

广发积极优势一年封闭运作混合型基金中
基金（FOF-LOF）
A 类基金份额
上市交易公告书

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

A 类基金份额注册登记人：中国证券登记结算有限责任公司

上市地点：深圳证券交易所

上市时间：2022 年 8 月 9 日

公告日期：2022 年 8 月 4 日

目录

一、	重要声明与提示.....	1
二、	基金概览	2
三、	基金的募集与上市交易.....	3
四、	持有人户数、持有人结构及前十名持有人.....	6
五、	基金主要当事人简介.....	7
六、	基金合同摘要	12
七、	基金财务状况	12
八、	基金投资组合	13
九、	基金中基金	16
十、	重大事件揭示	17
十一、	基金管理人承诺	18
十二、	基金托管人承诺	18
十三、	备查文件目录	18
附件：	基金合同摘要	19

一、重要声明与提示

《广发积极优势一年封闭运作混合型基金中基金（FOF-LOF）A 类基金份额上市交易公告书》（以下简称“本报告”）依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 1 号〈上市交易公告书的内容与格式〉》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，本基金管理人广发基金管理有限公司的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，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。本基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司保证本报告中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、深圳证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。凡本报告未涉及的有关内容，请投资者详细查阅 2022 年 3 月 24 日刊登在中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）和基金管理人网站（www.gffunds.com.cn）的《广发积极优势一年封闭运作混合型基金中基金（FOF-LOF）招募说明书》。

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

本基金《基金合同》生效后，连续五十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 万元人民币的情形，基金合同将自动终止。

在本基金封闭运作期内，基金份额持有人不能赎回基金份额，只能通过证券市场二级市场交易卖出基金份额变现。在证券市场持续下跌、基金二级市场交易不活跃等情形下，有可能出现基金份额二级市场交易价格低于基金份额净值的情形，即基金折价交易，从而影响持有人收益或产生损失。

本基金基金合同生效后的前一年为封闭运作期，封闭运作期届满后，本基金转为上市开放式基金（LOF），基金名称调整为“广发积极优势混合型基金中基金（FOF-LOF）”。

本基金为混合型基金中基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。投资者在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：本基金的特定风险，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。

本基金将投资内地与香港股票市场交易互联互通机制试点允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”），但会根据市场环境的变化以及投资策略的需要进行调整，选择将部分基金资产投资于港股通标的股票或选择不将基金资产投资于港股通标的股票，因此本基金存在不对港股进行投资的可能。

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

本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临投资存托凭证的特殊风险，详见招募说明书“风险揭示”部分。

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

二、 基金概览

1. 基金名称：广发积极优势一年封闭运作混合型基金中基金（FOF-LOF）

（1）A类基金份额

基金代码：162721

基金简称：广发积极优势一年封闭混合（FOF-LOF）A

基金场内简称：广发积极FOF-LOF

（2）C类基金份额

基金代码：013954

基金简称：广发积极优势一年封闭混合（FOF-LOF）C

2. 基金类型：基金中基金（FOF）

3. 基金运作方式：契约型开放式。

基金合同生效后的前一年为封闭运作期。在封闭运作期内，本基金不办理申购与赎回业

务。封闭运作期内A类基金份额上市交易后，投资者可将其持有的场外A类基金份额通过办理跨系统转托管业务转至场内后上市交易。封闭运作期届满后，本基金转为上市开放式基金（LOF），基金名称调整为“广发积极优势混合型基金中基金（FOF-LOF）”，并接受场外、场内申购赎回。基金管理人有权在封闭运作期届满前召集基金份额持有人大会，审议是否在封闭运作期届满后延长封闭运作期及延长封闭运作期的期限，具体事项由基金管理人另行公告。

4. 基金存续期限：不定期

5. 基金份额总额：

2022年8月2日，本基金总份额为408,994,101.61份，其中A类基金份额396,151,983.68份，C类基金份额12,842,117.93份。

6. 基金份额净值：

2022年8月2日，A类基金份额净值为1.0045，C类基金份额净值为1.0039。

7. 本次上市交易A类场内基金份额：235,648,717.00份

8. 上市交易的证券交易所：深圳证券交易所

9. 上市交易日期：2022年8月9日

10. 基金管理人：广发基金管理有限公司

11. 基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

12. 上市推荐人：无

13. 本次上市交易的A类基金份额登记机构：中国证券登记结算有限责任公司

三、 基金的募集与上市交易

（一） 本基金募集情况

1. 基金募集申请的核准机构和核准文号：中国证券监督管理委员会证监许可(2021)3172号。

2. 基金运作方式：契约型开放式。

基金合同生效后的前一年为封闭运作期。在封闭运作期内，本基金不办理申购与赎回业务。

封闭运作期内A类基金份额上市交易后，投资者可将其持有的场外A类基金份额通过办理跨系统转托管业务转至场内后上市交易。封闭运作期届满后，本基金转为上市开放式基金（LOF），基金名称调整为“广发积极优势混合型基金中基金（FOF-LOF）”，并接受场外、场内申购赎回。

