

摩根士丹利资源优选混合型  
证券投资基金（LOF）  
招募说明书（更新）

基金管理人：摩根士丹利基金管理（中国）有限公司

基金托管人：中国光大银行股份有限公司

## 重要提示

摩根士丹利资源优选混合型证券投资基金(LOF)（以下简称“本基金”）于2005年5月9日经中国证券监督管理委员会证监基金字[2005]79号文《关于同意巨田资源优选混合型证券投资基金募集的批复》核准公开募集。本基金的基金合同于2005年9月27日正式生效。本基金为上市契约型开放式基金。

本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核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的投资价值、市场前景和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

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，投资人购买基金，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。

基金在投资运作过程中可能面临各种风险，既包括市场风险，也包括基金自身的管理风险、技术风险和合规风险等。巨额赎回风险是开放式基金所特有的一种风险，当基金在开放期发生巨额赎回时，投资人将可能无法及时赎回持有的全部基金份额，也可能面临基金份额净值大幅波动风险。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资人在获得基金投资收益的同时，亦承担基金投资中出现的各类风险，包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资人连续大量赎回本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，信用风险，本基金的特定风险等。

基金分为股票型基金、混合型基金、债券型基金、货币市场基金等不同类型，投资人投资不同类型的基金将获得不同的收益预期，也将承担不同程度的风险。一般来说，基金的收益预期越高，投资人承担的风险也越大。本基金为混合型基金，理论上其长期平均风险收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

投资有风险，投资者认购（或申购）基金时应认真阅读本基金的基金合同、招募说明书、基金产品资料概要等法律文件，全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断本基金是否和投资者的风险承受能力相适应，同时，理性判断市场，对认购（或申购）本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立、谨慎决策。

投资者应当通过本基金管理人或销售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。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。

基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行负责。

根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法律法规及本基金基金合同的有关规定，经与基金托管人协商一致并报中国证监会相关派出机构备案，本基金对基金合同中的释义、申购赎回、基金的投资、估值和信息披露等有关条款进行了修订。上述修订于2018年3月24日起生效，系因相应的法律法规发生变动而进行，不涉及基金份额持有人权利义务关系的变化，对基金份额持有人的利益无实质性不利影响，且已履行适当程序。有关详细信息参见本公司于2018年3月24日发布的《摩根士丹利华鑫基金管理有限公司关于修订旗下基金基金合同、托管协议条款的公告》及本公司网站最新披露的本基金基金合同。

根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的规定，本基金本次更新招募说明书仅对基金合同、托管协议更新事项更新了相关章节，并对审计基金财产的会计师事务所相关信息进行了更新。除非另有说明，本招募说明书（更新）所载内容截止日为2023年8月17日，其中“五、相关服务机构”直销机构相关信息截止日为2023年9月1日，有关财务数据和净值表现截止日为2023年6月30日（财务数据未经审计）。

## 目录

一、绪言	1
二、释义	1
三、基金管理人	6
四、基金托管人	15
五、相关服务机构	18
六、基金的募集	43
七、基金合同的生效	43
八、基金份额的上市交易	43
九、基金份额的申购和赎回	44
十、基金份额的登记、非交易过户、系统内转托管和跨系统转登记	51
十一、基金转换	52
十二、基金的投资	52
十三、基金的业绩	61
十四、基金的财产	63
十五、基金资产的估值	64
十六、基金的收益分配	69
十七、基金的费用与税收	70
十八、基金的会计与审计	72
十九、基金的信息披露	73
二十、风险揭示	76
二十一、基金合同的终止与基金财产清算	82
二十二、基金合同的内容摘要	84
二十三、基金托管协议的内容摘要	92
二十四、对基金份额持有人的服务	98
二十五、其他应披露事项	100
二十六、招募说明书的存放及查阅方式	102
二十七、备查文件	102

## 一、绪 言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《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》）、《深圳证券交易所上市开放式基金业务规则》（以下简称《业务规则》）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性规定》”）及相关法律法规和《摩根士丹利资源优选混合型证券投资基金（LOF）基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

本招募说明书阐述了本基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资人投资决策有关的全部必要事项，投资人在做出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

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

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

## 二、释 义

在本招募说明书中除非文义另有所指，下列词语具有以下含义：

基金或本基金：	指摩根士丹利资源优选混合型证券投资基金（LOF）
基金合同或本基金合同：	指《摩根士丹利资源优选混合型证券投资基金（LOF）基金合同》及基金合同当事人对其不时做出的修订
招募说明书：	指《摩根士丹利资源优选混合型证券投资基金（LOF）招募说明书》以及基金管理人在基金合同生效后每6个月结束之日起45日内进行的对招募说明书的更新
基金产品资料概要：	指《摩根士丹利资源优选混合型证券投资基金（LOF）产品资料概要》及其更新
基金份额发售公告：	指《巨田资源优选混合型证券投资基金（LOF）基金份额发售公告》

托管协议：	指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《摩根士丹利资源优选混合型证券投资基金（LOF）托管协议》及协议当事人对其不时做出的补充及修订
《证券法》：	指《中华人民共和国证券法》
《基金法》：	指《中华人民共和国证券投资基金法》
《运作办法》：	指《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
《销售办法》：	指《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
《信息披露办法》：	指中国证监会2019年7月26日颁布、同年9月1日实施的指《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
《业务规则》：	指《深圳证券交易所上市开放式基金业务规则》及颁布机关对其不时做出的修订
《流动性规定》：	指《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
中国证监会：	指中国证券监督管理委员会
银行业监管机构：	指中国银行业监督管理委员会、中国人民银行或其他经国务院授权的机构
基金合同当事人：	指受基金合同约束，根据基金合同享受权利并承担义务的基金管理人、基金托管人和基金份额持有人
基金管理人：	指摩根士丹利基金管理（中国）有限公司
基金托管人：	指中国光大银行股份有限公司
基金销售代理人：	指符合中国证监会有关规定的条件并与基金管理人签订了销售服务代理协议，代为办理基金销售服务业务的机构，简称代销人
销售机构：	指基金管理人和基金销售代理人
注册登记业务：	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、基金份额注册登记、基金交易确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等
注册登记人：	指办理本基金注册登记业务的机构。本基金的注册登记人是中国证券登记结算有限责任公司
个人投资者：	指依据中华人民共和国有关法律法规及其他有关规定可以投资于证券投资基金的自然人投资者

机构投资者：	指依据中华人民共和国有关法律法规及其他有关规定可以投资于证券投资基金的法人、社会团体或其他组织
合格境外机构投资者：	指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》规定的条件，经中国证监会批准投资于中国证券市场，并取得国家外汇管理局额度批准的中国境外基金管理机构、保险公司、证券公司以及其他资产管理机构
基金份额持有人：	指依法或依基金合同、招募说明书取得基金份额的投资人
元：	指人民币元
基金合同生效日：	指本基金募集符合基金合同规定的条件，并获得中国证监会书面确认之日
基金合同终止日：	指基金合同规定的终止事由出现后按照基金合同规定的程序并经中国证监会批准终止基金合同的日期
开放日：	指销售机构为投资人办理基金申购、赎回等业务的工作日
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，最长不超过3个月
基金存续期：	指基金合同生效至基金合同终止，基金存续的不定期之期限
工作日：	指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日
T 日：	指认购、申购、赎回或其他交易的申请日
T+n 日：	指自T 日起第n 个工作日（不包含T 日）
日/天：	指公历日
月：	指公历月
认购：	指在基金募集期内，投资人购买本基金份额的行为
申购：	指在基金合同生效后投资人申请购买本基金份额的行为
赎回：	指基金份额持有人按基金合同规定的条件要求基金管理人购回基金份额的行为
巨额赎回：	指基金单个开放日，基金净赎回申请超过上一日基金总份额10%时的情形
基金转换：	指基金份额持有人按基金管理人规定的条件申请将其持有的某一基金（包括本基金）的基金份额转为基金管理人管理的、由同一注册登记人办理注册登记的其他基金（包括本基金）的基金份额的行为
销售场所：	指场外销售场所和场内交易场所，分别简称场外和场内
场外：	指通过深圳证券交易所外的销售机构进行基金份额认购、申购和赎回的场所
场内：	指通过深圳证券交易所内的会员单位进行基金份额认购、申

	购、赎回和上市交易的场所
注册登记系统：	指中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统
证券登记结算系统：	指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
发售：	指场外认购和场内认购
场外认购：	指基金募集期内投资人通过场外销售机构申请购买本基金份额的行为
场内认购：	指基金募集期内投资人通过场内会员单位申请购买本基金份额的行为
日常交易：	指申购、赎回和上市交易
场内申购、赎回	指场内会员单位接受投资人委托向深圳证券交易所交易系统申报的基金份额的申购、赎回
上市交易：	指基金存续期间投资人通过场内会员单位以集中竞价的方式买卖基金份额的行为
系统内转托管：	指持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（席位）之间进行转托管的行为
跨系统转登记：	指持有人将持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统间进行转登记的行为
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、银行存款利息及其他合法收入
基金资产总值：	指基金所购买的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
基金资产净值：	指基金资产总值减去基金负债后的价值
基金资产估值：	指计算评估基金财产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程
基金账户：	指基金注册登记人为投资人开立的记录其持有的基金份额及其变更情况的账户
基金交易账户：	指销售机构为投资人开立的记录其通过该销售机构买卖基金份额的变动及结余情况的账户
指定媒介：	指中国证监会指定的用以进行信息披露的全国性报刊及指定互联网网站（包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介
不可抗力：	指任何无法预见、不能避免、无法克服的事件或因素，包括：相关法律、法规或规章的变更；国际、国内金融市场风险事故



的发生；自然或无人破坏造成的交易系统或交易场所无法正常工作、战争、动乱或瘟疫等

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

### 三、基金管理人

#### （一）基金管理人概况

名称：摩根士丹利基金管理（中国）有限公司

注册地址：深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第二座第17层01-04室

办公地址：深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第二座第17层

法定代表人：王鸿嫔

成立时间：2003年3月14日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2003]33号

注册资本：60,000万元人民币

联系人：徐许

电话：（0755）88318883

股权结构为：摩根士丹利国际控股公司（100%）。

#### （二）主要人员情况

##### 1、董事会成员

高杰文（Todd Coltman）先生，于加利福尼亚州立大学获得本科和研究生学位，并在乔治敦大学取得法律学位。曾在年利达律师事务所（Linklaters）伦敦、香港和东京办公室以及众达律师事务所（Jones Day）的东京办公室担任律师。2004年加入摩根士丹利，负责摩根士丹利亚洲私募股权不动产业务（MSREI）的不动产收购融资。2007年担任MSREI日本业务运营总监，2009年担任MSREI亚洲（包括日本）业务运营总监。自2016年起至今担任摩根士丹利在亚洲的所有投资管理业务（MSIM）运营总监。目前担任摩根士丹利商务咨询（上海）有限公司董事、摩根士丹利资产（中国）有限公司董事、Morgan Stanley Properties Advisory Corp. Limited（成立于开曼群岛）董事、MSP China Holdings Limited（成立于开曼群岛）董事。现任基金管理人董事长。

侯杰明（Jeremy Alton Huff）先生，杜克大学文学学士，哈佛大学法学博士。曾任美国世达律师事务所律师、NBA中国法律副总监、NBA中国品牌娱乐副总裁。2017年3月至今任摩根士丹利董事总经理并担任中国首席运营官。目前担任摩根士丹利国际银行（中国）有限公司董事、摩根士丹利管理服务（上海）有限公司董事，摩根士丹利证券（中国）有限公司监事，摩根士丹利亚洲有限公司北京代表处普通代表。现任基金管理人董事。

王鸿嫔女士，台湾国立清华大学法学学士。曾任怡富证券投资信托有限公司副总经理，怡富证券投资顾问公司总经理，上投摩根基金管理有限公司总经理，上海富汇财富投资管理股份有限公司董事长兼总经理等。现任基金管理人董事、总经理。

Carlos Alfonso OYARBIDE SECO 先生，西班牙巴塞罗那自治大学经济学学士，宾夕法尼亚大学沃顿商学院工商管理硕士。曾任职于大通曼哈顿银行（纽约办公室）、瑞银集团菲利普斯&德鲁（伦敦办公室），1993年7月至2015年12月期间曾任摩根士丹利欧洲有限公司兼并与收购部董事总经理，摩根士丹利亚洲有限公司兼并与收购部董事总经理，摩根士丹利西班牙有限公司首席执行官，瑞士信贷集团董事总经理、亚太区金融机构部主管，摩根士丹利亚洲有限公司北京代表处董事总经理和摩根士丹利中国首席营运官。目前担任新黄河资本有限公司创始人及首席执行官、LIVALL IBEROAMERICA LLC 董事。现任基金管理人独立董事。

Thaddeus Thomas Beczak 先生，美国乔治城大学国际政治学学士，哥伦比亚大学工商管理硕士。1974年9月至1997年7月任职于摩根大通，曾任摩根大通证券亚洲有限公司首席执行官，1997年至2013年，先后曾任嘉里集团副主席，野村证券董事会主席，华兴证券香港有限公司董事会主席。2014年1月退休。目前兼任凤凰卫视投资（控股）有限公司独立非执行董事、太平洋网络有限公司独立非执行董事、Arnhold Holdings Limited 独立非执行董事、非营利性组织 The Association of Hong Kong Forum Limited 董事长。现任基金管理人独立董事。

蒋松涛先生，南京政治学院经济管理专业本科毕业。曾任上海无线电八厂厂长兼党委副书记，上海电子元件公司副总经理，上海信德企业发展有限公司副总经理。1998年至2009年任上海广电（集团）有限公司投资发展部经理、总裁助理兼战略发展部经理、副总裁。2010年至2018年任上海仪电（集团）有限公司副总裁，其中2015年至2017年兼任华鑫证券有限责任公司董事长，2014年至2017年兼任摩根士丹利华鑫证券有限责任公司董事。2018年5月退休。目前担任上海福赛特机器人股份有限公司独立董事。现任基金管理人独立董事。

## 2、监事

贺草先生，武汉大学电子信息科学与技术、金融学双学士，杜伦大学金融学硕士，伦敦政治经济学院风险与随机过程硕士。曾在德意志银行英国总部从事信用风险管理工作。2011年6月加入摩根士丹利英国公司，历任市场风险部、流动性风险部、风险中央职能部副总裁。2017年加入摩根士丹利国际银行（中国）有限公司任首席风险官。2020年2月加入基金管理人，目前担任风险管理部总监兼交易、运营业务条线负责人。现任职工监事。

## 3、高级管理人员

王鸿嫔女士，总经理、董事，简历同上。

李锦女士，哥伦比亚大学、伦敦商学院和香港大学联合授予工商管理学硕士、吉林大学经济管理学院国际金融专业硕士，26年证券基金行业工作经历。曾就职于巨田证券有限责任公司，历任交易管理总部综合管理部经理助理，总经理办公室主任助理，资产管理部理财部副经理、经理，研究所研究员；2003年9月加入基金管理人，历任基金运营部副总监、总监、

总经理助理、督察长，现任基金管理人副总经理。

何晓春先生，中南财经政法大学产业经济学博士，24年证券期货行业从业经历。曾任世纪证券有限责任公司江西分公司筹备组负责人；金鹰基金管理有限公司权益投资部总监、研究部副总监兼基金经理；深圳市吉富瑞泰资产管理有限公司法定代表人、总经理、执行董事、投资经理等职；2017年12月加入基金管理人，历任助理总经理兼任权益投资部总监，现任基金管理人副总经理。

许菲菲女士，中南财经大学国际会计专业学士，21年证券基金行业工作经历。曾任深圳市华新股份有限公司会计，宝盈基金管理有限公司基金会计。2005年6月加入基金管理人，历任基金运营部基金会计，监察稽核部高级监察稽核员、总监助理、副总监、总监。现任基金管理人督察长。

徐许女士，华东师范大学金融学硕士，特许金融分析师（CFA），中国注册会计师（CPA），14年证券从业经历。历任三一重工股份有限公司印度子公司财务部财务主管、TCL多媒体控股有限公司印度子公司财务部高级财务经理、伟创力研发（深圳）有限公司财务部财务经理、美泰玩具技术咨询（深圳）有限公司财务部财务经理。2009年6月加入基金管理人，历任财务管理部总监、财务管理部总监兼行政管理部总监、助理总经理兼财务管理部总监兼行政管理部总监，现任基金管理人财务负责人。

#### 4、本基金基金经理简介

徐达女士，美国弗吉尼亚大学经济学和商业学学士，11年证券从业经历，2012年7月加入基金管理人，历任研究管理部研究员、基金经理助理，现任权益投资部总监助理、基金经理。2016年6月起担任本基金基金经理，2017年1月至2019年9月担任摩根士丹利领先优势混合型证券投资基金基金经理，2017年12月至2019年9月担任摩根士丹利科技领先灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2022年2月起担任摩根士丹利现代服务业混合型证券投资基金基金经理。

沈菁女士，英国曼彻斯特大学会计与金融专业硕士，9年证券从业经历。曾任招商证券股份有限公司机构业务部机构销售、研究发展部煤炭行业分析师。2017年6月加入基金管理人，历任研究员、基金经理助理，现任基金经理。2023年2月起担任摩根士丹利资源优选混合型证券投资基金（LOF）的基金经理。

本基金历任基金经理：冀洪涛先生，自本基金合同生效之日起至2008年4月管理本基金；徐强先生，2011年6月至2012年4月管理本基金；何滨女士，2008年4月至2013年8月管理本基金；卞亚军先生，2013年6月至2015年1月管理本基金；孙海波先生，2015年1月至2016年6月管理本基金；王大鹏先生，2015年1月至2017年6月管理本基金。

#### 5、投资决策委员会成员

主任委员：何晓春，副总经理、权益投资部总监、基金经理。

副主任委员：施同亮，固定收益投资部副总监（主持工作）、基金经理。

委员：王大鹏，研究管理部总监、基金经理；余斌，数量化投资部总监、基金经理；李功舜，交易管理部总监；洪天阳，多资产投资部总监、基金经理。

秘书：王大鹏，研究管理部总监、基金经理。

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

### （三）基金管理人的职责

- 1、依法募集资金，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活期存款利息在基金募集期结束后30日内退还基金认购人；

25、执行生效的基金份额持有人大会的决议；

26、建立并保存基金份额持有人名册；

27、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

#### **（四）基金管理人的承诺**

1、基金管理人承诺严格遵守法律法规和基金合同，按照招募说明书列明的投资目标、策略及限制全权处理本基金的投资。

2、基金管理人承诺不从事违反《中华人民共和国证券法》的行为，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反《中华人民共和国证券法》行为的发生；

3、基金管理人承诺不从事违反《基金法》的行为，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，禁止基金财产用于下列投资或活动：

（1）承销证券；

- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；
- (5) 向基金管理人、基金托管人出资；
- (6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (7) 法律法规和中国证监会及基金合同禁止的其他活动。

上述禁止行为为引用当时有效的相关法律法规或监管部门的有关禁止性规定，如法律、行政法规或监管机构取消上述限制，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。

