

# 嘉实价值成长混合型证券投资基金更新招募说明书

(2024年08月27日更新)

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

## 重要提示

嘉实价值成长混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会 2019 年【8】月【14】日证监许可【1507】号《关于准予嘉实价值成长混合型证券投资基金注册的批复》注册募集。本基金基金合同于 2019 年 9 月 10 日正式生效，自该日起本基金管理人开始管理本基金。

本招募说明书是对原《嘉实价值成长混合型证券投资基金招募说明书》的更新，原招募说明书与本招募说明书不一致的，以本招募说明书为准。

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

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

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险、本基金的特有风险等等。

本基金为混合型证券投资基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金将投资港股通标的股票，将承担汇率风险以及因投资

环境、投资标的、市场制度、交易规则差异等带来的境外市场的风险。本基金投资港股通标的股票的具体风险请详见本招募“十六、风险揭示”章节。

本基金投资港股通标的股票的比例下限为零，即本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股通标的股票或选择不将基金资产投资于港股通标的股票，基金资产并非必然投资港股通标的股票。

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

本基金自《基金合同》生效后，连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人经与基金托管人协商一致，可对本基金进行清算，终止本基金合同，无需召开基金份额持有人大会进行表决。因此，投资者将面临基金合同可能终止的不确定性风险。

投资者在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的招募说明书、基金合同和基金产品资料概要，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策。

投资者应当通过本基金管理人或非直销销售机构购买和赎回基金。本基金在募集期内按 1 元面值发售并不改变基金的风险收益特征。投资者按 1 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 元、从而遭受损失的风险。

本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。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。

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

本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为 2024 年 7 月 18 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2024 年 6 月 30 日（未经审计），特别事项注明除外。

## 目录

一、绪言.....	4
二、释义.....	5
三、基金管理人.....	9
四、基金托管人.....	19
五、相关服务机构.....	23
六、基金的募集.....	55
七、基金合同的生效.....	58
八、基金份额的申购与赎回.....	59
九、基金的投资.....	72
十、基金的业绩.....	84
十一、基金的财产.....	86
十二、基金资产的估值.....	87
十三、基金的收益与分配.....	92
十四、基金的费用与税收.....	93
十五、基金的会计与审计.....	95
十六、基金的信息披露.....	96
十七、风险揭示.....	102
十八、基金合同的变更、终止与基金财产的清算.....	109
十九、基金合同的内容摘要.....	111
二十、基金托管协议的内容摘要.....	124
二十一、对基金份额持有人的服务.....	141
二十二、其他应披露事项.....	143
二十三、招募说明书存放及查阅方式.....	144
二十四、备查文件.....	145

## 一、绪言

《嘉实价值成长混合型证券投资基金更新招募说明书》（以下简称“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》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）、《证券投资基金信息披露编报规则第5号〈招募说明书的内容与格式〉》等有关法律法规以及《嘉实价值成长混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

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，并经中国证监会注册。基金合同是约定基金合同当事人之间基本权利义务的法律文件，其他与本基金相关的涉及基金合同当事人之间权利义务关系的任何文件或表述，均以基金合同为准。基金合同的当事人包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人。基金投资者自依基金合同取得本基金基金份额，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。基金份额持有人作为基金合同当事人并不以在基金合同上书面签章为必要条件。基金合同当事人按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

## 二、释义

本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

- 1、基金/本基金：指嘉实价值成长混合型证券投资基金
- 2、基金管理人：指嘉实基金管理有限公司
- 3、基金托管人：指中国工商银行股份有限公司
- 4、基金合同/《基金合同》：指《嘉实价值成长混合型证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充
- 5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《嘉实价值成长混合型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
- 6、招募说明书：指《嘉实价值成长混合型证券投资基金招募说明书》及其更新
- 7、基金份额发售公告：指《嘉实价值成长混合型证券投资基金基金份额发售公告》
- 8、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等以及颁布机关对其不时做出的修订
- 9、《基金法》：指2003年10月28日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，经2012年12月28日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自2013年6月1日起实施，并经2015年4月24日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修正的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 10、《销售办法》：指中国证监会2013年3月15日颁布、同年6月1日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 11、《信息披露办法》：指中国证监会2019年7月26日颁布、同年9月1日实施的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 12、《运作办法》：指中国证监会2014年7月7日颁布、同年8月8日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 13、《流动性风险管理规定》：指中国证监会2017年8月31日颁布、同年10月1日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订
- 14、港股通：指内地投资者经由上海证券交易所和深圳证券交易所设立的证券交易服务公司，向香港联合交易所进行申报，买卖规定范围内的香港联合交易所上市的股票的交易机制，或有权机构对该交易机制的修改或调整
- 15、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

16、**银行业监督管理机构**：指中国人民银行和/或国家金融监督管理总局等对银行业金融机构进行监督和管理的机构

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

18、**个人投资者**：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

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

20、**合格境外机构投资者**：指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》及相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者

21、**人民币合格境外机构投资者**：指按照《人民币合格境外机构投资者境内证券投资试点办法》及相关法律法规规定，运用来自境外的人民币资金进行境内证券投资的境外法人

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

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

24、**基金销售业务**：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务

25、**销售机构**：指嘉实基金管理有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务协议，办理基金销售业务的机构

26、**登记业务**：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等

27、**登记机构**：指办理登记业务的机构。基金的登记机构为嘉实基金管理有限公司或接受嘉实基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构

28、**基金账户**：指登记机构为投资人开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户

29、**基金交易账户**：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构办理认购、申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户

30、**基金合同生效日**：指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期

31、**基金合同终止日**：指基金合同规定的基金合同终止事由出现后，基金财产清算完毕，清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期

32、基金募集期：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过3个月

33、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

34、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

35、T日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日

36、T+n日：指自T日起第n个工作日（不包含T日），n为自然数

37、交易日：在境内、香港两地均为交易日且能够满足结算安排、开通港股通交易的交易日。具体交易日安排，由境内及香港两地证券交易所、证券交易服务公司对市场公布

38、开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日（若该工作日为非港股通交易日，则本基金不开放基金份额申购、赎回或其他业务）

39、开放时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

40、《业务规则》：指《嘉实基金管理有限公司开放式基金业务规则》，是由基金管理人制定并不时修订，规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金登记方面的业务规则，由基金管理人和投资人共同遵守

41、认购：指在基金募集期内，投资人根据基金合同、招募说明书及相关公告的规定申请购买基金份额的行为

42、申购：指基金合同生效后，投资人根据基金合同、招募说明书及相关公告的规定申请购买基金份额的行为

43、赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同、招募说明书及相关公告规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为

44、基金转换：指基金份额持有人按照本基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有的基金管理人管理的某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金基金份额的行为

45、转托管：指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基金份额销售机构的操作

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

47、巨额赎回：指本基金单个开放日，基金净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一工作日基金总份额的10%

48、元：指人民币元

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

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

51、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

52、基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

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

54、指定媒介：指中国证监会指定的用以进行信息披露的全国性报刊及指定互联网网站（包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介

55、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

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

57、不可抗力：指本基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

58、基金产品资料概要：指《嘉实价值成长混合型证券投资基金基金产品资料概要》及其更新



### 三、基金管理人

#### （一）基金管理人基本情况

名称	嘉实基金管理有限公司
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1318号1806A单元
办公地址	北京市朝阳区建国门外大街21号北京国际俱乐部C座写字楼12A层
法定代表人	经雷
成立日期	1999年3月25日
注册资本	1.5亿元
股权结构	中诚信托有限责任公司40%，DWS Investments Singapore Limited 30%，立信投资有限责任公司30%。
存续期间	持续经营
电话	(010) 65215588
传真	(010) 65185678
联系人	胡勇钦

嘉实基金管理有限公司经中国证监会证监基字[1999]5号文批准，于1999年3月25日成立，是中国第一批基金管理公司之一，是中外合资基金管理公司。公司注册地上海，总部设在北京并设北京、深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州、北京怀柔、武汉分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人、QDII和特定资产管理业务等资格。

#### （二）主要人员情况

##### 1、基金管理人董事、监事、总经理及其他高级管理人员基本情况

安国勇先生，联席董事长（代行董事长职责），博士研究生，中共党员。曾任职于招商银行北京分行，中国民航总局金飞民航经济发展中心总经理助理兼证券业务部经理，北京城市轨道交通建设管理有限公司副总经理，北京市保障性住房建设投资中心副总经理，中国人民财产保险股份有限公司船舶货运保险部总经理，华夏银行副行长（挂职），中国人保资产管理有限公司党委委员、副总裁。现任中诚信托有限责任公司党委委员、总裁。

王会妙女士，董事，北京大学经济学博士。曾就职于河北定州师范学院、国投信托有限责任公司。2011年5月加入中诚信托有限责任公司，曾任信托业务总部业务团队负责人（MD）、信托业务三部总经理、财富管理中心副总经理、资产配置部总经理、中诚资本管理（北京）有限公司总经理等职，现任中诚信托有限责任公司党委委员、副总裁，兼任中诚资本管理（北京）有限公司董事长、法定代表人。

Stefan Hoops 先生，董事，德国籍，毕业于德国拜罗伊特大学（University of Bayreuth），获得工商管理学位及经济学博士学位。2003年加入 Deutsche Bank AG（德意志银行）并担任过债券销售负责人、融资与解决方案负责人、全球市场部负责人、全球交易银行部负责人、企业银行业务全球负责人等多个职务。2022年6月起担任 DWS Group GmbH & Co. KGaA 首席执行官及总裁部负责人，同时担任 DB Group Management Committee（德银集团管理委员会）委员。2023年1月起，担任 DWS Management GmbH（DWS 集团）投资部负责人。

王静雯女士，董事，毕业于明尼苏达大学（University of Minnesota），获得数学与精算硕士学位。曾于安永会计师事务所（ERNST & YOUNG）担任精算咨询集团高级顾问；于美世集团（MERCER）担任首席咨询顾问，退休、风险和金融业务的合伙人兼亚洲主管；于花旗集团（CITIGROUP）担任董事总经理兼亚太区养老金、全球市场与证券服务主管；于东方汇理香港公司（Amundi Hong Kong Limited）担任董事总经理兼北亚机构业务主管；于东方汇理美国（Amundi US）担任资深董事总经理兼美国机构业务主管。于2021年9月加入德意志投资香港有限公司（DWS Investments Hong Kong Limited）担任 DWS Group 董事总经理兼亚太区客户主管，现任 DWS Group 亚太区负责人兼亚太区客户主管。