基金管理人有权在封闭运作期届满前召集基金份额持有人大会，审议是否在封闭运作期届满后延长封闭运作期及延长封闭运作期的期限，具体事项由基金管理人另行公告。

3. 基金合同期限：不定期。

4. 发售方式：本基金A类基金份额通过场内、场外两种方式公开发售，C类基金份额仅通过场外方式公开发售。

5. 发售日期及发售期限：本基金自2022年3月28日至2022年6月2日公开发售，共发售44个工作日。

6. 发售价格：人民币1.00元。

7. A类基金份额发售机构

(1) 场外发售机构

①直销机构：广发基金管理有限公司

②场外销售机构：详见基金管理人网站公示的基金销售机构名录。

(2) 场内销售机构：本基金办理场内认购业务的销售机构为具有基金销售业务资格、并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的深圳证券交易所会员单位。具体会员名单如下：爱建证券、安信证券、渤海证券、财达证券、财通证券、财信证券、长城证券、长江证券、川财证券、大通证券、大同证券、德邦证券、第一创业、东北证券、东方财富、东方证券、东海证券、东莞证券、东吴证券、东兴证券、高华证券、方正证券、光大证券、广发证券、国都证券、国海证券、国金证券、国开证券、国联证券、国融证券、国盛证券、国泰君安、国信证券、国元证券、海通证券、恒泰证券、红塔证券、宏信证券、华安证券、华宝证券、华创证券、华福证券、华金证券、华林证券、华龙证券、华融证券、华泰证券、华西证券、华鑫证券、江海证券、金元证券、九州证券、开源证券、联储证券、民生证券、南京证券、平安证券、瑞银证券、山西证券、上海证券、申万宏源证券、申万宏源西部证券、世纪证券、首创证券、太平洋证券、天风证券、万和证券、万联证券、网信证券、五矿证券、西部证券、西南证券、长城国瑞、湘财证券、新时代证券、信达证券、兴业证券、银河证券、银泰证券、英大证券、甬兴证券、粤开证券、招商证券、浙商证券、中航证券、中金财富、中金公司、中山证券、中泰证券、中天证券、中信建投、中信山东、中信证券、中信证券华南、中银证券、中邮证券、中原证券（排名不分先后）

本基金发售结束前获得基金销售业务资格的深圳证券交易所会员单位也可代理本基金场内基金份额的发售。基金管理人不再就此事项进行公告。

8. C类基金份额发售机构

(1) 直销机构：广发基金管理有限公司

(2) 场外销售机构：详见基金管理人网站公示的基金销售机构名录。

9. 验资机构名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

10. 募集资金总额及入账情况

本基金于2022年3月28日起公开募集，基金募集工作已于2022年6月2日顺利结束。经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验资，本次首次发售募集的有效认购资金扣除认购费

后的净认购金额为人民币408,893,701.33元,折合408,893,701.33份基金份额;有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息为人民币100,829.45元,其中人民币100,400.28元折合100,400.28份基金份额,剩余人民币429.17元归入基金资产。其中A类基金已收到的首次发售募集的有效认购资金扣除认购费后的净认购金额为人民币396,056,890.63元,折合396,056,890.63份基金份额;有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息为人民币95,522.22元,其中人民币95,093.05折合95,093.05份基金份额,剩余人民币429.17元归入基金资产。C类基金已收到的首次发售募集的有效认购资金扣除认购费后的净认购金额为人民币12,836,810.70元,折合12,836,810.70份基金份额;有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息为人民币5,307.23元,折合5,307.23份基金份额。本次募集有效认购户数为3,321户,募集总金额合计408,994,101.61元人民币,折算成基金份额408,994,101.61份。本次募集资金已于2022年6月8日划入基金托管账户。

11. 募集备案情况

根据《中华人民共和国证券投资基金法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》以及《广发积极优势一年封闭运作混合型基金中基金(FOF-LOF)基金合同》《广发积极优势一年封闭运作混合型基金中基金(FOF-LOF)招募说明书》的有关规定,本基金募集符合有关条件,本基金管理人已向中国证监会办理基金备案手续,并于2022年6月9日获书面确认,基金合同自该日起正式生效。自基金合同生效之日起,本基金管理人开始正式管理本基金。

12. 基金合同生效日: 2022年6月9日

13. 基金合同生效日的基金份额总额: 本次募集资金及利息结转的基金份额共计408,994,101.61份,已全部计入投资者账户,归投资者所有。

(二) 基金上市交易

1. 基金上市交易的核准机构和核准文号: 深圳证券交易所深证上[2022]721号。

2. 上市交易日期: 2022年8月9日。

3. 上市交易的证券交易所: 深圳证券交易所。

4. 基金场内简称: 广发积极FOF-LOF。

5. 交易代码: 162721。

投资者在深圳证券交易所各会员单位证券营业部均可参与本基金的二级市场交易。

6. 本次上市交易A类场内基金份额: 235,648,717.00份。

7. 未上市交易份额的流通规定: 未上市交易的A类基金份额登记在中国证券登记结算有限责任公司开放式基金注册登记结算系统,基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下可通过跨系统转托管转至中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记结算系统后,在深圳证券交易所上市交易。本基金A类基金份额于2022年8月9日开始办理跨系统转托管业务。本基金C类基金份额不开通跨系统转托管业务。

8. 基金净值的披露: 基金管理人每个估值日对基金资产估值,用于基金信息披露的基金

资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。本基金A类份额上市交易后，投资者可在每个估值日（T日）后的三个工作日（T+3日）内通过基金管理人网站以及其他规定披露媒介查询到T日的基金份额净值和基金份额累计净值。

四、 持有人户数、持有人结构及前十名持有人

（一） 持有人户数

截至2022年8月2日，本基金份额持有人户数为3,314户，平均每户持有的基金份额为123,414.03份。其中A类份额持有人户数为3,070户，平均每户持有的基金份额为129,039.73份；上市交易的场内A类份额持有人户数为1,374户，平均每户持有的基金份额为171,505.62份。