4、基金管理人承诺严格遵守法律法规，建立健全内部控制制度，采取有效措施，禁止发生下列行为：

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

5、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，不从事以下行为：

- (1) 越权或违规经营；
- (2) 违反《基金合同》或《托管协议》；
- (3) 故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益；
- (4) 在向中国证监会报送的资料中故意弄虚作假；
- (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) 违反现行有效的有关法律、法规、规章、《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；

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

- (9) 贬损同行，以抬高自己；
- (10) 以不正当手段谋求业务发展；
- (11) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
- (12) 法律法规、中国证监会及基金合同禁止的其他行为。

## 6、基金经理承诺

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

（2）不利用职务之便为自己及其代理人、受雇人或任何其他第三人牟取不当利益；

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

（4）不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。

### （五）基金管理人的内部控制制度

#### 1、内部控制目标

（1）保证基金管理人的经营运作严格遵守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，实现基金管理人的持续、稳定、健康发展；

（3）确保基金、基金管理人应披露的信息真实、准确、完整、及时；

（4）确保基金管理人成为一个决策科学、经营规范、管理高效、运作安全的持续、稳定、健康发展的基金管理公司。

#### 2、内部控制原则

（1）健全性原则。内部控制机制覆盖基金管理人的各项业务、各个部门和各级岗位，并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个环节。

（2）有效性原则。通过科学的内控手段和方法，建立合理的内部控制程序，维护内控制度的有效执行。

（3）独立性原则。基金管理人各机构、部门和岗位职责保持相对独立，基金财产、基金管理人固有财产、其他财产的运作必须相互分离。

（4）相互制约原则。基金管理人内部部门和岗位的设置须权责分明、相互制衡。

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

#### 3、内部控制体系

基金管理人的内部控制体系结构是一个分工明确、相互制约的组织结构，具体包括：

（1）董事会负责决定基金管理人内部管理机构的设置、制定基金管理人基本管理制度，对确保基金管理人建立及维持适当而有效的内部控制负有最终责任。董事会下设的风险控制和审计委员会负责审核基金管理人内部控制制度、检查公司和基金运作的合法合规情况等事项，并向董事会汇报。

（2）经营管理层负责组织设计公司的内部控制制度，拟订公司的基本管理制度和制定



公司的部门业务规章，并确保公司的日常经营运作活动合法合规。

（3）督察长负责监督检查基金管理人运作的合法合规情况及公司内部风险控制情况，并依据相关规定可独立向董事会和中国证监会报告。

（4）经营管理层下设的风险管理委员会协助经营管理层实施对各类业务和风险的总体控制以及解决公司内部控制中出现的问题。

（5）风险管理部负责跟踪和报告投资管理中的市场风险，评价基金投资业绩，并根据风险收益情况及时提出改进意见，为投资业务的稳健发展提供支持。

（6）监察稽核部独立于基金管理人其他部门和业务活动，对基金管理人内部控制制度、风险管理政策和措施的执行情况实行严格检查和及时反馈，并向督察长、风险管理委员会和经营管理层定期或不定期报告。

（7）各业务部门及员工对风险管理负有直接责任。各业务部门负责人在权限范围内，执行公司的各项风险管理程序，负责本部门业务风险的识别、监控，对本部门的风险管理负全部责任。每一位员工均负有一线风险控制职责，负责把公司的风险管理理念和控制措施落实到每一个业务环节当中，并在发现风险隐患和问题时负有报告、反馈和改进的义务。

#### 4、内部控制措施

（1）建立合理、完备、有效并易于执行的内部控制制度体系。基金管理人内部控制制度体系由不同层面的制度构成，按照其所管理的层次可以分为四个级别：第一级别是公司章程；第二级别是公司内部控制大纲；第三级别是公司基本管理制度；第四级别是公司各委员会、各部门根据业务需要制定的各种制度及实施细则等。基金管理人根据业务需要持续修订和更新各项制度，使其内部控制制度体系日趋完善。

（2）建立浓厚的风险管理文化。经营管理层牢固树立内控优先的风险管理理念，注重培养全体员工的风险防范意识，通过制度约束、学习培训使全体员工及时了解国家法律法规和公司规章制度，使风险管理意识深入人心，并贯穿到各个业务环节。

（3）建立严密有效的内控防线。依据自身经营特点，基金管理人建立起各岗位的自控与互控、相关部门之间的监督制衡、监察稽核部和督察长的独立监督等内控防线。

（4）建立并持续完善风险管理体系。基金管理人通过建立风险分类、识别、评估、报告及监督等程序，定期或不定期地对风险进行评估、预警，并通过清晰的汇报路径，使相关部门及经营管理层即时把握风险状况，及时、快速地采取风险控制措施。

（5）强化风险管理措施。随着业务发展及技术进步，基金管理人开始更多地采取系统化监控措施，增强风险管理的全面性、实时性和有效性。同时，采用数量化分析方法，提高风险管理的科学性。

#### 5、基金管理人关于内部控制制度的声明

（1）本基金管理人确知建立、实施、维持和完善内部控制制度是本基金管理人董事会及管理层的责任；

- （2）本基金管理人承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确；
- （3）本基金管理人承诺将根据市场环境的变化和业务的发展不断完善内部控制制度。

## 四、基金托管人

### （一）基本情况

名称：中国光大银行股份有限公司

住所及办公地址：北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心

成立日期：1992 年 6 月 18 日

批准设立机关和批准设立文号：国务院、国函[1992]7 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：466.79095 亿元人民币

法定代表人：王江

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【2002】75 号

资产托管部总经理：李守靖

电话：（010） 63636363

传真：（010） 63639132

网址：www.cebbank.com

### （二）资产托管部部门及主要人员情况

董事长王江先生，自 2022 年 8 月起任本行董事长、2022 年 3 月起任本行党委书记。现任中国光大集团股份公司党委书记、董事长，兼任中国光大集团股份公司党校校长、中国光大集团有限公司董事长。曾任中国建设银行山东省分行信贷风险管理处副处长，山东省德州市分行行长，山东省分行党委副书记、副行长，湖北省分行党委书记、行长，上海市分行党委书记、行长；交通银行党委委员、副行长；江苏省副省长；中国银行党委副书记、副董事长、行长；中国建设银行党委副书记、副董事长、行长。获经济学博士学位。第十三届全国人大代表，第十四届全国政协委员。

行长王志恒先生，自 2023 年 3 月起任本行执行董事、行长，2022 年 12 月起任本行党委副书记。现任中国光大集团股份公司党委委员、执行董事。曾任中国银行总行公司业务部公司规划处副处长，总行人力资源部主管、副总经理，广东省分行党委委员、副行长，青海省分行党委书记、行长，总行党委组织部部长、人力资源部总经理，北京市分行党委书记、行长，总行党委委员、副行长。获经济学硕士学位，经济师。

资产托管部总经理李守靖先生，曾任中国光大银行海口分行部门总经理，行长助理，副

行长；中国光大银行南宁分行副行长（主持工作）、行长。现任中国光大银行资产托管部总经理。

### （三）证券投资基金托管情况

截至 2023 年 6 月 30 日，中国光大银行股份有限公司托管公开募集证券投资基金共 314 只，托管基金资产规模 6351.28 亿元。同时，开展了证券公司资产管理计划、基金公司客户资产管理计划、职业年金、企业年金、QDII、QFII、银行理财、保险债权投资计划等资产的托管及信托公司资金信托计划、产业投资基金、股权基金等产品的保管业务。

### （四）托管业务的内部控制制度

#### 1、内部控制目标

确保有关法律法规在基金托管业务中得到全面严格的贯彻执行；确保基金托管人有关基金托管的各项管理制度和业务操作规程在基金托管业务中得到全面严格的贯彻执行；确保基金财产安全；保证基金托管业务稳健运行；保护基金份额持有人、基金管理公司及基金托管人的合法权益。

#### 2、内部控制的原则

（1）全面性原则。内部控制必须渗透到基金托管业务的各个操作环节，覆盖所有的岗位，不留任何死角。

（2）预防性原则。树立“预防为主”的管理理念，从风险发生的源头加强内部控制，防患于未然，尽量避免业务操作中各种问题的产生。

（3）及时性原则。建立健全各项规章制度，采取有效措施加强内部控制。发现问题，及时处理，堵塞漏洞。

（4）独立性原则。基金托管业务内部控制机构独立于基金托管业务执行机构，业务操作人员和内控人员分开，以保证内控机构的工作不受干扰。

#### 3、内部控制组织结构

中国光大银行股份有限公司董事会下设风险管理委员会、审计委员会，委员会委员由相关部门的负责人担任，工作重点是对总行各部门、各类业务的风险和内控进行监督、管理和协调，建立横向的内控管理制约体制。各部门负责分管系统内的内部控制的组织实施，建立纵向的内控管理制约体制。资产托管部建立了严密的内控督察体系，设立了投资监督与内控合规处，负责证券投资基金托管业务的内控管理。

#### 4、内部控制制度

中国光大银行股份有限公司资产托管部自成立以来严格遵照《基金法》、《中华人民共和国商业银行法》、《信息披露管理办法》、《运作办法》、《销售办法》等法律、法规的要求，并根据相关法律法规制订、完善了《中国光大银行证券投资基金托管业务内部控制规定》、《中国光大银行资产托管部保密规定》等十余项规章制度和实施细则，将风险控制落实到每一个工作环节。中国光大银行资产托管部以控制和防范基金托管业务风险为主线，在重要岗位（基金清算、基金核算、投资监督）还建立了安全保密区，安装了录像监视系统和录音监听系统，以保障基金信息的安全。

#### （五）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据法律、法规和基金合同等的要求，基金托管人主要通过定性和定量相结合、事前监督和事后控制相结合、技术与人工监督相结合等方式方法，对基金投资范围、投资组合比例每日进行监督；同时，对基金管理人就基金资产净值的计算、基金管理人和基金托管人报酬的计提和支付、基金收益分配、基金费用支付等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

基金托管人发现基金管理人的违反法律、法规和基金合同等规定的行为，及时以邮件、电话或书面等形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对确认并以邮件或书面形式对基金托管人发出回函。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

## 五、相关服务机构

### （一）基金份额发售机构

#### 1、直销机构

（1）摩根士丹利基金管理（中国）有限公司直销中心

注册地址：深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第二座第17层01-04室

办公地址：深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第二座第17层

联系人：时亚蒙

电话：（0755）88318898

传真：（0755）82990631

（2）摩根士丹利华鑫基金管理有限公司北京分公司

注册地址：北京市东城区安定门外大街208号院1号楼12层1205单元

办公地址：北京市东城区安定门外大街208号院1号楼12层1205单元

联系人：张宏伟

电话：（010）87986888

传真：（010）87986889

（3）摩根士丹利基金管理（中国）有限公司上海分公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1000号恒生银行大厦45楼011-111单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1000号恒生银行大厦45楼011-111单元

联系人：姜宁

电话：（021）63343311-2100

传真：（021）50429808

全国统一客服电话：400-8888-668

客户服务信箱：[msim-service@morganstanley.com.cn](mailto:msim-service@morganstanley.com.cn)

深圳、北京或上海的投资人单笔认（申）购金额超过100万元（含100万元）人民币以上的，可拨打直销中心的上述电话进行预约，本公司将提供上门服务。

#### 2、其他销售机构

（1）中国光大银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心

办公地址：北京市西城区太平桥大街25号A座6层财富管理中心

法定代表人：李晓鹏

客户服务电话：95595（全国）

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

（2）中国工商银行股份有限公司

注册（办公）地址：中国北京复兴门内大街55号

法定代表人：陈四清

客户服务电话：95588（全国）

网址：www.icbc.com.cn

（3）中国农业银行股份有限公司

注册（办公）地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：谷澍

客户服务电话：95599

网址：www.abchina.com

（4）中国银行股份有限公司

注册（办公）地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：刘连舸

客户服务电话：95566（全国）

网址：www.boc.cn

（5）中国建设银行股份有限公司

注册（办公）地址：北京市西城区金融大街 25 号

法定代表人：田国立

客户服务电话：95533

网址：www.ccb.com

（6）交通银行股份有限公司

注册（办公）地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号

法定代表人：任德奇

客户服务电话：95559 网址：www.bankcomm.com

（7）招商银行股份有限公司

注册（办公）地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：缪建民

客户服务电话：95555

网址：www.cmbchina.com

（8）招商银行股份有限公司招赢通

客户服务电话：95555

网址：fi.cmbchina.com

（9）中信银行股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层

办公地址：北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼中信大厦 12 层

法定代表人：朱鹤新

客户服务电话：95558

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

（10）中国民生银行股份有限公司

注册（办公）地址：北京市西城区复兴门内大街2号

法定代表人：高迎欣

联系人：穆婷

联系电话：010-56367136

客户服务电话：95568

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

（11）平安银行股份有限公司

注册（办公）地址：深圳市深南东路5047号

法定代表人：谢永林

联系人：赵杨

联系电话：021-50979384

客户服务电话：95511-3-8

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

（12）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：上海市黄浦区北京东路689号东银大厦26楼

法定代表人：郑杨

客户服务电话：95528

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

（13）宁波银行股份有限公司同业易管家平台

注册地址：浙江省宁波市鄞州区宁东路345号

办公地址：上海市浦东新区世纪大道210号20层

法定代表人：陆华裕

联系人：张正岳

联系电话：021-23262719

客户服务电话：95574

网址：<https://interbank.nbc.com.cn>

（14）华鑫证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区莲花街道福中社区深南大道2008号中国凤凰大厦1栋20C-1

房

办公地址：上海市徐汇区宛平南路8号

法定代表人：俞洋

联系人：刘熠



联系电话：18621576160

客户服务电话：95323/400-109-9918

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

（15）中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦

法定代表人：张佑君

联系人：秦夏

联系电话：010-60838614

客户服务电话：95548

网址：[www.cs.ecitic.com](http://www.cs.ecitic.com)

（16）中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址：北京市东城区朝内大街2号中信建投

法定代表人：王常青

联系人：刘畅

联系电话：010-65608231

客户服务电话：4008-888-108

网址：[www.csc108.com](http://www.csc108.com)

（17）中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市丰台区西营街8号院1号楼7至18层101

办公地址：北京市丰台区西营街8号院1号楼青海金融大厦

法定代表人：陈亮

联系人：辛国政

联系电话：010-80928123

客户服务电话：95551/4008-888-888

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

（18）信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

办公地址：北京市西城区宣武门西大街甲127号大成大厦6层

法定代表人：祝瑞敏

联系人：王薇安

联系电话：010-83252170

客户服务电话：95321

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

## （19）民生证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1168 号 B 座 2101、2104A 室

办公地址：上海市浦东新区浦明路 8 号财富金融广场 1 幢

法定代表人：冯鹤年

联系人：苏晋

联系电话：010-85127561

客户服务电话：95376

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

## （20）海通证券股份有限公司

注册地址：上海市广东路 689 号

办公地址：上海市广东路 689 号海通证券大厦 10 楼

法定代表人：周杰

联系人：李笑鸣

联系电话：021-23219275

客户服务电话：95553/ 4008-888-001

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

## （21）国泰君安证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号

办公地址：上海市静安区新闻路 669 号博华广场 21 层

法定代表人：贺青

联系人：钟伟镇

联系电话：021-38032284

客户服务电话：95521/400-8888-666

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

## （22）申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号世纪商贸广场 40 层

法定代表人：杨玉成

联系人：陈宇

联系电话：021-33388214

客户服务电话：95335/400-88-95335

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

## （23）光大证券股份有限公司

注册（办公）地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：刘秋明

联系人：戴巧燕

联系电话：021-52523576

客户服务电话：95525

网址：www.ebscn.com

（24）兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 268 号

办公地址：上海市浦东新区长柳路 36 号兴业证券大厦

法定代表人：杨华辉

联系人：乔琳雪

联系电话：021-38565547

客户服务电话：95562

网址：www.xyzq.com.cn

（25）长江证券股份有限公司

注册地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

办公地址：上海市世纪大道 1198 号一座世纪汇广场

法定代表人：李新华

联系人：奚博宇

联系电话：021-68751860

客户服务电话：95579/4008-888-999

网址：www.95579.com

（26）中银国际证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层

办公地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 31 楼

法定代表人：宁敏

联系人：王炜哲

联系电话：021-20328309

客户服务电话：400-620-8888

网址：www.bocichina.com

（27）东方证券股份有限公司

注册地址：上海市黄浦区中山南路 119 号东方证券大厦

办公地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 13 楼

法定代表人：金文忠

联系人：孔亚楠

联系电话：021-633258884081

客户服务电话：95503

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

（28）湘财证券股份有限公司

注册地址：湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼

办公地址：上海浦东陆家嘴环路958号华能联合大厦5层

法定代表人：高振营

联系人：江恩前

联系电话：021-387845808920

客户服务电话：95351

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

（29）华泰证券股份有限公司

注册地址：南京市江东中路228号

办公地址：深圳市福田区莲花街道益田路5999号基金大厦10楼

法定代表人：张伟

联系人：庞晓芸

联系电话：0755-82492193

客户服务电话：95597

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

（30）中泰证券股份有限公司

注册地址：济南市市中区经七路86号

办公地址：济南市经七路86号23层经纪业务总部

法定代表人：李峰

联系人：朱琴

联系电话：021-20315161

客户服务电话：95538

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

（31）中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001

办公地址：青岛市市南区东海西路28号龙翔广场东座5层

法定代表人：肖海峰

联系人：赵如意

联系电话：0532-85725062

客户服务电话：95548

网址：[sd.citics.com](http://sd.citics.com)

（32）山西证券股份有限公司

注册（办公）地址：太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼

法定代表人：王怡里

联系人：韩璐

联系电话：0351-8686656

客户服务电话：95573

网址：www.i618.com.cn

（33）华龙证券股份有限公司

注册地址：兰州市城关区东岗西路 638 号兰州财富中心 21 楼

办公地址：甘肃省兰州市城关区东岗西路 638 号财富大厦 19 楼

法定代表人：祁建邦

联系人：杨力

联系电话：0931-4890208

客户服务电话：95368

网址：www.hlzqgs.com

（34）东海证券股份有限公司

注册地址：江苏省常州延陵西路 23 号投资广场 18 层

办公地址：江苏省常州市延陵西路 29 号投资广场 18 楼

法定代表人：钱俊文

联系人：王一彦

联系电话：021-20333363

客户服务电话：95531

网址：www.longone.com.cn

（35）东吴证券股份有限公司

注册地址：苏州工业园区星阳街 5 号

办公地址：苏州工业园区星阳街 5 号东吴证券大厦 1907 室

法定代表人：范力

联系人：陆晓

联系电话：0512-62938521

客户服务电话：95330

网址：www.dwzq.com.cn

（36）国元证券股份有限公司

注册地址：安徽省合肥市梅山路 18 号

办公地址：安徽合肥市花园街花园宾馆 14 楼

法定代表人：俞仕新

联系人：李蔡

联系电话：0551-62272101

客户服务电话：95578/4008-888-777

网址：www.gyzq.com.cn

（37）方正证券股份有限公司

注册地址：长沙市天心区湘江中路二段36号华远华中心4、5号楼3701-3717

办公地址：北京市西城区阜成门外大街甲34号方正证券大厦8层

法定代表人：施华

联系人：丁敏

联系电话：010-59355997

客户服务电话：95571

网址：www.foundersc.com

（38）宏信证券有限责任公司

注册（办公）地址：成都市锦江区人民南路二段十八号川信大厦10楼

法定代表人：吴玉明

联系人：彭昱

联系电话：021-87341251

客户服务电话：95304/4008-366-366

网址：www.hxzq.cn

（39）中航证券有限公司

注册地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦A座41楼

办公地址：深圳市福田区深南中路航空大厦2907室

法定代表人：丛中

联系人：王紫雯

联系电话：15611538682

客户服务电话：95335/400-88-95335

网址：www.avicsec.com

（40）安信证券股份有限公司

注册（办公）地址：深圳市福田区福田街道福华一路119号安信金融大厦

法定代表人：黄炎勋

联系人：周楷钰

联系电话：17761201905

客户服务电话：95517

网址：www.essence.com.cn

（41）中国中金财富证券有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层-21层及第04层01、02、03、05、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、23单元