韩家乐先生，董事，清华大学经济管理学院工业企业管理专业，硕士研究生。1990年2月至2000年5月任海问证券投资咨询有限公司总经理。1994年至今任北京德恒有限责任公司总经理，2001年11月至今任立信投资有限责任公司董事长，2004年至今任陕西秦明电子（集团）有限公司董事长，2013年至今任麦克传感器股份有限公司董事长。

王巍先生，独立董事，美国 Fordham University 经济学博士。并购公会创始会长，金融博物馆理事长。曾长期担任中欧国际工商学院和长江商学院的客座教授。2004年主持创建了全联并购公会；2005年担任经济合作与发展组织（OECD）投资委员会专家委员，2007年起担任上海证券交易所公司治理专家委员会成员；2010年创建了系列金融博物馆，在北京、上海、天津、宁波、苏州、成都、沈阳、郑州和井冈山有十处不同主题的分馆，也参与香港金融博物馆的创建。神州数码信息服务股份有限公司独立董事、北京中关村银行股份有限公司独立董事、上海仁会生物制药股份有限公司独立董事。

汤欣先生，独立董事，法学博士，清华大学法学院教授、博士生导师，清华大学商法研究中心主任、清华大学全球私募股权研究院副院长。曾兼任中国证监会第一、二届并购重组审核委员会委员，中国上市公司协会第一、二届独立董事委员会主任委员、上海证券

交易所第四、五届上市委员会委员。现兼任最高人民法院执行特邀咨询专家、深圳证券交易所法律专业咨询委员会委员、中国证券投资基金业协会法制工作委员会委员、中国上市公司协会学术顾问委员会委员、贵州银行股份有限公司独立董事、民生证券股份有限公司独立董事、万达电影股份有限公司独立董事。

陈重先生，独立董事，博士，中共党员，明石投资管理有限公司副董事长，兼任明石创新技术集团股份有限公司董事、四川发展龙蟒股份有限公司董事。曾任中国企业联合会研究部副主任、主任，常务副理事长、党委副书记；重庆市人民政府副秘书长（分管金融工作）；新华基金管理股份有限公司董事长。重庆银行股份有限公司外部监事、爱美客技术发展股份有限公司监事会主席、豆神教育科技（北京）股份有限公司独立董事、四川省投资集团有限责任公司外部董事、重庆国际信托股份有限公司独立董事。

类承曜先生，独立董事，中共党员，中国人民大学财政金融学院财政系专业毕业，经济学博士。现任中国人民大学财政金融学院金融学教授、博士生导师、中债研究所所长，兼任 International Journal of Innovation and Entrepreneurship 中方副主编、《投资研究》编委会委员等职。2020年受聘为财政部财政风险研究专家工作室专家。现兼任北汽财务公司独立董事、余姚农商行独立董事、中华联合人寿保险监事。

经雷先生，董事，总经理，美国佩斯大学金融学和财会专业毕业，双学士，特许金融分析师（CFA）。1994年6月至2008年5月任AIG Global Investment Corp高级投资分析师、副总裁；2008年5月至2013年9月任友邦中国区资产管理中心首席投资总监、副总裁。2013年10月加入嘉实基金管理有限公司，2013年10月至2018年3月任公司首席投资官（固收/机构），2018年3月至今任公司总经理。

沈树忠先生，监事长，正高级会计师，管理学硕士。曾任中国糖业酒类集团公司财务部科员、财务部副经理、审计部经理、财务部经理、财务总监、副总经理、常务副总经理（主持工作）、法定代表人；兼任北京华堂商场有限公司董事、中日合资成都伊藤洋华堂商场有限公司副董事长、酒鬼酒股份有限公司董事。现任中诚信托有限责任公司财务总监。

穆群先生，监事，经济师，硕士研究生。曾任西安电子科技大学助教，长安信息产业（集团）股份有限公司董事会秘书，北京德恒有限责任公司财务主管。2001年11月至今任立信投资有限公司财务总监。

罗丽丽女士，监事，经济学硕士。2000年7月至2004年8月任北京兆维科技股份有限公司证券事务代表，2004年9月至2006年1月任平泰人寿保险股份有限公司（筹）法律事务主管，2006年2月至2007年10月任上海浦东发展银行北京分行法务经理，2007年10月至2010年12月任工银瑞信基金管理有限公司法律合规经理。2010年12月加入嘉实基金管理有限公司，曾任稽核部执行总监、基金运营部总监，现任财务部总监。

高华女士，监事，法学硕士，中共党员。2006年9月至2010年7月任安永华明会计师事务所高级审计师，2010年7月至2011年1月任联想（北京）有限公司流程分析师，2011

年1月至2013年11月任银华基金管理有限公司监察稽核部内审主管。2013年11月加入嘉实基金管理有限公司，曾任合规管理部稽核组总监，现任人力资源总监。

张峰先生，副总经理、硕士研究生。曾任职于国家计委，曾任嘉实基金管理有限公司督察长、副总经理兼首席市场官，国泰基金管理有限公司总经理，嘉实财富管理有限公司总经理。现任公司 Smart-Beta 和指数投资部负责人，公司副总经理。

姚志鹏先生，副总经理、硕士研究生。2011年加入嘉实基金管理有限公司，曾任股票研究部研究员、基金经理、成长风格投资总监兼权益投资部总监，现任公司副总经理、股票投研首席投资官。

程剑先生，副总经理、硕士研究生。2006年7月至2022年4月，历任海通证券股份有限公司固定收益部业务员、研究策略部经理及固定收益部总经理助理、副总经理。2022年4月加入嘉实基金管理有限公司，现任机构业务联席首席投资官兼启航解决方案战队负责人、公司副总经理。

杨竞霜先生，副总经理、首席信息官，博士研究生，美国籍。曾任日本恒星股份有限公司软件工程师，高盛集团核心策略部副总裁，瑞银集团信息技术部董事总经理，瑞信集团信息技术部董事总经理，北京大数据研究院常务副院长。2020年1月加入嘉实基金管理有限公司，现任公司副总经理、首席信息官。

郭松先生，督察长，硕士研究生。曾任职于国家外汇管理局、中汇储投资有限责任公司、国新国际投资有限公司。2019年12月加入嘉实基金管理有限公司，现任公司督察长。

李明先生，财务总监，大学本科。曾任职于北京商品交易所、首创证券经纪有限责任公司。2000年12月至今任嘉实基金管理有限公司首席财务官。

郭杰先生，机构首席投资官，硕士研究生。曾任职于富国基金管理有限公司、汇添富基金管理股份有限公司、海富通基金管理有限公司。2012年5月加入嘉实基金管理有限公司，历任部门总监、策略组组长，现任公司机构首席投资官。

## 2、首席风险官及投资总监

张敏女士，首席风险官，博士研究生。曾任德邦证券有限责任公司投资经理助理。2010年3月加入嘉实基金管理有限公司，曾任风险管理部副总监、风险管理部总监。

归凯先生，成长风格投资总监，硕士研究生。曾任国都证券研究所研究员、投资经理。2014年5月加入嘉实基金管理有限公司，曾任机构投资部投资经理、策略组投资总监。

胡涛先生，平衡风格投资总监，MBA。曾任北京证券投资银行部经理，中金公司股票研究经理，长盛基金研究员，友邦华泰基金基金经理助理，泰达宏利基金专户投资部副总经理、研究部研究主管、基金经理等职务。2014年3月加入嘉实基金管理有限公司，曾任 GARP 策略组投资总监。

洪流先生，平衡风格投资总监，硕士研究生。曾任新疆金新信托证券管理总部信息研究部经理，德恒证券信息研究中心副总经理、经纪业务管理部副总经理，兴业证券研究发展中心高级研究员、理财服务中心首席理财分析师，上海证券资产管理分公司客户资产管理部副总监，圆信永丰基金首席投资官。2019年2月加入嘉实基金管理有限公司，曾任上海 GARP 投资策略组投资总监。

张金涛先生，价值风格投资总监，硕士研究生。曾任中金公司研究部能源组组长，润晖投资高级副总裁负责能源和原材料等行业的研究和投资。2012年10月加入嘉实基金管理有限公司，曾任海外研究组组长、策略组投资总监。

胡永青先生，投资总监（固收+），硕士研究生。曾任天安保险固定收益组合经理，信诚基金投资经理，国泰基金固定收益部总监助理、基金经理。2013年11月加入嘉实基金管理有限公司，曾任策略组组长。

赵国英女士，投资总监（纯债），硕士研究生。曾任天安保险债券交易员，兴业银行资金营运中心债券交易员，美国银行上海分行环球金融市场部副总裁，中欧基金策略组负责人、基金经理。2020年8月加入嘉实基金管理有限公司。

### 3、基金经理

#### （1）现任基金经理

洪流先生，硕士研究生，25年证券从业经历，具有基金从业资格，中国国籍。曾任新疆金新信托证券管理总部信息研究部经理，德恒证券信息研究中心副总经理、经纪业务管理部副总经理，兴业证券研究发展中心高级研究员、理财服务中心首席理财分析师，上海证券资产管理分公司客户资产管理部副总监，圆信永丰基金首席投资官。2019年2月加入嘉实基金管理有限公司，曾任上海 GARP 投资策略组投资总监。现任平衡风格投资总监。2014年11月19日至2019年1月31日任圆信永丰双红利灵活配置混合型证券投资基金基金经理、2015年10月28日至2019年1月31日任圆信永丰优加生活股票型证券投资基金基金经理、2016年7月27日至2019年1月31日任圆信永丰强化收益债券型证券投资基金基金经理、2017年3月29日至2019年1月31日任圆信永丰多策略精选混合型证券投资基金基金经理、2017年11月30日至2019年1月31日任圆信永丰汇利混合型证券投资基金(LOF)基金经理、2017年12月13日至2019年1月31日任圆信永丰双利优选定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2020年1月20日至2023年1月19日任嘉实瑞熙三年封闭运作混合型证券投资基金基金经理。2019年8月1日至今任嘉实多元收益债券型证券投资基金基金经理、2019年9月4日至今任嘉实瑞虹三年定期开放混合型证券投资基金基金经理、2019年9月10日至今任嘉实价值成长混合型证券投资基金基金经理、2019年9月28日至今任嘉实策略增长混合型证券投资基金基金经理、2021年2月24日至今任嘉实