（二） 持有人结构

1、截至2022年8月2日，本基金份额持有人结构如下：

本基金总份额408,994,101.61份，上市交易的A类场内基金份额235,648,717.00份。其中机构投资者持有的本次上市交易的A类场内基金份额为212,816,875.00份，占本次上市交易A类场内基金份额比例为90.31%；个人投资者持有的本次上市交易的A类场内基金份额为22,831,842.00份，占本次上市交易A类场内基金份额比例为9.69%。

2、截至2022年8月2日，基金管理人的从业人员持有本基金的情况：

基金管理人的基金从业人员持有基金份额35,258.39份，占基金份额总量的0.0086%。基金管理人高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为0；本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为0。

（三） 截至2022年8月2日，本基金前十名场内基金份额持有人情况

序号	持有人名称（全称）	持有场内基金份额	占场内基金份额的比例
1	上海证券—国泰君安证券股份有限公司—上海证券正和2号FOF单一资产管理计划	50,003,888.00	21.22%
2	北京惠隆资本管理有限责任公司—惠隆逐风者3号私募证券投资基金	30,000,583.00	12.73%
3	中信证券股份有限公司	12,800,871.00	5.43%
4	华鑫证券有限责任公司	12,001,233.00	5.09%
5	申万宏源证券有限公司	12,000,816.00	5.09%

6	长江证券股份有限公司	10,500,714.00	4.46%
7	安信证券资管—安信证券股份有限公司—安信资管安融1号FOF单一资产管理计划	10,001,680.00	4.24%
8	中国银河证券股份有限公司	10,000,777.00	4.24%
9	招商证券股份有限公司	10,000,583.00	4.24%
10	东兴证券股份有限公司	9,999,583.00	4.24%

五、 基金主要当事人简介

(一) 基金管理人

1、公司概况

名称：广发基金管理有限公司

法定代表人：孙树明

总经理：王凡

注册资本：14,097.8万元人民币

注册地址：广东省珠海市横琴新区环岛东路3018号2608室

设立批准文号：中国证监会证监基金字[2003]91号

工商登记注册的法人营业执照文号：914400007528923126

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、中国证监会许可的其他业务

2、股东及其出资比例

股东名称	出资比例
广发证券股份有限公司	54.533%
烽火通信科技股份有限公司	14.187%
深圳市前海香江金融控股集团有限公司	14.187%
广州科技金融创新投资控股有限公司	7.093%
嘉裕元（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙）	3.87%
嘉裕祥（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙）	2.23%
嘉裕禾（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙）	1.55%
嘉裕泓（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙）	1.19%
嘉裕富（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙）	1.16%
合计	100%

3、内部组织结构及职能

自成立以来，公司不断致力于健全公司治理结构，严格按照法律法规要求，建立组织架构健全、职能划分明晰、制衡监督有效、内部运作协调、激励约束合理的公司治理架构，保持公司规范运作，保护基金份额持有人利益。公司设置了健全、清晰的组织架构，并根据业务需要进行了合理的职能分工。

公司组织架构主要分为投研条线、市场条线和中后台条线。其中，投研条线包括主动权益、指数投资、量化投资、固定收益投资、国际投资、资产配置、宏观策略、行业研究等职能部门，负责按各自专业分工开展投资研究、投资管理等工作。市场条线包括产品设计、零售业务、机构业务、互联网金融业务、养老金业务、战略与创新业务等职能部门，负责按各自所属客户群体开展产品设计、客户推广和客户服务等工作；中后台条线包括风险管理板块、业务支持板块和管理支持板块，上述板块包含相应职能部门，风险管理板块主要负责投资、产品与市场、运营方面的合规管理、内审稽核、投资风险管理及数据服务等工作，业务支持板块主要负责信息安全与运维、系统开发、数据平台研发、组合交易、会计与结算、注册登记等工作，管理支持板块主要负责规划研究、财务管理、人力行政等工作。

4、基金管理业务情况

经中国证监会证监基金字[2003]91号文批准，广发基金管理有限公司于2003年8月5日成立。公司及旗下子公司目前拥有公募基金管理、社保基金境内委托投资管理人、基本养老保险基金证券投资管理机构、特定客户资产管理、基金投资顾问、QDII、RQFII、QFII、受托管理保险资金投资管理人和保险保障基金委托资产管理投资管理人等业务资格，是具备综合资产管理能力与经验的大型基金管理公司。

公司坚持“专业创造价值、客户利益为上”的理念，致力成为多资产、多策略、多市场的领先全能资产管理机构，为投资者创造长期、稳定、可持续的回报，为我国资本市场的繁荣与发展贡献力量。

5、信息披露负责人：程才良

咨询电话：020-83936666

6、截止2022年6月30日，广发基金管理有限公司总人数825人，其中博士学位24人、硕士学位555人和学士学位212人。

7、本基金基金经理

杨喆女士，经济学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任国泰君安证券股份有限公司研究所分析师；先后任交银施罗德基金管理有限公司量化投资部投资经理、多元资产管理部副总监、基金经理。现任广发基金管理有限公司资产配置部联席总经理、广发优选配置两年封闭运作混合型基金中基金（FOF-LOF）基金经理（自2021年11月2日起任职）、广发核

心优选六个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金经理（自2021年11月19日起任职）、广发悦享一年持有期混合型基金中基金（FOF）基金经理（自2022年1月25日起任职）、广发安裕稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）基金经理（自2022年3月15日起任职）、广发积极优势一年封闭运作混合型基金中基金（FOF-LOF）基金经理（自2022年6月9日起任职）。

