信澳转型创新股票型证券投资基金基金合同》编写。

本招募说明书阐述了信澳转型创新股票型证券投资基金(以下简称“本基金”或“基金”)的投资目标、策略、风险、费率和基金交易等与投资者投资决策有关的必要事项,投资者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、准确性和完整性承担法律责任。

本基金根据本招募说明书所载资料申请募集。本招募说明书由信达澳亚基金管理有限公司解释。本基金管理人没有委托或者授权委托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。

本基金招募说明书依据本基金的基金合同编写,并经中国证监会注册。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件,其他与本基金相关的涉及基金合同当事人之间权利义务关系的任何文件或表述,均以基金合同为准。基金合同的当事人包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人。基金投资者取得依基金合同所发行的基金份额,即成为基金份额持有人和本基金基金合同的当事人,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。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为必要条件。基金合同当事人按照《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《销售办法》、《流动性风险规定》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务;基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅《信澳转型创新股票型证券投资基金基金合同》。

二、释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

- 1、基金或本基金：指信澳转型创新股票型证券投资基金
- 2、基金管理人：指信达澳亚基金管理有限公司
- 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《信澳转型创新股票型证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充
- 5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《信澳转型创新股票型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
- 6、招募说明书或本招募说明书：指《信澳转型创新股票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《信达澳银转型创新股票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 日第十一届全国人民代表大会常务委员第三十次会议通过，自 2013 年 6 月 1 日起实施的《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，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/或中国银行业监督管理委员会
- 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、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务
- 23、销售机构：指信达澳亚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。基金的登记机构为信达澳亚基金管理有限公司
- 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金融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

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《信达澳亚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 and 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及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、基金应收申购款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、基金产品资料概要：指《信澳转型创新股票型证券投资基金基金产品资料概要》及其更新

52、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

53、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（以下简称“指定报刊”）及指定互联网网站（以下简称“指定网站”，包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会电子披露网站）等媒介

54、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、恐怖袭击、传染病传播、法律法规变化、突发停电或其他突发事件、证券、期货交易所非正常暂停或停止交易

55、基金份额的类别：本基金根据申购费、赎回费、销售服务费收取方式不同，

将基金份额分为不同的类别：A类基金份额和C类基金份额。各类基金份额分设不同的基金代码，并分别计算并公布基金份额净值和基金份额累计净值

56、A类基金份额：指在投资人申购时收取申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额

57、C类基金份额：指在投资人申购时不收取申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，并从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额

58、销售服务费：指从基金财产中计提的，用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务的费用

三、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：信达澳亚基金管理有限公司

住所：深圳市南山区粤海街道海珠社区科苑南路 2666 号中国华润大厦 L1001

办公地址：深圳市南山区科苑南路 2666 号中国华润大厦 10 层

邮政编码：518063

成立日期：2006 年 6 月 5 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监基金字【2006】071 号

法定代表人：朱永强

电话：0755-83172666

传真：0755-83196151

联系人：韩宗惊

经营范围：基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务

组织形式：有限责任公司

注册资本：壹亿元

股本结构：信达证券股份有限公司出资 5400 万元，占公司总股本的 54% East Topco Limited 出资 4600 万元，占公司总股本的 46%

存续期间：持续经营

（二） 主要人员情况

1、董事、监事、高级管理人员

祝瑞敏，董事长，中国人民大学管理学博士，高级会计师。2007年4月至2012年4月历任东兴证券股份有限公司财务部总经理、公司助理总经理、公司副总经理，2012年4月至2019年4月任中国银河证券股份有限公司首席财务官，2019年4月至2020年11月担任信达证券股份有限公司党委副书记，2019年7月起担任信达证券股份有限公司董事，自2019年9月起担任信达证券股份有限公司总经理，2019年12月起兼任信达澳亚基金管理有限公司（原信达澳银基金管理有限公司）董事长，2020年11月起担任信达证券股份有限公司党委书记，2021年4月起兼任信达国际控股有限公司董事会主席、执行董事。2020年3月至2022年2月兼任信达澳亚基金管理有限公司法定代表人。

潘广建先生，副董事长，英国伯明翰大学工商管理硕士，加拿大注册会计师。曾任职于德勤会计师事务所稽核部、香港期货交易所监察部，1997年起历任山一证券分析员、香港证券及期货事务监察委员会助理经理、香港强制性公积金计划管理局经理、景顺亚洲业务发展经理、景顺长城基金管理公司财务总监、AXA 国卫市场部助理总经理、银联信托有限公司市场及产品部主管。2007年5月起任首域投资（香港）有限公司中国业务开发董事并于同年兼任信达澳亚基金管理有限公司（原信达澳银基金管理有限公司）监事至2016年5月13日。2016年5月14日起兼任信达澳亚基金管理有限公司董事。2019年起任澳大利亚联邦银行信达澳银董事，2019年12月起兼任信达澳亚基金管理有限公司副董事长。

朱永强先生，董事，浙江大学工学硕士，长江商学院高级管理人员工商管理硕士。2004年12月至2010年1月历任华泰联合证券有限责任公司总裁助理、副总裁，2010年1月至2012年11月任中信证券股份有限公司经纪业务发展管理委员会董事总经理，2012年11月至2016年10月任中国银河证券股份有限公司经纪业务线业务总监，兼任经纪管理总部总经理。2016年10月至2019年10月任前海开源基金管理有限公司执行董事长兼首席执行官。2019年12月5日起任信达澳亚基金管理有限公司（原信达澳银基金管理有限公司）董事，2019年12月31日起任信达澳亚基金管理有限公司（原信达澳银基金管理有限公司）总经理，2020年8月起兼任信

达澳亚基金管理有限公司首席信息官。2022年3月起兼任信达澳亚基金管理有限公司法定代表人。

李泉先生，董事，国防科工委指挥技术学院计算机应用专业学士，自1996年起历任招商银行深圳分行公司银行部业务经理，中信银行信用卡中心市场部副总经理，国信证券香港证券与期货经纪有限公司总裁，国京香港证券与期货有限公司总裁，天风国际证券集团副总裁。2021年6月起任香港新星资本有限公司董事。2021年11月起兼任信达澳亚基金管理有限公司（原信达澳银基金管理有限公司）董事。

宋若冰先生，独立董事，北京商学院经济法法学学士，自1993年起历任北京城建集团二公司职员，华联经济律师事务所、北京市高朋律师事务所、北京市正见永申律师事务所实习律师、律师，自2005年2月起至今任北京市德鸿律师事务所律师、高级合伙人。2021年11月起兼任信达澳亚基金管理有限公司（原信达澳银基金管理有限公司）独立董事。

杨棉之先生，独立董事，中国人民大学管理学博士，中国石油大学（北京）经济管理学院教授、博士生导师。财政部全国会计（学术类）领军人才，教育部高等学校会计类专业教学指导委员会委员，中国会计学会财务管理专业委员会委员，曾兼任国元证券、海螺水泥、徽商银行等上市公司独立董事。2021年11月起兼任信达澳亚基金管理有限公司（原信达澳银基金管理有限公司）独立董事。

屈文洲先生，独立董事，厦门大学金融学博士，清华大学经济管理学院博士后，自1995年8月起历任厦门建发信托投资公司投资部经理，中国证监会厦门监管局上市公司监管处借调，深圳证券交易所综合研究所研究员。自2005年起任厦门大学管理学院教授、博士生导师。2021年11月起兼任信达澳亚基金管理有限公司（原信达澳银基金管理有限公司）独立董事。

执行监事：

Ken Okamoto 先生，执行监事，Doshisha 大学本科，自1996年4月起，历任日本住友电气工业株式会社销售，Rakuta Inc 美国业务总经理，Rakuta Brasil 总裁，Rakuta Inc 软件服务赋能部门总经理。2018年8月起任Blockchainlock Inc. 总裁。2019年6月任香港新星资本有限公司董事。2021年11月起兼任信达澳亚基金管理有限公司（原信达澳银基金管理有限公司）执行监事。

韩冰女士，清华大学经济管理学院工商管理硕士，现任公司行政总监。20年证

券、基金从业经验。2001年4月至2014年9月任职世纪证券有限责任公司，任人力资源部负责人职务。2015年4月加入信达澳亚基金管理有限公司（原信达澳银基金管理有限公司），任行政总监，自2020年11月起兼任信达澳亚基金管理有限公司职工监事。

高级管理人员：

朱永强先生，总经理，浙江大学工学硕士，长江商学院高级管理人员工商管理硕士，具有证券与基金从业资格、基金业高级管理人员任职资格。2004年12月至2010年1月历任华泰联合证券有限责任公司总裁助理、副总裁，2010年1月至2012年11月任中信证券股份有限公司董事总经理，2012年11月至2016年10月任中国银河证券股份有限公司经纪业务线业务总监，兼任经纪管理总部总经理。2016年10月至2019年10月任前海开源基金管理有限公司执行董事长兼首席执行官。2019年12月5日起任信达澳亚基金管理有限公司（原信达澳银基金管理有限公司）董事，2019年12月31日起任信达澳亚基金管理有限公司总经理，2020年8月起兼任信达澳亚基金管理有限公司首席信息官。2022年3月起兼任信达澳亚基金管理有限公司法定代表人。

冯明远先生，副总经理，浙江大学计算机科学与技术专业硕士，具有证券与基金从业资格、基金业高级管理人员任职资格。2010年9月至2013年12月，就职于平安证券综合研究所，任行业研究员，2014年1月加入信达澳亚基金管理有限公司（原信达澳银基金管理有限公司），历任行业研究员、基金经理助理、基金经理、权益投资总部副总监、联席投资总监，2021年6月起任信达澳亚基金管理有限公司副总经理。

王建华先生，副总经理兼联席投资总监，复旦大学产业经济学硕士，具有基金从业资格、基金业高级管理人员任职资格。2009年9月至2012年7月任交通银行股份有限公司总行管培生；2012年8月至2015年4月历任交通银行苏州分行投资银行部副总经理、总经理；2015年4月至2019年6月任交通银行资管业务中心结构融资部、资本市场部总经理；2019年6月至2020年1月任交通银行理财有限责任公司权益投资部、研究部总经理。2021年3月起任信达澳亚基金管理有限公司（原信达澳银基金管理有限公司）副总经理兼联席投资总监。

魏庆孔先生，副总经理，兰州大学本科学历，具有证券与基金从业资格、基金业高级管理人员任职资格。1994年7月至1997年11月任兰州金属交易市场信息员；1997年11月至1998年8月任职国泰证券兰州营业部；1998年8月至2009年12月历任国泰君安证券兰州东岗西路营业部、国泰君安证券甘肃分公司；2010年1月至2017年4月历任中国银河证券营业部副总经理、总经理、重庆分公司总经理；2017年至2020年1月任前海开源基金机构事业部总经理。2020年2月加入信达澳亚基金管理有限公司（原信达澳银基金管理有限公司），任首席市场官，2021年11月起任公司副总经理。

于鹏先生，副总经理，中国人民大学经济学学士，具有证券与基金从业资格、基金业高级管理人员任职资格。历任中国建设银行总行信托投资公司证券总部驻武汉证券交易中心交易员、计划财务部会计、深圳证券营业部计划财务部副经理、经理；中国信达信托投资公司北京证券营业部总经理助理兼计财部经理；宏源证券股份有限公司北京营业部副总经理、机构管理总部业务监控部经理兼清算中心经理、资金财务总部副总经理、资金管理总部总经理兼客户资金存管中心总经理等职务。2005年10月加入信达澳亚基金管理有限公司（原信达澳银基金管理有限公司），历任财务总监、总经理助理兼财务总监、副总经理。

黄晖女士，副总经理兼董事会秘书，中南财经大学经济学学士，加拿大Concordia University经济学硕士，具有证券与基金从业资格、基金业高级管理人员任职资格。1999年起历任大成基金管理有限公司研究部分析师、市场部副总监、规划发展部副总监、机构理财部总监等职务。2000-2001年参与英国政府“中国金融人才培养计划”（FIST项目），任职于东方汇理证券公司（伦敦）。2005年8月加入信达澳亚基金管理有限公司（原信达澳银基金管理有限公司），任督察长兼董事会秘书，2019年4月起任信达澳亚基金管理有限公司副总经理。

徐伟文先生，督察长，湖南大学工业自动化专业学士，具有证券与基金从业资格、基金业高级管理人员任职资格。1993年7月至1995年8月任《证券时报》证券信息数据库工程师；1995年9月至1998年9月任职湘财证券公司经纪业务总部交易监控组主管；1999年1月至2004年8月历任广发证券深圳营业部电脑部经理、总部稽核部业务主管、IT审计主管；2004年8月至2008年9月任景顺长城基金管理有限公司法律稽核部稽核经理。2008年9月加入信达澳亚基金管理有限公司（原

信达澳银基金管理有限公司)，历任交易部经理、运营总监、首席信息官，2020年8月起任信达澳亚基金管理有限公司（督察长。

鲁力先生，副总经理，英国赫瑞瓦特大学精算学专业博士，具有证券与基金从业资格、基金业高级管理人员任职资格。2006年12月至2015年9月任南方基金管理有限公司产品开发部负责人，2015年9月至2020年2月历任前海开源基金管理有限公司产品总监、首席产品官、联席投资总监。2020年2月加入信达澳亚基金管理有限公司（原信达澳银基金管理有限公司），任产品创新部总监、基础设施和不动产部总监和运营管理总部总监，2022年2月起任公司副总经理。