办公地址：深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 座 18-21 楼

法定代表人：高涛

联系人：万玉琳

联系电话：0755-82026907

客户服务电话：95532/400-600-8008

网址：www.ciccwm.com

（42）招商证券股份有限公司

注册（办公）地址：深圳市福田区福田街道福华一路 111 号

法定代表人：霍达

联系人：业清扬

联系电话：0755-82943666

客户服务电话：95565/0755-95565

网址：www.newone.com.cn

（43）国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址：深圳市福田区福华一路 125 号国信金融大厦 37 楼

法定代表人：张纳沙

联系人：李颖

联系电话：0755-82130833

客户服务电话：95536

网址：www.guosen.com.cn

（44）平安证券股份有限公司

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

办公地址：上海市浦东新区张杨路 2389 弄 LCM 置汇旭辉广场 11 层

法定代表人：何之江

联系人：王阳

联系电话：021-38632136

客户服务电话：95511-8

网址：stock.pingan.com

（45）国海证券股份有限公司

注册地址：广西桂林市辅星路 13 号

办公地址：深圳市福田区竹子林四路紫竹七道 18 号光大银行大厦 28 楼

法定代表人：何春梅

联系人：梁冬路

联系电话：0771-5567517

客户服务电话：0771-95563

网址：www.ghzq.com.cn

（46）华西证券股份有限公司

注册地址：中国（四川）自由贸易试验区成都市高新区天府二街 198 号

办公地址：北京市西城区阜成门外大街 22 号外经贸大厦 909

法定代表人：杨炯洋

联系人：赵静静

联系电话：010-58124967

客户服务电话：95584

网址：www.hx168.com.cn

（47）世纪证券有限责任公司

注册地址：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

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 40 层

法定代表人：李强

联系人：徐玲娟

联系电话：0755-83199599

客户服务电话：956019

网址：www.csc.com.cn

（48）长城证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道金田路 2026 号能源大厦南塔楼 10-19 层

办公地址：上海市长宁区延安西路 1358 号迎龙大厦二楼

法定代表人：张巍

联系人：金夏

联系电话：0755-83516289

客户服务电话：95514/400-6666-888

网址：www.cgws.com

（49）万和证券股份有限公司

注册地址：海口市南沙路 49 号通信广场二楼

办公地址：深圳市福田区深南大道 7028 号时代科技大厦东区 3 层

法定代表人：冯周让

联系人：李宛真

联系电话：0755-82830333116

客户服务电话：4008-882-882

网址：www.wanhesec.com.cn



## （50）金元证券股份有限公司

注册地址：海南省海口市南宝路 36 号证券大厦 4 层

办公地址：深圳市深南大道 4001 号时代金融中心 3 层

法定代表人：王作义

联系人：刘萍

联系电话：0755-83025693

客户服务电话：95372

网址：www.jyzq.cn

## （51）德邦证券股份有限公司

注册地址：上海市普陀区曹杨路 510 号南半幢 9 楼

办公地址：上海市浦东新区福山路 500 号城建国际中心 26 楼

法定代表人：武晓春

联系人：刘然

联系电话：021-687616168259

客户服务电话：400-8888-128

网址：www.tebon.com.cn

## （52）广发证券股份有限公司

注册地址：广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街 2 号 618 室

办公地址：广州市天河区马场路 26 号广发证券大厦 36 楼

法定代表人：林传辉

联系人：黄岚

联系电话：020-87555888333

客户服务电话：95575

网址：www.gf.com.cn

## （53）华福证券有限责任公司

注册地址：福建省福州市鼓楼区鼓屏路 27 号 1#楼 3 层、4 层、5 层

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1088 号招商银行大厦 18 楼

法定代表人：黄金琳

联系人：王虹

联系电话：021-20655183

客户服务电话：95547

网址：www.hfzq.com.cn

## （54）东莞证券股份有限公司

注册（办公）地址：广东省东莞市莞城区可园南路一号

法定代表人：陈照星

联系人：陈士锐

联系电话：0769-22112151

客户服务电话：95328

网址：www.dgzq.com.cn

（55）中山证券有限责任公司

注册地址：深圳市南山区创业路 1777 号海信南方大厦 21、22 层

办公地址：深圳市南山区创业路 1777 号海信南方大厦 21、22 层

法定代表人：李永湖

联系人：罗艺琳

联系电话：0755-82943755

客户服务电话：95329

网址：www.zszq.com

（56）万联证券股份有限公司

注册（办公）地址：广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 F 栋 18、19 楼

法定代表人：袁笑一

联系人：丁思

联系电话：020-38286026

客户服务电话：95322

网址：www.wlzq.com.cn

（57）申万宏源西部证券有限公司

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

室

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号世纪商贸广场 40 层

法定代表人：王献军

联系人：陈宇

联系电话：021-33388214

客户服务电话：95523

网址：www.swhysc.com

（58）国金证券股份有限公司

注册（办公）地址：成都市青羊区东城根上街 95 号

法定代表人：冉云

联系人：陈瑀琦

联系电话：028-86692603

客户服务电话：95310

网址：www.gjzq.com.cn

## （59）中国国际金融股份有限公司

注册地址：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

办公地址：北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座6层

法定代表人：沈如军

联系人：任敏

联系电话：010-650511661753

客户服务电话：010-6505-1166

网址：www.cicc.com

## （60）上海证券有限责任公司

注册（办公）地址：上海市黄浦区四川中路213号7楼

法定代表人：何伟

联系人：邵珍珍

联系电话：021-53686262

客户服务电话：4008-918-918

网址：www.shzq.com

## （61）中信期货有限公司

注册（办公）地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层

法定代表人：张皓

联系人：梁美娜

联系电话：021-60812919

客户服务电话：400-990-8826

网址：www.citicsf.com

## （62）东方财富证券股份有限公司

注册地址：西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城10栋楼

办公地址：上海市徐汇区宛平南路88号东方财富大厦16楼

法定代表人：戴彦

联系人：付佳

联系电话：021-23586603

客户服务电话：95357

网址：www.18.cn

## （63）中信证券华南股份有限公司

注册（办公）地址：广州市天河区临江大道395号901室（部位：自编01），1001室

法定代表人：胡伏云

联系人：胡兴良

联系电话：020-88834780

客户服务电话：95548

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

（64）九州证券股份有限公司

注册地址：青海省西宁市南川工业园区创业路108号

办公地址：北京市朝阳区安立路30号仰山公园东一门2号楼

法定代表人：魏先锋

联系人：秦阳

联系电话：010-57672231

客户服务电话：95305

网址：<http://www.jzsec.com>

（65）天相投资顾问有限公司

注册地址：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701

办公地址：北京市西城区新街口外大街28号C座5层

法定代表人：林义相

联系人：谭磊

联系电话：010-66045182

客户服务电话：010-6604-5555

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

（66）和讯信息科技有限公司

注册（办公）地址：北京市朝阳区朝外大街22号1002室

法定代表人：章知方

联系人：陈慧慧

联系电话：010-85657353

客户服务电话：400-920-0022

网址：[licaike.hexun.com](http://licaike.hexun.com)

（67）深圳众禄基金销售股份有限公司

注册（办公）地址：深圳市罗湖区笋岗街道笋西社区梨园路8号HALO广场一期四层12-13室

法定代表人：薛峰

联系人：童彩平

联系电话：0755-33227950

客户服务电话：4006-788-887

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

（68）蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

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

办公地址：浙江省杭州市西湖区西溪路 556 号

法定代表人：王珺

联系人：韩爱彬

联系电话：0571-268888837494

客户服务电话：95188-8

网址：www.fund123.cn

（69）浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市文二西路 1 号元茂大厦 903

办公地址：浙江省杭州市余杭区五常街道同顺街 18 号同花顺大楼 4 层

法定代表人：吴强

联系人：李珍珍

联系电话：0571-889118188653

客户服务电话：952555

网址：www.5ifund.com

（70）上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号

办公地址：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼

法定代表人：杨文斌

联系人：高源

联系电话：021-36696312

客户服务电话：400-700-9665

网址：www.ehowbuy.com

（71）上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

办公地址：上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 7 楼宛平南路 88 号东方财富大厦

法定代表人：其实

联系人：王遂一

联系电话：021-545099778150

客户服务电话：95021/400-1818-188

网址：www.1234567.com.cn

（72）上海长量基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

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

法定代表人：张跃伟

联系人：詹慧萌

联系电话：021-20691832

客户服务电话：400-820-2899

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

（73）诺亚正行基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室

办公地址：上海市闵行区申滨南路1226号诺亚财富中心

法定代表人：汪静波

联系人：李娟

联系电话：021-80358749

客户服务电话：400-821-5399

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

（74）深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道民田路178号华融大厦27层2704

办公地址：北京市西城区宣武门外大街28号富卓大厦16层

法定代表人：洪弘

联系人：孙博文

联系电话：19931667791

客户服务电话：400-166-1188

网址：[money.jrj.com.cn](http://money.jrj.com.cn)

（75）宜信普泽（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区光华路7号楼20层20A1、20A2单元

办公地址：北京市朝阳区建国路88号SOHO现代城C座18层

法定代表人：才殿阳

联系人：魏晨

联系电话：010-52413385

客户服务电话：400-6099-200

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

（76）北京展恒基金销售股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安苑路11号西楼6层604、607

办公地址：北京市朝阳区安苑路15-1号邮电新闻大厦6层

法定代表人：闫振杰

联系人：李晓芳

联系电话：18334709980

客户服务电话：400-818-8000

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

（77）北京创金启富基金销售有限公司

注册（办公）地址：北京市西城区白纸坊东街2号院6号楼712室

法定代表人：梁蓉

联系人：王瑶

联系电话：010-661548288047

客户服务电话：010-6615-4828

网址：[corp.5irich.com](http://corp.5irich.com)

（78）上海汇付基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区九江路769号1807-3室

办公地址：上海市宜山路700号普天信息产业园2期C5栋汇付天下总部大楼2楼

法定代表人：金佶

联系人：甄宝林

联系电话：021-340139963011

客户服务电话：021-3401-3999

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

（79）上海陆金所基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区源深路1088号7层（实际楼层6层）

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号平安金融大厦15楼

法定代表人：陈祎彬

联系人：李童

联系电话：021-20662010

客户服务电话：4008-219-031

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

（80）上海联泰基金销售有限公司

注册地址：上海市普陀区兰溪路900弄15号526室

办公地址：上海市虹口区临潼路188号

法定代表人：尹彬彬

联系人：陈东

联系电话：021-52822063

客户服务电话：400-118-1188

网址：[www.66liantai.com](http://www.66liantai.com)

（81）上海凯石财富基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区西藏南路765号602-115室

办公地址：上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦4楼

法定代表人：陈继武

联系人：高皓辉

联系电话：021-63333389230

客户服务电话：400-643-3389

网址：www.vstonewealth.com

（82）深圳富济基金销售有限公司

注册（办公）地址：深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路 3088 号中洲大厦 3203A 单元

法定代表人：祝中村

联系人：曾瑶敏

联系电话：0755-83999907

客户服务电话：0755-8399-9907

网址：www.fujifund.cn

（83）上海利得基金销售有限公司

注册地址：上海市宝山区月浦镇塘南街 57 号 6 幢 221 室

办公地址：上海市虹口区东大名路 1098 号浦江金融世纪广场 18 层

法定代表人：李兴春

联系人：陈洁

联系电话：021-60195121

客户服务电话：400-032-5885

网址：www.leadfund.com.cn

（84）珠海盈米基金销售有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼 B1201-1203

法定代表人：肖雯

联系人：曾健灿

联系电话：020-89629023

客户服务电话：020-8962-9066

网址：www.yingmi.cn

（85）中证金牛（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市丰台区东管头 1 号 2 号楼 2-45 室

办公地址：北京市西城区宣武门外大街新华社第三工作区 A 座 4、5 层

法定代表人：吴志坚

联系人：焦金岩

联系电话：010-63156532



客户服务电话: 4008-909-998

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

(86) 北京汇成基金销售有限公司

注册地址: 北京市西城区宣武门外大街甲1号4层401-2

办公地址: 北京市西城区宣武门外大街甲1号环球财讯中心D座401

法定代表人: 王伟刚

联系人: 王骁骁

联系电话: 18601178886

客户服务电话: 400-619-9059

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

(87) 上海万得基金销售有限公司

注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区福山路33号11楼B座

办公地址: 上海市浦东新区浦明路1500号万得大厦11楼

法定代表人: 黄祎

联系人: 徐亚丹

联系电话: 021-51327185

客户服务电话: 400-799-1888

网址: [www.520fund.com.cn](http://www.520fund.com.cn)

(88) 北京新浪仓石基金销售有限公司

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

办公地址: 北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2地块新浪总部科研楼  
法定代表人: 穆飞虎

联系人: 李唯

联系电话: 010-62676979

客户服务电话: 010-6267-5369

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

(89) 北京中植基金销售有限公司

注册地址: 北京市经济技术开发区宏达北路10号五层5122室

办公地址: 北京市朝阳区建国路91号金地中心B座21层、29层

法定代表人: 武建华

客户服务电话: 400-8180-888

网址: <http://www.zzfund.com>

(90) 京东肯特瑞基金销售有限公司

注册地址: 北京市海淀区西三旗建材城中路12号17号平房157

办公地址：北京市通州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

法定代表人：李骏

联系人：邢锦超

联系电话：13811015790

客户服务电话：95118/400-098-8511/400-088-8816

网址：<https://kenterui.jd.com>

（91）南京苏宁基金销售有限公司

注册（办公）地址：南京玄武区苏宁大道1-5号

法定代表人：王锋

联系人：马重庆

联系电话：025-66996699887513

客户服务电话：95177

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

（92）济安财富（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区太阳宫中路16号院1号楼3层307

办公地址：北京市朝阳区东三环中路7号北京财富中心A座46层

法定代表人：杨健

联系人：李海燕

联系电话：010-65309516

客户服务电话：400-673-7010

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

（93）上海云湾基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路27号、明月路1257号1幢1层103-1、103-2办公区

办公地址：上海市浦东新区锦康路308号6号楼6楼

法定代表人：冯轶明

联系人：范泽杰

联系电话：021-20530186

客户服务电话：400-820-1515

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

（94）上海挖财基金销售有限公司

注册（办公）地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路759号18层03单元

法定代表人：吕柳霞

联系人：毛善波

联系电话：021-50810673

客户服务电话：021-5081-0673

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

（95）上海基煜基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区广东路500号30层3001单元

办公地址：上海市浦东新区银城中路488号太平金融大厦1503室

法定代表人：王翔

联系人：李关洲

联系电话：021-65370077

客户服务电话：400-820-5369

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

（96）北京雪球基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区创远路34号院6号楼15层1501室

办公地址：北京市朝阳区创远路34号院融新科技中心C座17层

法定代表人：李楠

联系人：衡欢

联系电话：18576351064

客户服务电话：400-159-9288

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

（97）腾安基金销售（深圳）有限公司

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

办公地址：深圳市南山区海天二路33号腾讯滨海大厦15楼

法定代表人：刘明军

联系人：郑骏锋

联系电话：0755-86013388/76879

客户服务电话：95017（拨通后转1再转8）/ 4000-890-555

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

（98）上海华夏财富投资管理有限公司

注册地址：上海市虹口区东大名路687号1幢2楼268室

法定代表人：毛淮平

联系人：张静怡

联系电话：010-88066184

客户服务电话：400-817-5666

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

## （99）嘉实财富管理有限公司

注册地址：海南省三亚市天涯区三亚湾路国际客运港区国际养生度假中心酒店 B 座(2 #楼)27 楼 2714 室

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

法定代表人：张峰

联系人：刘平

联系电话：010-85097325

客户服务电话：400-021-8850

网址：www.harvestwm.cn

## （100）大连网金基金销售有限公司

注册（办公）地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号诺德大厦 2 层 202 室

法定代表人：樊怀东

联系人：于秀

联系电话：0411-39027810

客户服务电话：4000-899-100

网址：www.yibaijin.com

## （101）江苏汇林保大基金销售有限公司

注册地址：南京市高淳区经济开发区古檀大道 47 号

办公地址：上海市龙华中路 868 号绿地海外滩办公 A1605 室

法定代表人：吴言林

联系人：孙平

联系电话：13564999938

客户服务电话：025-6604-6166 转 849

网址：www.huilinbd.com

## （102）北京度小满基金销售有限公司

注册（办公）地址：北京市海淀区西北旺东路 10 号院西区 4 号楼 1 层 103 室

法定代表人：盛超

联系人：宋刚

联系电话：17611169168

客户服务电话：95055-4

网址：www.baiyingfund.com

## （103）玄元保险代理有限公司

注册（办公）地址：中国（上海）自由贸易试验区张杨路 707 号 1105 室

法定代表人：马永谔

联系人：张苗苗

联系电话: 15110085067

客户服务电话: 010-5873-2782

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

(104) 泛华普益基金销售有限公司

注册(办公)地址: 成都市成华区建设路9号高地中心1101室

法定代表人: 于海锋

联系人: 曾健灿

联系电话: 020-28381666

客户服务电话: 400-080-3388

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

(105) 奕丰基金销售有限公司

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

办公地址: 深圳市南山区海德三道航天科技广场A座17楼1704室

法定代表人: TEO WEE HOWE

联系人: 叶健

联系电话: 0755-89460507

客户服务电话: 400-684-0500

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

(106) 和耕传承基金销售有限公司

注册(办公)地址: 河南自贸试验区郑州片区(郑东)东风南路东康宁街北6号楼5楼503

法定代表人: 温丽燕

联系人: 胡静华

联系电话: 18638787099

客户服务电话: 4000-555-671

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

(107) 中国人寿保险股份有限公司

注册(办公)地址: 中国北京市西城区金融大街16号

法定代表人: 王滨

客户服务电话: 95519

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

(108) 上海攀赢基金销售有限公司

注册地址: 上海市闸北区广中西路1207号306室

办公地址: 上海市浦东新区银城路116号大华银行大厦703室

法定代表人：郑新林

联系人：邓琦

联系电话：021-68889082

客户服务热线：021-68889082

网址：[www.pytz.cn](http://www.pytz.cn)