（二）基金托管人

1、基金托管人概况

本基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司，基本信息如下：

名称：上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市中山东一路12号

办公地址：上海市中山东一路12号

法定代表人：郑杨

成立时间：1992年10月19日

经营范围：经中国人民银行和中国银行业监督管理委员会批准，公司主营业务主要包括：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；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；同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱业务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外币兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代客外汇买卖；资信调查、咨询、见证业务；离岸银行业务；证券投资基金托管业务；全国社会保障基金托管业务；经中国人民银行和中国银行业监督管理委员会批准经营的其他业务。

组织形式：股份有限公司

注册资本：293.52亿元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基金字[2003]105号

联系人：胡波

联系电话：（021）61618888

上海浦东发展银行自2003年开展资产托管业务，是较早开展银行资产托管服务的股份制商业银行之一。经过二十年来的稳健经营和业务开拓，各项业务发展一直保持较快增长，各项经营指标在股份制商业银行中处于较好水平。

上海浦东发展银行总行于2003年设立基金托管部，2005年更名为资产托管部，2013年更名为资产托管与养老金业务部，2016年进行组织架构优化调整，并更名为资产托管部，目前下设证券托管处、客户资产托管处、养老金业务处、内控管理处、业务保障处、总行资

产托管运营中心（含合肥分中心）六个职能处室。

目前，上海浦东发展银行已拥有客户资金托管、资金信托保管、证券投资基金托管、全球资产托管、保险资金托管、基金专户理财托管、证券公司客户资产托管、期货公司客户资产托管、私募证券投资基金托管、私募股权托管、银行理财产品托管、企业年金托管等多项托管产品，形成完备的产品体系，可满足多领域客户、境内外市场的资产托管需求。

2、主要人员情况

郑杨，男，1966 年出生，研究生学历，博士学位，高级经济师。曾任国家经贸委经济法规司调研处副处长；中国机电设备招标中心开发处处长、第七招标业务处处长；国家外汇管理局资本项目司副司长；中国人民银行上海分行党委委员、副行长、国家外汇管理局上海市分局副局长；中国人民银行上海总部党委委员、副主任兼外汇管理部主任；上海市金融工作党委副书记、市金融办主任；上海市金融工作党委书记、市金融办主任；上海市金融工作党委书记、市地方金融监管局（市金融工作局）局长。现任上海浦东发展银行党委书记、董事长。

潘卫东，男，1966 年出生，硕士研究生，高级经济师。曾任宁波证券公司业务一部副经理；上海浦东发展银行宁波分行资财部总经理兼任北仑办事处主任、宁波分行副行长；上海浦东发展银行产品开发部总经理；上海浦东发展银行昆明分行行长、党组书记；上海市金融服务办公室挂职并任金融机构处处长；上海国际集团党委委员、总经理助理，上海国际集团党委委员、副总经理，上海国际信托有限公司党委书记、董事长；上海浦东发展银行党委委员、执行董事、副行长、财务总监。现任上海浦东发展银行党委副书记、副董事长、行长，上海国际信托有限公司董事长。

孔建，男，1968 年出生，博士研究生。历任工商银行山东省分行资金营运处副处长，上海浦东发展银行济南分行信管处总经理，上海浦东发展银行济南分行行长助理、副行长、党委书记、行长。现任上海浦东发展银行总行金融市场业务党委委员，资产托管部总经理。

3、基金托管业务经营情况

截止 2022 年 6 月 30 日，上海浦东发展银行证券投资基金托管规模为 13,000.65 亿元，比去年末增加 1.74%。托管证券投资基金共三百七十只支。

4、基金托管人的内部控制制度

（1）本行内部控制目标为：确保经营活动中严格遵守国家有关法律法规、监管部门监管规则和本行规章制度，形成守法经营、规范运作的经营思想。确保经营业务的稳健运行，保证基金资产的安全和完整，确保业务活动信息的真实、准确、完整，保护基金份额持有人的合法权益。

（2）本行内部控制组织架构为：总行法律合规部是全行内部控制的牵头管理部门，指导业务部门建立并维护资产托管业务的内部控制体系。总行风险监控部是全行操作风险的牵头管理部门。指导业务部门开展资产托管业务的操作风险管控工作。总行资产托管部下设内

控管理处。内控管理处是全行托管业务条线的内部控制具体管理实施机构，并配备专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，独立行使监督稽核职责。

(3) 内部控制制度及措施：本行已建立完善的内部控制制度。内控制度贯穿资产托管业务的决策、执行、监督全过程，渗透到各业务流程和各操作环节，覆盖到从事资产托管各级组织结构、岗位及人员。内部控制以防范风险、合规经营为出发点，各项业务流程体现“内控优先”要求。

具体内控措施包括：培育员工树立内控优先、制度先行、全员化风险控制的风险管理理念，营造浓厚的内控文化氛围，使风险意识贯穿到组织架构、业务岗位、人员的各个环节。制定权责清晰的业务授权管理制度、明确岗位职责和各项操作规程、员工职业道德规范、业务数据备份和保密等在内的各项业务管理制度；建立严格完善的资产隔离和资产保管制度，托管资产与托管人资产及不同托管资产之间实行独立运作、分别核算；对各类突发事件或故障，建立完备有效的应急方案，定期组织灾备演练，建立重大事项报告制度；在基金运作办公区域建立健全安全监控系统，利用录音、录像等技术手段实现风险控制；定期对业务情况进行自查、内部稽核等措施进行监控，通过专项/全面审计等措施实施业务监控，排查风险隐患。