李淑彦，副总经理，北京大学金融学硕士，具有证券与基金从业资格、基金业高级管理人员任职资格。2012年6月至2013年6月任博时基金管理有限公司研究员，2013年6月至2014年10月任永赢基金管理有限公司研究员。2015年5月加入信达澳亚基金管理有限公司（原信达澳银基金管理有限公司），历任行业研究员、基金经理助理、基金经理、权益投资总部副总监兼研究咨询部负责人，2021年11月16日起兼任专户投资部投资总监，2022年2月起任公司副总经理。

王咏辉先生，副总经理，英国牛津大学工程专业本科和牛津大学计算机专业硕士，具有基金从业资格、基金业高级管理人员任职资格、英国基金经理从业资格（IMC）、英国 IET 颁发的特许工程师（CEng）认证资格。曾任伦敦摩根大通（JPMorgan）投资基金管理公司分析员、高级分析师，汇丰投资基金管理公司（HSBC）高级分析师，伦敦巴克莱国际投资基金管理公司基金经理、部门负责人，巴克莱资本公司（Barclays Capital）部门负责人，泰达宏利基金管理公司（Manulife Teda）国际投资部负责人、量化投资与金融工程部负责人、基金经理，鹏华基金管理有限公司量化及衍生品投资部总经理、资产配置与基金投资部总监、基金经理兼投资决策委员会委员等职务。2017年10月加入信达澳亚基金管理有限公司（原信达澳银基金管理有限公司），任总经理助理、基金经理，2019年8月起任信达澳亚基金管理有限公司副总经理。

2、基金经理

（1）现任基金经理：

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限	证券	说明
----	----	-----------------	----	----

		任职日期	离任日期	从业年限	
朱然	本基金的基金经理	2021-12-20	-	8年	北京大学工学硕士，曾任甲骨文（中国）IT 工程师，广发证券(香港)海外市场 TMT 行业分析师，红土创新基金研究员、基金经理和投资副总监。2021 年 8 月加入信达澳亚基金权益投资部。现任信澳转型创新股票基金基金经理（2021 年 12 月 20 日起至今）。

(2) 曾任基金经理：

姓名	任本基金的基金经理期限	
	任职日期	离任日期
尹哲	2015 年 04 月 15 日	2015 年 09 月 08 日
杜蜀鹏	2015 年 04 月 15 日	2016 年 01 月 22 日
柴妍	2015 年 08 月 19 日	2016 年 10 月 27 日
冯士祯	2016 年 09 月 14 日	2019 年 04 月 26 日
王咏辉	2018 年 6 月 6 日	2021 年 12 月 20 日

3、公司公募基金投资审议委员会

公司公募基金投资审议委员会由 7 名成员组成，设主席 1 名，委员 6 名。名单如下：

主席：朱永强，总经理

委员：

冯明远，副总经理、联席投资总监

王咏辉，副总经理

李淑彦，副总经理兼任专户投资部总监及研究咨询部负责人

方敬，投资管理部总监

鲁力，副总经理兼任智能量化与全球投资部总监、产品创新部总监

王建华，副总经理、联席投资总监

上述人员之间不存在亲属关系。

上述人员之间不存在亲属关系。

（三）基金管理人的职责

按照《基金法》，基金管理人必须履行以下职责：

- 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、对所管理的不同基金分别管理、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基金收益；
- 5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- 6、编制季度报告、中期报告和年度报告；
- 7、计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回及转换价格；
- 8、严格按照法律法规、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
- 9、依据法律法规、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；
- 10、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；
- 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实施其他法律行为；
- 12、国务院证券监督管理机构规定的其他职责。

（四）基金管理人关于遵守法律法规的承诺

- 1、基金管理人承诺严格遵守《证券法》，并建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止违反《证券法》行为的发生；
- 2、基金管理人承诺严格遵守《基金法》、《运作办法》，建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止以下《基金法》、《运作办法》禁止的行为发生：
 - （1）将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
 - （2）不公平地对待其管理的不同基金财产；
 - （3）利用基金财产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) 法律法规和中国证监会禁止的其他行为。

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

(1) 越权或违规经营；

(2) 违反基金合同或托管协议；

(3) 损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法利益；

(4) 在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；

(5) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；

(6) 玩忽职守、滥用职权；

(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) 除按本公司制度进行基金投资外，直接或间接进行其他股票交易；

(9) 协助、接受委托或以其它任何形式为其它组织或个人进行证券交易；

(10) 违反证券交易场所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；

(11) 故意损害基金投资者及其它同业机构、人员的合法权益；

(12) 以不正当手段谋求业务发展；

(13) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；

(14) 信息披露不真实，有误导、欺诈成分；

(15) 法律法规和中国证监会禁止的其他行为。

(五) 基金管理人关于禁止性行为的承诺

本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、向其基金管理人、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、依照法律法规规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

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。

（六） 基金经理的承诺

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

2、不利用职务之便为自己及其代理人、受雇人或任何第三人谋取利益；

3、不违反现行有效的有关法律法规、基金合同和中国证监会的有关规定，泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；

4、不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

（七） 基金管理人的内部控制制度

本基金管理人为加强内部控制，促进公司诚信、合法、有效经营，保障基金份额持有人利益，维护公司及公司股东的合法权益，依据《证券法》、《证券投资基金公司管理办法》、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》等法律法规，并结合公司实际情况，制定《信达澳亚基金管理有限公司内部控制大纲》。

公司内部控制是指公司为防范和化解风险，保证经营运作符合公司的发展规划，在充分考虑内外部环境的基础上，通过建立组织机制、运用管理方法、实施操作程序与控制措施而形成的系统。公司建立科学合理、控制严密、运行高效的内部控制体系，制定科学完善的内部控制制度。

公司内部控制制度由内部控制大纲、基本管理制度、部门业务规章等部分组成。

公司董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任，公司管理层对内部控制制度的有效执行承担责任。

1、公司内部控制的总体目标

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

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

（3）确保基金、公司财务和其他信息真实、准确、完整、及时。

2、公司内部控制遵循以下原则

(1) 健全性原则。内部控制涵盖公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员，并包括决策、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。公司各机构、部门和岗位职责的设置保持相对独立，公司基金财产、自有资产与其他资产的运作相互分离。

(4) 相互制约原则。公司设置的各部门、各岗位权责分明、相互制衡。

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

3、公司制定内部控制制度遵循以下原则

(1) 合法合规性原则。公司内控制度符合国家法律、法规、规章和各项规定。

(2) 全面性原则。内部控制制度涵盖公司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。制定内部控制制度以审慎经营、防范和化解风险为出发点。

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

4、内部控制的基本要素

内部控制的基本要素包括控制环境、风险评估、控制活动、信息沟通和内部监控。

(1) 控制环境构成公司内部控制的基础，控制环境包括经营理念和内控文化、公司治理结构、组织结构、员工道德素质等内容。

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

(3) 健全公司法人治理结构，充分发挥独立董事和执行监事的监督职能，禁止不正当关联交易、利益输送和内部人控制现象的发生，保护投资者利益和公司合法权益。

(4) 公司的组织结构体现职责明确、相互制约的原则，各部门有明确的授权分工，操作相互独立。公司建立决策科学、运营规范、管理高效的运行机制，包括

民主、透明的决策程序和管理议事规则，高效、严谨的业务执行系统，以及健全、有效的内部监督和反馈系统。

(5) 依据公司自身经营特点设立顺序递进、权责统一、严密有效的内控防线：

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

②建立重要业务处理凭据传递和信息沟通制度，相关部门和岗位之间相互监督制衡。

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

(6) 建立有效的人力资源管理制度，健全激励约束机制，确保公司各级人员具备与其岗位要求相适应的职业操守和专业胜任能力。

(7) 建立科学严密的风险评估体系，对公司内外部风险进行识别、评估和分析，及时防范和化解风险。

(8) 建立严谨、有效的授权管理制度，授权控制贯穿于公司经营活动的始终。

①确保股东会、董事会、执行监事和管理层充分了解和履行各自的职权，建立健全公司授权标准和程序，保证授权制度的贯彻执行。

②公司各业务部门、分支机构和各级人员在规定授权范围内行使相应的职责。

③公司重大业务的授权采取书面形式，明确授权书的授权内容和时效。

④公司适当授权，建立授权评价和反馈机制，包括已获授权的部门和人员的反馈和评价，对已不适用的授权及时修改或取消授权。

(9) 建立完善的资产分离制度，公司资产与基金财产、不同基金的资产之间和其他委托资产，实行独立运作，分别核算。

(10) 建立科学、严格的岗位分离制度，明确划分各岗位职责，投资和交易、交易和清算、基金会计和公司会计等重要岗位不得有人员重叠。重要业务部门和岗位进行物理隔离。

(11) 制订切实有效的紧急应变措施，建立危机处理机制和程序。

(12) 维护信息沟通渠道的畅通，建立清晰的报告系统。

(13) 建立有效的内部监控制度，设置督察长和独立的监察稽核部门，对公司内部控制制度的执行情况进行持续的监督，保证内部控制制度落实。公司定期评价

内部控制的有效性，并根据市场环境、新的金融工具、新的技术应用和新的法律法规等情况进行适时改进。

5、内部控制的主要内容

(1) 公司自觉遵守国家有关法律法规，按照投资管理业务的性质和特点严格制定管理规章、操作流程和岗位手册，明确揭示不同业务可能存在的风险点并采取控制措施。

(2) 研究业务控制主要包括：

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

(3) 投资决策业务控制主要包括：

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

(4) 基金交易业务控制主要包括：

- ①基金交易实行集中交易制度，基金经理不得直接向交易员下达投资指令或者直接进行交易。
- ②建立交易监测系统、预警系统和交易反馈系统，完善相关的安全设施。
- ③交易管理部门审核投资指令，确认其合法、合规与完整后方可执行，如出现指令违法违规或者其他异常情况，应当及时报告相应部门与人员。

④公司执行公平的交易分配制度，确保不同投资者的利益能够得到公平对待。

⑤建立完善的交易记录制度，及时核对并存档保管每日投资组合列表等。

⑥建立科学的交易绩效评价体系。

根据内部控制的原则，制定场外交易、网下申购等特殊交易的流程和规则。

(5) 建立严格有效的制度，防止不正当关联交易损害基金份额持有人利益。基金投资涉及关联交易的，在相关投资研究报告中特别说明，并报公司投资审议委员会审议批准。

(6) 公司在审慎经营和合法规范的基础上力求金融创新。在充分论证的前提下周密考虑金融创新品种或业务的法律性质、操作程序、经济后果等，严格控制金融新品种、新业务的法律风险和运行风险。

(7) 建立和完善客户服务标准、销售渠道管理、广告宣传行为规范，建立广告宣传、销售行为法律审查制度，制定销售人员准则，严格奖惩措施。

(8) 制定详细的注册登记工作流程，建立注册登记电脑系统、数据定期核对、备份制度，建立客户资料的保密保管制度。

(9) 公司按照法律、法规和中国证监会有关规定，建立完善的信息披露制度，保证公开披露的信息真实、准确、完整、及时。

(10) 公司设置专门部门及高级管理人员负责信息披露工作，进行信息的组织、审核和发布。

(11) 加强对公司及基金信息披露的检查和评价，对存在的问题及时提出改进办法，对出现的失误提出处理意见，并追究相关人员的责任。

(12) 掌握内幕信息的人员在信息公开披露前不得泄露其内容。

(13) 根据国家法律法规的要求，遵循安全性、实用性、可操作性原则，严格制定信息系统的管理制度。

信息技术系统的设计开发符合国家、金融行业软件工程标准的要求，编写完整的技术资料；在实现业务电子化时，设置保密系统和相应控制机制，并保证计算机系统的可稽性，信息技术系统投入运行前，经过业务、运营等部门的联合验收。

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

(15) 计算机机房、设备、网络等硬件要求符合有关标准，设备运行和维护整

个过程实施明确的责任管理，严格划分业务操作、技术维护等方面的职责。

(16) 公司软件的使用充分考虑到软件的安全性、可靠性、稳定性和可扩展性，具备身份验证、访问控制、故障恢复、安全保护、分权制约等功能。信息技术系统设计、软件开发等技术人员不得介入实际的业务操作。用户使用的密码口令定期更换，不得向他人透露。数据库和操作系统的密码口令分别由不同人员保管。

(17) 对信息数据实行严格的管理，保证信息数据的安全、真实和完整，并能及时、准确地传递到会计等各职能部门；严格计算机交易数据的授权修改程序，并坚持电子信息数据的定期查验制度。

建立电子信息数据的即时保存和备份制度，重要数据异地备份并且长期保存。

(18) 信息技术系统定期稽核检查，完善业务数据保管等安全措施，进行排除故障、灾难恢复的演习，确保系统可靠、稳定、安全地运行。

(19) 依据《中华人民共和国会计法》、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》、《企业财务通则》等国家有关法律、法规制订基金会计制度、公司财务制度、会计工作操作流程和会计岗位工作手册，并针对各个风险控制点建立严密的会计系统控制。

(20) 明确职责划分，在岗位分工的基础上明确各会计岗位职责，禁止需要相互监督的岗位由一人独自操作全过程。

(21) 以基金为会计核算主体，独立建账、独立核算，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账簿记录等方面相互独立。基金会计核算与公司会计核算相互独立。