竞争力优选混合型证券投资基金基金经理、2021年3月16日至今任嘉实阿尔法优选混合型证券投资基金基金经理、2021年5月25日至今任嘉实品质优选股票型证券投资基金基金经理、2021年12月6日至今任嘉实兴锐优选一年持有期混合型证券投资基金基金经理、2023年1月20日至今任嘉实欣荣混合型证券投资基金（LOF）基金经理。

（2）历任基金经理

本基金无历任基金经理。

4、股票投资决策委员会

股票投资决策委员会的成员包括：公司副总经理、股票投研首席投资官姚志鹏先生，公司总经理经雷先生，首席风险官张敏女士，裕远投资管理中心总经理邵健先生，价值风格投资总监谭丽女士，成长风格投资总监归凯先生，大制造研究总监刘杰先生，大消费研究总监吴越先生，大周期研究总监肖觅先生。

5、上述人员之间均不存在近亲属关系。

（三）基金管理人的职责

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

2、办理基金备案手续；

3、对所管理的不同基金资产分别管理、分别记账，进行证券投资；

4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

6、编制季度报告、中期报告和年度报告；

7、计算并公告基金资产净值和基金份额累计净值，确定基金份额申购、赎回价格；

8、办理与基金资产管理业务活动有关的信息披露事项；

9、召集基金份额持有人大会；

10、保存基金资产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

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

12、有关法律法规和中国证监会规定的其他职责。

（四）基金管理人的承诺

1、本基金管理人承诺严格遵守相关法律法规、基金合同和中国证监会的有关规定，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反有关法律法规、基金合同和中国证监会有关规定的行为发生。

2、本基金管理人承诺严格遵守《中华人民共和国证券法》、《基金法》及有关法律法规，建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止下列行为发生：

- （1）将其固有财产或者他人财产混同于基金资产从事证券投资；
- （2）不公平地对待其管理的不同基金资产；
- （3）利用基金资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）法律法规或中国证监会规定禁止的其他行为。

3、本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，不得将基金资产用于以下投资或活动：

- （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）向其基金管理人、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、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先的原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上（含三分之二）的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

#### 4、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、受雇人或任何第三人谋取利益；

（3）不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，泄露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）不从事损害基金资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、内部控制制度概述

为加强内部控制，防范和化解风险，促进公司诚信、合法、有效经营，保障基金份额持有人利益，根据《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》并结合公司具体情况，公司已建立健全内部控制体系和内部控制制度。

公司内部控制制度由内部控制大纲、基本管理制度、部门业务规章等部分组成。公司内部控制大纲是对公司章程规定的内控原则的细化和展开，是各项基本管理制度的纲要和总揽。基本管理制度包括投资管理、信息披露、信息技术管理、公司财务管理、基金会计、人力资源管理、资料档案管理、业绩评估考核、合规管理和风险控制、紧急应变等制度。部门业务规章是对各部门的主要职责、岗位设置、岗位职责、操作守则等具体说明。

### 2、内部控制的原则

（1）健全性原则：内部控制包括公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员，并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个环节；

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

（3）独立性原则：公司各机构、部门和岗位在职能上必须保持相对独立；

（4）相互制约原则：组织结构体现职责明确、相互制约的原则，各部门有明确的授权分工，操作相互独立。

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

### 3、内部控制组织体系

（1）公司董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任。董事会下设风控与内审委员会，负责检查公司内部管理制度的合法合规性及内控制度的执行情况，充分发挥独立董事监督职能，保护投资者利益和公司合法权益。

（2）股票投资决策委员会为公司投资管理的最高决策机构，由总经理、副总经理、投资及研究总监组成，负责指导基金资产的运作、确定基本的投资策略和投资组合的原则。

（3）风险控制委员会为公司风险管理的最高决策机构，由公司总经理、督察长及相关总监组成，负责全面评估公司经营管理过程中的各项风险，并提出防范化解措施。

（4）督察长积极对公司各项制度、业务的合法合规性及公司内部控制制度的执行情况进行监察、稽核，定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况。

（5）合规管理部门：公司管理层重视和支持合规风控工作，并保证合规管理部门的独立性和权威性，配备了充足合格的合规风控人员，明确合规管理部门及其各岗位的职责和 workflows、组织纪律。合规管理部门具体负责公司各项制度、业务的合法合规性及公司内部控制制度的执行情况的监控检查工作。



（6）业务部门：部门负责人为所在部门的风险控制第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控及时报告的义务。

（7）岗位员工：公司努力树立内控优先和风险管理理念，培养全体员工的风险防范意识，营造一个浓厚的内控文化氛围，保证全体员工及时了解国家法律法规和公司规章制度，使风险意识贯穿到公司各个部门、各个岗位和各个环节。员工在其岗位职责范围内承担相应的内控责任，并负有对岗位工作中发现的风险隐患或风险问题及时报告、反馈的义务。

#### 4、内部控制措施

公司确立“制度上控制风险、技术上量化风险”，积极吸收或采用先进的风险控制技术和手段，进行内部控制和风险管理。

（1）公司逐步健全法人治理结构，充分发挥独立董事和监事会的监督职能，严禁不正当关联交易、利益输送和内部人控制现象的发生，保护投资者利益和公司合法权益。

（2）公司设置的组织结构，充分体现职责明确、相互制约的原则，各部门均有明确的授权分工，操作相互独立。公司逐步建立决策科学、运营规范、管理高效的运行机制，包括民主、透明的决策程序和管理议事规则，高效、严谨的业务执行系统，以及健全、有效的内部监督和反馈系统。

（3）公司设立了顺序递进、权责统一、严密有效的内控防线：

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

②建立重要业务处理凭据传递和信息沟通制度，相关部门和岗位之间相互监督制衡。

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

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

（6）授权控制应当贯穿于公司经营活动的始终，授权控制的主要内容包括：

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

②公司各部门、分公司及员工在规定授权范围内行使相应的职责；

③重大业务授权采取书面形式，授权书应当明确授权内容和时效；

④对已获授权的部门和人员建立有效的评价和反馈机制，对已不适用的授权应及时修改或取消授权。

（7）建立完善的基金财务核算与基金资产估值系统和资产分离制度，基金资产与公司自有资产、其他委托资产以及不同基金的资产之间实行独立运作，分别核算，及时、准确和完整地反映基金资产的状况。

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

（9）建立和维护信息管理系统，严格信息管理，保证客户资料等信息安全、真实和完整。积极维护信息沟通渠道的畅通，建立清晰的报告系统，各级领导、部门及员工均有明确的报告途径。

（10）建立和完善客户服务标准，加强基金销售管理，规范基金宣传推介，不得有不正当销售行为和不正当竞争行为。

（11）制订切实有效的应急应变措施，建立危机处理机制和程序，对发生严重影响基金份额持有人利益、可能引起系统性风险、严重影响社会稳定的突发事件，按照预案妥善处理。

（12）公司建立健全内控制度，督察长、合规管理部门对公司内部控制制度的执行情况进行持续的监督，保证内部控制制度落实；定期评价内部控制的有效性并适时改进。

①对公司各项制度、业务的合法合规性进行监控核查，确保公司各项制度、业务符合有关法律、行政法规、部门规章及行业监管规则；

②对内部风险控制制度的持续监督。合规管理部门持续完善“风险责任授权体系”机制，组织相关业务部门、岗位共同识别风险点，界定风险责任人，确保所有识别出的关键风险点均有对应控制措施，及时防范和化解风险；

③督察长按照公司规定，向董事会、经营管理主要负责人报告公司经营管理的合法合规情况和合规管理工作开展情况。

#### 5、基金管理人关于内部控制的声明

（1）基金管理人承诺以上关于内部控制的披露真实、准确；

（2）基金管理人承诺根据市场变化和基金管理人发展不断完善内部控制体系和内部控制制度。

## 四、基金托管人

### （一）基金托管人基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司  
注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号  
成立时间：1984 年 1 月 1 日  
法定代表人：廖林  
注册资本：人民币 35,640,625.7089 万元  
联系电话：010-66105799  
联系人：郭明

### （二）主要人员情况

截至 2024 年 3 月，中国工商银行资产托管部共有员工 210 人，平均年龄 38 岁，99%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

### （三）基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自 1998 年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本养老保险、企业年金基金、QFI 资产、QDII 资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII 专户资产、ESCROW 等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至 2023 年 12 月，中国工商银行共托管证券投资基金 1404 只。自 2003 年以来，本行连续二十一年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的 97 项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

### （四）基金托管人的内部控制制度

中国工商银行资产托管部自成立以来，各项业务飞速发展，始终保持在资产托管行业的优势地位。这些成绩的取得，是与资产托管部“一手抓业务拓展，一手抓内控建设”的做法是分不开的。资产托管部非常重视改进和加强内部风险管理工作，在积极拓展各项托管业务的同时，把加强风险防范和控制的力度，精心培育内控文化，完善风险控制机制，

强化业务项目全过程风险管理作为重要工作来做。从2005年至今共十七次顺利通过评估组织内部控制和安全措施最权威的 ISAE3402 审阅，全部获得无保留意见的控制及有效性报告。充分表明独立第三方对我行托管服务在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可，也证明中国工商银行托管服务的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨，达到国际先进水平。目前，ISAE3402 审阅已经成为年度化、常规化的内控工作手段。”

#### 1、内部风险控制目标

保证业务运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，强化和建立守法经营、规范运作的经营思想和经营风格，形成一个运作规范化、管理科学化、监控制度化的内控体系；防范和化解经营风险，保证托管资产的安全完整；维护持有人的权益；保障资产托管业务安全、有效、稳健运行。

#### 2、内部风险控制组织结构

中国工商银行资产托管业务内部风险控制组织结构由中国工商银行稽核监察部门（内控合规部、内部审计局）、资产托管部内设风险控制处及资产托管部各业务处室共同组成。总行稽核监察部门负责制定全行风险管理政策，对各业务部门风险控制工作进行指导、监督。资产托管部内部设置专门负责稽核监察工作的内部风险控制处，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，对业务的运行独立行使稽核监察职权。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