5、托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

(1) 监督依据

托管人严格按照有关政策法规、以及基金合同、托管协议等进行监督。监督依据具体包括：

- 1) 《中华人民共和国证券法》；
- 2) 《中华人民共和国证券投资基金法》；
- 3) 《公开募集证券投资基金运作管理办法》；
- 4) 《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》；
- 5) 《基金合同》、《基金托管协议》；
- 6) 法律、法规、政策的其他规定。

(2) 监督内容

我行根据基金合同及托管协议约定，对基金合同生效之后所托管基金的投资范围、投资比例、投资限制等进行严格监督，及时提示基金管理人违规风险。

(3) 监督方法

1) 资产托管部设置核算监督岗位，配备相应的业务人员，在授权范围内独立行使对基金管理人投资交易行为的监督职责，规范基金运作，维护基金投资人的合法权益，不受任何外界力量的干预；

2) 在日常运作中，凡可量化的监督指标，由核算监督岗通过托管业务的自动处理程序进行监督，实现系统的自动跟踪和预警；

3) 对非量化指标、投资指令、管理人提供的各种报表和报告等,采取人工监督的方法。

(4) 监督结果的处理方式

1) 基金托管人对基金管理人的投资运作监督结果,采取定期和不定期报告形式向基金管理人和中国证监会报告。定期报告包括基金监控周报等。不定期报告包括提示函、临时日报、其他临时报告等;

2) 若基金托管人发现基金管理人违规违法操作,以电话、邮件、书面提示函的方式通知基金管理人,指明违规事项,明确纠正期限。在规定期限内基金托管人再对基金管理人违规事项进行复查,如果基金管理人违规事项未予纠正,基金托管人将报告中国证监会。如果发现基金管理人投资运作有重大违规行为时,基金托管人应立即报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正;

3) 针对中国证监会、中国人民银行对基金投资运作监督情况的检查,应及时提供有关情况和资料。

(三) 上市推荐人

无。

(四) 验资机构

名称: 安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)

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

法人代表: 毛鞍宁

电话: 020-28812888

传真: 020-28812618

经办注册会计师: 赵雅、马婧

六、 基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件。

七、 基金财务状况

(一) 基金募集期间费用

本次基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用,不从基金资产中支付。各基金销售机构根据本基金招募说明书设定的费率收取认购费。

(二) 基金上市前重要财务事项

本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

（三）基金资产负债表

截至公告日前两个工作日即2022年8月2日，本基金的资产负债表（未经审计）如下：

金额单位：人民币元

资产	期末余额	负债和所有者权益	期末余额
资产：		负债：	
银行存款	96,397,990.10	短期借款	-
结算备付金	3,436,028.49	交易性金融负债	-
存出保证金	-	衍生金融负债	-
交易性金融资产	311,439,094.56	卖出回购金融资产款	-
其中：股票投资	-	应付证券清算款	-
基金投资	311,439,094.56	应付赎回款	-
债券投资	-	应付管理人报酬	355,336.81
资产支持证券投资	-	应付托管费	74,699.29
贵金属投资	-	应付销售服务费	4,689.17
其他投资	-	应付投资顾问费	-
衍生金融资产	-	应交税费	-
买入返售金融资产	-	应付利息	-
债权投资	-	应付利润	-
其中：债券投资	-	递延所得税负债	-
资产支持证券投资	-	其他负债	28,301.35
其他投资	-	负债合计	463,026.62
应收证券清算款	-	所有者权益：	
应收股利	23,867.40	实收基金	408,994,101.61
应收申购款	-	未分配利润	1,839,852.32
递延所得税资产	-	所有者权益合计	410,833,953.93
其他资产	-		
资产总计：	411,296,980.55	负债和所有者权益总计	411,296,980.55

八、基金投资组合

截至公告日前两个工作日即2022年8月2日，广发积极优势一年封闭运作混合型基金中基金（FOF-LOF）（本基金合同自2022年6月9日起生效，本报告期自2022年6月9日至2022年8月2日）的投资组合报告如下：

（一）报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
----	----	-------	--------------

1	权益投资	-	-
	其中：普通股	-	-
	存托凭证	-	-
2	基金投资	311,439,094.56	75.72
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	99,834,018.59	24.27
8	其他资产	23,867.40	0.01
9	合计	411,296,980.55	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

本基金本报告期末未持有境内股票。

2、报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

(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

本基金本报告期末未持有股票。

(四) 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

(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

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**

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

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

本基金本报告期末未持有权证。

(九) 本基金投资的股指期货交易情况说明

- 1、本基金本报告期末未持有股指期货。
- 2、本基金本报告期内未进行股指期货交易。

(十) 本基金投资的国债期货交易情况说明

- 1、本基金本报告期末未持有国债期货。
- 2、本基金本报告期内未进行国债期货交易。

(十一) 投资组合报告附注

- 1、报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。
- 2、本报告期内，基金投资的前十名股票未出现超出基金合同规定的备选股票库的情形。
- 3、其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	23,867.40
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	23,867.40

4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

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，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