(22) 采取适当的会计控制措施，以确保会计核算系统的正常运转。

①建立凭证制度，通过凭证设计、登录、传递、归档等一系列凭证管理制度，确保正确记载经济业务，明确经济责任。

②建立账务组织和账务处理体系，正确设置会计账簿，有效控制会计记账程序。

③建立复核制度，通过会计复核和业务复核防止会计差错的产生。

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

(24) 规范基金清算交割工作，在授权范围内，及时准确地完成基金清算，确保基金财产的安全。

(25) 建立严格的成本控制和业绩考核制度，强化会计的事前、事中和事后监督。

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

(27) 严格制定财务收支审批制度和费用报销运作管理办法，自觉遵守国家财税制度和财经纪律。

(28) 公司设立督察长，对董事会负责，经董事会聘任，报中国证监会核准。根据公司监察稽核工作的需要和董事会授权，督察长可以列席公司相关会议，调阅公司相关档案，就内部控制制度的执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能。督察长定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况，董事会对督察长的报告进行审议。

(29) 公司设立监察稽核部门，对公司管理层负责，开展监察稽核工作，公司保证监察稽核部门的独立性和权威性。

(30) 明确监察稽核部门及内部各岗位的具体职责，配备充足的监察稽核人员，严格监察稽核人员的专业任职条件，严格监察稽核的操作程序和组织纪律。

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

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

6、基金管理人关于内部控制制度的声明

(1) 本公司承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确。

(2) 本公司承诺根据市场变化和公司业务发展不断完善内部控制制度。

四、基金托管人

（一）基金托管人情况

1、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：李莉

联系电话：(021)6063 7259

2、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。自 2007 年起，托管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，并已经成为常规化的内控工作手段。

3、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、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 2020 年二季度末，中国建设银行已托管 1000 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。中国建设银行先后 9 次获得《全球托管人》“中国最佳托管银行”、4 次获得《财资》“中国最佳次托管银行”、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 2016 年被《环球金融》评为中国市场唯一一家“最佳托管银行”、在 2017 年及 2019 年分别荣获《亚洲银行家》“最佳托管系统实施奖”、“中国年度托管业务科技实施奖”。

（二）基金托管人的内部控制制度

1、内部控制目标

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

2、内部控制组织结构

中国建设银行设有风险与内控管理委员会，负责全行风险管理与内部控制工作，对托管业务风险控制工作进行检查指导。资产托管业务部配备了专职内控合规人员负责托管业务的内控合规工作，具有独立行使内控合规工作职权和能力。

3、内部控制制度及措施

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

（三）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

1、监督方法 依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的“新一代托管应用监督子系统”，严格按照现行法律法规以及基金合同规定，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。

2、监督流程

(1) 每工作日按时通过新一代托管应用监督子系统，对各基金投资运作比例控制等情况进行监控，如发现投资异常情况，向基金管理人进行风险提示，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，如有重大异常事项及时报告中国证监会。

(2) 收到基金管理人的划款指令后，对指令要素等内容进行核查。

(3) 通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求基金管理人进行解释或举证，如有必要将及时报告中国证监会。

五、相关服务机构

(一) 销售机构及联系人

1、直销机构

名称：信达澳亚基金管理有限公司

住所：深圳市南山区粤海街道海珠社区科苑南路 2666 号中国华润大厦 L1001

办公地址：广东省深圳市南山区粤海街道科苑南路 2666 号中国华润大厦 10 层

法定代表人：朱永强

电话：0755-83077068

传真：0755-83077038

联系人：刘华

公司网址：www.fscinda.com

邮政编码：518063

2、代销机构

序号	名称	注册地址	法定代表人	办公地址	客服电话	联系人	网站
1	中国建设银行股份有限公司	北京市西城区金融大街 25 号	田国立	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼	95533	吴寒冰	www.ccb.com

2	交通银行股份有限公司	上海市浦东新区自由贸易试验区银城中路188号	任德奇	同“注册地址”	95559	王菁	www.bankcomm.com
3	平安银行股份有限公司	深圳市罗湖区深南东路5047号	谢永林	同“注册地址”	95511-3	汤俊劼、赵杨	www.bank.pingan.com
4	渤海银行股份有限公司	天津市河东区海河东路218号	李伏安	天津市河东区海河东路218号渤海银行大厦	95541/400888811	王宏	www.cbhb.com.cn
5	西安银行股份有限公司	陕西省西安市高新路60号	郭军	同“注册地址”	96779/4008696779	白智	www.xacbank.com
6	南洋商业银行(中国)有限公司	上海市浦东新区世纪大道800号三层、六层至九层	孙建东	中国(上海)自由贸易试验区世纪大道800号三层、六层至九层(不含六层A座)	4008302066	施艳	www.ncbchina.cn/cn/index.html
7	恒丰银行股份有限公司	山东省烟台市芝罘区南大街248号	蔡国华	同“注册地址”	95395	顾于斌	www.hfbank.com.cn
8	江苏江南农村商业银行股份有限公司	江苏省常州市和平中路413号	陆向阳	同“注册地址”	0519-96005	李仙、蒋姣	www.jnbank.com.cn
9	信达证券股份有限公司	北京市西城区闹市口大街9号院1号楼	祝瑞敏	同“注册地址”	95321	付婷、任立秋	www.cindasc.com
10	中国银河证券股份有限公司	北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座	陈共炎	北京市丰台区西营街8号院1号楼青海金融大厦	95551/4008888888	辛国政	www.chinastock.com.cn
11	中信建投证券股份有限公司	北京市朝阳区安立路66号4号楼	王常青	北京东城区朝内大街2号凯恒中心B座16层	95587/400888108	刘畅	www.csc108.com

12	申万宏源 证券有限 公司	上海市徐 汇区长乐 路 989 号 45 层	杨玉成	上海市徐汇区 长乐路 989 号 45 层	95523 /4008 89552 3	陈宇	www.swh ysc.com
13	申万宏源 西部证券 有限公司	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	韩志谦	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	40080 00562	黄莹	www.hys ec.com
14	华龙证券 股份有限 公司	甘肃省兰 州市城关 区东岗西 路 638 号兰 州财富中 心 21 楼	李晓安	同“注册地 址”	95368 /4006 89888 8	范坤、杨 力	www.hlz qgs.com
15	中信证券 股份有限 公司	广东省深 圳市福田 区中心 3 路 8 号卓越时 代广场（二 期）北座	张佑君	北京市朝阳 区亮马桥路 48 号中信 证券大厦 18 层	95558	杜杰	www.cs. ecitic. com
16	中信证券 （山东）有 限责任公 司	青岛市崂 山区深圳 路 222 号青 岛国际金 融广场 1 号 楼 20 层 2001	姜晓林	同“注册地 址”	95548	孙秋月	www.zxz qsd.com .cn
17	国泰君安 证券股份 有限公司	中国（上 海）自由贸 易试验区 商城路 618 号	贺青	上海市静安 区南京西路 768 号国 泰君安大厦	95521	钟伟镇	www.gtj a.com
18	光大证券 股份有限 公司	上海市静 安区新闻 路 1508 号	刘秋明	同“注册地 址”	95525	戴巧燕、 姚崑	www.ebs cn.com
19	海通证券 股份有限 公司	上海市黄 浦区广东 路 689 号	周杰	上海市广东 路 689 号海 通证券大 厦	95553 /4008 88800 1	李笑鸣	www.hts ec.com

20	招商证券股份有限公司	深圳市福田区福田街道福华一路111号	霍达	同“注册地址”	95565/4008888111	黄婵君	www.newone.com.cn
21	国信证券股份有限公司	深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16-26层	何如	深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16层至26层	95536	李颖	www.guosen.com.cn
22	安信证券股份有限公司	深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元	黄炎勋	同“注册地址”	95517	刘志斌	www.essence.com.cn
23	平安证券股份有限公司	深圳市福田区中心区金田路4036号荣超大厦16-20层	刘世安	同“注册地址”	95511	王阳	stock.pingan.com
24	东兴证券股份有限公司	北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层	魏庆华	同“注册地址”	95309/4008888993	和志鹏	www.dxzq.net
25	世纪证券有限责任公司	深圳市前海深港合作区南山街道桂湾五路128号前海深港基金小镇对冲基金中心406	李强	广东省深圳市福田区福田街道金田路2026号能源大厦北塔23-25楼	4008323000	徐玲娟	www.csc.com.cn
26	华福证券有限责任公司	福州市鼓楼区温泉街道五四路157号新天地大厦7-9层	黄金琳	福州市五四路157号新天地大厦7至10层	95547	王虹,刘蕴祺	www.hfzq.com.cn
27	中信证券华南股份	广州市天河区珠江	胡伏云	同“注册地址”	95396	何雯、宋丽雪	www.gzs.com.cn

	有限公司	西路5号 501房					
28	新时代证 券股份有 限公司	北京市海 淀区北三 环西路99 号院1号楼 15层1501	林雯	同“注册地址”	95399	田芳芳	www.xsd zq.cn
29	长江证 券股份有 限公司	武汉市新 华路特8号 长江证 券大 厦	李新华	同“注册地址”	95579 /4008 88899 9	奚博宇	www.955 79.com
30	中泰证 券股份有 限公司	济南市市 中区经七 路86号	李峰	上海市花园石 桥路66号东亚 银行金融大厦 18层	95538	朱琴	www.zts .com.cn
31	粤开证 券股份有 限公司	广州经济 技术开 发区科学大 道60号开 发区金控 中心21、 22、23层	严亦斌	深圳市福田区 深南中路2002 号中广核大厦 北楼10层	95564	彭莲	www.ykz q.com
32	长城证 券股份有 限公司	深圳市福 田区深南 大道6008 号特区报 业大厦14、 16、17层	张巍	深圳市福田区 深南大道6008 号特区报业大 厦14层	40066 66888	王涛	www.cgw s.com
33	恒泰证 券股份有 限公司	内蒙古呼 和浩特市 赛罕区敕 勒川大街 东方君座D 座光大银 行办公楼 14-18楼	庞介民	同“注册地址”	95608 8	熊丽	www.cnh t.com.c n
34	太平洋证 券股份有 限公司	云南省昆 明市北京 路926号同 德广场写 字楼31楼	李长伟	北京市西城 区北展北街9号华 远企业号D座3 单元	95397	王婧	www.tpy zq.com
35	国金证 券股份有 限公司	四川省成 都市青羊 区东城根	冉云	同“注册地址”	95310	杜晶、陈 瑀琦	www.gjz q.com.c n

		上街 95 号					
36	首创证券股份有限公司	北京市西城区德胜门外大街 115 号德胜尚城 E 座	毕劲松	同“注册地址”	95381	刘宇	www.sczq.com.cn
37	华西证券股份有限公司	四川省成都市高新区天府二街 198 号华西证券大厦	杨炯洋	同“注册地址”	95584	谢国梅	www.hxl68.com.cn
38	山西证券股份有限公司	山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼	侯巍	同“注册地址”	95573/4006661618	郭熠	www.i618.com.cn
39	五矿证券有限公司	深圳市福田区金田路 4028 号荣超经贸中心办公楼 47 层 01 单元	赵立功	同“注册地址”	4001840028	濮耘瑶	www.wkzq.com.cn/
40	联储证券有限责任公司	广东省深圳市福田区华强北路圣廷苑酒店 B 座 26 楼	沙常明	北京市朝阳区安定路 5 号院 3 号楼中建财富国际中心 27 层联储证券	4006206868	史梦可	www.lczq.com
41	东方财富证券股份有限公司	西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城 10 栋楼	徐伟琴	上海市徐汇区宛平南路 88 号东方财富大厦	95357	付佳	http://www.18.cn
42	中银国际证券股份有限公司	上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层	宁敏	同“注册地址”	4006208888	初晓、王炜哲	www.bocichina.com
43	方正证券股份有限	湖南省长沙市天心	施华	北京市朝阳区北四环中路盘	95571	丁敏	www.foundersc.