#### 3、内部风险控制原则

（1）合法性原则。内控制度应当符合国家法律法规及监管机构的监管要求，并贯穿于托管业务经营管理活动的始终。

（2）完整性原则。托管业务的各项经营管理活动都必须有相应的规范程序和监督制约；监督制约应渗透到托管业务的全过程和各个操作环节，覆盖所有的部门、岗位和人员。

（3）及时性原则。托管业务经营活动必须在发生时能准确及时地记录；按照“内控优先”的原则，新设机构或新增业务品种时，必须做到已建立相关的规章制度。

（4）审慎性原则。各项业务经营活动必须防范风险，审慎经营，保证基金资产和其他委托资产的安全与完整。

（5）有效性原则。内控制度应根据国家政策、法律及经营管理的需要适时修改完善，并保证得到全面落实执行，不得有任何空间、时限及人员的例外。

（6）独立性原则。设立专门履行托管人职责的管理部门；直接操作人员和控制人员必须相对独立，适当分离；内控制度的检查、评价部门必须独立于内控制度的制定和执行部门。

#### 4、内部风险控制措施实施

（1）严格的隔离制度。资产托管业务与传统业务实行严格分离，建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度，并采取

了良好的防火墙隔离制度，能够确保资产独立、环境独立、人员独立、业务制度和管理独立、网络独立。

（2）高层检查。主管行领导与部门高级管理层作为工行托管业务政策和策略的制定者和管理者，要求下级部门及时报告经营管理情况和特别情况，以检查资产托管部在实现内部控制目标方面的进展，并根据检查情况提出内部控制措施，督促职能管理部门改进。

（3）人事控制。资产托管部严格落实岗位责任制，建立“自控防线”、“互控防线”、“监控防线”三道控制防线，健全绩效考核和激励机制，树立“以人为本”的内控文化，增强员工的责任心和荣誉感，培育团队精神和核心竞争力。并通过进行定期、定向的业务与职业道德培训、签订承诺书，使员工树立风险防范与控制理念。

（4）经营控制。资产托管部通过制定计划、编制预算等方法开展各种业务营销活动、处理各项事务，从而有效地控制和配置组织资源，达到资源利用和效益最大化目的。

（5）内部风险管理。资产托管部通过稽核监察、风险评估等方式加强内部风险管理，定期或不定期地对业务运作状况进行检查、监控，指导业务部门进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施，排查风险隐患。

（6）数据安全控制。我们通过业务操作区相对独立、数据和传真加密、数据传输线路的冗余备份、监控设施的运用和保障等措施来保障数据安全。

（7）应急准备与响应。资产托管业务建立专门的灾难恢复中心，制定了基于数据、应用、操作、环境四个层面的完备的灾难恢复方案，并组织员工定期演练。为使演练更加接近实战，资产托管部不断提高演练标准，从最初的按照预订时间演练发展到现在的“随机演练”。从演练结果看，资产托管部完全有能力在发生灾难的情况下两个小时内恢复业务。

## 5、资产托管部内部风险控制情况

（1）资产托管部内部设置专职稽核监察部门，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，全面贯彻落实全程监控思想，确保资产托管业务健康、稳定地发展。

（2）完善组织结构，实施全员风险管理。完善的风险管理体系需要从上至下每个员工的共同参与，只有这样，风险控制制度和措施才会全面、有效。资产托管部实施全员风险管理，将风险控制责任落实到具体业务部门和业务岗位，每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责，通过建立纵向双人制、横向多部门制的内部组织结构，形成不同部门、不同岗位相互制衡的组织结构。

（3）建立健全规章制度。资产托管部十分重视内控制度的建设，一贯坚持把风险防范和控制的理念和方法融入岗位职责、制度建设和工作流程中。经过多年努力，资产托管部已经建立了一整套内部风险控制制度，包括：岗位职责、业务操作流程、稽核监察制度、信息披露制度等，覆盖所有部门和岗位，渗透各项业务过程，形成各个业务环节之间的相互制约机制。

（4）内部风险控制始终是托管部工作重点之一，保持与业务发展同等地位。资产托管业务是商业银行新兴的中间业务，资产托管部从成立之日起就特别强调规范运作，一直将建立一个系统、高效的风险防范和控制体系作为工作重点。随着市场环境的变化和托管业务的快速发展，新问题、新情况不断出现，资产托管部始终将风险管理放在与业务发展同等重要的位置，视风险防范和控制为托管业务生存和发展的生命线。

（五）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《基金法》、基金合同、托管协议和有关基金法规的规定，基金托管人对基金的投资范围和投资对象、基金投融资比例、基金投资禁止行为、基金参与银行间债券市场、基金资产净值的计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查，其中对基金的投资比例的监督和核查自基金合同生效之后六个月开始。

基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、基金合同、基金托管协议或有关基金法律法规规定的行为，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。

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

## 五、相关服务机构

### （一）基金份额发售机构

#### 1、直销机构

##### （1）嘉实基金管理有限公司直销中心

办公地址	北京市丰台区丽泽路16号院4号楼汇亚大厦12层		
电话	(010) 65215588	传真	(010) 65215577
联系人	黄娜		

##### （2）嘉实基金管理有限公司网上直销

具体信息详见本公司网站（[www.jsfund.cn](http://www.jsfund.cn)）。

#### 2、非直销销售机构

序号	销售机构名称	销售机构信息
1	中国工商银行股份有限公司	注册地址，办公地址：北京市西城区复兴门内大街55号 住所：北京市西城区复兴门内大街55号 法定代表人：廖林 联系人：杨菲 传真：010-66107914 客服电话：95588 网址： <a href="http://www.icbc.com.cn">http://www.icbc.com.cn</a> , <a href="http://www.icbc-ltd.com">http://www.icbc-ltd.com</a>
2	中国农业银行股份有限公司	注册地址，办公地址：北京市东城区建国门内大街69号 住所：北京市东城区建国门内大街69号 法定代表人：谷澍 联系人：林葛 电话：(010)85108227 传真：(010)85109219 客服电话：95599 网址： <a href="https://www.abchina.com/cn">https://www.abchina.com/cn</a>
3	中国银行股份有限公司	办公地址：中国北京市复兴门内大街1号 注册地址：北京市复兴门内大街1号 住所：北京市复兴门内大街1号 法定代表人：葛海蛟

		<p>联系人：梅非奇  电话：(010)66596688  传真：(010)66594946  客服电话：95566  网址：<a href="http://www.boc.cn">http://www.boc.cn</a></p>
4	交通银行股份有限公司	<p>注册地址，办公地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号  住所：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  联系人：高天  电话：021-58781234  传真：021-58408483  客服电话：95559  网址：<a href="http://www.bankcomm.com">www.bankcomm.com</a></p>
5	招商银行股份有限公司	<p>注册地址，办公地址：深圳市福田区深南大道7088号  住所：深圳市福田区深南大道7088号  法定代表人：缪建民  联系人：季平伟  电话：(0755) 83198888  传真：(0755) 83195050  客服电话：95555  网址：<a href="http://www.cmbchina.com">http://www.cmbchina.com</a></p>
6	中信银行股份有限公司	<p>办公地址：北京市朝阳区光华路10号院1号楼中信大厦  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  住所：北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层  法定代表人：方合英  联系人：丰靖  电话：95558  客服电话：95558  网址：<a href="http://www.citicbank.com">http://www.citicbank.com</a></p>
7	上海浦东发展银行股份有限公司	<p>办公地址：上海市浦东新区博成路1306号B栋  注册地址：上海市中山东一路12号  住所：上海市中山东一路12号  法定代表人：张为忠  联系人：江逸舟、赵守良  电话：(021)61618888  传真：(021)63604199  客服电话：95528  网址：<a href="http://www.spdb.com.cn">http://www.spdb.com.cn</a></p>



8	兴业银行股份有限公司	<p>注册地址，办公地址：中国福建省福州市台江区江滨中大道398号兴业银行大厦</p> <p>住所：中国福建省福州市台江区江滨中大道398号兴业银行大厦</p> <p>法定代表人：吕家进</p> <p>联系人：卞晷煜</p> <p>电话：(021) 52629999</p> <p>传真：(021) 62569070</p> <p>客服电话：95561</p> <p>网址：<a href="http://www.cib.com.cn">http://www.cib.com.cn</a></p>
9	中国民生银行股份有限公司	<p>办公地址：中国北京市西城区复兴门内大街2号民生银行大厦</p> <p>注册地址：中国北京市西城区复兴门内大街2号</p> <p>住所：中国北京市西城区复兴门内大街2号</p> <p>法定代表人：高迎欣</p> <p>联系人：王志刚</p> <p>电话：(010)58560666</p> <p>客服电话：95568</p> <p>网址：<a href="http://www.cmbc.com.cn">http://www.cmbc.com.cn</a></p>
10	北京银行股份有限公司	<p>办公地址：北京市西城区金融大街丙17号</p> <p>注册地址：北京市西城区金融大街甲17号首层</p> <p>住所：北京市西城区金融大街甲17号首层</p> <p>法定代表人：霍学文</p> <p>联系人：谢小华</p> <p>电话：(010) 66223587</p> <p>传真：(010) 66226045</p> <p>客服电话：95526</p> <p>网址：<a href="http://www.bankofbeijing.com.cn">http://www.bankofbeijing.com.cn</a></p>
11	上海银行股份有限公司	<p>办公地址：上海市浦东新区银城中路168号</p> <p>注册地址：上海市自由贸易试验区银城中路168号</p> <p>住所：上海市自由贸易试验区银城中路168号</p> <p>法定代表人：金煜</p> <p>联系人：王笑</p> <p>电话：021-68475888</p> <p>传真：021-68476111</p> <p>客服电话：95594</p> <p>网址：<a href="http://www.bosc.cn">http://www.bosc.cn</a></p>
12	广发银行股份有限公司	<p>注册地址，办公地址：广州市越秀区东风东路713号</p> <p>住所：广州市越秀区东风东路713号</p> <p>法定代表人：王凯</p> <p>联系人：詹全鑫、张扬眉</p> <p>电话：(020) 38322256</p>