（109）上海中欧财富基金销售有限公司

注册（办公）地址：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 1008-1 室

法定代表人：许欣

联系人：刘弘义

联系电话：15608193006

客户服务热线：400-100-2666

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

基金管理人可以根据情况变化增加或者减少销售机构，并另行公告。销售机构可以根据情况变化增加或者减少其销售城市、网点，并另行公告。

## （二）注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

注册地址：北京西城区太平桥大街 17 号

办公地址：北京西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：周明

电话：（010）50938856

传真：（010）50938991

联系人：崔巍

## （三）律师事务所和经办律师

名称：北京市金杜律师事务所

注册地址：北京市朝阳区东三环中路 39 号建外 SOHU A 座 31 层

办公地址：北京市朝阳区东三环中路 39 号建外 SOHU A 座 31 层

负责人：王玲

电话：（010）58785588、（0755）22163333

联系人：冯艾

经办律师：宋萍萍、靳庆军

## （四）会计师事务所和经办注册会计师

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼

执行事务合伙人：李丹

电话：021-23237080

联系人：仲文渊

经办注册会计师：魏佳亮、仲文渊

## 六、基金的募集

本基金由基金管理人依照《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》及有关法律法规和基金合同募集，基金募集申请经中国证监会于 2005 年 5 月 9 日核准，核准文件名称为中国证监会证监基金字【2005】79 号文《关于同意巨田资源优选混合型证券投资基金募集的批复》。

本基金募集期为 2005 年 8 月 8 日至 2005 年 9 月 20 日。业经德勤华永会计师事务所有限公司德师报（验）字（05）第 SZ001 号验证，按照每份基金份额面值人民币 1.00 元计算，本基金募集期共募集 309,568,999.66 份基金份额，有效认购户数为 1,644 户。

## 七、基金合同的生效

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《摩根士丹利资源优选混合型证券投资基金（LOF）基金合同》及其它相关规定，本基金募集符合有关规定和条件，已向中国证监会办理完毕基金备案手续，并于 2005 年 9 月 27 日获书面确认，基金合同自该日起正式生效。

## 八、基金份额的上市交易

### （一）上市交易的地点

深圳证券交易所。

### （二）上市交易的时间

本基金已于 2007 年 7 月 5 日在深圳证券交易所上市交易。投资者可在交易日的交易时间使用深圳证券账户通过各深圳证券交易所会员单位的营业网点报盘买入和卖出本基金。

### （三）上市交易的规则

- 1、本基金上市首日的开盘参考价为前一交易日基金份额净值；
- 2、本基金实行价格涨跌幅限制，涨跌幅比例为 10%，自上市首日起实行；
- 3、本基金买入申报数量为 100 份或其整数倍；
- 4、本基金申报价格最小变动单位为 0.001 元人民币；
- 5、本基金上市交易遵循《深圳证券交易所交易规则》及《业务规则》的相关规定。

#### （四）上市交易的费用

本基金上市交易的费用按《业务规则》有关规定办理。

#### （五）上市交易的行情揭示

本基金在深圳证券交易所挂牌交易，交易行情通过行情发布系统揭示。行情发布系统同时揭示基金前一交易日的基金份额净值。

#### （六）上市交易的注册登记

投资人T日买入成功后，注册登记人在T日自动为投资人登记权益并办理注册登记手续，投资人自T+1日（含该日）后有权卖出该部分基金；

投资人T日卖出成功后，注册登记人在T日自动为投资人办理扣除权益的注册登记手续。

#### （七）上市交易的停复牌

本基金的停复牌按照《业务规则》的相关规定执行。

#### （八）暂停上市的情形和处理方式

本基金上市后，发生下列情况之一时，应暂停上市交易：

- 1、基金份额持有人数连续20个工作日低于1000人；
- 2、基金总份额连续20个工作日低于2亿份；
- 3、违反国家有关法律、法规，被中国证监会决定暂停上市；
- 4、深圳证券交易所认为须暂停上市的其他情况。

发生上述暂停上市情形时，基金管理人在接到深圳证券交易所通知后，应立即在指定报刊和网站上刊登暂停上市公告。

#### （九）恢复上市的公告

暂停上市情形消除后，基金管理人可向深圳证券交易所提出恢复上市申请，经深圳证券交易所核准后，可恢复本基金上市，并在指定报刊和网站上刊登恢复上市公告。

#### （十）终止上市的情形和处理方式

发生下列情况之一时，本基金应终止上市交易：

- 1、自暂停上市之日起半年内未能消除暂停上市原因的；
- 2、基金合同终止；
- 3、基金份额持有人大会决定终止上市；
- 4、深圳证券交易所认为须终止上市的其他情况。

发生上述终止上市情形时，基金管理人在报经中国证监会批准后终止本基金的上市，并在指定报刊和网站上刊登终止上市公告。

## 九、基金份额的申购和赎回

### （一）场内基金份额的申购与赎回

- 1、申购与赎回办理的场所



具有基金代销业务资格、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，具体名单详见深圳证券交易所网站（<http://www.szse.cn/>）。

## 2、申购、赎回账户

投资者通过场内申购、赎回应使用中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开立的人民币普通股票账户或证券投资基金账户。

## 3、申购与赎回办理的开放日及开放时间

### （1）开放日及开放时间

深圳证券交易所的工作日为本基金的场内申购赎回开放日。业务办理时间为深圳证券交易所交易时间。

（2）申购、赎回开始日：2005年10月26日。

若出现新的证券交易市场或交易所交易时间改变，基金管理人可视情况对营业时间进行相应的调整并公告，并报中国证监会备案。

## 4、申购与赎回的原则

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

（2）基金采用金额申购和份额赎回的方式，即申购以金额申请，赎回以份额申请。申购申报单位为1元人民币，赎回申报单位为1份基金份额。

（3）当日的申购与赎回申请可以在当日交易结束时间前撤销，在当日的交易时间结束后不得撤销。

## 5、申购份额、赎回金额的计算方式

本基金根据基金份额净值计算申购份额和赎回金额。

### （1）申购份额的计算方法（外扣法）：

净申购金额 = 申购金额 / (1 + 申购费率)

申购费用 = 申购金额 - 净申购金额

申购份额 = 净申购金额 / 申购当日基金份额净值

场内申购份额保留到整数位，不足1份对应的资金返还至投资者资金账户。

例：某非养老金投资者通过场内投资10000元申购本基金，假设申购费率为1.5%，申购当日基金份额净值为1.0250元，则其申购费用、可得到的申购份额及返还的资金余额为：

净申购金额 = 10000 / (1 + 1.5%) = 9852.22元

申购费用 = 10000 - 9852.22 = 147.78元

申购份额 = 9852.22 / 1.0250 = 9611.92份

因场内份额保留至整数份，故该投资者申购所得份额为9611份，不足1份部分对应的申购资金返还给该投资者。

实际净申购金额 = 9611 × 1.025 = 9851.28元

退款金额 = 10000 - 9851.28 - 147.78 = 0.94元

## （2）赎回金额的计算方法

赎回总金额=赎回份额×赎回当日基金份额净值

赎回费用=赎回总金额×赎回费率

净赎回金额=赎回总金额-赎回费用

赎回金总额、净赎回金额按四舍五入的原则保留到小数点后两位。

例：某投资者赎回本基金 10000 份基金份额，持有时间为 10 个月，赎回费率为 0.5%，假设赎回当日基金份额净值为 1.0250 元，则其可得净赎回金额为：

赎回总金额=10000×1.0250=10250 元

赎回费用=10250×0.005=51.25 元

净赎回金额=10250-51.25=10198.75 元

即：投资者赎回 10000 份基金份额，假设赎回当日基金份额净值为 1.0250 元，则可得 10198.75 元净赎回金额。

## 6、申购与赎回的登记结算

基金申购、赎回的登记结算按照中国证券登记结算有限责任公司的有关规定办理。

### （二）场外基金份额的申购与赎回

#### 1、申购与赎回场所

（1）本公司直销网点（见“五、相关服务机构”部分相关内容）；

（2）经本公司委托，具有代销本基金资格的商业银行或其他机构的营业网点（见“五、相关服务机构”部分相关内容）；

（3）本基金管理人同时考虑在适当的时候，投资人可通过基金管理人或指定基金代销机构进行电话、传真或网上等形式的申购、赎回，具体规则由基金管理人另行确定并公告。

#### 2、申购与赎回的开放日及开放时间

申购、赎回的开放日为证券交易所的正常交易日。开放日的具体业务办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所及其他证券交易场所交易日的交易时间。

申购、赎回开始日：2005 年 10 月 26 日。

若出现新的证券交易市场或交易所交易时间改变，基金管理人可视情况对营业时间进行相应的调整并公告，并报中国证监会备案。

投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回申请的，其基金份额申购、赎回价格为下次办理基金份额申购、赎回时间所在开放日的价格。

#### 3、申购和赎回数额限制

##### （1）申购数额的限制

投资者首次申购单笔最低金额为人民币1元，追加申购单笔最低金额为人民币1元；其中个人投资者通过本公司直销中心首次申购公司旗下基金的单笔最低金额为100万元（含），已有在本基金管理人直销中心认购或申购公司旗下基金记录的个人投资人不受首次申购最低金额100万元（含）的限制，但受追加申购最低金额的限制。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；投资人可多次申购，对单个投资人累计持有份额不设上限限制，但法律法规、中国证监会、本基金招募说明书另有规定的除外。

#### （2）赎回数额的限制

赎回的最低份额为1份基金份额，基金份额持有人可将其全部或部分基金份额赎回，但某笔赎回导致单个发生交易账户的基金份额余额少于1份时，余额部分基金份额必须一同赎回。

（3）基金管理人有权对单个投资人累计持有的基金份额上限进行限制，但本基金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%（但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）。法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

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

（5）基金管理人可以根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整上述申购金额和赎回份额的数量限制，或者新增基金规模控制措施，基金管理人必须根据《信息披露办法》的规定在指定媒介上刊登公告。

### 4、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的基金份额净值为基准进行计算；

（2）“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

（3）当日的申购、赎回申请可以在当日15:00以前撤销；

（4）基金管理人可根据基金运作的实际情况更改上述原则。基金管理人应按照《信息披露办法》的规定在指定媒介上公告。

### 5、申购、赎回的程序

#### （1）申购与赎回的申请方式

基金投资人必须根据基金销售机构规定的手续，在开放日的业务办理时间向基金销售机构提出申购、赎回的申请。

投资人在申购本基金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，必须有足够的基金份额余额。否则所提交的申购、赎回的申请无效而不予成交。

#### （2）申购、赎回申请的确认

T日规定时间受理的申请，正常情况下，基金注册登记人在T+1日内为投资人对该交易的有效性进行确认，在T+2日后（包括该日）投资人可向销售机构或以销售机构规定的其它方式查询申购、赎回的成交情况。

#### （3）申购与赎回的款项支付的方式与时间

基金申购采用全额缴款方式。投资人赎回申请成功后，基金管理人应会同基金托管人按有关规定在T+7日（包括该日）内支付赎回款项。在发生巨额赎回的情形时，款项的支付办

法参照基金合同的有关条款处理。

#### 6、申购份额与赎回金额的计算方式

##### （1）基金申购份额的计算（外扣法）

申购份额以当日基金份额净值为基准计算，计算结果以四舍五入的方式保留到小数点后2位。

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

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

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

例：某投资人投资10000元申购本基金，申购费率为1.5%，假设申购当日基金份额净值为1.0500元，则：

$$\text{净申购金额} = 10000 / (1 + 1.5\%) = 9852.22 \text{元}$$

$$\text{申购费用} = 10000 - 9852.22 = 147.78 \text{元}$$

$$\text{申购份额} = 9852.22 / 1.0500 = 9383.07 \text{份}$$

即：投资人投资10000元申购本基金，假设申购当日基金份额净值为1.0500元，则可得9383.07份基金份额。

##### （2）基金赎回金额的计算

赎回金额以当日基金份额净值为基准计算，计算结果以四舍五入的方式保留到小数点后2位。

$$\text{赎回总金额} = \text{赎回份数} \times \text{赎回当日基金份额净值}$$

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

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

例：某投资人赎回10000份基金份额，对应的赎回费率为0.5%，假设赎回当日基金份额净值是1.0500元，则：

$$\text{赎回总金额} = 10000 \times 1.0500 = 10500 \text{元}$$

$$\text{赎回费用} = 10500 \times 0.5\% = 52.5 \text{元}$$

$$\text{净赎回金额} = 10500 - 52.5 = 10447.5 \text{元}$$

即：投资人赎回本基金10000份基金份额，假设赎回当日基金份额净值是1.0500元，则其可得到的净赎回金额为10447.5元。

##### （3）基金份额净值的计算

$$T \text{日基金份额净值} = T \text{日收市后基金资产净值} / T \text{日基金份额余额}$$

T日的基金份额净值采用四舍五入方法保留到小数点后4位，在当天收市后计算，并于次日公告。遇特殊情况，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。

### （三）暂停或拒绝申购的情形和处理方式

1、除出现如下情形，基金管理人不得拒绝或暂停基金投资人的申购申请：

（1）不可抗力的原因导致基金无法正常运转；

- （2）证券交易场所在交易时间非正常停市，导致无法计算当日的基金资产净值；
- （3）基金财产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或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的利益；
- （4）基金管理人、基金托管人、基金销售代理人或基金注册登记人的技术保障和人员支持等不充分；
- （5）当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金申购申请；
- （6）基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过基金份额总数的50%，或者有可能导致投资者变相规避前述50%比例要求的情形；
- （7）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单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；或该投资人单日或单笔申购金额超过单个投资人单日或单笔申购金额上限时；
- （8）基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔申购；
- （9）法律、法规规定或中国证监会认定的其它可暂停申购的情形。

2、发生上述除第（6）、（7）、（8）项外的暂停申购情形时，基金管理人应当在指定媒介上刊登暂停申购公告。当发生上述第（6）项情形时，基金管理人可以采取比例确认等方式对该投资人的申购申请进行限制，基金管理人有权拒绝该等全部或者部分申购申请。

#### （四）暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

1、除下列情形外，基金管理人不得拒绝接受或暂停基金份额持有人的赎回申请：

- （1）因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项；
- （2）证券交易场所依法决定临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；
- （3）因市场剧烈波动或其它原因而出现连续巨额赎回，导致本基金的现金支付出现困难；
- （4）当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金赎回申请或延缓支付赎回款项；
- （5）基金合同约定的其他特殊情形。

发生上述情形之一的，基金管理人应在当日向中国证监会报告备案。

已接受的赎回申请，基金管理人将足额支付；如暂时不能足额支付的，可支付的部分按每个赎回申请人已被接受的赎回申请量占已接受赎回申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分由基金管理人按照发生的情况制定相应的处理办法在后续开放日予以支付。同时，在出现上述第（3）款的情形时，对已接受的赎回申请可延期支付赎回款项，最长不超过正

常支付时间20个工作日，并在指定媒介上公告。投资人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。

2、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。

#### **（五）其它暂停申购、赎回及延缓支付赎回款项的情形及处理方式**

发生基金合同或招募说明书中未予载明的事项，但基金管理人认为有正当理由认为需要暂停基金份额申购、赎回申请的，应当报经中国证监会备案。经备案后，基金管理人应当及时在指定媒介上刊登暂停申购、赎回公告。在暂停申购、赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购、赎回业务的办理。

#### **（六）拒绝或暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告**

1、发生暂停申购和赎回情况的，基金管理人应在当日立即向中国证监会备案并应在规定期限内指定媒介上刊登暂停公告；

2、如果发生暂停的时间为一日，第2个工作日基金管理人应在中国证监会指定媒介上刊登基金重新开放申购、赎回公告并公布最近一个工作日的基金份额净值；

3、如果发生暂停的时间超过一日但少于2周，暂停结束基金重新开放申购、赎回时，基金管理人应提前一个工作日在指定媒介上刊登基金重新开放申购、赎回公告，并在重新开放申购、赎回日公告最近一个工作日的基金份额净值。

4、如果发生暂停的时间超过2周，暂停期间，基金管理人应每2周至少重复刊登提示性公告一次；当连续暂停时间超过2个月时，可将重复刊登暂停公告的频率调整为每月一次。暂停结束基金重新开放申购、赎回时，基金管理人应按照《信息披露办法》的规定在指定媒介上连续刊登基金重新开放申购、赎回公告并在重新开放申购、赎回日公告最近一个工作日的基金份额净值。

#### **（七）巨额赎回的情形及处理方式**

##### **1、巨额赎回的认定**

若单个开放日基金份额净赎回申请（赎回申请总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一日本基金总份额的10%时，即认为基金发生了巨额赎回。

##### **2、巨额赎回的处理方式**

当本基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据本基金当时的资产组合状况决定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兑付基金投资人的赎回申请时，按正常赎回程序执行。

（2）部分延期赎回：当基金管理人认为兑付投资人的赎回申请可能导致本基金份额持有人的利益受损或无法实现时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一日本基金总份额的10%的前提下，对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；未受理部分可延迟至下一个工作日办理。

转入第2个工作日的赎回申请不享有优先权并以该开放日的本基金份额净值为依据计算赎回金额，依此类推，直到全部赎回为止。基金份额持有人在申请赎回时可选择将当日未获受理部分予以撤销。场内的赎回申请在遇到巨额赎回时不予办理延期赎回，当日未获受理部分予以撤销。

（3）若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额20%的，基金管理人有权对该单个基金份额持有人超出该比例的赎回申请实施延期办理，对该单个基金份额持有人剩余赎回申请与其他账户赎回申请按前述条款处理。场内赎回申请遵循中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则处理。

（4）巨额赎回的公告：当本基金发生巨额赎回并部分延期赎回时，基金管理人应说明有关处理方法，并在两日内在指定媒介上刊登公告。

本基金连续2个工作日以上发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过正常支付时间20个工作日，并应当在指定媒介上进行公告。

#### （八）定期定额投资计划

投资者可通过基金管理人指定的基金销售机构办理基金定期定额投资业务，约定每期扣款日和扣款金额，由销售机构于每期约定扣款日在投资者指定资金账户内自动完成扣款和基金申购申请。本基金定期定额申购的每期最低扣款金额为1元。投资者办理基金定期定额投资业务的具体实施方法，请参见基金管理人的相关公告。

### 十、基金份额的登记、非交易过户、系统内转托管和跨系统转登记

#### （一）基金份额的登记

1、本基金的份额采用分系统登记的原则。场外认购或申购买的基金份额登记在注册登记系统持有人开放式基金账户下；场内认购、申购或上市交易买入的基金份额登记在证券登记结算系统持有人证券账户下。

2、登记在证券登记结算系统中的基金份额既可上市交易，也可直接申请赎回。

#### （二）非交易过户

基金注册登记人受理继承、捐赠和司法强制执行等情况下的非交易过户。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。捐赠是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它自然人、法人、社会团体或其它组织。具体条件、程序以《中国证券登记结算有限公司开放式证券投资基金登记结算业务指南》为准。

#### （三）系统内转托管

1、系统内转托管是指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（席位）之间进行转托管的行为。

2、基金份额登记在注册登记系统的基金份额持有人在变更办理基金赎回业务的销售机构（网点）时，销售机构（网点）之间不能通存通兑的，可办理已持有基金份额的系统内转托管。