	公司	区湘江中路二段 36 号华远华中心 4、5 号楼 3701-3717		古大观 A 座 40 层			com
44	中国国际金融股份有限公司	北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层	沈如军	同“注册地址”	400-910-1166	王潇、杨涵宇	https://www.cicc.com
45	诺亚正行基金销售有限公司	上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室	汪静波	同“注册地址”	4008215399	李娟	www.noah-fund.com
46	深圳众禄基金销售股份有限公司	深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼 801	薛峰	深圳市罗湖区梨园路 8 号 HALO 广场 4 楼	4006788887	童彩平、徐丽平	www.zlfund.cn; www.jjmmw.com
47	上海天天基金销售有限公司	上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层	其实	上海市徐汇区宛平南路 88 号金座东方财富大厦	95021/4001818188	屠彦洋	www.1234567.com.cn
48	上海好买基金销售有限公司	上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号	杨文斌	同“注册地址”	4007009665	杨文斌	www.howbuy.com
49	蚂蚁（杭州）基金销售有限公司	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	祖国明	浙江省杭州市西湖区万塘路 18 号黄龙时代广场 B 座 6F	4000766123	韩爱彬	www.fund123.cn
50	和讯信息科技有限公司	北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 1002 室	王莉	同“注册地址”	4009200022	陈慧慧、陈艳琳	licaike.hexun.com
51	浙江同花顺基金销	杭州市文二西路一	吴强	杭州市余杭区五常街道同顺	4008773772	朱琼	www.5ifund.com

	售有限公司	号 903 室		路 18 号同花顺 大楼			
52	上海联泰 基金销售 有限公司	中国（上 海）自由贸 易试验区 富特北路 277 号 3 层 310 室	燕斌	上海市长宁区 金钟路 658 弄 2 号楼 B 座 6 楼	40011 81188	兰敏	www.66z ichan.c om
53	北京展恒 基金销售 股份有限 公司	北京市顺 义区后沙 峪镇安富 街 6 号	闫振杰	北京朝阳区北 四环中路 27 号 院 5 号楼 A 座 6 层 11 室	40081 88000	闫振杰	www.myf und.com
54	浦领基金 销售有限 公司	北京市朝 阳区望京 东园四区 2 号楼 10 层 1001 号 04 室	聂婉君	北京市朝阳区 望京中航资本 大厦 10 层	40001 25899	李艳	www.zsc ffund.c om
55	中信期货 有限公司	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	张皓	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	40099 08826	刘宏莹	www.cit icsf.co m
56	上海长量 基金销售 有限公司	上海市浦 东新区高 翔路 526 号 2 幢 220 室	张跃伟	上海市浦东新 区东方路 1267 号 11 层	40082 02899	苗明、党 敏	www.eri chfund. com
57	北京虹点 基金销售 有限公司	北京市朝 阳区工人 体育场北 路甲 2 号盈 科中心 B 座 裙房 2 层	郑毓栋	北京市朝阳区 工人体育馆北 路甲 2 号盈科中 心 B 座裙楼二层	40061 80707	陈铭洲	www.hon gdianfu nd.com
58	上海陆金 所基金销 售有限公 司	上海市自 由贸易试 验区陆家 嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元	王之光	同“注册地址”	40082 19031	程晨	www.luf unds.co m
59	上海利得 基金销售	上海市宝 山区蕴川	李兴春	上海虹口区东 大名路 1098 号	95733	陈洁	www.lea dfund.c

	有限公司	路 5475 号 1033 室		浦江国际金融 广场 53 楼			om. cn
60	深圳市金 斧子基金 销售有限 公司	深圳市南 山区粤海 街道科技 园中区科 苑路 15 号 科兴科学 园 B 栋 3 单 元 11 层 1108	赖任军	同“注册地址”	40093 02888	陈丽霞	www.jfz inv.com
61	珠海盈米 基金销售 有限公司	珠海市横 琴新区宝 华路 6 号 105 室 -3491	肖雯	广州市海珠区 琶洲大道东 1 号 保利国际广场 南塔 12 楼 B1201-1203	89629 066	梁文燕、 邱湘湘	www.yin gmi.cn
62	北京创金 启富基金 销售有限 公司	北京西城 区白纸坊 东街 2 号院 6 号楼 712 室	梁蓉	同“注册地址”	40062 62818	王瑶	www.5ir ich.com
63	北京钱景 基金销售 有限公司	北京市海 淀区丹棱 街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012	赵荣春	同“注册地址”	40089 36885	田伟静	www.qia njing.c om
64	中证金牛 (北京)投 资咨询有 限公司	北京市丰 台区东管 头 1 号 2 号 楼 2-45 室	钱昊旻	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	40089 09998	孙雯	www.jnl c.com
65	北京广源 达信基金 销售有限 公司	北京市西 城区新街 口外大街 28 号 C 座 六层 605 室	齐剑辉	北京市朝阳区 望京宏泰 东街浦项 中心 B 座 19 层	40062 36060	王永霞	www.niu niufund .com
66	上海万得 基金销售 有限公司	中国(上 海)自由 贸易试验 区福山路 33 号 11 楼 B 座	王廷富	上海市浦东 新区福山 路 33 号 8 楼	40082 10203	徐亚丹	www.520 fund.co m.cn
67	北京富国 大通资产 管理有限	北京市东 城区北三 环东路 36	许家宝	北京市朝阳区 安定路 5 号 院 3 号楼 中建财富	40008 80088	方芳	www.fug uowealt h.com

	公司	号1号楼 A2501室		国际中心25层			
68	上海基煜 基金销售 有限公司	上海市崇 明县长兴 镇潘园公 路1800号 2号楼6153 室(上海泰 和经济发 展区)	王翔	上海市黄浦区 广东路500号 30层3001单元	40082 05369	居晓菲	www.jiy ufund.c om.cn
69	北京汇成 基金销售 有限公司	北京市海 淀区中关 村大街11 号E世界财 富中心A座 11层1108 号	王伟刚	北京市海淀区 中关村大街11 号E世界财富中 心A座11层	40061 99059	王骁骁	www.hcj ijin.co m
70	中民财富 基金销售 (上海)有 限公司	上海市黄 浦区中山 南路100号 7层05单 元	弭洪军	上海市黄浦区 中山南路100号 17层	40087 65716	黄鹏	www.cmi wm.com
71	北京植信 基金销售 有限公司	北京市密 云县兴盛 南路8号院 2号楼106 室-67	王军辉	北京市朝阳区 惠河南路盛世 龙源10号	40068 02123	吴鹏	www.zhi xin-inv .com
72	京东肯特 瑞基金销 售有限公 司	北京市海 淀区西三 旗建材城 中路12号 17号平房 157	王苏宁	北京市通州区 亦庄经济技术 开发区科创十 一街18号院京 东集团总部A座 15层	95118	黄立影、 江卉	kenteru i.jd.co m/
73	喜鹊财富 基金销售 有限公司	西藏拉萨 市柳梧新 区柳梧大 厦1513室	陈皓	同“注册地址”	40069 97719	曹砚财	www.xiq uefund. com
74	一路财富 (北京)基 金销售有 限公司	北京市西 城海淀区 宝盛南路1 号院20号 楼9层 101-14	吴雪秀	同“注册地址”	40000 11566	董宣	www.yil ucaifu. com

75	南京苏宁基金销售有限公司	南京市玄武区苏宁大道1号	王锋	同“注册地址”	95177	张云飞	www.snjijin.com
76	济安财富(北京)基金销售有限公司	北京市朝阳区太阳宫中路16号院1号楼3层307	杨健	同“注册地址”	4006737010	李海燕	www.jianfortune.com
77	北京蛋卷基金销售有限公司	北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507	钟斐斐	北京市朝阳区创远路34号院融新科技中心C座17层	4005199288	王悦	www.danjuanapp.com
78	北京度小满基金销售有限公司	北京市海淀区西北旺东路10号院西区4号楼1层103室	葛新	同“注册地址”	95055	孙博超	www.baiyingfund.com
79	腾安基金销售(深圳)有限公司	深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入住深圳市前海商务秘书有限公司)	刘明军	深圳市南山区海天二路腾讯滨海大厦南塔15层	95017(微信)0755-86013860(QQ用户)	赵晨	https://qian.qq.com/index.shtml
80	嘉实财富管理有限公司	上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心办公楼二期53层5312-15单元	赵学军	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	4000218850	李雯	www.harvestwm.cn
81	江苏汇林保大基金销售有限公司	南京市高淳区经济开发区古檀大道47号	吴言林	南京市鼓楼区中山北路2号绿地紫峰大厦2005室	025-66046166	张竞妍	www.huilinbd.com
82	上海华夏财富投资	上海市虹口区东大	毛淮平	北京市西城区金融大街33号	4008175666	张静怡	www.amcfortune.

	管理有限公司	名路687号 1幢2楼 268室		通泰大厦B座8 层			com
83	和耕传承 基金销售 有限公司	河南自贸 试验区郑 州片区(郑 东)东风南 路康宁 街北6号楼 5楼503	温丽燕	同“注册地址”	0371-8 55183 96	董亚芳	https://w ww.360ji nrong.net /
84	宜信普泽 (北京)基 金销售有 限	北京市朝 阳区西大 望路1号9 层公寓 1008	才殿阳	同“注册地址”	40060 99200	魏晨	www.yix infund.co m
85	大连网金 基金销售 有限公司	辽宁省大 连市沙河 口区体坛 路22号诺 德大厦2层 202室	樊怀东	同“注册地址”	40008 99100	于秀	www.yib aijin.com
86	泛华普益 基金销售 有限公司	成都市成 华区建设 路9号高 地中心 1101室	于海峰	广州市天河 区珠江城 大厦42 楼-普益财 富	40008 03388	隋亚方	https://w ww.puyif und.com/ /
87	中国人寿 保险股份 有限公司	北京市西 城区金融 大街16号	王滨	同“注册地址”	95519	秦泽伟	www.e-c hinalife.c om

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或变更上述代销机构，并在基金管理人网站公示。

(二) 注册登记机构

名称：信达澳亚基金管理有限公司

住所：深圳市南山区粤海街道海珠社区科苑南路 2666 号中国华润大厦 L1001

办公地址：广东省深圳市南山区粤海街道科苑南路 2666 号中国华润大厦 10
层

法定代表人：朱永强

电话：0755-83172666

传真：0755-83196151

联系人：刘玉兰

（三）出具法律意见书的律师事务所和经办律师

名称：上海源泰律师事务所

办公地址：上海市浦东南路 256 号华夏银行大厦 1405 室

负责人：廖海

电话：021-51150298

传真：021-51150398

联系人：刘佳

经办律师：刘佳、徐莘

（四）审计基金财产的会计师事务所和经办注册会计师

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

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

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

法定代表人（执行事务合伙人）：毛鞍宁

联系电话：010-58153000

传真：010-85188298

联系人：昌华

经办注册会计师：昌华、高鹤

六、基金的募集

（一）本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》、本基金的基金合同及其他有关规定募集。

（二）本基金于 2015 年 1 月 23 日经中国证监会证监许可【2015】119 号文准予注册。

(三) 本基金为股票型基金，运作方式为契约型开放式，基金存续期限为不定期。

(四) 本基金募集期间基金份额净值为人民币 1.00 元，按面值发售。

(五) 本基金自 2015 年 3 月 19 日起向社会公开募集，截至 2015 年 4 月 13 日募集工作顺利结束。本次募集份额合计 2,863,538,912.44 份，有效认购户数为 24,610 户。

七、基金备案与基金合同的生效

(一) 基金合同的生效

根据有关规定，本基金满足基金合同生效条件，基金合同于 2015 年 4 月 15 日起正式生效。自基金合同生效日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

(二) 基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

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

法律法规另有规定时，从其规定。

八、基金份额的申购与赎回

(一) 申购和赎回场所

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。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。若基金管理人或其指定的代销机构开通电话、传真或网上等交易方式，投资人可以通过上述方式进行申购与赎回。

(二) 申购和赎回的开放日及时间

1、开放日及开放时间

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

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

2、申购、赎回开始日及业务办理时间

本基金已于 2015 年 5 月 18 日起开始办理日常申购赎回业务。

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

（三）申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的该类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当日开放时间结束前撤销，在当日的开放时间结束后不得撤销；

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

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

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。

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、赎回申请无效。

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，否则所提交的申购申请无效。投资人提交申购申请，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。

投资人在提交赎回申请时须持有足够的基金份额余额，否则所提交的赎回申请无效。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。在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。

遇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，则赎回款顺延至上述情形消除后支付。

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，投资人可在 T+2 日后(包括该日)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。销售机构对申购和赎回申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购和赎回的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资者应及时查询并妥善行使合法权利。若申购不成功，则申购款项退还给投资人。

(五) 申购和赎回的数量限制及余额的处理方式

1、投资者可多次申购，但单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的 50%，也不得通过一致行动人等方式变相达到或超过基金份额总数的 50%（在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过 50%的除外）。

2、投资人在代销机构销售网点首次申购的最低金额为人民币 10 元(含申购费)，追加申购的最低金额为人民币 10 元（含申购费）；各销售机构对本基金最低申购金额及交易级差有其他规定的，以各销售机构的业务规定为准。投资人在直销机构

销售网点首次申购的最低金额为人民币 5 万元（含申购费），追加申购的最低金额为人民币 1 万元（含申购费）；通过本基金管理人基金网上交易系统特定交易方式申购本基金暂不受前述限制，详见基金管理人届时发布的相关公告；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。具体申购金额限制以各基金销售机构的公告为准。

3、投资者赎回本基金时，可以申请将其持有的部分或全部基金份额赎回，单笔赎回的最低份额为10份基金份额，若某投资者在该销售网点托管的基金份额不足10份或某笔赎回导致该持有人在销售网点托管的基金份额少于10份，则全部基金份额必须一并赎回；如因红利再投资、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10份的情况，不受此限，但再次赎回时必须一次性全部赎回。

4、单个基金份额持有人持有本基金的最低限额为10份；

5、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；

6、基金管理人可根据市场情况，在不损害基金份额持有人权益的情况下，调整上述申购金额和赎回份额的数量限制，调整前基金管理人必须依照《信息披露办法》的有关规定在中国证监会指定媒介上刊登公告；

7、申购份额、余额的处理方式：申购的某类基金份额的有效份额为净申购金额除以当日的该类基金份额净值，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，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担；

8、赎回金额的处理方式：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，并扣除相应的赎回费用，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，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