		传真：(020) 87310955 客服电话：400-830-8003 网址： <a href="http://www.cgbchina.com.cn">http://www.cgbchina.com.cn</a>
13	平安银行股份有限公司	办公地址：中国广东省深圳市深南东路 5047 号 注册地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号 住所：深圳市罗湖区深南东路 5047 号 法定代表人：谢永林 联系人：张青 电话：0755-22166118 传真：0755-82080406 客服电话：95511-3 网址： <a href="http://www.bank.pingan.com">http://www.bank.pingan.com</a>
14	宁波银行股份有限公司	注册地址，办公地址：浙江省宁波市鄞州区宁东路 345 号 住所：浙江省宁波市鄞州区宁东路 345 号 法定代表人：陆华裕 联系人：胡技勋 电话：(0574) 89068340 传真：(0574) 87050024 客服电话：95574 网址： <a href="http://www.nbcb.com.cn">http://www.nbcb.com.cn</a>
15	上海农村商业银行股份有限公司	注册地址，办公地址：上海市黄浦区中山东二路 70 号 住所：上海市黄浦区中山东二路 70 号 法定代表人：徐力 联系人：施传荣 电话：021-38523692 传真：021-50105124 客服电话：(021)962999 网址： <a href="http://www.srcb.com">http://www.srcb.com</a>
16	北京农村商业银行股份有限公司	注册地址，办公地址：北京市西城区月坛南街 1 号院 2 号楼 住所：北京市西城区月坛南街 1 号院 2 号楼 法定代表人：付东升 联系人：王薇娜 电话：(010)85605006 传真：(010)85605345 客服电话：96198 网址： <a href="http://www.bjrcb.com">http://www.bjrcb.com</a>
17	青岛银行股份有限公司	注册地址，办公地址：山东省青岛市崂山区秦岭路 6 号 3 号楼 住所：山东省青岛市崂山区秦岭路 6 号 3 号楼 法定代表人：景在伦 联系人：徐伟静

		电话：0532-68629925 传真：0532-68629939 客服电话：96588(青岛)、4006696588(全国) 网址： <a href="http://www.qdccb.com/">http://www.qdccb.com/</a>
18	浙商银行股份有限公司	办公地址：浙江省杭州市萧山区鸿宁路1788号 注册地址：浙江省杭州市庆春路288号 住所：浙江省杭州市庆春路288号 法定代表人：张荣森（代） 联系人：谢冰然 电话：0571-88260386 客服电话：95527 网址： <a href="http://www.czbank.com">http://www.czbank.com</a>
19	东莞银行股份有限公司	办公地址：东莞市莞城区体育路21号 注册地址：广东省东莞市莞城区体育路21号 住所：广东省东莞市莞城区体育路21号 法定代表人：卢国锋 联系人：朱杰霞 电话：0769-22111802 传真：0769-23156406 客服电话：956033 网址： <a href="http://www.dongguanbank.cn/">http://www.dongguanbank.cn/</a>
20	江苏银行股份有限公司	注册地址，办公地址：江苏省南京市中华路26号 住所：江苏省南京市中华路26号 法定代表人：夏平 联系人：张洪玮 电话：(025)58587036 传真：(025)58587820 客服电话：95319 网址： <a href="http://www.jsbchina.cn">http://www.jsbchina.cn</a>
21	渤海银行股份有限公司	注册地址，办公地址：天津市河东区海河东路218号 住所：天津市河东区海河东路218号 法定代表人：王锦虹 联系人：王宏 电话：(022)58316666 传真：(022)58316569 客服电话：400-888-8811 网址： <a href="http://www.cbhb.com.cn">http://www.cbhb.com.cn</a>
22	大连银行股份有限公司	注册地址，办公地址：辽宁省大连市中山区中山路88号 住所：辽宁省大连市中山区中山路88号 法定代表人：彭寿斌 联系人：沈宗达 电话：0411-82311936

		<p>传真：0411-82311731  客服电话：4006640099  网址：www.bankofdl.com</p>
23	东莞农村商业银行股份有限公司	<p>注册地址，办公地址：广东省东莞市东城区鸿福东路2号  住所：广东省东莞市东城区鸿福东路2号  法定代表人：卢国锋  联系人：洪晓琳  电话：0769-22866143  传真：0769-22866282  客服电话：(0769)961122  网址：http://www.drcbank.com/</p>
24	杭州联合农村商业银行股份有限公司	<p>办公地址：杭州市上城区建国中路99号  注册地址：浙江省杭州市上城区建国中路99号  住所：浙江省杭州市上城区建国中路99号  法定代表人：张海林  联系人：胡莹  电话：0571—87923324  传真：0571—87923214  客服电话：96596  网址：http://www.urcb.com</p>
25	昆仑银行股份有限公司	<p>办公地址：北京市西城区金融大街甲1号亚光大厦B座  注册地址：新疆克拉玛依市世纪大道7号  住所：新疆克拉玛依市世纪大道7号  法定代表人：王忠来  联系人：张乐乐、刘晓、陈应洪  电话：010-89026816、010-89026787  传真：010-89025421  客服电话：95379  网址：http://www.klb.cn</p>
26	日照银行股份有限公司	<p>注册地址，办公地址：山东省日照市烟台路197号  住所：山东省日照市烟台路197号  法定代表人：杨宝峰  联系人：孔颖  电话：0633-8081590  传真：0633-8081276  客服电话：4006896588  网址：www.bankofrizhao.com.cn</p>
27	广东南粤银行股份有限公司	<p>办公地址：湛江经济技术开发区乐山路27号财富汇金融中心  注册地址：湛江经济技术开发区乐山路27号财富汇金融中心1层01、02号商铺、2层01号商</p>

		<p>铺、3层01号商铺、39-45层办公室</p> <p>住所：湛江经济技术开发区乐山路27号财富汇金融中心1层01、02号商铺、2层01号商铺、3层01号商铺、39-45层办公室</p> <p>法定代表人：蒋丹</p> <p>联系人：陈静</p> <p>电话：0759-3309132</p> <p>传真：0759-2631600</p> <p>客服电话：4000961818</p> <p>网址：<a href="http://www.gdnybank.com">www.gdnybank.com</a></p>
28	浙江义乌农村商业银行股份有限公司	<p>注册地址，办公地址：浙江省义乌市福田街道城北路677号</p> <p>住所：浙江省义乌市福田街道城北路677号</p> <p>法定代表人：吴志良</p> <p>联系人：王芳</p> <p>电话：0579-85562712</p> <p>传真：0579-85627331</p> <p>客服电话：4008896596</p> <p>网址：<a href="http://www.ywbank.com/">http://www.ywbank.com/</a></p>
29	云南红塔银行股份有限公司	<p>办公地址：云南省昆明市盘龙区世博路低碳中心A座</p> <p>注册地址：云南省玉溪市东风南路2号</p> <p>住所：云南省玉溪市东风南路2号</p> <p>法定代表人：李光林</p> <p>联系人：马杰</p> <p>电话：0871-65236624</p> <p>传真：0871-65236614</p> <p>客服电话：0877-96522</p> <p>网址：<a href="http://www.ynhtbank.com">www.ynhtbank.com</a></p>
30	九江银行股份有限公司	<p>注册地址，办公地址：江西省九江市濂溪区长虹大道619号</p> <p>住所：江西省九江市濂溪区长虹大道619号</p> <p>法定代表人：周时辛</p> <p>联系人：程科夫</p> <p>电话：95316</p> <p>客服电话：95316</p> <p>网址：<a href="http://www.jjccb.com">www.jjccb.com</a></p>
31	财咨道信息技术有限公司	<p>注册地址，办公地址：辽宁省沈阳市浑南区白塔二南街18-2号B座601</p> <p>住所：辽宁省沈阳市浑南区白塔二南街18-2号B座601</p> <p>法定代表人：朱荣晖</p> <p>联系人：庞文静</p> <p>电话：400-003-5811</p>

		<p>客服电话：400-003-5811 网址：www.jinjiwo.com</p>
32	江苏汇林保大基金销售有限公司	<p>办公地址：南京市鼓楼区中山北路2号绿地紫峰大厦2005室 注册地址：南京市高淳区经济开发区古檀大道47号 住所：南京市高淳区经济开发区古檀大道47号 法定代表人：吴言林 联系人：林伊灵 电话：025-66046166-810 传真：025-56663409 客服电话：025-66046166 网址：http://www.huilinbd.com/</p>
33	嘉晟瑞信(天津)基金销售有限公司	<p>注册地址，办公地址：天津市南开区南门外大街与服装街交口悦府广场1号楼1708室 住所：天津市南开区南门外大街与服装街交口悦府广场1号楼1708室 法定代表人：陈晓 联系人：侯国治 电话：022-59006885 客服电话：400-883-2993 网址：www.jsrxfund.com</p>
34	青岛意才基金销售有限公司	<p>注册地址，办公地址：山东省青岛市市南区澳门路98号青岛海尔洲际酒店B座20层 住所：山东省青岛市市南区澳门路98号青岛海尔洲际酒店B座20层 法定代表人：Giamberto Giraldo 联系人：高赞 电话：0532-87071088 客服电话：400-612-3303 网址：www.yitsai.com</p>
35	博时财富基金销售有限公司	<p>注册地址，办公地址：深圳市福田区莲花街道福新社区益田路5999号基金大厦19层 住所：深圳市福田区莲花街道福新社区益田路5999号基金大厦19层 法定代表人：王德英 联系人：崔丹 电话：0755-83169999 客服电话：4006105568 网址：www.boserawealth.com</p>
36	诺亚正行基金销售有限公司	<p>办公地址：上海市杨浦区秦皇岛路32号C栋 注册地址：上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室 住所：上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室</p>

		<p>法定代表人：汪静波  联系人：张裕  电话：021-38509735  传真：021-38509777  客服电话：400-821-5399  网址：<a href="http://www.noah-fund.com">http://www.noah-fund.com</a></p>
37	深圳众禄基金销售股份有限公司	<p>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  注册地址：深圳市罗湖区宝安北路笋岗仓库区笋岗3号仓库整栋(HALO广场一期)4层12-13室  住所：深圳市罗湖区宝安北路笋岗仓库区笋岗3号仓库整栋(HALO广场一期)4层12-13室  法定代表人：薛峰  联系人：童彩平  电话：0755-33227950  传真：0755-33227951  客服电话：4006-788-887  网址：<a href="http://www.zlfund.cn">http://www.zlfund.cn</a></p>
38	上海好买基金销售有限公司	<p>办公地址：上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼  注册地址：上海市虹口区东大名路501号6211单元  住所：上海市虹口区东大名路501号6211单元  法定代表人：杨文斌  联系人：张茹  电话：021-20613999  传真：021-68596916  客服电话：4007009665  网址：<a href="https://www.howbuy.com/">https://www.howbuy.com/</a></p>
39	上海长量基金销售有限公司	<p>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  注册地址：浦东新区高翔路526号2幢220室  住所：浦东新区高翔路526号2幢220室  法定代表人：张跃伟  联系人：单丙烨  电话：021-20691869  传真：021-20691861  客服电话：400-089-1289  网址：<a href="http://www.erichfund.com">http://www.erichfund.com</a></p>
40	上海利得基金销售有限公司	<p>办公地址：上海市虹口区东大名路1098号浦江国际金融广场53层  注册地址：中国（上海）自由贸易试验区临港新片区海基六路70弄1号208-36室  住所：中国（上海）自由贸易试验区临港新片区</p>