3、基金份额登记在证券登记结算系统的基金份额持有人在变更办理上市交易的会员单位（席位）时，可办理已持有基金份额的系统内转托管。

#### （四）跨系统转登记

1、跨系统转登记是指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统之间进行转登记的行为。

2、本基金跨系统转登记的具体业务按照中国证券登记结算有限公司的相关规定办理。

## 十一、基金转换

基金转换指基金份额持有人按基金管理人规定的条件申请将其持有的某一基金的基金份额转为同一基金管理人管理的、由同一注册登记人办理注册登记的其他基金的基金份额。

基金管理人于 2006 年 10 月 26 日开通本基金与基金管理人管理的摩根士丹利华鑫货币市场基金间的转换业务。因摩根士丹利华鑫货币市场基金基金合同终止，本基金于 2015 年 1 月 22 日起暂停基金转换业务。本基金恢复基金转换业务时，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相关规则并公告，并提前告知基金托管人与相关机构。

## 十二、基金的投资

本基金所指的资源是指能够被企业占有和利用，为企业创造经济价值，提升企业核心竞争力，具有战略发展意义的自然资源，具体包括土地资源、水资源、生物资源、矿产资源、旅游资源等。

资源类上市公司为拥有自然资源、开采自然资源或直接对自然资源进行加工、开发的上市公司。具体包括：拥有土地资源、水资源或者生物资源的农林牧渔业上市公司；拥有或开采矿产资源的采掘业上市公司；拥有基础原材料基地的制造业上市公司；对水资源进行开发的水电、自来水类上市公司；对土地资源、水资源进行开发的交通设施类上市公司；对土地资源进行开发的房地产上市公司；对旅游资源进行经营、开发的旅游业上市公司。

本基金管理人认为：在我国及世界范围内，自然资源具有绝对稀缺和相对稀缺的总体特征。有限的资源储量与持续增长的需求，以及资源定价的市场化决定了自然资源价值将长期持续提升。



本基金管理人研究表明，目前我国资源类上市公司的盈利能力高于市场平均水平，充分体现了资源类公司的价值性；同时，资源类上市公司的市盈率、市净率、企业总价值与息税、折旧及摊销前盈利之比（EV/EBITDA）均低于市场平均水平，其相对投资价值比较明显。

本基金立足于充分把握自然资源价值性、稀缺性和独占性的特点，通过投资于拥有优质土地资源、水资源、生物资源、矿产资源、旅游资源的上市公司，为投资者获取长期、稳定、丰厚的投资回报。

### （一）投资目标

将中国资源的经济价值转换为持续的投资收益，为基金份额持有人谋求长期、稳定的投资回报。

本基金将把握资源的价值变化规律，对各类资源的现状和发展进行分析判断，及时适当调整各类资源行业的配置比例，重点投资于各类资源行业中的优势企业，分享资源长期价值提升所带来的投资收益。

### （二）投资方向

在国内证券市场依法发行上市的 A 股、债券及经中国证监会批准的允许本基金投资的其他金融工具，其中投资于资源类上市公司股票的比例不低于基金股票资产的 80%。

### （三）投资策略

本基金将中长期持有以资源类股票为主的股票投资组合，并注重资产在资源类各相关行业的配置，适当进行时机选择。采用“自上而下”为主、结合“自下而上”的投资方法，将资产管理策略体现在资产配置、行业配置、股票及债券选择的过程中。

#### （1）一级资产配置

1) 本基金通过资产配置来确定投资组合中股票、债券和现金的比例。资产配置主要根据以下内容进行：

- a、国家有关法律、法规和基金契约的有关规定；
- b、国内外宏观经济环境及相关指标，包括 GDP 增长率、消费需求变化趋势、进出口增长变化趋势、总投资变化趋势；
- c、国家财政政策包括国债发行趋势、政府财政收支状况、税收政策及政府转移支付政策等；
- d、国家货币政策、利率走势及通货膨胀预期、物价变化趋势；
- e、国家产业政策、产业投资增长变化、投入产出状况；
- f、各地区、各行业发展状况；
- g、证券市场政策环境、市场资金供求状况、投资者状况及市场发展趋势。

在正常市场情况下，本基金资产中股票投资比例的变动范围为：基金资产净值的 30%-95%；债券投资比例的变动范围为：基金资产净值的 0%-65%；现金或到期日在一年以内的政府债券比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。法律法规和监管部门对上述比例另有规定时从其规定。

2) 根据本基金管理人关于旗下基金权证投资方案：

a、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千分之五；

b、本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的百分之三；

c、公司管理的全部基金持有的同一权证不得超过该权证的百分之十。

中国证监会另有规定的，不受前款第 a、b、c 项规定的比例限制。因证券市场波动、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不符合上述投资比例的，本公司将在十个交易日之内调整完毕。

#### （2）二级资产配置

本基金采用“自上而下”为主、结合“自下而上”的投资方法，主要配置方法如下：

A、根据上市公司资源的类别、数量、与主营业务的密切程度判断公司是否属于资源类公司，所有资源类公司形成资源类股票库；

B、在资源类股票库的基础上剔除 ST 等财务异常公司股票形成投资的基准库；

C、运用资源评价体系对基准库公司所拥有的资源进行评级并作三级分类，由一级资源类公司形成备选库；

D、运用投资价值综合评价系统对备选库公司的财务状况、内在价值、相对价值进行综合评级，依据系统评价的结果，并结合公司实地调研的结论建立起基金的投资组合；

E、对投资组合内股票的收益、风险特征、流动性指标、预期收益率进行量化分析，在分析结果基础上构造有效投资组合，以实现组合整体的风险收益最优化。

#### （3）股票投资策略

A、根据资源的经济价值，注重对资源类上市公司所拥有的资源价值评估和公司证券价值的估值分析；对于精选个股将坚持中长期持有为主的策略。

B、我国证券市场处于新兴加转轨的阶段，市场的波动性较强，所以本基金将依据市场判断和政策分析，同时根据类别行业的周期性特点，采取适当的时机选择策略，以优化组合表现。

#### （4）债券投资策略

本基金采取“自上而下”为主，“自下而上”为辅的投资策略，以长期利率趋势分析为基础，兼顾中短期经济周期、政策方向等因素在类别资产配置、市场资产配置、券种选择 3 个层面进行主动性投资管理。积极运用“久期管理”，动态调整组合的投资品种，以达到预期投资目标。

#### （5）权证投资策略

对权证的投资建立在对标的证券和组合收益风险进行分析的基础之上，权证在基金的投资中将主要起到锁定收益和控制风险的作用。

以 BS 模型和二叉树模型为基础来对权证进行定价，并根据市场情况对定价模型和参数进行适当修正。

在组合构建和操作中运用的投资策略主要包括但不限于保护性看跌策略、抛补的认购权证、双限策略等。

#### （四）投资决策程序

##### 1、投资决策依据

- 1) 国家有关法律、法规和基金合同的有关规定；
- 2) 国内外宏观经济发展状况、微观经济运行环境和证券市场发展趋势；
- 3) 投资品种的预期收益率和风险水平；

##### 2、投资决策程序

###### （1）投资研究

本基金管理人研究团队充分利用外部和内部的研究资源提供研究成果，挖掘投资机会，为投资决策委员会和基金经理提供决策支持。

###### （2）投资决策

投资决策委员会是基金投资的最高决策机构，负责制定基金的投资原则、投资目标及整体资产配置策略和风险控制策略，并对基金经理进行授权，对基金的投资进行总体监控。如遇重大事项，投资决策委员会及时召开临时会议做出决议。

###### （3）组合构建

基金经理根据投资委员会确定的总体投资策略和原则以及研究团队提供的分析和建议等信息，在遵守基金合同的前提下，在投资决策委员会的授权范围内构建具体的投资组合，进行组合的日常管理。

###### （4）交易执行

本基金实行集中交易制度。交易团队负责执行基金经理投资指令，同时承担一线风险监控职责。

###### （5）风险与绩效评估

投资风险管理团队由风险管理团队和监察稽核团队组成。风险管理团队定期或不定期对基金投资风险与绩效进行评估；监察稽核团队对基金投资的合规性进行日常监控及事后检查；风险管理委员会定期召开会议，结合市场、法律等环境的变化，对基金投资组合进行风险评估，并提出风险防范措施及意见。

###### （6）组合调整

基金经理将跟踪行业状况、证券市场和上市公司的发展变化、基金申购和赎回的现金流量情况以及组合风险与绩效评估的结果，对投资组合进行动态调整。

本基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下，有权根据市场环境变化和实际需要调整上述投资程序，并在更新的招募说明书中公告。

#### （五）业绩比较基准

依据本基金基金合同的约定，经与相关基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，自2015年9月29日起，本基金的业绩比较基准变更为：

沪深 300 指数收益率×70%+标普中国债券指数收益率×30%

本基金股票投资部分的业绩比较基准是沪深 300 指数，债券投资部分的业绩比较基准是

标普中国债券指数。

沪深 300 指数是沪深证券交易所第一次联合发布的反映 A 股市场整体走势的指数，由中证指数公司编制和维护，是在上海和深圳证券市场中选取 300 只 A 股作为样本编制而成。该指数样本对沪深市场的覆盖度高，具有良好的市场代表性，投资人可以方便地从报纸、互联网等财经媒体中获取。同时，该指数编制方法清晰透明，具有独立性和良好的市场流动性；与市场整体表现具有较高的相关度，且指数历史表现强于市场平均收益水平，适合作为本基金的权益投资部分业绩基准。

标普中国债券指数是中信标普指数信息服务有限公司所开发的债券系列指数之一，该系列指数包括 6 只固定收益指数，分别跟踪中国政府债、企业债、金融债、服务债、工业债和公用事业债的业绩表现以及具有综合意义的全债指数。标普中国债券指数旨在追踪中国的政府债、企业债、金融债、服务债、公用事业债和工业债券市场，它涵盖了在上海证券交易所和深圳证券交易所上市的债券。纳入标普中国债券指数的债券的信用评级都在投资级以上。适合作为本基金的固定收益投资部分业绩基准。

如果上述基准指数停止计算编制或更改名称，或者今后法律法规发生变化，又或者市场推出更具权威、且更能够表征本基金风险收益特征的指数，则基金管理人将视情况经与基金托管人协商同意并按照监管部门要求履行适当程序后调整本基金的业绩比较基准，而无需召开基金份额持有人大会审议，并及时公告并报证监会备案，同时在更新的招募说明书中列示。

上述事项已于 2015 年 9 月 29 日在指定媒介上公告。

#### （六）风险收益特征

本基金为混合型基金，风险介于股票型和债券型基金之间，适于能承担一定风险、追求较高收益和长期资本增值的投资人投资。

#### （七）投资限制

##### 1、组合限制

本基金以《基金法》、《运作办法》等相关法律、法规和基金合同为基础，通过构造投资组合降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。基金的投资组合将遵循以下限制：

- （1）本基金持有一家上市公司的股票，其市值不得超过本基金资产净值的 10%；
  - （2）本基金与本基金管理人管理的其他基金持有一家上市公司发行的证券，不超过该证券的 10%；
  - （3）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%；
  - （4）本基金主动投资于流动性受限资产的市场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；

（5）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；

（6）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；

（7）本《基金合同》关于投资范围、投资策略和投资比例的约定；

（8）法律法规或中国证监会规定的其它比例限制。

除上述“三、投资范围”中的“现金或到期日在一年以内的政府债券比例不低于基金资产净值的 5%”及第（4）、（5）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不符合第（1）和第（2）项规定的比例或者基金合同约定的投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内调整完毕。

## 2、建仓期

本基金建仓时间为基金合同生效之日起 3 个月。

## 3、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

（1）承销证券；

（2）向他人贷款或者提供担保；

（3）从事承担无限责任的投资；

（4）买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；

（5）向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；

（6）买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；

（7）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

（8）依照法律、行政法规有关规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。如法律法规有关规定发生变更，上述禁止行为应相应变更。

## （八）基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

1、不谋求对上市公司的控股；

2、有利于基金财产的安全和增值；

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

## （九）基金投资组合报告

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

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 7 月 18 日复核

了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。本投资组合报告所载数据截至 2023 年 6 月 30 日，本报告中所列财务数据未经审计。

#### 1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	408,165,754.15	85.58
	其中：股票	408,165,754.15	85.58
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	56,622,344.56	11.87
8	其他资产	12,158,888.26	2.55
9	合计	476,946,986.97	100.00

#### 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	2,149,650.00	0.46
B	采矿业	3,188,871.00	0.68
C	制造业	341,823,509.60	72.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	14,525,236.00	3.08
E	建筑业	11,623,759.16	2.46
F	批发和零售业	14,899.05	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	4,462,560.00	0.95
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	20,173.74	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	10,722,663.00	2.27
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	926,625.00	0.20
N	水利、环境和公共设施管理业	18,707,807.60	3.96
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	408,165,754.15	86.44

3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

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	603699	纽威股份	1,849,300	27,517,584.00	5.83
2	002444	巨星科技	1,235,004	27,021,887.52	5.72
3	688121	卓然股份	632,774	23,665,747.60	5.01
4	603305	旭升集团	726,680	20,252,571.60	4.29
5	002126	银轮股份	962,100	17,029,170.00	3.61
6	600011	华能国际	1,568,600	14,525,236.00	3.08
7	002384	东山精密	558,900	14,475,510.00	3.07
8	600475	华光环能	1,174,770	13,956,267.60	2.96
9	002965	祥鑫科技	242,000	13,474,560.00	2.85
10	603556	海兴电力	529,452	13,363,368.48	2.83

4、报告期末按券种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

根据本基金基金合同规定，本基金不参与贵金属投资。

8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(1) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

根据本基金基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

(2) 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(1) 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

(2) 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

根据本基金基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

(3) 本期国债期货投资评价

根据本基金基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

11、投资组合报告附注

(1) 本基金投资的前十名证券的发行主体未出现本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。

(2) 基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

(3) 其他资产的构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	436,256.73
2	应收证券清算款	11,661,746.79
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	60,884.74



6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	12,158,888.26

（4）报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

（5）报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 十三、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

1、自基金合同生效以来至 2023 年 6 月 30 日，本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较表：

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准收 益率标准差④	①-③	②-④
2005 年 9 月 27 日至 2005 年 12 月 31 日	1.95%	0.12%	0.52%	0.61%	1.43%	-0.49%
2006 年 1 月 1 日至 2006 年 12 月 31 日	115.15%	1.27%	76.97%	0.98%	38.18%	0.29%
2007 年 1 月 1 日至 2007 年 12 月 31 日	159.00%	2.21%	98.12%	1.61%	60.88%	0.60%
2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日	-47.62%	1.84%	-49.18%	2.10%	1.56%	-0.26%
2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日	76.75%	1.67%	61.47%	1.43%	15.28%	0.24%
2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	18.51%	1.30%	-6.77%	1.09%	25.28%	0.21%
2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	-18.09%	0.95%	-17.46%	0.93%	-0.63%	0.02%
2012 年 1 月 1 日至	-0.97%	0.82%	6.71%	0.88%	-7.68%	-0.06%

2012年12月31日							
2013年1月1日至 2013年12月31日	11.93%	1.33%	-2.90%	0.96%	14.83%	0.37%	
2014年1月1日至 2014年12月31日	4.97%	1.46%	36.26%	-3.11%	0.84%	-30.29%	0.62% -1.70%
2015年1月1日至 2015年12月31日	42.45%	2.56%	8.56%	1.71%	33.89%	0.85%	
2016年1月1日至 2016年12月31日	-10.04%	1.49%	-7.00%	0.98%	-3.04%	0.51%	
2017年1月1日至 2017年12月31日	18.40%	0.81%	14.81%	0.45%	3.59%	0.36%	
2018年1月1日至 2018年12月31日	-25.16%	1.35%	-16.28%	0.94%	-8.88%	0.41%	
2019年1月1日至 2019年12月31日	21.07%	1.21%	26.06%	0.87%	-4.99%	0.34%	
2020年1月1日至 2020年12月31日	71.02%	1.69%	19.94%	1.00%	51.08%	0.69%	
2021年1月1日至 2021年12月31日	15.34%	1.39%	-1.98%	0.82%	17.32%	0.57%	
2022年1月1日至 2022年12月31日	-35.01%	1.38%	-14.57%	0.90%	-20.44%	0.48%	
2023年1月1日至 2023年6月30日	-4.85%	0.92%	0.29%	0.59%	-5.14%	0.33%	
自基金合同生效起至 2023年6月30日	896.16%	1.50%	287.25%	1.14%	608.91%	0.36%	

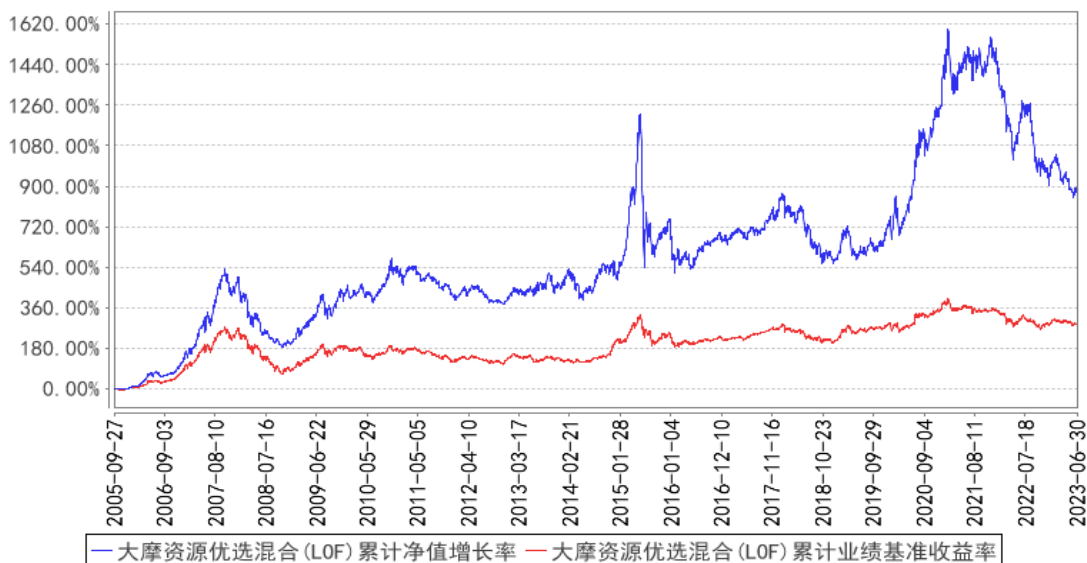
2、自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

摩根士丹利资源优选混合型证券投资基金 (LOF)

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2005年9月27日至2023年6月30日)

大摩资源优选混合 (LOF) 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金基金合同于 2005 年 9 月 27 日正式生效。按照本基金基金合同的规定，基金管理人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。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合基金合同约定。

## 十四、基金的财产

### (一) 基金财产的构成

#### 1、基金资产总值

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

其构成主要有：

- (1) 银行存款及其应计利息；
- (2) 清算备付金及其应计利息；
- (3) 根据有关规定缴纳的保证金；
- (4) 应收证券交易清算款；
- (5) 应收申购款；
- (6) 股票投资及其估值调整；
- (7) 债券投资及其估值调整和应计利息；
- (8) 权证投资及其估值调整；
- (9) 其他投资及其估值调整；
- (10) 其他资产等。