（六）申购和赎回费率

1、申购费率

本基金 C 类基金份额不收取申购费。

申购采用前端收费模式，费率按认购金额采用比例费率，投资人在一天之内如果有多笔认购，适用费率按单笔分别计算。本基金 A 类基金份额的申购费率表如下：

申购金额 (M)	申购费率
M < 50万元	1.5%
50万元 ≤ M < 200万元	1.0%
200万元 ≤ M < 500万元	0.6%
M ≥ 500万元	每笔1000元

投资者选择红利自动再投资所转成的份额不收取申购费用。

本基金A类基金份额的申购费用由A类基金份额申购人承担,可用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用,不列入基金资产。

2、赎回费率

投资人在赎回各类基金份额时,应交纳赎回费。赎回费用由赎回基金份额的基金持有人承担,在基金份额持有人赎回基金份额时收取。

(1) 本基金A类基金份额的赎回费率如下表所示:

持有基金份额期限	赎回费率
T < 7 日	1.5%
7 ≤ T < 30 日	0.75%
30 日 ≤ T < 1 年	0.5%
1 年 ≤ T < 2 年	0.25%
T ≥ 2 年	0

对于持有期少于 30 日的 A 类基金份额所收取的赎回费,全额计入基金财产;对于持有期不少于 30 日但少于 3 个月的 A 类基金份额所收取的赎回费,其 75% 计入基金财产;对于持有期不少于 3 个月但少于 6 个月的 A 类基金份额所收取的赎回费,其 50% 计入基金财产;对于持有期长于 6 个月的 A 类基金份额所收取的赎回费,其 25% 计入基金财产。未计入基金财产部分用于支付登记费和必要的手续费。赎回费率随赎回基金份额持有期限的增加而递减。

注: 1 年指 365 天。3 个月指 90 天,6 个月指 180 天,以此类推。

(2) 本基金C类基金份额的赎回费率如下表所示:

持有时间 D (天)	C 类基金份额赎回费率
D < 7	1.50%
7 ≤ D < 30	0.50%

30≤D	0%
------	----

投资者可将其持有的全部或部分 C 类基金份额赎回。赎回费用由赎回 C 类基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回 C 类基金份额时收取。对持续持有期少于 30 日的 C 类基金份额持有人收取的赎回费全额计入基金财产。

3、基金管理人可以根据法律法规规定及基金合同调整申购费率、赎回费率或收费方式，最新的申购费率、赎回费率或收费方式在招募说明书（更新）或相关公告中列示。费率或收费方式如发生变更，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式开始实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

4、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。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率、基金赎回费率和销售服务费率。

（七）申购份额与赎回金额的计算方式

1、申购份额的计算

（1）A 类基金份额的申购

本基金 A 类基金份额的申购金额包括申购费用和净申购金额。其中：

申购份额的计算方式如下：

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

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

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

对于适用固定金额申购费的申购：净申购金额 = 申购金额 - 申购费用

例：某投资人投资 10,000 元申购本基金 A 类基金份额，假设申购当日 A 类基金份额净值为 1.050 元，则可得到的 A 类基金份额为：

$$\text{净申购金额} = 10,000 / (1 + 1.5\%) = 9,852.22 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 10,000 - 9,852.22 = 147.78 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 9,852.22 / 1.050 = 9,383.07 \text{ 份}$$

即：投资人投资 10,000 元申购本基金 A 类基金份额，其对应费率为 1.5%，假设申购当日 A 类基金份额净值为 1.050 元，则其可得到 9,383.07 份 A 类基金份额。

（2）C 类基金份额的申购

$$\text{申购金额} = \text{申请总金额}$$

申购份额=申购金额/申购日C类基金份额净值

例：某投资人投资500,000.00元申购本基金C类基金份额，假定申购当日C类基金份额净值为1.0500元，则可得到的C类基金份额为：

申购份额=500,000.00/1.0500=476,190.48份

即：投资人投资500,000.00元申购本基金C类基金份额，假定申购当日C类基金份额净值为1.0500元，则可得到476,190.48份C类基金份额。

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：

赎回总额=赎回份数×T日某类基金份额净值

赎回费用=赎回总额×赎回费率

赎回金额=赎回总额-赎回费用

例：某投资人赎回本基金10,000份A类基金份额，持有时间为6个月，对应的赎回费率为0.5%，假设赎回当日A类基金份额净值是1.050元，则其可得到的赎回金额为：

赎回总额=10,000×1.050=10,500元

赎回费用=10,500×0.5%=52.5

赎回金额=10,500-52.5=10,447.5元

即：投资人赎回本基金1万份A类基金份额，持有期限为6个月，假设赎回当日A类基金份额净值是1.050元，则其可得到的赎回金额为10447.5元。

3、T日基金份额净值的计算

本基金A类基金份额和C类基金份额分别设置代码，分别计算和公告各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。

T日某类基金份额净值 = T日该类基金资产净值 / T日该类基金份额总数。

T日的各类基金份额净值在当天收市后计算，均精确到0.001元，小数点后第4位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

T日的各类基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

（八）拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

1、因不可抗力导致基金无法正常运作。

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接收投资人的申购申请。

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

4、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。

5、基金管理人、基金托管人、基金销售机构或登记机构的异常情况导致基金销售系统、基金登记系统或基金会计系统无法正常运作。

6、当一笔新的申购申请被确认成功，使本基金总规模超过基金管理人规定的本基金总规模上限时；或使本基金单日申购金额或净申购比例超过基金管理人规定的当日申购金额或净申购比例上限时；或该投资人累计持有的份额超过单个投资人累计持有的份额上限时；或该投资人当日申购金额超过单个投资人单日或单笔申购金额上限时。

7、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过 50%，或者变相规避 50%集中度的情形时。

8、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，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申购赎回申请的措施。

9、法律法规、基金合同的规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第 1、2、3、4、5、8、9 项暂停申购情形时，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还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

（九）暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接收投

资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。

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

4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

5、继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时，可暂停接受投资人的赎回申请。

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

7、法律法规、基金合同规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形时，基金管理人应按规定报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。若出现上述第 4 项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

（十）巨额赎回的情形及处理方式

1、巨额赎回的认定

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

2、巨额赎回的处理方式

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

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

（2）部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的 10%的前提下

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各类基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

(3) 暂停赎回：连续 2 个开放日以上(含 2 个开放日)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。

(4) 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 10%，基金管理人可以先行对该单个基金份额持有人超出 10% 以上的部分赎回申请实施延期办理，而对该单个基金份额持有人 10% 以内（含 10%）的赎回申请与当日其他投资者的赎回申请按前述条款处理。

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。

(十一) 暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

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

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

3、如发生暂停的时间超过 1 日，基金管理人可以根据暂停申购或赎回的时间，依据《信息披露办法》的有关规定，最迟于重新开放申购或赎回日在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，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，届时将不再另行发布重新开放的公告。

(十二) 基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理、且由同一登记机构办理注册登记的其他基金之间的转换业务，基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及基金合同的规定制定并公告，并提前告知基金托管人与相关机构。

（十三）基金的非交易过户

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

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

（十四）基金的转托管

基金份额持有人可办理已持有基金份额在不同销售机构之间的转托管，基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。

（十五）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。

（十六）基金的冻结和解冻

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

九、基金的投资

（一）投资目标

本基金通过积极主动的管理，在有效控制风险的前提下，深度挖掘企业转型创新过程中产生的各类投资机遇，力争在中长期为投资者获取超越业绩比较基准的投资回报。

（二）投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票等）、存托凭证、债券（含中小企业私募债、可转换债券等）、债券回购、现金、货币市场工具、权证、股指期货、资产支持证券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。

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

本基金的投资组合比例为：股票及存托凭证资产占基金资产的比例为 80%-95%，其中投资于本基金定义的转型创新主题相关的股票资产占非现金基金资产的比例不低于 80%；债券（含中小企业私募债、可转换债券等）资产、现金、货币市场工具、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例为 5%-20%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；权证的投资比例不超过基金资产净值的 3%；资产支持证券的投资比例不超过基金资产净值的 20%。

（三）投资策略

本基金采取自上而下和自下而上相结合的积极主动的投资策略，并对投资组合进行动态调整。由于本基金为股票型基金，核心投资策略为股票精选策略，同时辅以资产配置策略优化投资组合的风险收益，提升投资组合回报。

1、资产配置策略

本基金管理人使用趋势和估值相结合的方式，结合定量和定性分析，从多个角度考虑宏观经济面、政策面、市场面等多种因素，综合分析评判证券市场的特点及

其演化趋势。通过分析股票、债券等资产的预期收益风险的匹配关系，在此基础上，在投资比例限制范围内，确定或调整投资组合中股票和债券的比例。

本基金考虑的宏观经济指标包括 GDP 增长率、居民消费价格指数(CPI)、生产者价格指数(PPI)、采购经理人指数 (PMI)、货币供应量(M0, M1, M2)的增长率等指标。

本基金考虑的市场因素包括但不限于市场的资金供求变化、上市公司的盈利增长情况、市场总体 P/E、P/B 等指标相对于长期均值水平的偏离度、经济增速相近的国家估值水平横向比较等多种指标，通过对上述指标的综合分析和研究实施投资组合的资产配置。

2、股票精选策略

本基金主要的股票投向是通过内生或者外延方式，使得公司的商业模式、主营业务领域实现创新升级或者跨行业转型升级，获得新的核心竞争优势，进而推动企业价值高速成长的企业。

(1) 转型创新的涵义

在不同的经济发展阶段，由于特定的社会需求、技术以及当时的政策导向等多种因素的共同作用下，各个产业的发展速度、空间和行业前景存在差异，企业开展业务的具体商业模式也不尽相同。在原有业务发展面临困境，或是新行业面临高速发展的机遇，部分企业通过并购、重组、拓展等策略进入新行业获得竞争优势和新的发展机遇，或者通过内生的技术、组织、机制等创新手段，开拓具有较好发展前景的业务领域，获得新的转折性的发展机遇，称之为转型创新。

本基金转型创新的界定主要包括转型和创新两个方面：

一是转型的界定，主要包括传统行业、产能过剩行业的企业切入新的领域以及由于收购兼并获得新的增长机会。

传统行业企业转型主要是指传统行业的企业切入新的业务领域，例如水泥、钢铁等传统行业的企业，由于掌握了余热发电、污水处理等新的技术，进而切入政府产业政策长期鼓励的节能环保行业，企业实现成功转型；或者企业通过兼并收购那些政府产业政策鼓励、前景良好的中小企业进而获得了全新的增长机会。

二是业务创新的界定，主要包括企业在公司治理结构、新的技术、新的营销渠道、新的产品或者新的管理模式方面实现了创新突破，进而拉动企业进入一个新的

增长周期。

公司治理结构方面的创新包括：公司进行混合所有制改革或者股权激励，由于治理结构的优化，使得公司潜力得到更大的释放，进而推动公司业绩进入一个新的增长周期；新的技术是指公司由于长期研发或者专利权购买等原因掌握了国内或者国际同行业领先的先进技术，进而获得了新的增长机会；新的营销渠道是指公司产品销售渠道获得了实质性突破，例如介入电子商务或者其他新的渠道领域，进而拉动公司销售快速增长；新的产品是指公司开发出更加适合目标客户需求的新产品，实现销售收入的快速增长；新的管理模式是指公司由于在内部管理方面引入激励约束机制更强的管理制度，例如事业部制度等，进而带动公司进入一个新的增长阶段。

（2）转型创新主题股票的挖掘

1) 初选股票库的构建

本基金对初选股票库的构建，是在转型创新主题界定的范畴中，过滤掉明显不具备投资价值的股票。剔除的股票包括法律法规和本基金管理人制度明确禁止投资的股票、ST 和*ST 股票、筹码集中度高且流动性差的股票、涉及重大案件和诉讼的股票等。

同时，本基金将密切关注股票市场企业动态，根据实际情况调整初选股票库。

2) 风格股票库的构建

在初选股票库的基础上，本基金将结合定量评估、定性分析和估值分析来综合评估备选公司转型创新活动的价值，从中选择通过转型创新实现增长的上市公司。

① 行业配置

本基金将持续跟踪经济发展状况、产业结构升级、技术发展趋势以及国家的相关政策等，评估各行业在社会经济发展中的作用，高度关注具备良好经济效益或社会溢出效应，预期未来一段时间内将保持高增长的行业，确定为主题行业。具体分析时，管理人通过跟踪各行业整体的收入增速、利润增速、毛利率变动幅度、ROIC 变动情况，依此来判断各行业的景气度，再根据行业整体的估值情况，市场的预期，目前机构配置的比例来综合考虑各行业在组合中的配置比例。在操作过程中，本基金将根据宏观经济中期趋势、政策环境变化、各行业景气度情况以及估值区间水平等因素，对行业配置不断进行调整和优化。

② 个股精选

本基金基于动态静态指标相结合的原则，采用内在价值、相对价值相结合的评估方法，如市盈增长比率（PEG）、市盈率（P/E）、市净率（P/B）、企业价值/息税前利润（EV/EBIT）、企业价值/息税、折旧、摊销前利润（EV/EBITDA）、自由现金流贴现（DCF）等，对企业进行合理性评估。

（3）转型创新的投资决策

转型创新主题投资中，确定转型切入的主题行业所处的发展阶段尤其重要，基金管理人定期召开投资决策委员会会议，由宏观经济研究员、策略研究员、行业研究员和基金经理对主题行业进行评估，综合考虑主题发展阶段、主题催化因素、主题市场容量、主题估值水平等因素，确定每个主题行业的配置权重范围，从而进行相关转型创新主题股票的配置。