九、 基金中基金

1、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基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额 (份)	公允价值 (元)	占基金资产 净值比例 (%)	是否属于 基金管理 人及管理 人关联方 所管理的 基金
1	004672	华夏短债 债券 A	契约型开 放式	58,250,49 0.02	60,143,630 .95	14.64	否
2	003949	兴全稳泰 债券 A	契约型开 放式	35,581,56 6.34	40,175,146 .55	9.78	否
3	162715	广发聚源 债券 (LOF)A	契约型开 放式	27,223,23 0.49	30,272,232 .30	7.37	是
4	004545	永赢天天 利货币 A	契约型开 放式	30,076,39 2.51	30,076,392 .51	7.32	否
5	010208	平安日增 利货币 B	契约型开 放式	30,063,10 5.38	30,063,105 .38	7.32	否
6	519718	交银纯债 债券发起 A/B	契约型开 放式	18,410,19 9.76	20,081,845 .90	4.89	否
7	013151	长信低碳 环保量化 股票 C	契约型开 放式	3,987,081 .85	10,546,230 .20	2.57	否
8	005001	交银持续 成长主题 混合	契约型开 放式	4,790,399 .08	10,451,213 .67	2.54	否
9	000308	建信创新 中国混合	契约型开 放式	1,716,566 .52	10,386,944 .01	2.53	否
10	008328	诺安新兴 产业混合	契约型开 放式	5,992,682 .93	10,364,345 .13	2.52	否

2、当期交易及持有基金产生的费用

项目	本期费用 2022年6月9日至2022年8 月2日	其中：交易及持有基金管理人以 及管理人关联方所管理基金产 生的费用
当期交易基金产生的申购费（元）	9,010.00	-
当期交易基金产生的赎回费（元）	-	-
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	28,215.61	429.17
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	252,003.58	5,696.74
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	47,277.72	1,898.91

注：当期持有基金产生的应支付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，上表列示金额为按照本基金对被投资基金的持仓根据被投资基金基金合同约定的相应费率计算得出。

根据相关法律法规及本基金合同的约定，基金管理人不得对基金中基金财产中持有的自身管理的基金部分收取基金中基金的管理费，基金托管人不得对基金中基金财产中持有的自身托管的基金部分收取基金中基金的托管费。基金管理人运用本基金财产申购自身管理的其他基金的（ETF除外），应当通过直销渠道申购且不收取申购费、赎回费（按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取，并计入基金资产的赎回费用除外）、销售服务等销售费用，其中申购费、赎回费在实际申购、赎回时按上述规定执行，销售服务费由本基金管理人从被投资基金收取后返还至本基金基金资产。

3、本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本报告期内，本基金所投资的子基金未发生包括转换运作方式、与其他基金合并、终止基金合同、召开基金份额持有人大会及大会表决意见等重大影响事件。

十、 重大事件揭示

本基金自基金合同生效至上市交易公告书刊登前未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

十一、 基金管理人承诺

本基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规、《基金合同》的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

（二）真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件，披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息，并接受中国证监会、深圳证券交易所的监督管理。

（三）在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后，将及时予以公开澄清。

十二、 基金托管人承诺

基金托管人就该基金上市交易后履行托管人职责做出如下承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规、基金合同的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

（二）根据《基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及本基金基金合同、托管协议的规定，对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金份额净值计算进行监督和核查。如发现基金管理人违反《基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及本基金基金合同、托管协议的规定，将及时通知基金管理人纠正；基金管理人未能在限期内纠正的，基金托管人将及时向中国证监会报告。

十三、 备查文件目录

以下备查文件存放于基金管理人和基金托管人的办公场所，投资者可在办公时间免费查阅。

（一）中国证监会批准广发积极优势一年封闭运作混合型基金中基金（FOF-LOF）募集的文件

（二）《广发积极优势一年封闭运作混合型基金中基金（FOF-LOF）基金合同》

（三）《广发积极优势一年封闭运作混合型基金中基金（FOF-LOF）招募说明书》

- (四) 《广发积极优势一年封闭运作混合型基金中基金（FOF-LOF）托管协议》
- (五) 法律意见书
- (六) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (七) 基金托管人业务资格批件、营业执照

风险提示：基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。销售机构根据法规要求对投资者类别、风险承受能力和基金的风险等级进行划分，并提出适当性匹配意见。投资者在投资基金前应认真阅读基金合同、招募说明书（更新）和基金产品资料概要（更新）等基金法律文件，全面认识基金产品的风险收益特征，在了解产品情况及销售机构适当性意见的基础上，根据自身的风险承受能力、投资期限和投资目标，对基金投资作出独立决策，选择合适的基金产品。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

广发基金管理有限公司

二〇二二年八月四日

附件：基金合同摘要

一、基金合同当事人的权利与义务

（一）基金管理人的权利与义务

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

- （1）依法募集资金；
- （2）自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
- （3）依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- （4）销售基金份额；
- （5）按照规定召集基金份额持有人大会；

(6) 依据《基金合同》及有关法律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；

(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) 依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

(2) 办理基金备案手续；

(3) 自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；

(4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

(5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；

(6) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己

及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

(7) 依法接受基金托管人的监督；

(8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回的价格；

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(10) 编制季度报告、中期报告和年度报告；

(11) 严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

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

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

(14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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

(16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 20 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内发出，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) 基金在募集期间未能达到基金的备案条件,《基金合同》不能生效,基金管理人承担全部募集费用,将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人；

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(26) 建立并保存基金份额持有人名册；

(27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(二) 基金托管人的权利与义务

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

(1) 自《基金合同》、《托管协议》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等投资所需账户、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》、《托管协议》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等投资所需账户，按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

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

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

(9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

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

(11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 20 年以上；

(12) 保存基金份额持有人名册；

(13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

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

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

(16) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；

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

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

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

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

(21) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

（三）基金份额持有人

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

同一类别的每份基金份额具有同等的合法权益。本基金 A 类基金份额与 C 类基金份额由于基金份额净值的不同，基金收益分配的金额以及参与清算后的剩余基金财产分配的数量将可能有所不同。

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）依法转让或者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召集基金份额持有人大会；
- （5）出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- （6）查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- （7）监督基金管理人的投资运作；
- （8）对基金管理人、基金托管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；
- （9）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