#### 2、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

## （二）基金财产的账户

本基金财产以基金托管人名义开立基金托管专户、以基金的名义在基金托管人营业机构开设基金银行存款账户和证券交易资金账户，以基金托管人和基金联名的方式开立基金证券账户，以基金的名义开立银行间债券托管账户，并报中国证监会及银行业监管机构备案。开立的基金各类专用账户，与基金管理人、基金托管人、销售代理人、注册登记人自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

## （三）基金财产的保管与处分

1、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。基金管理人、基金托管人不得将基金财产归入其固有财产。

2、基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益，归入基金财产。

3、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。

4、非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

## 十五、基金资产的估值

### （一）估值日

基金资产估值日为相关的证券交易所的正常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营业日。

### （二）估值方法

#### 1、股票估值方法

（1）上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按最近交易日的收盘价估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

对旗下基金持有的长期停牌股票参照“指数收益法”进行估值，其中行业指数参照交易所行业分类指数。

#### （2）未上市股票的估值：

①首次发行未上市的股票，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，按成本价估值。

②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，按估值日其所在证券交易所上市的同一股票的市价进行估值。

③送股、转增股、配股和公开增发新股等方式发行的未上市股票，按估值日其所在证券交易所上市的同一股票的市价进行估值。

④非公开发行有明确锁定期流通受限的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

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

（4）国家有最新规定的，按其规定进行估值。

为确保证券投资基金估值的合理性和公允性，根据《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（证监会公告【2017】13号）和中国证券投资基金业协会发布的《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》（中基协发【2017】6号）（以下简称“估值指引”），本公司已于2017年12月31日前按照估值指引要求完成了实施工作。经与相关托管银行、会计师事务所协商一致，本基金自持有流通受限股票之日起，参考估值指引进行估值。上述调整事项已于2018年2月6日在指定媒体上公告。

## 2、债券估值方法

（1）在证券交易所市场挂牌交易的实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，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的，按最近交易日的收盘价估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

（2）在证券交易所市场挂牌交易的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，估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按最近交易日债券收盘价减去所含的债券应收利息后的净价进行估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

（3）首次发行未上市债券采用估值技术确定的公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

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

（5）交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，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，按成本进行后续计量。

（6）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。

（7）在任何情况下，基金管理人如采用本项第（1）—（6）小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第（1）—（6）小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上形成的债券估值，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

（8）国家有最新规定的，按其规定进行估值。

为确保证券投资基金估值的合理性和公允性，根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》（以下简称“估值处理标准”）的有关规定，经与相关基金托管人、会计师事务所协商一致，自 2015 年 3 月 25 日起，对本基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外）的估值方法进行调整，采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。上述调整事项已于 2015 年 3 月 26 日在指定媒体上公告。

### 3、权证估值方法

（1）基金持有的权证，从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的权证按估值日其所在证券交易所挂牌的收盘价估值；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的，以最近交易日的收盘价估值；估值日无交易，且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。

（2）首次发行未上市的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

（3）因持有股票而享有的配股权，以及停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值进行估值。

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

（5）国家有最新规定的，按其规定进行估值。

4、其他有价证券等资产按国家有关规定进行估值。

5、根据有关法律法规，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，基金管理人有权按照其对基金净值的计算结果对外予以公布。

### （三）估值对象

基金所拥有的股票、债券、权证和银行存款本息、应收款项和其他投资等资产。

### （四）估值程序

基金日常估值由基金管理人进行。基金管理人完成估值后，将估值结果以书面形式并加盖业务公章发送给基金托管人，基金托管人按法律法规和基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金托管人复核无误后加盖业务公章返回给基金管理人；月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

### （五）基金份额净值计价错误的确认与处理

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。基金份额净值的计算采用四舍五入方法保留到小数点后4位。当基金份额净值小数点后4位以内(含第4位)发生差错时，视为基金份额净值错误。

本基金合同的当事人应按照以下约定处理：

#### 1、差错类型

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

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

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

#### 2、差错处理原则

（1）差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已产生的差错，给当事人造成损失的，由差错责任方承担赔偿责任；若差错责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责任。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正。

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

（3）因差错而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但差错责任方仍应对差错负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失（“受损方”），则差错责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给差错责任方。

（4）差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式。

（5）差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人过错造成基金财产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人过错造成基金财产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。基金管理人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损失。

（7）按法律法规规定的其他原则处理差错。

### 3、差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

（2）根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；

（3）根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失；

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

### 4、基金份额净值差错处理的原则和方法如下：

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

（2）错误偏差达到基金份额净值的 0.25%时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告。

（3）因基金份额净值计算错误，给基金或基金份额持有人造成损失的，应由基金管理人先行赔付，基金管理人按差错情形，有权向其他当事人追偿。

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

（5）前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

### （六）暂停估值的情形及处理

1、基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

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

3、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；

4、如出现基金管理人认为属于紧急事故的任何情况，会导致基金管理人不能出售或评估基金资产的；

5、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，基金管理人经与基金托管人协商一致的；

6、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

### （七）基金资产净值的确认

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



净值予以公布。

#### （八）特殊情形的处理

1、基金管理人或基金托管人按股票估值方法中的第（3）项、债券估值方法的第（7）项、权证估值方法的第（4）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；

2、由于证券交易所或登记结算公司发送的数据错误，或战争、火灾、地震、洪水等不可抗力原因，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，但未能发现错误的，由此造成的基金份额净值计价错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。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；

3、如遇国家颁布的有关基金会计制度的变化所造成的误差，不作为基金份额净值错误处理。

## 十六、基金的收益分配

### （一）基金收益的构成

- 1、买卖证券差价；
- 2、基金投资所得红利、股息、债券利息；
- 3、存款利息；
- 4、其他收入。

因运用基金财产带来的成本或费用的节约应计入收益。

### （二）基金净收益

基金净收益为基金收益扣除按照国家有关规定可以在基金收益中扣除的费用后的余额。

### （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，基金收益每年至少分配1次，最多6次，基金每次收益分配比例最低不低于已实现收益的60%，但若基金合同生效不满3个月则可不进行收益分配；

2、场外投资人可以选择现金分红或红利再投资（即基金份额持有人将所获分配的现金收益按照本基金合同有关基金份额申购的约定转为基金份额）；场内投资人只能选择现金分红；本基金分红的默认方式为现金分红；

- 3、基金当期收益应先弥补前期亏损后，才可进行当期收益分配；
- 4、每一基金份额享有同等分配权；
- 5、法律、法规或监管机关另有规定的，从其规定。

### （四）基金收益分配方案的确定与公告

基金收益方案中应载明基金收益的范围、基金净收益、基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式、支付方式等内容。

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

### （五）基金收益分配中发生的费用

- 1、 红利分配采用红利再投资方式的，免收申购费用。
- 2、 收益分配时所发生的银行转帐或其他手续费用由基金份额持有人自行承担。

## 十七、基金的费用与税收

### （一）与基金运作有关的费用

#### 1、与基金运作有关的基金费用种类：

- （1）基金管理人的管理费；
- （2）基金托管人的托管费；
- （3）基金的证券交易费用；
- （4）基金合同生效后的信息披露费用；
- （5）基金份额持有人大会费用；
- （6）基金合同生效后的会计师费和律师费；
- （7）在中国证监会有关规定的情况下，基金管理人按照有关规定收取的基金持续销售和服务基金份额持有人的销售服务费；
- （8）按照国家有关规定和基金合同约定可以列入的其他费用。

上述费用从基金财产中支付。

#### 2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

##### （1）基金管理人的管理费

在通常情况下，本基金的管理费按前一日基金资产净值 1.20% 的年费率计算，计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费；

E 为前一日基金资产净值。

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据基金管理人的划款指令，于次月的前 2 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

##### （2）基金托管人的托管费

在通常情况下，本基金的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计算，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，由基金托管人根据基金管理人的划款指令，于次月的前 2 个工作日内从基金资产中一次性支取。

（3）上述第一条中 3—8 项基金费用根据有关法规、基金合同及相应协议的规定，按费用实际支出金额，列入当期基金费用。

### 3、管理费和托管费的调整

基金管理人和基金托管人可磋商酌情降低基金管理费、基金托管费，下调前述费率无须召开基金份额持有人大会。基金管理人按照《信息披露办法》的规定在指定媒介刊登公告。

#### （二）与基金销售有关的费用

##### 1、申购费用

本基金的申购包括柜台（场外）申购和深圳证券交易所（场内）申购两种方式。

本基金申购费用在申购时收取并由申购人承担，用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

##### （1）申购费率

本基金的申购费率为最高不超过 1.5%，投资人在一天之内如果有多笔申购，适用按单笔分别计算。

本基金自 2013 年 11 月 1 日起，对于通过本公司直销中心申购本基金的养老金客户实施特定申购费率。养老金客户指基本养老保险基金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金等，包括全国社会保障基金、可以投资基金的地方和行业社会保障基金、企业年金单一计划以及集合计划。如将来出现经养老金监管部门认可的新的养老金类型，基金管理人可在招募说明书更新时或发布临时公告将其纳入养老金客户范围，并按规定向中国证监会备案。

通过基金管理人的直销中心申购本基金基金份额的养老金客户申购费率见下表：

申购金额（M）	申购费率
M < 100 万元	0.6%
100 万元 ≤ M < 500 万元	0.4%
M ≥ 500 万元	收取固定费用 1000 元

除养老金客户外的其他投资者申购本基金基金份额的申购费率按申购金额分段设定如下：

申购金额（M）	申购费率
M < 100 万元	1.5%
100 万元 ≤ M < 500 万元	1.0%
M ≥ 500 万元	收取固定费用 1000 元

##### （2）申购费用计算方式

净申购金额 = 申购金额 / (1 + 申购费率)

申购费用 = 申购金额 - 净申购金额

### 2、赎回费用

##### （1）赎回费率

赎回费率为最高不超过 1.5%。赎回费在投资人赎回基金份额时收取，所收取的赎回费 25%归基金资产，其余的用于支付注册登记费及其他必要的手续费；其中，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，并将上述赎回费全额计入基金财产。投资人在场内外赎回的赎回费率按持有时间分段设定如下：

持有基金份额期限	场外赎回费率	场内赎回费率
小于 7 天	1.5%	1.5%
7 天（含）至 1 年以内	0.5%	0.5%
1 年（含）至 2 年	0.25%	0.5%
持有期 2 年（含）以上	0%	0.5%

注：1 年指 365 天

#### （2）赎回费用计算方式

赎回总金额 = 赎回份额 × 赎回当日基金份额净值

赎回费用 = 赎回总金额 × 赎回费率

### 3、基金转换费用

本基金的转换费用的费率水平、计算公式、收取方式等详见“基金转换”一章。

基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

### 4、与基金销售有关的费率的调整

基金管理人可以在基金合同规定的范围内调整与基金销售有关费用标准，调整后的费用标准在最新的招募说明书中列示。上述费用标准如发生变更，基金管理人应按《信息披露办法》的规定在指定媒介公告。

### 5、其他费用

其他基金费用根据有关法规及相关协议规定，按费用实际支出金额，列入当期费用，从基金财产中支付。基金合同生效前的验资费、律师费、基金合同、招募说明书、基金份额发售公告等信息披露费用由基金管理人承担。

#### （三）不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不得列入基金费用。

其他不得列入基金费用的项目依据有关规定执行。

#### （四）基金的税收

本基金运作过程中涉及各纳税主体，其纳税义务按国家税收的有关法律法规执行。

## 十八、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每年1月1日至12月31日；
- 3、基金核算以人民币为记帐本位币，以人民币元为记帐单位；
- 4、会计核算制度依据国家相关规定执行；
- 5、本基金独立建帐、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帐目、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）基金审计

- 1、基金管理人应聘请与基金管理人、基金托管人相独立的、具有从事证券、期货相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对基金年度财务报表及其他规定事项进行审计；
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师，须事先征得基金管理人和基金托管人同意；
- 3、基金管理人（或基金托管人）认为有充足理由更换会计师事务所，经基金托管人（或基金管理人）同意后可以更换。更换会计师事务所应在按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

## 十九、基金的信息披露

### （一）信息披露的形式

本基金的信息披露将严格按照《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》、《证券投资基金信息披露编报规则》、《业务规则》、基金合同及其他有关规定进行。

### （二）信息披露的内容及时间

#### 1、基金募集信息

（1）基金募集申请经中国证监会核准后，基金管理人应当在基金份额发售的3日前，将基金招募说明书、基金合同摘要登载在指定报刊和网站上；基金管理人、基金托管人应当同时将基金合同、基金托管协议登载在网站上。

（2）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）基金管理人应当在基金合同生效的次日在指定媒介上登载基金合同生效公告。

（4）基金合同生效后，基金招募说明书、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，更新基金招募说明书及基金产品资料概要并登载在指定网站上；基金招募说明书、基金产品资料概要的其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。

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

## 2、基金运作信息

(1) 基金份额获准在证券交易所上市交易的，基金管理人应当在基金份额上市交易的 3 个工作日前，将基金份额上市交易公告书登载在指定网站上。

(2) 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公告一次基金份额净值和基金份额累计净值。

(3) 基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过指定网站、基金销售机构网站或者营业网点，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

(4) 基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在指定网站披露半年度和年度最后一日的基金份额净值和基金份额累计净值。

(5) 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，并保证投资人能够在基金份额发售网点查阅或者复制前述信息资料。

(6) 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，并将年度报告登载在指定网站上，并将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。基金年度报告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。

(7) 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，并将中期报告登载在指定网站上，并将中期报告提示性公告登载在指定报刊上。

(8) 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，并将季度报告登载在指定网站上，并将季度报告提示性公告登载在指定报刊上。

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。

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

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

## 3、基金临时信息

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

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）基金终止上市交易、终止基金合同、基金清算；
- （3）转换基金运作方式、基金合并；
- （4）更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；
- （5）基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；
- （6）基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- （7）基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人的实际控制人变更；
- （8）基金募集期延长或提前结束募集；
- （9）基金管理人的高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；
- （10）基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过 50%；
- （11）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 30%；
- （12）涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼；
- （13）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；
- （14）基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易事项，但中国证监会另有规定的除外；
- （15）基金收益分配事项；
- （16）管理费、托管费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- （17）基金份额净值计价错误达基金份额净值 0.5%；
- （18）变更基金份额发售机构；
- （19）基金开始办理申购、赎回；
- （20）基金发生巨额赎回并延期办理；
- （21）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；
- （22）基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；
- （23）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；
- （24）基金信息披露义务人认为可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的其他事项或中国证监会规定的其他事项。

召开基金份额持有人大会的，召集人应当至少提前 30 日公告基金份额持有人大会的召

开时间、会议形式、审议事项、议事程序和表决方式等事项。基金份额持有人依法自行召集持有人大会，基金管理人、基金托管人对基金份额持有人大会决定的事项不依法履行信息披露义务的，召集人应当履行相关信息披露义务。

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

### （三）基金信息披露事务管理

1、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。

2、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、行政法规、中国证监会的规定和基金合同的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金产品资料概要、基金清算报告等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人出具书面文件或者电子确认。

3、基金管理人、基金托管人应当在指定报刊中选择披露信息的报刊。

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

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

投资人还可以直接登录基金管理人的网站查阅和下载上述文件。

## 二十、风险揭示

### 一、投资于本基金面临的主要风险

基金风险表现为基金收益的波动，基金管理过程中任何影响基金收益的因素都是基金风险的来源。基金的风险按来源可以分为市场风险、管理风险、流动性风险、操作风险、合规性风险、政策变更风险、本基金特有的风险、法律风险和其他风险等。

#### 1、市场风险

本基金为混合型证券投资基金，证券市场的变化将影响基金的业绩。因此，宏观和微观经济因素、国家政策、市场变动、行业与证券发行人的变化、投资人风险收益偏好和市场流动程度等影响证券市场的各种因素将影响到本基金业绩，从而产生市场风险，这种风险主要包括：



#### （1）经济周期风险

随着宏观、微观经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平及证券市场也将呈现周期性变化。本基金投资于股票、债券等金融工具的收益水平也会随之变化，从而产生风险。

#### （2）政策风险

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

#### （3）上市公司经营风险

本基金所投资的上市公司可能会因为经营不善，基本面状况恶化而导致其股票价格下跌，使得基金投资收益下降。此外，股票价格也会受到市场整体估值水平的影响，并可能会低于上市公司的合理价值。虽然本基金可通过分散化投资减少非系统性风险，但并不能完全消除该种风险。

#### （4）利率风险

金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着债券的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。本基金直接投资于股票和债券，其收益水平会受到利率变化的影响而产生波动。

#### （5）信用风险

指基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，或者证券发行人经营不善，信息披露不真实、不完整，都可能导致基金资产损失和收益变化。

#### （6）购买力风险

如果发生通货膨胀，基金投资于证券所获得的收益可能会被通货膨胀抵消，从而影响基金资产的实际收益率。

#### （7）再投资风险

再投资风险反映了利率下降对固定收益证券收回本息后以及回购到期后再投资收益的影响。当利率下降时，基金收回固定收益证券本息以及回购到期后进行再投资时，将获得比之前较少的收益率。

#### （8）市场供需风险

如果宏观经济环境、政府财政政策、市场监管政策、市场参与主体经营环境等发生变化，证券市场参与主体可用资金数量和证券市场可供投资的证券数量可能发生相应的变化，最终影响证券市场的供需关系，造成基金投资收益的变化。

#### （9）债券收益率曲线变动风险

债券收益率曲线变动风险是指与收益率曲线非平行移动有关的风险。

#### （10）利差风险

债券市场不同期限、不同类属债券之间的利差变动导致相应期限和类属债券价格变化的风险。

### （11）债券回购风险

债券回购为提升基金整体投资收益提供了可能，但也存在一定的风险。在进行回购操作时，可能存在回购利率大于债券投资收益而导致的风险以及由于回购操作导致投资总量放大，同时对投资组合的波动性进行了放大，致使整个组合风险放大的风险。回购比例越高，风险暴露程度也就越高，对基金净值造成损失的可能性也就越大。

### 2、管理风险

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和对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平。因此，本基金可能因为基金管理人的管理水平、管理手段和管理技术等因素影响基金收益水平。

### 3、流动性风险

流动性风险是指本基金无法及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险；或是为应对投资者赎回，变现冲击成本较高，给基金资产造成损失的风险。本基金的流动性风险一方面来自于投资人的集中巨额赎回，另一方面来自于其投资组合或其中的部分资产变现能力变弱所产生的风险。主要包括：

1) 巨额赎回风险：本基金属于开放式基金，在本基金存续期间，可能会发生巨额赎回的情形。当本基金发生单一投资者持有基金份额占比较大的情形时，若上述投资者集中大额赎回本基金，亦可能引发巨额赎回的情形。投资者可能面临以下风险：

A. 由于我国证券市场的波动性较大，在市场价格下跌时会出现交易量急剧减少的情形，此时出现巨额赎回可能会导致基金资产变现困难，从而产生流动性风险，甚至影响基金份额净值。此外，当出现巨额赎回时，因基金运作特点导致的费用计提、计入基金资产的赎回费以及基金持仓证券价格波动等因素，也可能影响基金份额净值，极端情况下可能会造成基金份额净值的大幅波动。