		海基六路70弄1号208-36室 法定代表人：李兴春 联系人：曹怡晨 电话：021-50583533 传真：021-50583633 客服电话：400-032-5885 网址：www.leadfund.com.cn
41	嘉实财富管理有限公司	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(100020) 注册地址：海南省三亚市天涯区凤凰岛1号楼7层710号 住所：海南省三亚市天涯区凤凰岛1号楼7层710号 法定代表人：张峰 联系人：闫欢 电话：400-021-8850 传真：-- 客服电话：400-021-8850 网址：http://www.harvestwm.cn
42	北京创金启富基金销售有限公司	办公地址：中国北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A 注册地址：北京市西城区白纸坊东街2号院6号楼712室 住所：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：魏素清 电话：010-66154828 传真：010-63583991 客服电话：400-6262-818 网址：http://www.5irich.com
43	宜信普泽(北京)基金销售有限公司	办公地址：北京市朝阳区建国路88号楼15层1809 注册地址：北京市朝阳区光华路7号楼20层20A1、20A2单元 住所：北京市朝阳区光华路7号楼20层20A1、20A2单元 法定代表人：才殿阳 联系人：魏晨 电话：010-52413385 传真：010-85894285 客服电话：400-6099-200 网址：http://www.yixinfund.com
44	通华财富(上海)基金销售有限	办公地址：上海市浦东新区新金桥路28号新金桥



	公司	大厦5楼 注册地址：上海市虹口区同丰路667弄107号201室 住所：上海市虹口区同丰路667弄107号201室 法定代表人：沈丹义 联系人：褚志朋 电话：021-60818730 传真：021-60818187 客服电话：400-101-9301 网址：www.tonghuafund.com
45	北京中植基金销售有限公司	办公地址：北京朝阳区大望路金地中心A座28层 注册地址：北京市北京经济技术开发区宏达北路10号五层5122室 住所：北京市北京经济技术开发区宏达北路10号五层5122室 法定代表人：武建华 联系人：侯艳红 电话：010-53572363 传真：010-56642623 客服电话：400-8180-888 网址：http://www.zzfund.com
46	北京汇成基金销售有限公司	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4层 注册地址：北京市西城区宣武门外大街甲1号4层401-2 住所：北京市西城区宣武门外大街甲1号4层401-2 法定代表人：王伟刚 联系人：宋子琪 电话：010-62680527 传真：010-62680527 客服电话：400-619-9059 网址：www.hcfunds.com
47	海银基金销售有限公司	办公地址：上海市浦东新区银城中路8号4楼402室 注册地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路8号402室 住所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路8号402室 法定代表人：巩巧丽 联系人：秦琮 电话：021-80134149 传真：021-80133413

		<p>客服电话：4008081016 网址：<a href="http://www.fundhaiyin.com">http://www.fundhaiyin.com</a></p>
48	上海联泰基金销售有限公司	<p>办公地址：上海市虹口区临潼路188号 注册地址：上海市普陀区兰溪路900弄15号526室 住所：上海市普陀区兰溪路900弄15号526室 法定代表人：尹彬彬 联系人：兰敏 电话：021-52822063 传真：021-52975270 客服电话：400-118-1188 网址：<a href="http://www.66liantai.com">www.66liantai.com</a></p>
49	上海汇付基金销售有限公司	<p>办公地址：上海市中山南路100号金外滩国际广场19楼 注册地址：上海市黄浦区九江路769号1807-3室 住所：上海市黄浦区九江路769号1807-3室 法定代表人：金佶 联系人：陈云卉 电话：021-33323998 传真：021-33323837 客服电话：400-820-2819 网址：<a href="http://www.hotjijin.com">www.hotjijin.com</a></p>
50	泰信财富基金销售有限公司	<p>办公地址：北京市朝阳区建国路乙118号京汇大厦1206 注册地址：北京市朝阳区建国路乙118号10层1206 住所：北京市朝阳区建国路乙118号10层1206 法定代表人：彭浩 联系人：孔安琪 电话：010-53579668 客服电话：400-004-8821 网址：<a href="http://www.taixincf.com">http://www.taixincf.com</a></p>
51	上海基煜基金销售有限公司	<p>办公地址：上海市浦东新区银城中路488号太平金融大厦1503(2021年报) 注册地址：上海市黄浦区广东路500号30层3001单元 住所：上海市黄浦区广东路500号30层3001单元 法定代表人：王翔 联系人：蓝杰 电话：021-65370077 传真：021-55085991 客服电话：4008-205-369 网址：<a href="http://www.jiyufund.com.cn">http://www.jiyufund.com.cn</a></p>

52	上海中正达广基金销售有限公司	<p>注册地址，办公地址：上海市龙兰路 277 号 1 号楼 1203、1204 室</p> <p>住所：上海市龙兰路 277 号 1 号楼 1203、1204 室</p> <p>法定代表人：黄欣</p> <p>联系人：戴珉微</p> <p>电话：021-33768132</p> <p>传真：021-33768132*802</p> <p>客服电话：400-6767-523</p> <p>网址：<a href="http://www.zhongzhengmoney.com/web">http://www.zhongzhengmoney.com/web</a></p>
53	北京虹点基金销售有限公司	<p>办公地址：北京市朝阳区工人体育场北路甲 2 号裙房 2 层 222 单元</p> <p>注册地址：北京市朝阳区东三环北路 17 号 10 层 1015 室</p> <p>住所：北京市朝阳区东三环北路 17 号 10 层 1015 室</p> <p>法定代表人：何静</p> <p>联系人：姜颖</p> <p>电话：13522549431</p> <p>传真：010-65951887</p> <p>客服电话：400-068-1176</p> <p>网址：<a href="http://www.hongdianfund.com">http://www.hongdianfund.com</a></p>
54	深圳新华信通基金销售有限公司	<p>办公地址：深圳市福田区深南大道 2003 号华嵘大厦 710、711 室</p> <p>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）</p> <p>住所：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）</p> <p>法定代表人：戴媛</p> <p>联系人：郭佶欣</p> <p>电话：400-000-5767</p> <p>客服电话：400-000-5767</p> <p>网址：<a href="http://xintongfund.com">xintongfund.com</a></p>
55	上海攀赢基金销售有限公司	<p>办公地址：上海浦东新区银城中路 488 号 603 室</p> <p>注册地址：上海市闸北区广中西路 1207 号 306 室</p> <p>住所：上海市闸北区广中西路 1207 号 306 室</p> <p>法定代表人：郑新林</p> <p>联系人：吴卫东</p> <p>电话：021-68889082</p> <p>传真：021-68889283</p> <p>客服电话：021-68889082</p> <p>网址：<a href="http://www.pytz.cn">http://www.pytz.cn</a></p>
56	奕丰基金销售有限公司	<p>办公地址：深圳市南山区蛇口街道后海滨路与海德三道交汇处航天科技广场 A 座 17 楼 1704 室</p>

		<p>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)</p> <p>住所：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)</p> <p>法定代表人：TEO WEE HOWE</p> <p>联系人：叶健</p> <p>电话：0755-89460500</p> <p>传真：0755-21674453</p> <p>客服电话：400-684-0500</p> <p>网址：<a href="https://www.ifastps.com.cn/">https://www.ifastps.com.cn/</a></p>
57	中证金牛(北京)基金销售有限公司	<p>办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲1号环球财讯中心A座5层</p> <p>注册地址：北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室</p> <p>住所：北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室</p> <p>法定代表人：钱昊旻</p> <p>联系人：仲甜甜</p> <p>电话：010-59336492</p> <p>传真：010-59336510</p> <p>客服电话：010-59336512</p> <p>网址：<a href="http://www.jnlc.com">http://www.jnlc.com</a></p>
58	大连网金基金销售有限公司	<p>办公地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路22号2F</p> <p>注册地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路22号诺德大厦2层202室</p> <p>住所：辽宁省大连市沙河口区体坛路22号诺德大厦2层202室</p> <p>法定代表人：樊怀东</p> <p>联系人：于舒</p> <p>电话：0411-39027828</p> <p>传真：0411-39027835</p> <p>客服电话：4000-899-100</p> <p>网址：<a href="http://www.yibaijin.com/">http://www.yibaijin.com/</a></p>
59	中民财富基金销售(上海)有限公司	<p>办公地址：上海市黄浦区老太平弄88号A、B单元</p> <p>注册地址：上海市黄浦区中山南路100号7层05单元</p> <p>住所：上海市黄浦区中山南路100号7层05单元</p> <p>法定代表人：弭洪军</p> <p>联系人：茅旦青</p> <p>电话：021-33355392</p> <p>传真：021-63353736</p> <p>客服电话：400-876-5716</p> <p>网址：<a href="http://www.cmiwm.com/">http://www.cmiwm.com/</a></p>

60	上海中欧财富基金销售有限公司	注册地址，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 住所：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：屠帅颖 电话：021-68609600 客服电话：400-700-9700 网址： <a href="https://www.zocaifu.com/">https://www.zocaifu.com/</a>
61	万家财富基金销售(天津)有限公司	办公地址：北京市东城区朝阳门北大街9号泓晟国际中心16层 注册地址：天津自贸区（中心商务区）迎宾大道1988号滨海浙商大厦公寓2-2413室 住所：天津自贸区（中心商务区）迎宾大道1988号滨海浙商大厦公寓2-2413室 法定代表人：戴晓云 联系人：王茜蕊 电话：021-38909613 传真：010-59013828 客服电话：021-38909613 网址： <a href="http://www.wanjiawealth.com">http://www.wanjiawealth.com</a>
62	上海华夏财富投资管理有限公司	办公地址：北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层 注册地址：上海市虹口区东大名路687号1幢2楼268室 住所：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：仲秋玥 电话：010-88066632 传真：010-88066214 客服电话：400-817-5666 网址： <a href="http://www.amcfortune.com">www.amcfortune.com</a>
63	中国人寿保险股份有限公司	注册地址，办公地址：中国北京市西城区金融大街16号 住所：中国北京市西城区金融大街16号 法定代表人：白涛 联系人：赵文栋 电话：010-63632878 客服电话：95519 网址： <a href="http://www.e-chinalife.com">www.e-chinalife.com</a>
64	国泰君安证券股份有限公司	办公地址：上海市静安区南京西路768号 注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路618号