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

- (7) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- (8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序规则

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。

本基金的基金份额持有人大会暂不设立日常机构。

(一) 召开事由

1、除法律法规，基金合同和中国证监会另有规定外，当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

- (1) 终止《基金合同》；
- (2) 更换基金管理人；
- (3) 更换基金托管人；
- (4) 转换基金运作方式；
- (5) 调整基金管理人、基金托管人的报酬标准及提高销售服务费率，但法律法规要求调整该等报酬标准或提高销售服务费率的除外；
- (6) 变更基金类别；
- (7) 本基金与其他基金的合并；
- (8) 变更基金投资目标、范围或策略；
- (9) 变更基金份额持有人大会程序；
- (10) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- (11) 单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；
- (12) 终止 A 类基金份额上市，但因 A 类基金份额不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市的除外；
- (13) 对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；
- (14) 法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

2、在不违反有关法律法规和《基金合同》约定，并对基金份额持有人利益无实质性不

利影响的前提下，以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

- （1）法律法规要求增加的基金费用的收取；
- （2）在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式，调低销售服务费率；
- （3）因相应的法律法规、深圳证券交易所或登记机构的相关业务规则发生变动而应当对《基金合同》进行修改；
- （4）对《基金合同》的修改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；
- （5）《基金合同》明确约定无需召开基金份额持有人大会的情况；
- （6）基金管理人、登记机构、基金销售机构在法律法规规定或中国证监会许可的范围内调整有关认购、申购、赎回、转换、基金交易、非交易过户、转托管等业务规则；
- （7）基金推出新业务或服务，或调整基金份额类别设置；
- （8）本基金的基金管理人代表本基金基金份额持有人的利益，参与所持有基金的基金份额持有人大会，并在遵循本基金基金份额持有人利益优先原则的前提下行使相关投票权利；
- （9）按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

（二）会议召集人及召集方式

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

2、基金管理人未按规定召集或不能召开时，由基金托管人召集。

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

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

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

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

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

（三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

（1）会议召开的时间、地点和会议形式；

（2）会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；

（3）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；

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

（5）会务常设联系人姓名及联系电话；

（6）出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；

（7）召集人需要通知的其他事项。

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、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。

（四）基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式或法律法规和监管机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证明委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或基金托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

(1) 亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；

(2) 经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的 50%（含 50%）。

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

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 50%（含 50%）；

(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。

参加基金份额持有人大会的持有人的基金份额低于第 1 款第（2）项、或者第 2 款第（3）项规定比例的，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月

以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上基金份额的持有人参加，方可召开。

3、在法律法规及监管机构允许的前提下，基金份额持有人大会可通过网络、电话或其他方式召开，基金份额持有人可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式进行表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

4、基金份额持有人授权他人代为出席会议并表决的，在法律法规及监管机构允许的前提下，授权方式可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式，具体方式在会议通知中列明。

（五）议事内容与程序

1、议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如《基金合同》的重大修改、决定终止《基金合同》、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及《基金合同》规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开前及时公告。

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

2、议事程序

（1）现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

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

（2）通讯开会

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

（六）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1、一般决议，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的 50% 以上（含 50%）通过方为有效；除下列第 2 项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。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》、本基金与其他基金合并以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时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。

（七）计票

1、现场开会

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

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

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

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

2、通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

(八) 生效与公告

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

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

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

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

(九) 实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定

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

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

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

3、通讯开会的直接出具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相关基金份额的二分之一（含二分之一）；

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

(含三分之一) 相关基金份额的持有人参与或授权他人参与基金份额持有人大会投票;

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

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

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

同一主侧袋账户内的每份基金份额具有平等的表决权。

(十)基金管理人代表本基金出席本基金持有的基金份额持有人大会并参与表决的特别约定

本基金持有的基金召开基金份额持有人大会时,本基金管理人应代表本基金基金份额持有人的利益参与所持有基金的份额持有人大会,并在遵循本基金份额持有人利益优先原则的前提下行使相关投票权利。本基金管理人需将表决意见事先征求基金托管人的意见,并将表决意见在定期报告中予以披露。

法律法规对于本基金参与本基金持有的基金召开基金份额持有人大会的程序或要求另有规定的,从其规定。

(十一)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报监管机关并提前公告后,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、基金收益分配原则、执行方式

(一) 基金收益分配原则

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

2、本基金收益分配方式分两种: 现金分红与红利再投资, 登记在注册登记系统基金份额持有人基金账户下的基金份额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。登记在证券登记系统基金份额持有人深圳证券账户下的基金份额, 只能选择现金分红的方式, 具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定;

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值; 即基金收益分配基准日的基金份额净

值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在符合法律法规及基金合同约定，并对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，经与基金托管人协商一致，基金管理人可对基金收益分配原则和支付方式进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

（二）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

（三）收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

（四）基金收益分配中发生的费用

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

（五）实施侧袋机制期间的收益分配

本基金实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配，详见招募说明书的规定。

四、与基金财产管理、运作有关费用的提取、支付方式与比例

（一）基金管理人的管理费

本基金投资于本基金管理人所管理的基金的部分不收取管理费。本基金的管理费按前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金管理人自身管理的其他基金份额所对应资产净值的剩余部分的 1.00% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

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扣除本基金持有的基金管理人自身管理的其他基金份额所

对应资产净值的剩余部分，若为负数，则 E 取 0。

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。

（二）基金托管人的托管费

本基金投资于本基金托管人所托管的基金的部分不收取托管费。本基金的托管费按前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金托管人自身托管的其他基金份额所对应资产净值的剩余部分的 0.20% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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扣除本基金持有的基金托管人自身托管的其他基金份额所对应资产净值的剩余部分，若为负数，则 E 取 0。