B. 当发生巨额赎回时，根据《基金合同》的约定，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定部分延期办理赎回或暂停接受基金的赎回申请或延缓支付赎回款，投资者将面临无法及时赎回所持有基金份额的风险。若本基金发生巨额赎回且发生单一投资者的赎回申请超过上一开放日基金总份额 20%以上的，基金管理人有权采取具体措施对其进行延期办理赎回申请，该投资者可能面临当日的部分赎回申请被延期办理的风险。

2) 变现风险：投资组合的变现能力较弱所导致基金收益变动的风险。当本基金持有的部分证券品种交投不活跃、成交量不足或是处于跌停板时，资产变现的难度可能会加大，若存在证券停牌的情形，资产可能难以在短时间内迅速变现。或者，由于基金持有的某种资产集中度过高，导致难以在短时间内迅速变现，有可能导致基金的净值出现损失。本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，其中股票投资占基金资产的比例为 30%-95%，债券投资占基金资产净值的比例为 0%-65%，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%。股票流动性较好，存在部分股票品种停牌或交投不活跃的情况；大部分债券品种流动性较好，存在部分债券品种停牌或是企业债、资产证券化、回购等品种流动性

相对较差的情况。综上所述，本基金拟投资市场、行业及资产的流动性良好，流动性风险相对可控。但如果市场短时间内发生较大变化或基金赎回量较大，可能会影响到基金的流动性和投资收益。

本基金由基金管理人作为交易参与者通过交易单元在证券交易所进行证券交易。根据《证券交易资金前端风险控制业务规则》等有关规定，证券交易所、证券登记机构对交易参与者相关交易单元的全天净买入申报金额总量实施额度管理，并通过交易所对交易参与者实施前端控制。因不可抗力、意外事件、技术故障、重大差错等原因导致资金前端控制出现异常的，交易所、证券登记机构可以采取限制交易单元交易权限等处理措施，本基金可能因上述业务规则而无法完成某笔或某些交易，进而可能会影响到基金的流动性，亦有可能导致基金的净值出现损失。

为了控制流动性风险，本基金将在坚持分散化投资和精选个券原则的基础上，通过一系列风险控制措施加强对流动性风险的跟踪、防范和控制。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

具体措施，详见招募说明书“九、基金份额的申购与赎回”中“（七）巨额赎回的情形及处理方式”的相关内容。

2) 暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项

具体措施，详见招募说明书“九、基金份额的申购与赎回”中“（四）暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形”的相关内容。

3) 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，并将上述赎回费全额计入基金财产。当投资者持有基金的期限少于一定天数时，将需承担较高的基金赎回成本。

4) 暂停基金估值

当本基金发生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等暂停基金估值的情形时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停基金估值，并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，投资者将面临无法及时赎回所持有基金份额或如期进行基金投资的风险。

当本基金出现上述1)、2)、4)情形时，本基金可能无法及时满足所有投资者的赎回申请，投资者收到赎回款项的时间也可能晚于预期或可能增加投资者赎回的成本。

#### 4、操作风险

相关当事人在业务各环节操作过程中，因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失

误或违反操作规程等引致的风险，例如，越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误、IT 系统故障等风险。

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

#### 5、合规性风险

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

#### 6、政策变更风险

因相关法律法规或监管机构政策修改等资产管理人无法控制的因素的变化，使基金或投资者利益受到影响的，例如，监管机构基金估值政策的修改导致基金估值方法的调整而引起基金净值波动的风险、相关法规的修改导致基金投资范围变化基金管理人调整投资组合而引起基金净值波动的风险等。

#### 7、税收风险

在本基金存续期间，税收征管部门可能会对增值税等应税行为的认定以及适用的税率等进行调整。届时，基金管理人将执行更新后的政策，可能会因此导致基金资产实际承担的税费发生变化。该等情况下，基金管理人有权根据法律法规及税收政策的变化相应调整税收处理，该等调整可能会影响到基金投资者的收益，也可能导致基金财产的估值调整。由于前述税收政策变化导致对基金资产的收益影响，将由持有该基金的基金投资者承担。对于现有税收政策未明确事项，本基金主要参照行业协会建议方案进行处理，可能会与税收征管认定存在差异，从而产生税费补缴及滞纳金，该等税费及滞纳金将由基金财产承担。

#### 8、本基金特有的风险

（1）本基金为混合型基金，存在大类资产配置风险，有可能受到经济周期、市场环境或管理人对市场所处的经济周期和产业周期的判断不足等因素的影响，导致基金的大类资产配置比例偏离最优化水平，给基金投资组合的绩效带来风险。本基金在股票投资中重点投资资源类上市公司股票，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的风险。该类型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。因此，本基金整体表现可能在特定时期内低于其他基金。此外，本基金以对资源类行业作为重点配置对象，也面临行业投资过于集中而带来的投资风险。本基金坚持价值和长期投资理念，重视股票投资风险的防范，但是基于投资范围的规定，本基金无法完全规避股票市场和债券市场的下跌风险。

#### （2）上市交易的风险

本基金已在深圳证券交易所挂牌上市，由于上市期间可能因信息披露导致基金停牌，投资人在停牌期间不能买卖基金份额，产生风险；同时，可能因上市后交易对手不足导致基金流动性风险；另外，当基金份额持有人将份额转向场外交易后导致场内的基金份额或持有

人数不满足上市条件时，本基金存在暂停上市或终止上市的可能。

#### （3）基金份额二级市场交易价格折溢价的风险

本基金在证券交易所的交易价格可能不同于基金份额净值，从而产生折价或者溢价的情况，虽然基金份额净值反映基金投资组合的资产状况，但是交易价格受到很多因素的影响，比如中国的经济情况、投资人的信心以及本基金的供需情况等。

#### （4）本基金投资科创板的风险

本基金可根据投资策略需要或市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于科创板或选择不将基金资产投资于科创板，基金资产并非必然投资于科创板。

科创板股票在发行、上市、交易、退市制度等方面的规则与其他板块不同，除与其他投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临以下风险：

1) 流动性风险：由于科创板股票的投资者门槛较高，股票流动性弱于 A 股其他板块，投资者可能在特定阶段对科创板个股形成一致性预期，因此存在基金持有股票无法正常交易的风险。

2) 退市风险：科创板的退市标准将比 A 股其他板块更加严格，且不再设置暂停上市、恢复上市和重新上市等环节，因此上市公司退市风险更大，可能给基金净值带来不利影响。

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

4) 交易价格波动风险：科创板股票竞价交易设置较宽的涨跌幅限制，首次公开发行股票，上市后的前 5 个交易日不设涨跌幅限制，其后涨跌幅限制为 20%，较宽的涨跌幅限制可能使得股票价格产生较大波动，从而导致本基金净值出现较大波动的风险。

（5）本基金可能因持续规模较小或基金持有人人数不足等原因，导致基金转型、合并或终止的风险。

### 9、法律风险

由于交易合约在法律上无效、合约内容不符合法律的规定，或者由于税制、破产制度的改变等法律上的原因，给交易者带来损失的可能性。例如，在 OTC（也称为柜台市场）的交易中，主要来自两个方面：一是合约的不可实施性，包括合约潜在的非合法性，对手缺乏进行该项交易的合法资格，以及现行的法律法规发生变更而使该合约失去法律效力等；二是交易对手因经营不善等原因失去清偿能力或不能依照法律规定对其为清偿合约进行平仓交易。

### 10、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）战争、自然灾害等不可抗力导致基金资产遭受损失产生的风险，以及由此致使基

金的申购和赎回不能按正常时限完成而产生的风险；

（7）其他风险。

## 二、声明

1、本基金未经任何一级政府、机构及部门担保。投资人投资于本基金，须自行承担投资风险；

2、除基金管理人直接办理本基金的销售外，本基金还通过基金销售机构销售，基金管理人与基金销售机构都不能保证其收益或本金安全。

3、本基金基金合同、招募说明书等法律文件中涉及基金风险收益特征或风险状况的表述仅为主要基于基金投资方向与策略特点的概括性表述；而本基金各销售机构依据中国证券投资基金业协会发布《基金募集机构投资者适当性管理实施指引（试行）》及内部评级标准、将基金产品按照风险由低到高顺序进行风险级别评定划分，其风险评级结果所依据的评价要素可能更多、范围更广，与本基金法律文件中的风险收益特征或风险状况表述并不必然一致或存在对应关系。同时，不同销售机构因其采取的具体评价标准和方法的差异，对同一产品风险级别的评定也可能各有不同；销售机构还可能根据监管要求、市场变化及基金实际运作情况等适时调整对本基金的风险评级。敬请投资人知悉，在购买本基金时按照销售机构的要求完成风险承受能力与产品风险之间的匹配检验，并须及时关注销售机构对于本基金风险评级的调整情况，谨慎作出投资决策。

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，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。本基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。基金管理人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。

## 二十一、基金合同的终止与基金财产清算

### 一、基金合同的变更

（一）变更下列基金合同的内容，对基金合同当事人权利、义务产生重大影响，应先召开基金份额持有人大会，决议通过后方可变更。

1、变更基金类别；

2、变更基金投资目标、范围或策略；

3、变更基金份额持有人大会程序；

4、终止基金合同，但法律法规另有规定或基金合同另有约定的除外；

5、转换基金运作方式；

6、提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；

7、更换基金管理人、基金托管人；

8、法律法规或基金合同约定的其他事项。

（二）出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会，而是由基金管理人和基金托管人同意变更并报中国证监会备案后公布。

- 1、调低基金管理费、基金托管费；
- 2、因相应的法律法规发生变动并且本基金合同必须遵照进行变更；
- 3、基金合同的变更不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化；
- 4、基金合同的变更对基金份额持有人利益无实质性不利影响。

## 二、基金合同的终止

出现下列情况之一的，基金合同终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人职责终止，在6个月内没有新基金管理人承接其原有职责的；
- 3、基金托管人职责终止，在6个月内没有新基金托管人承接其原有职责的；
- 4、法律、法规及基金合同约定的其他情形。

## 三、基金财产的清算

基金合同终止时，基金管理人应予公告并组织清算小组对基金财产进行清算。

### 1、基金财产清算小组

基金合同终止之日起30个工作日内成立基金财产清算小组。

（1）基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事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。清算小组可以聘用必要的工作人员。

（2）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。

### 2、基金财产清算程序

- （1）基金合同终止后，由清算小组统一接管基金财产；
- （2）清算小组对基金财产进行清理和确认；
- （3）对基金财产进行评估；
- （4）对基金财产进行变现；
- （5）将基金清算结果报告中国证监会；
- （6）公布基金清算公告；
- （7）进行基金剩余财产的分配。

### 3、清算费用

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

### 4、基金清算剩余财产的分配

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财产扣除基金财产清算费

用后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

#### 5、基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项应及时公告；清算小组作出的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，律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并公告。基金清算报告由基金清算小组报经中国证监会备案后3个工作日内公告。基金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。

#### 6、基金财产清算帐册及文件的保存

基金财产清算帐册及文件由基金托管人保存15年以上。

## 二十二、基金合同的内容摘要

### （一）基金合同当事人及权利义务

#### 1、基金管理人的权利与义务

##### （1）基金管理人的权利

- 1) 依法并依照基金合同的规定独立运用并管理基金资产；
- 2) 依照基金合同的相关规定获得基金管理费及其它约定和法定的收入；
- 3) 依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- 4) 有关法律法规和基金合同规定的其他权利。

##### （2）基金管理人的义务

- 1) 依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
- 2) 办理基金备案手续；
- 3) 自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；
- 4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；
- 5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记帐，进行证券投资；
- 6) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；
- 7) 依法接受基金托管人的监督；
- 8) 按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；
- 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) 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，并按有关规定计算和公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回的价格；

12) 严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行与基金财产管理业务活动有关的信息披露及报告义务；

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

14) 保存基金财产管理业务活动的记录、帐册、报表和其他相关资料；

15) 按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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

17) 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；

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

19) 基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

20) 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实施其它法律行为；

21) 有关法律法规和基金合同规定的其它义务。

## **2、基金托管人的权利与义务**

### **(1) 基金托管人的权利**

1) 获得基金托管费；

2) 监督基金管理人对本基金的投资运作；

3) 有关法律法规和基金合同规定的其它权利。

### **(2) 基金托管人的义务**

1) 安全保管基金财产；

2) 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；

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

4) 保存基金托管业务活动的记录、帐册、报表和其他相关资料；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；

5) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；

6) 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) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

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

- 9) 按照规定监督基金管理人的投资运作；
- 10) 参加基金清算小组，参与基金资产的保管、清理、估价、变现和分配；
- 11) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；
- 12) 保守基金商业秘密。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；
- 13) 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；
- 14) 建立并保存基金份额持有人名册；
- 15) 按规定制作相关帐册并与基金管理人核对；
- 16) 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；
- 17) 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；
- 18) 因违反基金合同导致基金财产损失，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- 19) 基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿；
- 20) 有关法律法规和基金合同规定的其他义务。

### 3、基金份额持有人的权利与义务

#### （1）基金份额持有人权利

每份基金份额具有同等的合法权益。基金份额持有人享有下列权利：

- 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；
- 5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- 6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- 7) 监督基金管理人的投资运作；
- 8) 对基金管理人、基金托管人、基金份额发售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；
- 9) 有关法律法规和基金合同规定的其他权利。

#### （2）基金份额持有人义务

- 1) 遵守基金合同；
- 2) 交纳基金认购、申购款项及规定的费用；

- 3) 在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；
- 4) 不从事任何有损基金及其他基金合同当事人合法权益的活动；
- 5) 返还持有基金份额过程中获得的不当得利；
- 6) 有关法律法规和基金合同规定的其他义务。

## （二）基金份额持有人大会

基金份额持有人大会由基金份额持有人或基金份额持有人合法的授权代表共同组成。

### 1、召开事由

（1）需要决定下列事项之一时，应召开基金份额持有人大会：

- 1) 变更基金类别；
- 2) 变更基金投资目标、范围或策略；
- 3) 变更基金份额持有人大会程序；
- 4) 终止基金合同，但法律法规另有规定或基金合同另有约定的除外；
- 5) 转换基金运作方式；
- 6) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；
- 7) 更换基金管理人、基金托管人；
- 8) 法律法规或基金合同约定的其他事项。

（2）出现以下情形之一的，可由基金管理人和基金托管人协商后修改，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；
- 2) 在法律法规和基金合同规定的范围内变更本基金的申购费率、赎回费率或收费方式；
- 3) 因相应的法律法规发生变动应当对基金合同进行修改；
- 4) 对基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化；
- 5) 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；
- 6) 按照法律法规或基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其它情形。

### 2、召集人和召集方式

（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十日内决定是否召集，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六十日内召开；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。

（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十日内决定是否召集，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六十日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%（含 10%）以上的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起十日内决定是否召集，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六十日内召开。

（5）如在上述第 4 条情况下，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，并至少提前三十日报中国证监会备案。

（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、通知

召开基金份额持有人大会，召集人应在会议召开前 30 天，在指定媒介公告通知。基金份额持有人大会通知至少应载明以下内容：

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

采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定通讯方式和书面表决方式，并在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见的寄交的截止时间和收取方式。

### 4、会议召开的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式或通讯开会方式召开。

会议的召开方式由会议召集人确定，但更换基金管理人和基金托管人必须以现场开会方式召开。

（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。若基金托管人或基金管理人经通知但拒绝到场参加会议，不影响该次基金份额持有人大会决议的有效性。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；

2) 经核对，汇总到会者出示的在权利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利登记日基金总份额的 50%（含 50%）。

（2）通讯开会。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）召集人按《基金合同》规定公布会议通知后，在两个工作日内连续公布相关提示性公告；

2）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。若基金托管人或基金管理人经通知但拒绝到场监督，则召集人可仅在公证机关的监督下收取书面表决意见，而不影响通讯开会方式的有效性；

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利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书符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定；

5）会议通知公布前报中国证监会备案。

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

## 5、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》的重大变更、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。

基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权利登记日基金总份额 10%（含 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。

基金份额持有人大会的召集人发出召集现场会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开日 30 天前公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少有 30 天的间隔期。

基金份额持有人大会的召集人发出以通讯方式开会的通知后，该次基金份额持有人大会不得增加、减少或修改需由该次基金份额持有人大会审议表决的提案。

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。

大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

1) 关联性。大会召集人对于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。

2) 程序性。大会召集人可以对提案涉及的程序性问题做出决定。如将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。

单独或合并持有权利登记日基金总份额 10%（含 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，或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，其时间间隔不少于六个月。

## （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。

### 2) 通讯开会

在通讯开会的情况下，公告会议通知时应当同时公布提案，在所通知的表决截止日期后两个工作日内统计全部有效表决，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所持表决权的三分之二（含三分之二）以上通过方可做出。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止基金合同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，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，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，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。

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。

计票过程应由公证机关予以公证。

### （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。若基金托管人（或基金管理人）授权代表经通知但拒绝到场监督，则大会召集人可自行授权3名监督员进行计票，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决议应当由会议召集人自通过之日起5日内报中国证监会核准或者备案，并自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

除非《基金合同》或法律法规另有规定，生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人和基金托管人均有法律约束力。

基金份额持有人大会决议自生效之日起2个工作日内在指定媒介公告。

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决议。

### （三）基金合同的变更与终止

#### 1、基金合同的变更

（1）变更下列基金合同的内容，对基金合同当事人权利、义务产生重大影响，应先召开基金份额持有人大会，决议通过后方可变更。

- 1) 变更基金类别；
- 2) 变更基金投资目标、范围或策略；
- 3) 变更基金份额持有人大会程序；

- 4) 终止基金合同，但法律法规另有规定或基金合同另有约定的除外；
- 5) 转换基金运作方式；
- 6) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；
- 7) 更换基金管理人、基金托管人；
- 8) 法律法规或基金合同约定的其他事项。

(2) 出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会，而是由基金管理人和基金托管人同意变更并报中国证监会备案后公布。

- 1) 调低基金管理费、基金托管费；
- 2) 因相应的法律法规发生变动并且本基金合同必须遵照进行变更；
- 3) 基金合同的变更不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化；
- 4) 基金合同的变更对基金份额持有人利益无实质性不利影响。

## 2、基金合同的终止

出现下列情况之一的，基金合同终止：

- (1) 基金份额持有人大会决定终止的；
- (2) 基金管理人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人承接其原有职责的；
- (3) 基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金托管人承接其原有职责的；
- (4) 基金合同约定的其他情形。

### （四）争议的处理

基金合同当事人发生纠纷的，可以通过协商或者调解解决。基金合同当事人不愿通过协商、调解解决或者协商、调解不成的，可以依据事后达成的书面仲裁协议，向仲裁机构申请仲裁。基金合同当事人之间没有达成书面仲裁协议的，可以向有管辖权的人民法院起诉。

### （五）基金合同存放及投资者取得基金合同的方式

本基金合同自生效之日对本基金合同当事人具有同等的法律约束力。

本基金合同正本一式 8 份，除上报中国证监会和银行业监管机构各 2 份外，基金管理人和基金托管人各持有 2 份。每份具有同等的法律效力。

基金合同可印制成册并对外公开散发或供投资人在有关场所查阅，但应以基金合同正本为准。

## 二十三、基金托管协议的内容摘要

### （一）托管协议当事人

#### 1、基金管理人

名称：摩根士丹利基金管理（中国）有限公司

注册地址：深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第二座第 17 层 01-04 室



办公地址：深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第二座第17层

邮政编码：518048

法定代表人：王鸿嫔

成立时间：2003年3月14日

注册资本：25,000万元人民币

批准设立机关：中国证监会

批准设立文号：证监基金字[2003]33号

组织形式：有限责任公司

营业期限：永续经营

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、基金托管人

名称：中国光大银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心

办公地址：北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心

邮政编码：100033

法定代表人：王江

成立时间：1992年6月18日

注册资本：466.79095亿元人民币

组织形式：股份制商业银行

营业期限：持续经营

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；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；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；提供信用证服务及担保；代收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；经中国人民银行和国家外汇管理局批准的其他业务。