3、存托凭证投资策略

在控制风险的前提下，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。

4、债券投资策略

本基金的债券投资将坚持价值投资理念，通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势以及不同类属的收益率水平、流动性和信用风险等因素，以久期控制和结构分布策略为主，以收益率曲线策略、利差策略等为辅，构造能够提供稳定收益的债券和货币市场工具组合。

中小企业私募债券投资策略：由于中小企业私募债券具有流动性较差、信息披露不公开、风险收益水平较高等特点，因此对该类信用产品的投资主要遵循精选个券、总量控制、分散投资、长期持有的原则。对个券投资前主要采取与股票投资相似的公司分析方式，对中小企业私募债券发行人的公司治理、发展前景、经营管理、财务状况及偿债能力作出综合评价，从而选择收益率水平与信用风险匹配，利差对违约风险和流动性风险构成合理补偿的个券进行投资。投资以后以高于普通信用债的频度对发行人的情况进行密切跟踪，包括且不限于对发行人进行电话和实地调研，与受托人、投行、评级机构等中介机构进行信息沟通等等，以保持对发行人经营状况和偿债能力变化情况的了解。对于组合里的中小企业私募债券暴露，根据本基金的类属配置策略、个券的投资价值和流动性管理要求，进行总量控制、分散投资，降低流动性和信用风险。

5、权证投资策略

本基金将权证作为有效控制基金投资组合风险、提高投资组合收益的辅助工具。本基金在投资权证时，将根据权证对应公司基本面研究成果确定权证的合理估值，发现市场对股票权证的非理性定价，谨慎进行投资，追求较为稳健的当期收益。

6、股指期货投资策略

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。

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在严格控制风险的前提下，通过参与股指期货投资，管理组合的系统性风险，改善组合的风险收益特征。

（1）时机选择策略

本基金通过对宏观经济运行状况、市场情绪、市场估值指标等的研究分析，判断是否需要投资组合进行套期保值及选择套期保值的期货合约。

（2）期货合约选择和头寸选择策略

本基金根据对需进行套期保值的投资组合的beta值的计算，在考虑期货合约基差、流动性等因素的基础上，选择合适的期货合约作为套期保值工具，并根据数量模型计算所需的期货合约头寸。本基金将对投资组合的beta值进行跟踪，动态调整期货合约的头寸。

（3）展期策略

当套期保值的时间较长时，需要对股指期货合约进行展期。本基金在跟踪不同交割日期期货合约价差的基础上，选择合适的交易时机及期货合约进行展期。

（4）保证金管理策略

本基金将通过数量化模型，根据套期保值的时间、投资组合及期货合约的波动性等参数计算所需的结算准备金，避免因保证金不足被迫平仓导致的套保失败。

若相关法律法规发生变化时，基金管理人期货投资管理从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。

（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) 股票及存托凭证资产占基金资产的比例为 80%-95%，其中投资于本基金定义的转型创新主题相关的股票资产占非现金基金资产的比例不低于 80%；债券（含中小企业私募债、可转换债券等）资产、现金、货币市场工具、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例为 5%-20%；

(2) 本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，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；

(3) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；

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

(5) 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%；

(6) 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%；

(7) 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%；

(8) 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%；

(9) 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%；

(10) 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%；

(11) 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%；

(12) 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；

(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%，在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不展期；

(15) 基金总资产不得超过基金净资产的百分之一百四十；

(16) 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。基金管理人应制定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；

(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；

(18) 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%；

(19) 本基金在任何交易日日终，持有的买入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；

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

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

(22) 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%；

(23) 本基金持有单只中小企业私募债券，其市值不得超过该基金资产净值的10%；

(24) 本基金与本基金管理人管理的其他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%；本基金与本基金管理人管理的其他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%；

(25) 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；

(26) 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；

(27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

本基金在开始进行股指期货投资之前，应与基金托管人、期货公司三方一同就股指期货开户、清算、估值、交收等事宜另行签署协议。

除上述第(2)、(12)、(17)、(25)项外，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，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。

如果法律法规对上述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。

法律法规或监管部门对上述组合限制政策作出强制性调整的，本基金应当按照法律法规或监管部门的规定执行；如法律法规或监管部门对上述组合限制政策的调整或修改对本基金的效力并非强制性的，则基金管理人与基金托管协商一致后，可按照法律法规或监管部门调整或修改后的组合限制政策执行，而无需基金份额持有人大会审议决定，但基金管理人在执行法律法规或监管部门调整或修改后的组合限制政策前，应向投资者履行信息披露义务并向监管机关报告或备案。

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) 向其基金管理人、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。

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。

（五）业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×85%+上证国债指数收益率×15%

采用该业绩比较基准主要基于如下考虑：

1、沪深 300 指数是由中证指数有限公司编制的反映 A 股市场整体走势的指数，编制合理、透明、运用广泛，具有较强的代表性与权威性，能够反映 A 股市场总体发展趋势，可以作为本基金股票投资部分的基准。

2、上证国债指数是以上海证券交易所上市的所有固定利率国债为样本，按照国债发行量加权而成，是上证指数系列的第一只债券指数，能够反映债券市场整体变动状况，具有较强的市场代表性，可以作为本基金债券投资部分的基准。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，经与基金托管人协商一致，本基金可在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告，不需要召开基金份额持有人大会。

（六）风险收益特征

本基金为股票型基金，属于较高风险、较高预期收益率的基金产品。

（七）基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

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

2、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；

3、有利于基金财产的安全与增值；

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

（八）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、转融通。

（九）基金的投资组合报告

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司复核了本次更新招募说明书中的投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本投资组合报告期所载数据截止至 2021 年 3 月 31 日。本报告中财务资料未经审计。

一) 报告期末基金资产组合情况

单位：人民币元

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	277,594,019.95	92.74
	其中：股票	277,594,019.95	92.74
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	15,825,799.24	5.29
8	其他资产	5,918,534.80	1.98
9	合计	299,338,353.99	100.00

二) 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

单位：人民币元

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	17,845,986.00	5.99
C	制造业	187,057,071.89	62.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供	108,186.12	0.04

	应业		
E	建筑业	107,944.00	0.04
F	批发和零售业	650,758.76	0.22
G	交通运输、仓储和邮政业	3,148,696.20	1.06
H	住宿和餐饮业	270,250.00	0.09
I	信息传输、软件和信息技术服务业	392,985.38	0.13
J	金融业	27,322,663.30	9.17
K	房地产业	6,069,338.30	2.04
L	租赁和商务服务业	25,749,537.32	8.64
M	科学研究和技术服务业	4,166,942.00	1.40
N	水利、环境和公共设施管理业	150,200.68	0.05
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	53,523.00	0.02
Q	卫生和社会工作	4,465,065.00	1.50
R	文化、体育和娱乐业	34,872.00	0.01
S	综合	-	-
	合计	277,594,019.95	93.17

2、报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本报告期末未持有沪港通股票。

三) 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	601888	中国中免	74,154	22,697,056.32	7.62
2	600519	贵州茅台	10,682	21,460,138.00	7.20
3	300750	宁德时代	60,039	19,342,764.63	6.49
4	002271	东方雨虹	370,701	18,965,063.16	6.37
5	600188	兖州煤业	1,062,900	14,062,167.00	4.72
6	600019	宝钢股份	1,405,100	11,353,208.00	3.81
7	601012	隆基股份	127,664	11,234,432.00	3.77
8	601318	中国平安	141,600	11,143,920.00	3.74
9	600036	招商银行	212,855	10,876,890.50	3.65
10	600309	万华化学	100,335	10,595,376.00	3.56

四) 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注: 本基金本报告期末未持有债券。

五) 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

注: 本基金本报告期末未持有债券。

六) 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

注: 本基金本报告期末未持有资产支持证券。

七) 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

注: 本基金本报告期末未持有贵金属。

八) 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

注: 本基金本报告期末未持有权证。

九) 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

注: 本基金本报告期末未持有股指期货。

2、本基金投资股指期货的投资政策

注: 本基金本报告期末参与投资股指期货。

十) 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

注: 本基金未参与投资国债期货。

2、报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注: 本基金本报告期末未持有国债期货。

3、本期国债期货投资评价

注: 本基金未参与投资国债期货。

十一) 投资组合报告附注

1、本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内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、处罚的情形及相关投资决策程序说明。

隆基股份（601012）：

隆基股份于2020年4月19日发布《河南隆基建设有限公司被郑州市金水区税务局行政处罚金水税罚（2019）178561号》的公告，主要内容为河南隆基2016年10月个人所得税未按照规定期限办理纳税申报。

本基金管理人经过审慎分析，认为行政处罚未对上市公司整体经营产生重大影响。

除了以上证券外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体报告期内没有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、处罚的情形。

2、本基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库的情形。

3、其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	170,182.87
2	应收证券清算款	446,807.55
3	应收股利	-
4	应收利息	170,040.33
5	应收申购款	14,449.81
6	其他应收款	5,117,054.24
7	其他	-
8	合计	5,918,534.80

4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5、期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限的情况。

6、投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

十、基金的业绩

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预示其未来表现。投资有风险，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及基金合同。

(一) 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较(截至 2019 年 12 月 31 日):

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
2015 年 (2015 年 4 月 15 日至 2015 年 12 月 31 日)	-20.40%	3.16%	-12.45%	2.30%	-7.95%	0.86%
2016 年 (2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日)	-18.59%	1.96%	-8.94%	1.19%	-9.65%	0.77%
2017 年 (2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日)	20.22%	0.82%	18.42%	0.54%	1.80%	0.28%

2018 年 (2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日)	-25.29%	1.38%	-21.10%	1.14%	-4.19%	0.24%
2019 年 (2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日)	28.35%	1.17%	31.08%	1.06%	-2.73%	0.11%
2020 年 (2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日)	64.93%	1.60%	23.77%	1.22%	41.16%	0.38%
自基金合同生效起至今 (2015 年 4 月 15 日至 2021 年 3 月 31 日)	13.10%	1.78%	17.89%	1.29%	-4.79%	0.49%

(二) 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

信达澳银转型创新股票型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2015 年 4 月 15 日生效，2015 年 5 月 18 日开始办理申购、赎回业务。

2、本基金的投资组合比例为：股票及存托凭证资产占基金资产的比例为 80%-95%，其中投资于本基金定义的转型创新主题相关的股票资产占非现金基金资产的比例不低于 80%；债券（含中小企业私募债、可转换债券等）资产、现金、货币市场工具、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例为 5%-20%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%；权证的投资比例不超过基金资产净值的 3%；资产支持证券的投资比例不超过基金资产净值的 20%。本基金按规定在合同生效后六个月内达到上述规定的投资比例。

3、本基金从 2022 年 06 月 01 日起新增 C 类基金份额，此前存续的基金份额为 A 类基金份额。

十一、基金的财产

（一）基金资产总值

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

（二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

（三）基金财产的账户

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

（四）基金财产的保管和处分

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

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

十二、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、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

（三）估值方法

1、证券交易所上市的有价证券的估值

（1）交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重

大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

（2）交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，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，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；

（3）交易所上市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债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

（4）交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

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

（3）首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

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

4、同一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。

5、本基金对中小企业私募债券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估价。

6、股票指数期货合约的估值：

(1) 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；

(2) 在任何情况下，基金管理人如采用本项第(1)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)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。

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

8、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进行。

9、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，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对于基金净值的计算结果对外予以公布。

(四) 估值程序

1、各类基金份额净值是按照每个工作日闭市后，某类基金份额的基金资产净值除以当日该类基金份额的余额数量计算，各类基金份额净值均精确到 0.001 元，小数点后第四位四舍五入。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各类基金份额净值，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，将各类基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人

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。当任一类基金份额净值小数点后 3 位以内(含第 3 位)发生估值错误时，视为该类基金份额净值错误。

基金合同的当事人应按照以下约定处理：

1、估值错误类型

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

上述估值错误的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等。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。由于不可抗力原因造成投资人的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

2、估值错误处理原则

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

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

（3）因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但估值错误责任方仍应对估值错误负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失(“受损方”)，则估值错误责任方应赔

偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给估值错误责任方。

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

(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。基金管理人和托管人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直接损失。

(7) 按法律法规规定的其他原则处理差错。

3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

(4) 根据估值错误处理的方法，需要修改基金登记机构交易数据的，由基金登记机构进行更正，并就估值错误的更正向有关当事人进行确认。

4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

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

(2) 错误偏差达到该类基金份额净值的 0.25% 时，基金管理人应当通报基金托

管人并报中国证监会备案；错误偏差达到该类基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告。

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

4、占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障投资人的利益，已决定延迟估值；如果出现基金管理人认为属于紧急事故的任何情况，导致基金管理人不能出售或评估基金资产时；

5、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

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

(八) 特殊情况的处理

1、基金管理人或基金托管人按估值方法第 7 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、期货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。

十三、基金收益与分配

（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多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 20%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后的各类基金份额净值均不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权，由于本基金各类基金份额收取费用情况不同，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

（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。由于不同基金份额类别对应的可分配收益不同，基金管理人可相应制定不同的收益分配方案。

（五）收益分配方案的确定、公告与实施

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

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相应类别的基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。

十四、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、销售服务费；
- 4、除法律法规、中国证监会另有规定外，《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券、期货交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、基金的开户费用、账户维护费用；
- 10、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