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。

（三）基金销售服务费

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按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.40% 年费率计提。计算方法如下：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，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。

（四）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。

（五）实施侧袋机制期间的基金费用

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

（六）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。基金财产投资的相关税收，由基金份额持有人承担，基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

五、基金资产的投资方向和投资限制

（一）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，包括经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金（包括 QDII 基金、香港互认基金及其他经中国证监会依法核准或注册的基金）、国内依法发行上市的股票（包括创业板及其他依法上市的股票、存托凭证）、港股通标的股票、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券以及经法律法规或中国证监会允许投资的其他债券类金融工具）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。

本基金为混合型基金中基金（FOF），投资于经中国证监会依法核准或注册的证券投资基金的比例不低于基金资产的 80%，权益类资产（包括股票、股票型基金和混合型基金）投资占基金资产的比例为 60%-95%，其中混合型基金指基金合同中明确约定股票投资占基金资产的比例为 60%以上或者最近 4 个季度披露的股票投资占基金资产的比例均在 60%以上的混合型基金，投资于货币市场基金的比例不高于基金资产的 15%，投资于港股通标的股票不超过股票资产的 50%，但封闭运作期到期前的两个月内及到期后的两个月内不受前述比例限

制。本基金封闭期届满转换为开放式运作后，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，本基金所指的现金类资产范围不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等资金类别，法律法规另有规定的从其规定。

如未来法律法规或监管机构对投资比例要求有变更的，基金管理人在履行适当程序后，可以做出相应调整。

（二） 投资限制

1、 组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金为混合型基金中基金（FOF），投资于经中国证监会依法核准或注册的证券投资基金的比例不低于基金资产的 80%，其中权益类资产（包括股票、股票型基金和混合型基金）投资占基金资产的比例为 60%-95%，投资于货币市场基金的比例不高于基金资产的 15%，投资于港股通标的股票不超过股票资产的 50%，但封闭运作期到期前的两个月内及到期后的两个月内不受前述比例限制；

（2）本基金封闭期届满转型为“广发积极优势混合型基金中基金（FOF-LOF）”后，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，本基金所指的现金类资产范围不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等资金类别，法律法规另有规定的从其规定；

（3）本基金持有一家公司发行的证券，其市值（同一家公司在境内和香港同时上市的 A+H 股合并计算）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（同一家公司在境内和香港同时上市的 A+H 股合并计算），不超过该证券的 10%；

（5）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%；

（6）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%；

（7）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%；

（8）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%；

（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%，债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

(12) 本基金持有单只基金的市值，不得超过基金资产净值的 20%，且不得持有其他基金中基金；

(13) 除 ETF 联接基金外，本基金管理人管理的全部基金中基金持有单只基金不得超过被投资基金净资产的 20%，被投资基金净资产规模以最近定期报告披露的规模为准；

(14) 本基金投资其他基金，被投资基金的运作期限应当不少于 1 年、最近定期报告披露的基金净资产应不低于 1 亿元；

(15) 本基金投资于封闭运作基金、定期开放基金等流通受限基金的资产占基金资产净值的比例不得超过 10%；

(16) 转型为“广发积极优势混合型基金中基金（FOF-LOF）”后，本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述比例限制；

(17) 转型为“广发积极优势混合型基金中基金（FOF-LOF）”后，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合该比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(18) 转型为“广发积极优势混合型基金中基金（FOF-LOF）”后，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本基金合同约定的投资范围保持一致；

(19) 在封闭运作期内，基金总资产不得超过基金净资产的 200%，转型为“广发积极优势混合型基金中基金（FOF-LOF）”后，基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

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

(21) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

因证券市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合前款第（12）、（13）条规定的比例的，基金管理人应当在 20 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。除上述第（9）、（12）、（13）、（17）、（18）项规定的情形外，因证券、期货市场波动、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。

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。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。

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、行政法规和国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

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

3、法律法规或监管部门取消上述组合限制、禁止行为规定或从事关联交易的条件和要求，本基金可不受相关限制。法律法规或监管部门对上述组合限制、禁止行为规定或从事关联交易的条件和要求进行变更的，本基金可以变更后的规定为准；经与基金托管人协商一致，基金管理人可依据法律法规或监管部门规定直接对基金合同进行变更，该变更无须召开基金份额持有人大会审议。

六、基金净值的计算方法和公告方式

（一）基金资产净值的计算方法

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

（二）基金净值信息的公告方式

《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规定网站披露一次基金份额净值和基金份额累计净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在不晚于每个开放日的 3 个工作日内，通过规定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的 3 个工作日内，在规定网站披露半年度和年度最后一日的基金份额净值和基金份额累计净值。

七、基金合同的变更、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。对于法律法规规定和基金合同约定可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效，生效后方可执行，自表决通过之日起五日内报中国证监会备案，自决议生效之日起两日内在规定媒介公告。

（二）《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- 3、连续五十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 万元人民币情形的；
- 4、《基金合同》约定的其他情形；
- 5、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规定的注册会计师、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，但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的，清算期限相应顺延。

(四) 清算费用

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

(五) 基金财产清算剩余资产的分配

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

(六) 基金财产清算的公告

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

(七) 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 20 年以上。

八、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，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上海国际

经济贸易仲裁委员会，根据该会届时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点在上海。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。

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

《基金合同》受中国法律管辖。

九、基金合同存放地和投资者取得合同的方式

《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。