### （二）基金托管人和基金管理人之间的业务监督、核查

#### 1、基金托管人对基金管理人的业务监督、核查

（1）根据《基金法》、基金合同、本协议和有关基金法规的规定，基金托管人对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金费用的支付、基金申购资金的到账和赎回资金的划付、基金收益分配、基金的融资条件等行为的合法性、合规性进行监督和核查，其中对基金的投资比例的监督和检查自本基金的基金合同生效之后6个月开始。

（2）基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、基金合同、本协议或有关基金法规规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对，并以书面形式对基金托管人发出回函确认。在限期内，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。基金托管人有义务要求基金管理人赔偿因其过失致使投资者遭受的损失。

（3）基金托管人发现基金管理人有关重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

## **2、基金管理人有关基金托管人的业务监督、核查**

（1）根据《基金法》、基金合同、本协议及其他有关规定，基金管理人就基金托管人是否及时执行基金管理人的划款指令、是否擅自动用基金资产、是否按时将分配给基金份额持有人的收益划入分红派息账户等事项，对基金托管人进行监督和核查。

（2）基金管理人定期对基金托管人保管的基金资产进行核查。基金管理人发现基金托管人未对基金资产实行分帐管理、擅自挪用基金资产、因基金托管人的过错导致基金资产灭失、减损或处于危险状态的，基金管理人应立即以书面的方式要求基金托管人予以纠正并采取必要的补救措施。基金管理人有关义务要求基金托管人赔偿基金因此所遭受的损失。

（3）基金管理人发现基金托管人的行为违反《基金法》、基金合同、本协议或有关基金法规的规定，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对基金管理人发出回函。在限期内，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。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应报告中国证监会。

（4）基金管理人发现基金托管人有关重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金托管人限期纠正。

## **3、基金托管人与基金管理人在业务监督、核查中的配合、协助**

基金管理人和基金托管人有义务配合和协助对方依照本协议对基金业务执行监督、核查。基金管理人或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，情节严重或经监督方提出警告仍不改正的，监督方应报告中国证监会。

### **（三）基金财产保管**

#### **1、基金财产保管的原则**

（1）基金托管人依法持有基金财产，应安全保管所收到的基金的全部财产。基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。

（2）基金托管人必须为基金设立独立的账户，与基金托管人的其他业务和其他基金的托管业务实行严格的分帐管理。

（3）基金托管人应安全、完整地保管基金财产；未经基金管理人的正当指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。属于基金托管人实际有效控制下的实物证券在基金托管人保管期间的损坏、灭失，由此产生的责任应由基金托管人承担。

（4）对于因为基金投资产生的应收财产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到帐日期并通知托管人，到帐日基金财产没有到达托管人处的，托管人应及时通知基金管理人采

取措施进行催收。

（5）对于基金申（认）购过程中产生的应收财产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到帐日期并通知基金托管人，到帐日基金财产没有到达托管人处的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。

（6）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、募集资金的验证

认购期内销售机构按销售与服务代理协议的约定，将认购资金划入基金认购专户。基金设立募集期满，由基金管理人聘请具有从事证券业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的2名以上（含2名）中国注册会计师签字有效。验资完成，基金管理人应将募集到的全部资金存入基金托管人为基金开立的基金托管专户中。

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事宜。

## 3、基金的银行账户的开设和管理

在集中账户托管模式下，基金托管人以基金托管人的名义在其营业机构开设基金托管专户，保管基金的银行存款。该基金托管专户是指基金托管人在集中托管模式下，代表所托管的基金与中国证券登记结算有限责任公司进行一级结算的专用账户。该账户的开设和管理由基金托管人承担。本基金的一切货币收支活动，均需通过基金托管人的基金托管专户进行。在分散账户托管模式下，基金托管人以基金的名义在其营业机构开设基金银行存款账户。

基金托管专户和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。

基金托管专户和基金银行账户的管理应符合《银行账户管理办法》、《现金管理条例》、《中国人民银行利率管理的有关规定》、《关于大额现金支付管理的通知》、《支付结算办法》以及中国人民银行的其它规定。

## 4、基金证券账户、证券交易资金账户的开设和管理

基金托管人以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限公司上海分公司/深圳分公司开设证券账户。

基金证券账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借和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。

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公司上海分公司/深圳分公司开立基金证券交易资金账户，用于证券清算。

## 5、债券托管乙类账户的开设和管理

（1）基金合同生效后，基金管理人负责向中国证监会和中国银行业监督管理机构申请基金进入全国银行间同业拆借市场进行交易。由基金管理人在中国外汇交易中心开设同业拆借市场交易账户，由基金托管人在中央国债登记结算有限责任公司开设债券托管乙类账户，

并由基金托管人负责基金的债券的后台匹配及资金的清算。

（2）同业拆借市场交易账户和债券托管账户根据中国银行业监督管理机构、中国外汇交易中心和中央国债登记结算有限责任公司的有关规定，由基金管理人和基金托管人签订补充协议，进行使用和管理。基金管理人和基金托管人应一起负责为基金对外签订全国银行间国债市场回购主协议，正本由基金托管人保管，基金管理人保存副本。

## **6、基金有关实物证券的保管**

实物证券由基金托管人存放于托管银行的保管库；也可存入中央国债登记结算有限责任公司或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。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。托管人对托管人以外机构实际有效控制的证券不承担责任。

## **7、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，由基金管理人负责签署。签署时应保证基金一方持有 2 份以上正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。如上述合同只有一份正本先由基金管理人取得，则基金管理人应及时将正本送达基金托管人处保管。

### **（四）基金资产净值计算和会计核算**

#### **1、基金资产净值的计算和复核**

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。基金份额净值是指计算日基金资产净值除以计算日基金总份额后的价值。

基金管理人应在每个工作日对基金资产进行估值。用于基金信息披露的基金净值信息由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金资产净值并以加密传真方式或基金管理人、基金托管人双方确认的其他方式发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核后，盖章并以加密传真方式或基金管理人、基金托管人双方确认的其他方式传送给基金管理人，由基金管理人对外发布基金净值公告。

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。因此，就与本基金有关的会计问题，本基金的会计责任方是基金管理人，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見，按照基金管理人對基金淨值的計算結果對外予以公布。

#### **2、基金帳冊的建立與核對**

基金管理人和基金托管人在基金合同生效后，应按照相关各方约定的同一记帐方法和会计处理原则，分别独立地设置、登录和保管本基金的全套帐册，对相关各方各自的帐册定期进行核对，互相监督，以保证基金资产的安全。若双方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。

经对帐发现相关各方的帐目存在不符的，基金管理人和基金托管人必须及时查明原因并纠正，保证相关各方平行登录的帐册记录完全相符。若当日核对不符，暂时无法查找到错帐的原因而影响到基金资产净值的计算和公告的，以基金管理人的帐册为准。

#### **3、基金财务报表与定期报告的编制和复核**

基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。月度报表的编制，应于每月终了后5个工作日内完成。

《基金合同》生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在指定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。《基金合同》终止的，基金管理人不再更新基金招募说明书。基金管理人在每个季度结束之日起15个工作日内完成季度报告编制并公告；在上半年结束之日起两个月内完成中期报告编制并公告；在每年结束之日起三个月内完成年度报告编制并公告。

基金管理人在月度报表完成当日，对报表加盖公章后，以加密传真方式将有关报表提供基金托管人复核；基金托管人在2个工作日内立即进行复核，并将复核结果及时书面通知基金管理人。基金管理人在季度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到后5个工作日内进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在中期报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到后10个工作日内进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在年度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到后15个工作日内复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金托管人在复核过程中，发现相关各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，调整以相关各方认可的帐务处理方式为准。

核对无误后，基金托管人在基金管理人提供的报告上加盖公章，相关各方各自留存一份。

基金托管人在对财务会计报告、季度报告、更新招募说明书、中期报告或年度报告复核完毕后，需盖章确认或出具相应的复核确认书，以备有权机构对相关文件审核时提示。

#### **（五）基金份额持有人名册的登记和保管**

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人委托中国证券登记结算有限公司担任本基金的注册登记人，基金份额持有人名册的编制及持续保管义务由注册登记人承担，但基金管理人应保证基金份额持有人名册的真实性、准确性和完整性。

基金合同生效日、基金合同终止日、基金权益登记日、基金份额持有人大会权利登记日、每月最后一个交易日等涉及到基金重要事项日期的基金份额持有人名册，由注册登记人编制，由基金管理人审核并交基金托管人保管。基金托管人有权要求基金管理人提供任意一个交易日或全部交易日的基金份额持有人名册，基金管理人应及时提供，不得拖延或拒绝提供，但基金托管人应保证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。

涉及到基金份额持有人名册的所有费用，应从注册登记费用中支取，不得从基金财产中列支，也不得向基金托管人另外收取。

基金托管人和注册登记人对基金份额持有人名册的保管，按国家法律法规及证券监督管理部门的要求执行。

#### **（六）争议处理和法律适用**

相关各方当事人同意，因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议，除经友好协商可以解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲

裁的地点在北京，仲裁裁决是终局性的并对相关各方均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

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

本协议受中国法律管辖。

#### （七）托管协议的修改和终止

1、本协议相关各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。修改后的新协议向中国证监会办理完必要的核准或备案手续后生效。

2、发生以下情况，本托管协议终止：

- （1）基金合同终止；
- （2）因基金托管人解散、依法被撤销、破产或其他事由造成本基金更换基金托管人；
- （3）因基金管理人解散、依法被撤销、破产或其他事由造成本基金更换基金管理人；
- （4）发生《基金法》或其他法律法规规定的终止事项。

## 二十四、对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务。基金管理人根据基金份额持有人的需要和市场的变化，有权增加或变更服务项目。主要服务内容如下：

### （一）网上交易服务

投资人可通过基金管理人的直销网点、基金管理人委托的其他销售机构（以下简称“销售机构”）的销售网点或通过销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购、赎回、信息查询等业务。

基金管理人网上直销平台（<https://etrade.morganstanleyfunds.com.cn>）自2022年7月25日起不再接受新开户、认购、申购（包括定期定额投资）、转换业务申请，但已持有基金份额的投资者可继续办理赎回业务，具体业务规则和相关公告请详见基金管理人网站。

### （二）网上查询服务

通过基金管理人直销渠道（包括直销柜台、网上直销平台）开立基金账户和交易账户的个人投资者，可通过基金管理人网上交易平台（<https://etrade.morganstanleyfunds.com.cn>）享有账户查询、账单查询、资料修改等多项在线查询服务。

个人投资者如需查询通过销售机构开立基金账户、交易及持有基金的有关信息，可7×24小时通过本公司全国统一客服热线自助语音查询，或工作日8:30-11:30、13:00-17:00期间通过身份验证后由客服人工查询，亦可直接通过办理开户及/或交易业务的所在销售机构进行查询，具体查询途径与方式请遵循销售机构的规则。

### （三）服务产品的定制及发送

投资人可根据个人需要，通过基金管理人客服电话、电子邮件、短信等方式订阅或取消

对账单服务及免费定制信息。投资人还可通过发送邮件、短信进行业务咨询。

1、对账单服务：基金管理人将按照投资人需求，提供月度电子邮件账单或月度短信账单。投资人可通过拨打基金管理人客服电话、发送电子邮件或短信等方式向基金管理人主动定制月度短信账单。对于未订阅账单服务、且有手机号码的投资人，基金管理人将默认提供年度短信账单。对于未订阅账单服务、且有邮件联系方式的投资人，基金管理人将默认提供月度电子邮件账单。

若投资人因特殊原因需要获取指定期间的纸质对账单，可拨打基金管理人客服热线400-8888-668（免长途话费）按“9”转人工服务，提供姓名、开户证件号码或基金账号、持有基金名称、购买销售机构、购买金额等，客服人员核对信息无误后，将通过平信方式为投资人免费邮寄纸质对账单。

对账单服务发送规则如下：如投资人成功定制电子邮件账单或短信账单，基金管理人将在每月初5个工作日内发送。

2、免费定制信息：投资人可定制的信息包括：基金份额净值、基金视窗等信息。基金管理人可通过邮件或短信方式向投资人发送所定制的信息。

#### （四）在线客服服务

投资人可登录基金管理人网站（[www.morganstanleyfunds.com.cn](http://www.morganstanleyfunds.com.cn)）通过“在线客服”进行业务咨询或留言。在线客服提供基金产品信息查询、基金业务咨询、服务投诉和建议等服务。

在线客服服务时间为周一至周五上午9:00-11:00，下午13:00-17:00（节假日除外）。

#### （五）客户服务中心电话服务

客户服务中心自动语音系统提供7×24小时基金净值信息、账户交易情况基金产品与服务等信息查询。

客户服务中心人工座席提供每周五天，每天不少于7小时的座席服务，投资人可通过该电话查询认购、申购和赎回等交易情况、基金账户余额、信息定制、资料修改、服务投诉及获得其他业务咨询等专项服务。

#### （六）客户投诉处理

投资人可以通过拨打基金管理人客户服务中心电话或以书信、传真、电子邮件等方式，对基金管理人所提供的服务提出建议或投诉（具体渠道见以下服务联系方式）。

对于工作日受理的投诉，原则上当日回复，不能当日回复的，在3个工作日内回复。对于非工作日受理的投诉，原则上在顺延的第一个工作日回复，不能及时回复的，在3个工作日内回复。

#### （七）服务联系方式

基金管理人网址：[www.morganstanleyfunds.com.cn](http://www.morganstanleyfunds.com.cn)

客服电子信箱：[msim-service@morganstanley.com.cn](mailto:msim-service@morganstanley.com.cn)

全国统一客服电话：400-8888-668（免长途费）

传真：（0755）82990631

信件邮寄地址：深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第二座第17层摩根士丹利基金客户服务中心

邮编：518048

（八）如本招募说明书存在任何您/贵机构无法理解的内容，请通过上述方式联系基金管理人。请确保投资前，您/贵机构已经全面理解了本招募说明书。

## 二十五、其他应披露事项

序号	公告事项	法定披露日期
1	本公司关于旗下部分基金增加东吴证券股份有限公司为销售机构并参与费率优惠活动的公告	2022年11月2日
2	本基金招募说明书（更新）	2022年11月16日
3	本基金基金产品资料概要更新	2022年11月16日
4	本公司关于网上交易系统在2022年12月9日至10日部分时段暂停服务的公告	2022年12月8日
5	本公司高级管理人员变更公告	2022年12月31日
6	本公司关于系统升级期间暂停电话自助语音服务的公告	2023年1月7日
7	本公司旗下全部基金2022年4季度报告提示性公告	2023年1月20日
8	本基金2022年第4季度报告	2023年1月20日
9	本公司关于系统升级期间暂停电话自助语音服务的公告	2023年2月10日
10	本公司关于暂停电话自助语音服务的公告	2023年2月18日
11	本公司关于暂停电话自助语音服务的公告	2023年2月21日
12	本基金基金经理变更公告	2023年2月28日
13	本基金招募说明书（更新）	2023年2月28日
14	本基金基金产品资料概要更新	2023年2月28日
15	本公司关于系统升级期间暂停电话自助语音服务的公告	2023年3月16日
16	本公司关于系统升级期间暂停电话自助语音服务的公告	2023年3月17日
17	本公司关于旗下部分基金增加嘉实财富管理有限公司为销售机构并参与费率优惠活动的公告	2023年3月24日
18	本公司旗下全部基金2022年年度报告提示性公告	2023年3月30日
19	本基金2022年年度报告	2023年3月30日
20	本公司关于系统升级期间暂停电话自助语音服务的公告	2023年3月30日
21	本公司关于公司官网在2023年4月16日部分时段暂停服务的公告	2023年4月15日



22	本公司旗下全部基金 2023 年 1 季度报告提示性公告	2023 年 4 月 21 日
23	本基金 2023 年 1 季度报告	2023 年 4 月 21 日
24	本公司关于客服系统、公司官网、网上交易系统、短信及邮件系统相关服务暂停的公告	2023 年 4 月 21 日
25	本公司关于旗下基金增加上海中欧财富基金销售有限公司为销售机构并参与费率优惠活动的公告	2023 年 4 月 26 日
26	本公司关于旗下基金增加上海中欧财富基金销售有限公司为销售机构并参与费率优惠活动的公告	2023 年 4 月 27 日
27	本公司关于旗下基金增加上海中欧财富基金销售有限公司为销售机构并参与费率优惠活动的更正公告	2023 年 4 月 27 日
28	本公司关于系统升级期间暂停电话自助语音服务的公告	2023 年 5 月 12 日
29	本公司法定名称变更的公告	2023 年 6 月 3 日
30	本基金招募说明书（更新）	2023 年 6 月 7 日
31	本基金基金产品资料概要更新	2023 年 6 月 7 日
32	本公司关于旗下基金更名事宜的公告	2023 年 6 月 8 日
33	本基金基金合同（更新）	2023 年 6 月 8 日
34	本基金托管协议（更新）	2023 年 6 月 8 日
35	本基金招募说明书（更新）	2023 年 6 月 9 日
36	本基金基金产品资料概要更新	2023 年 6 月 9 日
37	本公司关于调整开放式基金业务规则的公告	2023 年 6 月 10 日
38	本公司关于部分直销银行账户信息变更的公告	2023 年 6 月 16 日
39	本公司关于旗下部分基金参与中银国际证券股份有限公司费率优惠活动的公告	2023 年 6 月 19 日
40	本公司关于变更公司客服邮箱的公告	2023 年 7 月 10 日
41	本公司关于公司股东及实际控制人变更的公告	2023 年 7 月 18 日
42	本公司关于董事变更的公告	2023 年 7 月 18 日
43	本公司旗下全部基金 2023 年 2 季度报告提示性公告	2023 年 7 月 20 日
44	本基金 2023 年第 2 季度报告	2023 年 7 月 20 日
45	本公司关于公司官网、网上交易系统相关服务暂停的公告	2023 年 7 月 28 日

注：以上公告事项披露在规定媒介及基金管理人网站上。

## 二十六、招募说明书的存放及查阅方式

本招募说明书存放在本基金管理人、基金托管人和销售代理人的办公场所，投资者可在办公时间免费查阅；投资人在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件，但应以招募说明书正本为准。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

投资者还可以直接登录基金管理人的网站([www.morganstanleyfunds.com.cn](http://www.morganstanleyfunds.com.cn))查阅和下载招募说明书。

## 二十七、备查文件

- （一）中国证监会核准本基金募集的文件；
- （二）本基金基金合同；
- （三）本基金登记结算服务协议；
- （四）本基金托管协议；
- （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；
- （八）中国证监会要求的其他文件。

摩根士丹利基金管理（中国）有限公司

二〇二三年十月十七日