		住所：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号 法定代表人：贺青 联系人：黄博铭 电话：(021)38676666 传真：(021)38670666 客服电话：95521 网址： <a href="http://www.gtja.com">http://www.gtja.com</a>
65	中信建投证券股份有限公司	办公地址：北京东城区朝内大街 2 号凯恒中心 B 座 16 层 注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼 住所：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼 法定代表人：王常青 联系人：谢欣然 电话：010-86451810 客服电话：(8610)65608107 网址： <a href="http://www.csc108.com">http://www.csc108.com</a>
66	国信证券股份有限公司	办公地址：深圳市福田区福华一路 125 号国信金融大厦 注册地址：深圳市红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层 住所：深圳市红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层 法定代表人：张纳沙 联系人：李颖 电话：0755-81682519 客服电话：95536 网址： <a href="http://www.guosen.com.cn">http://www.guosen.com.cn</a>
67	招商证券股份有限公司	注册地址，办公地址：深圳市福田区福田街道福华一路 111 号 住所：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 电话：0755-82943666 传真：0755-83734343 客服电话：95565 网址： <a href="http://www.cmschina.com">http://www.cmschina.com</a>
68	广发证券股份有限公司	办公地址：广州市天河区马场路 26 号广发证券大厦 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 住所：广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街 2 号 618 室 法定代表人：林传辉

		<p>联系人：陈姗姗  电话：（020）66338888  客服电话：95575 或致电各地营业网点  网址：<a href="http://www.gf.com.cn">http://www.gf.com.cn</a></p>
69	中信证券股份有限公司	<p>办公地址：深圳市福田区中心三路8号中信证券大厦；北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦  注册地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座  住所：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座  法定代表人：张佑君  联系人：王一通  电话：010-60838888  客服电话：95558  网址：<a href="http://www.citics.com">http://www.citics.com</a></p>
70	海通证券股份有限公司	<p>办公地址：上海市黄浦区中山南路888号海通外滩金融广场  注册地址：上海市黄浦区广东路689号  住所：上海市黄浦区广东路689号  法定代表人：周杰  联系人：张家瑞  电话：021-23185429  传真：021-63809892  客服电话：95553 或拨打各城市营业网点咨询电话  网址：<a href="http://www.htsec.com">http://www.htsec.com</a></p>
71	申万宏源证券有限公司	<p>注册地址，办公地址：上海市徐汇区长乐路989号45层  住所：上海市徐汇区长乐路989号45层  法定代表人：杨玉成  联系人：王昊洋  电话：021-33389888  传真：021-33388224  客服电话：95523 或 4008895523  网址：<a href="http://www.swhysc.com">http://www.swhysc.com</a></p>
72	兴业证券股份有限公司	<p>注册地址，办公地址：福建省福州市湖东路268号  住所：福建省福州市湖东路268号  法定代表人：杨华辉  联系人：乔琳雪  电话：021-38565547  客服电话：95562  网址：<a href="http://www.xyzq.com.cn">http://www.xyzq.com.cn</a></p>
73	长江证券股份有限公司	<p>注册地址，办公地址：湖北省武汉市江汉区淮海</p>

		<p>路 88 号 住所：湖北省武汉市江汉区淮海路 88 号 法定代表人：金才玖 联系人：奚博宇 电话：027-65799999 传真：027-85481900 客服电话：95579 或 4008-888-999 网址：<a href="http://www.95579.com">http://www.95579.com</a></p>
74	国投证券股份有限公司	<p>注册地址，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 住所：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：彭洁联 电话：0755-81682531 客服电话：95517 或 4008-001-001 网址：<a href="http://www.essence.com.cn">http://www.essence.com.cn</a></p>
75	华泰证券股份有限公司	<p>注册地址，办公地址：江苏省南京市江东中路 228 号华泰证券广场 住所：江苏省南京市江东中路 228 号华泰证券广场 法定代表人：张伟 联系人：郭力铭 电话：18936886079 客服电话：95597 网址：<a href="http://www.htsc.com.cn/">http://www.htsc.com.cn/</a></p>
76	中信证券(山东)有限责任公司	<p>办公地址：青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座 注册地址：青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001 住所：青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001 法定代表人：肖海峰 联系人：赵如意 电话：0532-85725062 客服电话：95548 网址：<a href="http://sd.citics.com">http://sd.citics.com</a></p>
77	东吴证券股份有限公司	<p>注册地址，办公地址：江苏省苏州市工业园区星阳街 5 号 住所：江苏省苏州市工业园区星阳街 5 号 法定代表人：范力 联系人：陆晓 电话：0512-52938521 传真：0512-62938527 客服电话：95330</p>



		网址： <a href="http://www.dwzq.com.cn">http://www.dwzq.com.cn</a>
78	光大证券股份有限公司	注册地址，办公地址：上海市静安区新闻路1508号 住所：上海市静安区新闻路1508号 法定代表人：刘秋明 联系人：郁疆 客服电话：95525 网址： <a href="http://www.ebscn.com">http://www.ebscn.com</a>
79	中信证券华南股份有限公司	注册地址，办公地址：广州市天河区临江大道395号901室1001室 住所：广州市天河区临江大道395号901室1001室 法定代表人：陈可可 联系人：郭杏燕 电话：020-88834787 客服电话：95548 网址： <a href="http://www.gzs.com.cn">http://www.gzs.com.cn</a>
80	东莞证券股份有限公司	办公地址：广东省东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼 注册地址：东莞市莞城区可园南路一号 住所：东莞市莞城区可园南路一号 法定代表人：陈照星 联系人：梁微 电话：0769-22115712 客服电话：95328 网址： <a href="http://www.dgzq.com.cn/">http://www.dgzq.com.cn/</a>
81	东海证券股份有限公司	办公地址：上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦 注册地址：江苏省常州市延陵西路23号投资广场18层 住所：江苏省常州市延陵西路23号投资广场18层 法定代表人：王文卓 联系人：王一彦 电话：(021)20333333 传真：021-50498825 客服电话：95531;400-8888-588 网址： <a href="http://www.longone.com.cn">http://www.longone.com.cn</a>
82	华西证券股份有限公司	注册地址，办公地址：四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦 住所：四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦 法定代表人：杨炯洋 联系人：赵静静

		<p>电话：010-58124967  客服电话：028-86150207  网址：<a href="http://www.hx168.com.cn">http://www.hx168.com.cn</a></p>
83	申万宏源西部证券有限公司	<p>注册地址，办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室  住所：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室  法定代表人：王献军  联系人：王昊洋  电话：021-33389888  传真：021-33388224  客服电话：95523 或 4008895523  网址：<a href="http://www.swhysc.com">www.swhysc.com</a></p>
84	中泰证券股份有限公司	<p>注册地址，办公地址：山东省济南市市中区经七路86号  住所：山东省济南市市中区经七路86号  法定代表人：王洪  联系人：张峰源  电话：021-20315719  客服电话：95538  网址：<a href="http://www.zts.com.cn">http://www.zts.com.cn</a></p>
85	中航证券有限公司	<p>办公地址：北京市朝阳区望京东园四区2号中航产融大厦35层  注册地址：江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号南昌国际金融大厦A栋41层  住所：江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号南昌国际金融大厦A栋41层  法定代表人：戚侠  联系人：孙健  客服电话：95335  网址：<a href="http://avicsec.com/main/home/index.shtml">http://avicsec.com/main/home/index.shtml</a></p>
86	西部证券股份有限公司	<p>注册地址，办公地址：陕西省西安市新城区东大街319号8幢10000室  住所：陕西省西安市新城区东大街319号8幢10000室  法定代表人：徐朝晖  联系人：梁承华  电话：(029)87416168  传真：(029)87406710  客服电话：95582  网址：<a href="http://www.west95582.com">http://www.west95582.com</a></p>
87	华鑫证券有限责任公司	<p>办公地址：上海市徐汇区宛平南路8号  注册地址：深圳市福田区香蜜湖街道东海社区深</p>

		<p>南大道 7888 号东海国际中心一期 A 栋 2301A 住所：深圳市福田区香蜜湖街道东海社区深南大道 7888 号东海国际中心一期 A 栋 2301A 法定代表人：俞洋 联系人：刘熠 电话：021-64339000 客服电话：95323，4001099918（全国） 网址：<a href="http://www.cfsc.com.cn">http://www.cfsc.com.cn</a></p>
88	中国中金财富证券有限公司	<p>办公地址：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 18-21 层及第 04 层 注册地址：深圳市南山区粤海街道海珠社区科苑南路 2666 号中国华润大厦 L4601-L4608 住所：深圳市南山区粤海街道海珠社区科苑南路 2666 号中国华润大厦 L4601-L4608 法定代表人：高涛 联系人：陈梓基 客服电话：95532 网址：<a href="https://www.ciccwm.com/ciccwmweb/">https://www.ciccwm.com/ciccwmweb/</a></p>
89	东方财富证券股份有限公司	<p>办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号东方财富大厦 注册地址：西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城 10 栋楼 住所：西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城 10 栋楼 法定代表人：戴彦 联系人：陈亚男 电话：021-23586583 传真：021-23586789 客服电话：95357 网址：<a href="http://www.18.cn">http://www.18.cn</a></p>
90	国金证券股份有限公司	<p>办公地址：上海市浦东新区芳甸路 1088 号 7 楼 注册地址：成都市青羊区东城根上街 95 号 住所：成都市青羊区东城根上街 95 号 法定代表人：冉云 联系人：郭元媛 电话：15690849268 客服电话：95310 网址：<a href="http://www.gjq.com.cn">http://www.gjq.com.cn</a></p>
91	华宝证券股份有限公司	<p>注册地址，办公地址：中国(上海)自由贸易试验区浦电路 370 号 2、3、4 层 住所：中国(上海)自由贸易试验区浦电路 370 号 2、3、4 层 法定代表人：刘加海 联系人：夏元</p>