（二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由托管人根据与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，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。费用自动扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

2、基金托管人的托管费

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由托管人根据与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，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。费用自动扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

3、销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.60%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务。

销售服务费按 C 类基金份额前一日的基金资产净值的 0.60% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，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。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

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

（三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

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

（四）费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率等费率，须召开基金份额持有人大会；调低基金管理费率、基金托管费率等费率，无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前 2 日在至少一种指定媒介上公告。

（五）基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。基金财产投资的相关税收，由基金份额持有人承担。

十五、基金的会计与审计

（一）基金会计政策

- 1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；
- 2、基金的会计年度为公历年度的 1 月 1 日至 12 月 31 日；基金首次募集的会计年度按如下原则：如果《基金合同》生效少于 2 个月，可以并入下一个会计年度；
- 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在 2 日内在指定媒介公告。

十六、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披露方式、登载媒介、报备方式等规定发生变化时，本基金从其最新规定。

（二）信息披露义务人

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律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媒介披露，并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

（三）本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

- 1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；
- 2、对证券投资业绩进行预测；

- 3、违规承诺收益或者承担损失；
- 4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构；
- 5、登载任何自然人、法人和非法人组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；
- 6、中国证监会禁止的其他行为。

（四）本基金公开披露的信息应采用中文文本。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：

1、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，并刊登在指定网站及基金销售机构网站或营业网点；基金产品资料概要其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金产品资料概要。

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

应当将《基金合同》、基金托管协议登载在网站上。

2、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。

3、《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。

4、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各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。

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各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。

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各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。

5、基金份额申购、赎回价格

基金管理人应当在《基金合同》、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资者能够在基金销售机构网站或营业网点查阅或者复制前述信息资料。

6、基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告

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

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

基金管理人应当在每个季度结束之日起 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。

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

7、临时报告

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，并登载在指定报刊和指定网站上。

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

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

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，中国证监会另有规定的情形除外；

14) 基金收益分配事项；

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

16) 任一类基金份额净值计价错误达该类基金份额净值百分之零点五；

17) 本基金开始办理申购、赎回；

18) 本基金发生巨额赎回并延期办理；

19) 本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；

20) 本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；

21) 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时；

22) 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。

8、澄清公告

在《基金合同》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。

9、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，应当依法报国务院证券监督管理机构备案，并予以公告。

10、投资于股指期货的信息

本基金投资股指期货，需按规定在季度报告、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。

11、投资于中小企业私募债的信息

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。本基金投资中小企业私募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中小企业私募债券的名称、数量、期限、收益率等信息，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）等文件中披露中小企业私募债券的投资情况。

12、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。

13、本基金投资存托凭证的信息披露依照境内上市交易的股票执行。

14、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、各类基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告、更新的招募说明书、基金产品资料概要、基金清算报告等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人进行书面或电子确认。

基金管理人、基金托管人应当在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。

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）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、期货交易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。

十七、风险揭示

（一）市场风险

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

1、政策风险

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

2、经济周期风险

证券市场是国民经济的晴雨表，而经济运行则具有周期性的特点。随宏观经济

运行的周期性变化，基金所投资于证券的收益水平也会随之变化，从而产生风险。

3、利率风险

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

4、收益率曲线风险

不同信用水平货币市场投资品种应具有不同短期收益率曲线结构，若收益率曲线没有如预期变化导致基金投资决策出现偏差将影响基金的收益水平。

5、购买力风险

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

6、国际竞争风险

随着中国市场开放程度的提高，上市公司的发展必然要受到国际市场同类技术或同类产品公司的强有力竞争，部分上市公司有可能不能适用新的行业形势而业绩下滑。尤其是中国加入 WTO 以后，中国境内公司将面临前所未有的市场竞争，上市公司在这些因素的影响下将存在更大不确定性。

7、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、财务状况、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。上市公司还可能出现难以预见的变化。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。

（二）信用风险

基金交易对手方发生交易违约或者基金持仓债券的发行人拒绝支付债券本息，导致基金财产损失。

（三）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。

（四）流动性风险

本基金运作方式为契约型开放式，基金规模将随着基金投资者对基金份额的申购和赎回而不断波动，若由于基金投资者的连续大量赎回，导致基金管理人的现金支付出现困难，或被迫在不适当的价格大量抛售证券，使基金资产净值受到不利影响，从而产生流动性风险。

本基金主要的流动性风险管理方法说明：

1. 本基金的申购、赎回安排

本基金的申购、赎回安排详见招募说明书“第八部分 基金份额的申购与赎回”。

2. 拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

债券市场流动性风险是指通过该市场来出售与购买债券方面存在的困难而对投资者所形成的风险。因银行间债券市场具有交易频繁、交易金额较大、交易链条较长的特点、若个别机构因流动性不足、则有可能造成后续交易链条中的其他机构收到牵连，将会对市场的稳定性造成影响。

3. 巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

在本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决定全额赎回或延缓支付赎回款项。同时，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工作日基金总份额的 10%，基金管理人应当先行对该单个基金份额持有人超出 10% 以上的部分赎回申请实施延期办理，而对该单个基金份额持有人 10% 以内（含 10%）的赎回申请与当日其他投资者的赎回申请按全额赎回或延缓支付赎回款项条款处理。

4. 实施备用流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响

本基金可能实施备用的流动性风险管理工具，以更好地应对流动性风险。基金管理人经与基金托管人协商，在确保投资者得到公平对待的前提下，可依照法律法规及基金合同的约定，综合运用各类流动性风险管理工具，对赎回申请等进行适度调整，作为特定情形下基金管理人流动性风险管理的辅助措施，包括但不限于：（1）延期办理巨额赎回申请；（2）暂停接受赎回申请；（3）延缓支付赎回款项；（4）收取短期赎回费，本基金对持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5% 的赎回费；（5）暂停基金估值，当前一估值日基金资产净值 50% 以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人

协商一致，本基金将暂停基金估值。

当基金管理人实施流动性风险管理工具时，可能对投资者产生一定的潜在影响，包括但不限于不能申购本基金、赎回申请不能确认或者赎回款项延迟到账、如持有期限少于7日会产生较高的赎回费造成收益损失等。提示投资者了解自身的流动性偏好、合理做好投资安排。

（五）本基金特有风险

本基金属于股票型基金，股票投资比例保持在80%以上，同时本基金也将适度投资于固定收益市场，如果股票市场、债券市场出现整体下跌，本基金的净值表现将受到影响。本基金在股票投资中重点配置转型创新主题的上市公司股票，这种评估具有一定的主观性，将在个股投资决策中给基金带来一定的不确定性风险。该类股票的波动会受到宏观经济环境、行业周期和公司自身经营状况等因素的影响，从而导致本基金的投资风险。另外，本基金的资产配置模型有可能不能预测市场未来较短时间内非理性的变动，造成基金净值表现低于市场表现。同时本基金可能因持续规模较小而被合并导致基金终止的风险。

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

（六）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、因业务竞争压力可能产生的风险；
- 6、其他风险。

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。对于可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

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

（二）《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，在履行相关程序后，《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具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

(七) 基金财产清算账册及文件的保存

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

十九、基金合同的内容摘要

(一) 基金合同当事人的权利及义务

1、基金管理人的权利与义务

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

1) 依法募集基金；

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) 召集基金份额持有人大会;
 - 6) 依据《基金合同》及有关法律的规定监督基金托管人, 如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律的规定, 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》及有关法律的规定决定基金收益的分配方案;
 - 11) 在《基金合同》约定的范围内, 拒绝或暂停受理申购与赎回申请;
 - 12) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利, 为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利;
 - 13) 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;
 - 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、转换和非交易过户的业务规则;
 - 17) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。
- (2) 根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定, 基金管理人的义务包括但不限于:
- 1) 依法募集基金, 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、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。

2、基金托管人的权利与义务

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

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

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

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

4) 根据相关市场规则，为基金开设证券账户、为基金办理证券交易资金清算。

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和证券账户, 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、各类基金份额净值、基金份额申购、赎回价格;

9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项;

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

11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 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。

3、基金份额持有人的权利与义务

(1) 根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金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者按规定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》；

2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，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各种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。

4、本基金合同当事各方的权利义务以本基金合同为依据，不因基金账户名称而有所改变。

(二) 基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

本基金份额持有人大会不设日常机构。

1、召开事由

(1) 当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

1) 终止《基金合同》（法律法规、中国证监会另有规定的除外）；

2) 更换基金管理人；

3) 更换基金托管人；

4) 转换基金运作方式（法律法规、中国证监会另有规定的除外）；

5) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准或提高销售服务费率，但法律法规要求提高该等报酬标准或基金合同另有约定的除外；

6) 变更基金类别；

- 7) 本基金与其他基金的合并（法律法规、中国证监会另有规定的除外）；
- 8) 变更基金投资目标、范围或策略（法律法规、中国证监会另有规定或基金合同另有约定的除外）；
- 9) 变更基金份额持有人大会程序，法律法规、中国证监会另有规定的除外；
- 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) 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) 调低基金管理费、基金托管费及其他应由基金承担的费用；
- 2) 法律法规要求增加的基金费用的收取；
- 3) 在不违反法律法规和基金合同约定且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率、销售服务费率、变更收费方式、或增加、减少、调整基金份额类别设置；
- 4) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；
- 5) 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生变化；
- 6) 在不违反法律法规和基金合同约定且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金推出新业务或服务；
- 7) 在不违反法律法规和基金合同约定且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人、登记机构、基金销售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；
- 8) 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。

2、会议召集人及召集方式

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

(2) 基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集；

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

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

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

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

3、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) 授权委托书证明的内容要求(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、书面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书面表决意见的计票进行监督的,不影响表决意见的计票效力。

4、基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式或法律法规和监管机关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书委派代表出席,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书符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定,并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符;

- 2) 经核对,汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示,有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一(含二分之一)。若

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

（2）通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式在表决截至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）到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取书面表决意见的，不影响表决效力；

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

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

5）会议通知公布前报中国证监会备案。

（3）在法律法规或监管机构允许的情况下，经会议通知载明，基金份额持有

人也可以采用网络、电话或其他方式进行表决，或者采用网络、电话或其他合法方式授权他人代为出席会议并表决。

(4) 在会议召开方式上，本基金亦可采用其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开基金份额持有人大会，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。

5、议事内容与程序

(1) 议事内容及提案权

1) 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。

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进行解释和说明。

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) 单独或合并持有权益登记日基金总份额 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。

6) 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7条规定程序确定和公布监票人,然后由大会主持人宣读提案,经讨论后进行表决,并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表,在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下,由基金托管人授权其出席会议的代表主持;如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会,则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的二分之一以上(含二分之一)选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会,不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名(或单位名称)、身份证明文件号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名(或单位名称)和联系方式等事项。

2) 通讯开会

在通讯开会的情况下,首先由召集人提前30日公布提案,在所通知的表决截止日期后2个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决,在公证机关监督下形成决议。

6、表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议:

(1) 一般决议,一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上(含二分之一)通过方为有效;除下列第(2)项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

(2) 特别决议,特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上(含三分之二)通过方可做出。除基金合同另有约定外,转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、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书面表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

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

7、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。

若监督员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。

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

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

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

(2) 通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计

票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

若监督员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。

8、生效与公告

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

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 日内在指定媒介上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

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

9、本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人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。

（三）基金合同的变更、终止与基金财产的清算

1、《基金合同》的变更

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

（2）关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，并自决议生效后两日内在指定媒介公告。

2、《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，在履行相关程序后，《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。

3、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) 对基金财产进行分配。

(5)、基金财产清算的期限为 6 个月。

4、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。

5、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。

6、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具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见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。

7、基金财产清算账册及文件的保存

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

（四）争议的处理和适用的法律

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，任何一方均有权将争议提交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，仲裁费用和律师费均由败诉方承担。

争议处理期间，《基金合同》各方当事人应恪守职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行《基金合同》规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

《基金合同》受中国法律管辖。

（五）基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

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

二十、基金托管协议的内容摘要

（一）基金托管协议当事人

1、基金管理人

名称：信达澳亚基金管理有限公司

注册地址：深圳市南山区粤海街道海珠社区科苑南路 2666 号中国华润大厦 L1001

办公地址：深圳市南山区科苑南路 2666 号中国华润大厦 10 层

邮政编码：518063

法定代表人：朱永强

成立日期：2006年6月5日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2006]071号

组织形式：有限责任公司

注册资本：壹亿元

存续期间：持续经营

经营范围：基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务

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)

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：王洪章

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

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，以便基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合《基金合同》关于证券选择标准的约定进行

监督，对存在疑义的事项进行核查。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票等）、存托凭证、债券（含中小企业私募债、可转换债券等）、债券回购、现金、货币市场工具、权证、股指期货、资产支持证券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。

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

本基金的投资组合比例为：股票及存托凭证资产占基金资产的比例为 80%-95%，其中投资于本基金定义的转型创新主题相关的股票资产占非现金基金资产的比例不低于 80%；债券（含中小企业私募债、可转换债券等）资产、现金、货币市场工具、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例为 5%-20%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；权证的投资比例不超过基金资产净值的 3%；资产支持证券的投资比例不超过基金资产净值的 20%。

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）本基金的投资组合比例为：股票及存托凭证资产占基金资产的比例为 80%-95%，其中投资于本基金定义的转型创新主题相关的股票资产占非现金基金资产的比例不低于 80%；债券（含中小企业私募债、可转换债券等）资产、现金、货币市场工具、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例为 5%-20%；

（2）本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当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；

（3）本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；

（4）本基金持有的全部权证，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%；

(6) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；

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

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

(9) 本基金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；

(10) 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；

(11) 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%，在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不展期；

(12) 本基金基金总资产不得超过基金净资产的百分之一百四十；

(13) 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 15%；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 5%；

(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%。

(16) 本基金在任何交易日日终，持有的买入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。

(17) 本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的

股票总市值的 20%。

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

(19) 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%。

(20) 本基金持有单只中小企业私募债券，其市值不得超过该基金资产净值的 10%；

(21) 本基金与本基金管理人管理的且由本基金托管人托管的其他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%；本基金与本基金管理人管理的且由本基金托管人托管的其他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；

(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，与境内上市交易的股票合并计算；

本基金在进行股指期货投资之前，应与基金托管人、期货公司三方一同就股指期货开户、清算、估值、交收等事宜另行签署协议。

如果法律法规对上述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，则本基金投资不再受相关限制。

除上述第（2）、（9）、（14）、（22）项外，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

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，法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。

法律法规或监管部门对上述组合限制政策作出强制性调整的，本基金应当按照法律法规或监管部门的规定执行；如法律法规或监管部门对上述组合限制政策的调整或修改对本基金的效力并非强制性的，则基金管理人与基金托管协商一致后，可按照法律法规或监管部门调整或修改后的组合限制政策执行，而无需基金份额持有

人大会审议决定，但基金管理人在执行法律法规或监管部门调整或修改后的组合限制政策前，应向投资者履行信息披露义务并向监管机关报告或备案。

在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

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通过事后监督方式进行监督。

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，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。

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。

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。

5、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。对本基金因投资受限证券导致的流动性风险，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，基金管理人应在两日内编制临时报告书，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) 本基金投资受限证券时的法律法规遵守情况。

2) 在基金投资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受限证券有新规定的，从其规定。

6、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。

7、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、各类基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查。

8、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。

9、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。

10、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。

11、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。

（三）基金管理人对于基金托管人的业务核查

1、基金管理人对于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各类基金份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

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

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结算公司结算数据完成场内交易交收、托管资产开户银行扣收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。

2、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。

3、基金银行账户的开立和管理

(1) 基金托管人应负责本基金的资金账户的开设和管理。

(2) 基金托管人可以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。本基金的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益、收取申购款，均需通过本基金的资金账户进行。

(3) 基金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。

(4) 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。

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

4、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。

证券账户开户费由本基金财产承担，于证券账户开立次月第七个工作日由基金

托管人从本基金银行存款账户中直接扣收；若因基金银行存款余额不足导致证券账户开户费无法扣收，基金托管人顺延至次月第七个工作日进行扣收；证券账户开立后连续六个月内，因本基金银行存款余额持续不足导致证券账户开户费无法扣收的，基金管理人有权先行支付基金托管人垫付的开户费用。

(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，则基金托管人比照上述关于账户开立、使用的规定执行。

5、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。

6、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。

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

际有效控制的资产不承担保管责任。

8、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。

(五) 基金资产净值计算和会计核算

1、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。各类基金份额净值是按照每个交易日闭市后，某类基金份额的基金资产净值除以当日该类基金份额的余额数量计算，各类基金份额净值均精确到 0.001 元，小数点后第四位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

每个交易日计算基金资产净值及各类基金份额净值，并按规定公告。

(2) 基金管理人应每交易日对基金资产估值。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。基金管理人每个交易日对基金资产估值后，将各类基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

2、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、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

(2) 估值方法

1) 证券交易所上市的有价证券的估值

①交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收

盘价) 估值; 如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的, 可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素, 调整最近交易市价, 确定公允价格;

②交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值, 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, 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;

③交易所上市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债券应收利息得到的净价进行估值; 估值日没有交易的, 且最近交易日后经济环境未发生重大变化, 按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的, 可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素, 调整最近交易市价, 确定公允价格;

④交易所上市不存在活跃市场的有价证券, 采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券, 采用估值技术确定公允价值, 在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下, 按成本估值。

2) 处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理:

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

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

③首次公开发行有明确锁定期的股票, 同一股票在交易所上市后, 按交易所上市的同一股票的估值方法估值; 非公开发行有明确锁定期的股票, 按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

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

4) 同一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。

5) 股票指数期货合约的估值:

① 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。

② 在任何情况下，基金管理人如采用本项第①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。

6) 本基金对中小企业私募债券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估价。

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

8) 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进行。

9) 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 7) 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。

3、基金份额净值错误的处理方式

(1) 当任一类基金份额净值小数点后 3 位以内(含第 3 位)发生差错时，视为该类基金份额净值错误；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；错误偏差达到该类基金份额净值的 0.25%时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到该类基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告；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各类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各类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各类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、期货交易所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。

4、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) 占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障投资人的利益，已决定延迟估值；如果出现基金管理人认为属于紧急事故的任何情况，导致基金管理人不能出售或评估基金资产时；

(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一致的；

(5) 中国证监会和《基金合同》认定的其他情形。

5、基金会计制度

按国家有关部门规定的会计制度执行。

6、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。

7、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。

8、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，法律法规另有规定的从其规定。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，并保证其的真实性、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）托管协议的变更、终止与基金财产的清算

1、托管协议的变更程序

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

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。

3、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) 将清算结果报中国证监会备案并公告；

7) 对基金财产进行分配。

(5) 基金财产清算的期限为 6 个月。

(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具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计、并由律师事务所出具法律意见书后，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15年以上，法律法规另有规定的从其规定。

（10）本基金被其他基金吸收合并引起本基金基金合同终止的，本基金财产可不予变现和分配，并入其他基金。本基金的债权债务由合并后的基金享有和承担。本基金清算的其他事项按照《基金合同》的其他约定执行。

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，并将根据基金份额持有人的需要和市场的变化增加、修改这些服务项目。

（一）服务内容

1、基金份额持有人注册登记服务

基金管理人委托注册登记机构为基金份额持有人提供注册登记服务。基金注册登记机构配备安全、完善的电脑系统及通讯系统，准确、及时地为基金投资者办理基金账户、基金份额的登记、管理、托管与转托管，股东名册的管理，权益分配时红利的登记、派发，基金交易份额的清算过户和基金交易资金的交收等服务。

2、红利再投资服务

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，且不收取任何申购费用。

3、定期定额投资计划

基金管理人在合适时机将为基金投资者提供定期定额投资的服务。通过定期定

额投资计划，投资者可以通过固定的渠道，定期定额申购基金份额，该定期申购计划不受最低申购金额的限制，以另行公告为准。

4、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。

5、基金网上交易服务

基金管理人已经开通网上交易服务。在未来市场和技术条件成熟时，基金管理人将提供更多类型的基金电子交易服务。

6、理财服务

基金份额持有人可通过公司网站、在线客服、客服电话等方式向本基金管理人定制电子对账单。基金管理人将对留有联系方式的客户按照约定的方式向客户主动提供电子邮件和短信服务。但由于基金份额持有人未详实填写或未及时更新相关信息（包括手机号码、电子邮箱等）导致基金管理人无法送达的除外。如无联系方式的客户您可以通过以下渠道进行查询或者订阅电子、短信账单。

网站 www.fscinda.com

客服电话：400-8888-118

基金管理人提供多样化服务模式，包括客服热线、网站查询、网站在线客服，实行工作日人工服务、7×24小时自助服务方式，基金份额持有人可与基金管理人及时沟通，参与基金管理人举办的各种互动活动。基金管理人也将妥善处理基金份额持有人提出的建议或投诉。

（二）联系方式

1、信达澳亚公司客服电话：400-8888-118/0755-83160160/83077038（传真）

2、信达澳亚公司网址：www.fscinda.com

3、信达澳亚直销中心电话：0755-82858168/83077068/83077038（传真）

二十二、其他应披露事项

序号	公告事项	法定披露日期
----	------	--------

1	信达澳银基金管理有限公司旗下基金年度净值公告	2020年1月1日
2	信达澳银基金行业高级管理人员变更公告	2020年1月2日
3	信达澳银转型创新股票型证券投资基金招募说明书（更新）	2020年1月6日
4	信达澳银转型创新股票型证券投资基金招募说明书（更新）摘要	2020年1月6日
5	信达澳银转型创新股票型证券投资基金2019年第4季度报告	2020年1月18日
6	信达澳银基金管理有限公司关于调整旗下基金2020年春节假期清算交收安排及申购赎回等交易业务的提示性公告	2020年1月30日
7	信达澳银基金管理有限公司关于直销账户信息的提示性公告	2020年2月4日
8	信达澳银基金管理有限公司关于网上交易系统升级对外业务暂停服务的公告	2020年2月28日
9	信达澳银转型创新股票型证券投资基金招募说明书（更新）摘要	2020年3月6日
10	信达澳银转型创新股票型证券投资基金招募说明书（更新）	2020年3月6日
11	信达澳银基金管理有限公司关于在网上直销平台开展货币基金转换业务费率优惠活动的公告	2020年3月9日
12	信达澳银基金管理有限公司关于公司法定代表人变更的公告	2020年3月17日
13	信达澳银基金管理有限公司关于推迟披露旗下公募基金2019年年度报告的公告	2020年3月26日
14	信达澳银转型创新股票型证券投资基金2020年第1季度报告	2020年4月22日

15	信达澳银转型创新股票型证券投资基金 2019 年年度报告	2020 年 4 月 30 日
16	信达澳银基金管理有限公司关于公司北京分公司迁址的公告	2020 年 5 月 13 日
17	信达澳银基金管理有限公司关于取消纸质对账单的公告	2020 年 5 月 20 日
18	信达澳银基金管理有限公司关于网上交易系统升级对外业务暂停服务的公告	2020 年 5 月 22 日
19	信达澳银基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	2020 年 6 月 22 日
20	信达澳银基金管理有限公司关于网上交易系统升级对外业务暂停服务的公告	2020 年 6 月 24 日
21	信达澳银基金管理有限公司旗下基金半年度净值公告	2020 年 7 月 1 日
22	信达澳银基金管理有限公司在直销柜台开展认购申购费率优惠活动的公告	2020 年 7 月 13 日
23	信达澳银基金管理有限公司直销柜台开展认购申购费率优惠活动的公告	2020 年 7 月 15 日
24	信达澳银转型创新股票型证券投资基金 2020 年二季度报告	2020 年 7 月 20 日
25	信达澳银基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	2020 年 8 月 1 日
26	信达澳银基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	2020 年 8 月 22 日
27	信达澳银转型创新股票型证券投资基金 2020 年中期报告	2020 年 8 月 28 日
28	信达澳银转型创新股票型证券投资基金基金产品资料概要更新	2020 年 8 月 28 日
29	信达澳银基金管理有限公司关于提醒投资者谨防金融诈骗的提示性公告	2020 年 9 月 30 日

30	信达澳银转型创新股票型证券投资基金 2020 年三季度报告	2020 年 10 月 28 日
31	信达澳银基金管理有限公司旗下基金年度净值公告	2021 年 1 月 1 日
32	信达澳银基金管理有限公司关于系统维护对外业务暂停服务的公告	2021 年 1 月 8 日
33	信达澳银基金管理有限公司关于网上交易系统、微信交易系统升级对外业务暂停服务的公告	2021 年 1 月 19 日
34	信达澳银转型创新股票型证券投资基金 2020 年四季度报告	2021 年 1 月 21 日
35	信达澳银基金管理有限公司关于我司旗下部分基金参加腾安基金费率优惠活动的公告	2021 年 2 月 22 日
36	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金持有的债券调整估值的公告	2021 年 3 月 10 日
37	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金持有的债券调整估值的公告	2021 年 3 月 11 日
38	信达澳银基金管理有限公司关于旗下部分基金在东方财富证券股份有限公司开通定投业务的公告	2021 年 3 月 18 日
39	关于旗下基金持有的债券调整估值的公告	2021 年 3 月 18 日
40	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金持有的债券调整估值的公告	2021 年 3 月 19 日
41	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金持有的债券调整估值的公告	2021 年 3 月 24 日
42	信达澳银转型创新股票型证券投资基金 2020 年年度报告	2021 年 3 月 30 日
43	信达澳银基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	2021 年 3 月 30 日

44	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金持有的债券调整估值的公告	2021年4月8日
45	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金持有的债券调整估值的公告	2021年4月16日
46	信达澳银转型创新股票型证券投资基金2021年一季度报告	2021年4月21日

二十三、招募说明书的存放及查阅方式

（一）招募说明书的存放地点

本招募说明书存放在基金管理人、销售机构和注册登记机构的办公场所，并刊登在基金管理人的网站上。

（二）招募说明书的查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅本基金的招募说明书，也可按工本费购买本招募说明书的复印件，但应以本基金招募说明书的正本为准。

二十四、备查文件

备查文件等文本存放在基金管理人和销售机构的办公场所和营业场所，在办公时间内可供免费查阅。

- （一）中国证监会注册信达澳银转型创新股票型基金募集的文件
- （二）《信澳转型创新股票型证券投资基金基金合同》
- （三）《信澳转型创新股票型证券投资基金托管协议》
- （四）《信达澳亚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和营业执照
- （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

信达澳亚基金管理有限公司

二〇二二年六月一日