		<p>电话：(021) 68777222          传真：(021) 68777822          客服电话：4008209898          网址：<a href="http://www.cnhbstock.com">http://www.cnhbstock.com</a></p>
92	天风证券股份有限公司	<p>办公地址：湖北省武汉市武昌区中北路217号天风大厦2号楼25层          注册地址：湖北省武汉市东湖新技术开发区高新大道446号天风证券大厦20层          住所：湖北省武汉市东湖新技术开发区高新大道446号天风证券大厦20层          法定代表人：余磊          联系人：诸培宁          电话：027-87618867          传真：027-87618863          客服电话：95391;4008005000          网址：<a href="http://www.tfzq.com">http://www.tfzq.com</a></p>
93	湘财证券股份有限公司	<p>办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路958号华能联合大厦5楼          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          住所：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          法定代表人：高振营          联系人：江恩前          电话：(021)38784580          客服电话：95351          网址：<a href="http://www.xcsc.com">http://www.xcsc.com</a></p>
94	大同证券有限责任公司	<p>办公地址：山西省太原市小店区长治路世贸中心12层          注册地址：山西省大同市平城区迎宾街15号桐城中央21层          住所：山西省大同市平城区迎宾街15号桐城中央21层          法定代表人：董祥          联系人：纪肖峰          电话：0351-7219280          传真：0351-4137986          客服电话：4007121212          网址：<a href="http://www.dtsbc.com.cn">http://www.dtsbc.com.cn</a></p>
95	第一创业证券股份有限公司	<p>注册地址，办公地址：深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼          住所：深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼          法定代表人：吴礼顺</p>

		<p>联系人：王雯  电话：0755-23838752  客服电话：95358  网址：<a href="http://www.firstcapital.com.cn">http://www.firstcapital.com.cn</a></p>
96	金元证券股份有限公司	<p>办公地址：海口市南宝路36号证券大厦4楼  注册地址：海口市南宝路36号证券大厦4楼  住所：海口市南宝路36号证券大厦4楼  法定代表人：王作义  联系人：唐乙丹  客服电话：400-8888-228  网址：<a href="http://www.jyzq.cn">http://www.jyzq.cn</a></p>
97	华龙证券股份有限公司	<p>办公地址：甘肃省兰州市城关区东岗西路638号兰州财富中心19楼  注册地址：甘肃省兰州市东岗西路638号兰州财富中心21楼  住所：甘肃省兰州市东岗西路638号兰州财富中心21楼  法定代表人：祁建邦  联系人：周鑫  电话：0931-4890208  客服电话：95368  网址：<a href="http://www.hlzq.com/">http://www.hlzq.com/</a></p>
98	国融证券股份有限公司	<p>办公地址：北京市西城区闹市口大街1号长安兴融中心西楼11层  注册地址：内蒙古自治区呼和浩特市武川县腾飞大道1号4楼  住所：内蒙古自治区呼和浩特市武川县腾飞大道1号4楼  法定代表人：张智河  联系人：胡俊珂  电话：83991462  客服电话：95385  网址：<a href="http://www.grzq.com">http://www.grzq.com</a></p>
99	粤开证券股份有限公司	<p>办公地址：广州市黄埔区科学大道60号开发区控股中心19、21、22、23层  注册地址：广东省广州市黄埔区科学大道60号开发区控股中心19、21、22、23层  住所：广东省广州市黄埔区科学大道60号开发区控股中心19、21、22、23层  法定代表人：严亦斌  联系人：彭莲  电话：0755-83331195  客服电话：95564  网址：<a href="http://www.ykzq.com/">http://www.ykzq.com/</a></p>

100	长城国瑞证券有限公司	<p>注册地址，办公地址：厦门市思明区莲前西路2号莲富大厦17楼</p> <p>住所：厦门市思明区莲前西路2号莲富大厦17楼</p> <p>法定代表人：李鹏</p> <p>联系人：陈月月</p> <p>电话：0592-2079658</p> <p>客服电话：400-0099-886</p> <p>网址：<a href="http://www.gwgsc.com">http://www.gwgsc.com</a></p>
101	联储证券股份有限公司	<p>办公地址：北京市朝阳区安定路5号院3号楼中建财富国际中心27层</p> <p>注册地址：山东省青岛市崂山区香港东路195号8号楼15层</p> <p>住所：山东省青岛市崂山区香港东路195号8号楼15层</p> <p>法定代表人：吕春卫</p> <p>联系人：陈茜</p> <p>电话：010-86499838</p> <p>传真：010-86499401</p> <p>客服电话：021-80295794;0755-36991988</p> <p>网址：<a href="http://www.lczq.com/">http://www.lczq.com/</a></p>
102	中信期货有限公司	<p>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1303-1305室、14层</p> <p>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13层1301-1305、14层</p> <p>住所：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13层1301-1305、14层</p> <p>法定代表人：张皓</p> <p>联系人：梁美娜</p> <p>传真：021-60819988</p> <p>客服电话：400-990-8826</p> <p>网址：<a href="http://www.citicsf.com/">http://www.citicsf.com/</a></p>
103	上海证券有限责任公司	<p>注册地址，办公地址：上海市黄浦区四川中路213号7楼</p> <p>住所：上海市黄浦区四川中路213号7楼</p> <p>法定代表人：何伟</p> <p>联系人：邵珍珍</p> <p>电话：(021)53686888</p> <p>传真：(021)53686100-7008</p> <p>客服电话：4008918918</p> <p>网址：<a href="http://www.shzq.com">http://www.shzq.com</a></p>
104	国都证券股份有限公司	<p>注册地址，办公地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层</p> <p>住所：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层</p>

		<p>法定代表人：翁振杰  联系人：张晖  电话：010-87413731  客服电话：400-818-8118  网址：<a href="http://www.guodu.com">http://www.guodu.com</a></p>
105	恒泰证券股份有限公司	<p>注册地址，办公地址：内蒙古自治区呼和浩特市新城区海拉尔东街满世尚都办公商业综合楼  住所：内蒙古自治区呼和浩特市新城区海拉尔东街满世尚都办公商业综合楼  法定代表人：祝艳辉  联系人：阴冠华  电话：010-83270885  客服电话：4001966188  网址：<a href="http://www.cnht.com.cn">http://www.cnht.com.cn</a></p>
106	江海证券有限公司	<p>办公地址：哈尔滨市松北区创新三路 833 号  注册地址：哈尔滨市香坊区赣水路 56 号  住所：哈尔滨市香坊区赣水路 56 号  法定代表人：赵洪波  联系人：周俊  客服电话：956007  网址：<a href="http://www.jhzq.com.cn/">http://www.jhzq.com.cn/</a></p>
107	银泰证券有限责任公司	<p>注册地址，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 18 楼  住所：深圳市福田区竹子林四路紫竹七道 18 号光大银行 18 楼  法定代表人：刘强  联系人：刘翠玲  客服电话：95341  网址：<a href="http://www.ytzq.com/">http://www.ytzq.com/</a></p>
108	开源证券股份有限公司	<p>注册地址，办公地址：陕西省西安市高新区锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层  住所：陕西省西安市高新区锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层  法定代表人：李刚  联系人：张蕊  传真：029-88365835  客服电话：95325  网址：<a href="http://www.kysec.cn">http://www.kysec.cn</a></p>
109	深圳市新兰德证券投资咨询有限公司	<p>办公地址：北京市丰台区丽泽平安幸福中心 B 座 31 层  注册地址：深圳市福田区梅林街道梅都社区中康路 136 号深圳新一代产业园 2 栋 3401  住所：深圳市福田区梅林街道梅都社区中康路</p>

		<p>136号深圳新一代产业园2栋3401          法定代表人：张斌          联系人：孙博文          电话：010-83363002          传真：010-83363072          客服电话：400-166-1188-2          网址：<a href="http://www.new-rand.cn">http://www.new-rand.cn</a></p>
110	和讯信息科技有限公司	<p>办公地址：北京市朝阳区朝阳门外泛利大厦10层          注册地址：北京市朝阳区朝外大街22号1002室          住所：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          电话：010-85657353          传真：8610-65884788          客服电话：4009200022          网址：<a href="http://licaike.hexun.com/">http://licaike.hexun.com/</a></p>
111	上海挖财基金销售有限公司	<p>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          注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路759号18层03单元          住所：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          电话：021-50810687          传真：021-58300279          客服电话：021-50810673          网址：<a href="http://www.wacaijijin.com">http://www.wacaijijin.com</a></p>
112	贵州省贵文文化基金销售有限公司	<p>办公地址：贵州省贵阳市南明区龙洞堡文化创意园CCDI大楼          注册地址：贵州省贵阳市南明区龙洞堡电子商务港太升国际A栋2单元5层17号          住所：贵州省贵阳市南明区龙洞堡电子商务港太升国际A栋2单元5层17号          法定代表人：陈成          联系人：唐宜为          电话：18616726630          客服电话：0851-85407888          网址：<a href="http://www.gwcaifu.com">http://www.gwcaifu.com</a></p>
113	腾安基金销售(深圳)有限公司	<p>办公地址：深圳市南山区海天二路33号腾讯滨海大厦15楼          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）</p>



		住所：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） 法定代表人：林海峰 联系人：谭广锋 电话：0755-86013388-80618 传真：- 客服电话：95017 网址： <a href="http://www.tenganxinxi.com">http://www.tenganxinxi.com</a> 或 <a href="http://www.txfund.com">http://www.txfund.com</a>
114	北京百度百盈基金销售有限公司	办公地址：北京市海淀区西北旺东路10号院西区4号楼 注册地址：北京市海淀区西北旺东路10号院西区4号楼1层103室 住所：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：林天赐 电话：010-59403028 传真：010-59403027 客服电话：95055 网址： <a href="http://www.duxiaomanfund.com">http://www.duxiaomanfund.com</a>
115	上海天天基金销售有限公司	办公地址：上海市徐汇区宛平南路88号金座 注册地址：上海市徐汇区龙田路190号2号楼二层 住所：上海市徐汇区龙田路190号2号楼二层 法定代表人：其实 联系人：潘世友 电话：95021 传真：(021) 64385308 客服电话：400-1818-188 网址： <a href="http://www.1234567.com.cn">http://www.1234567.com.cn</a>
116	蚂蚁(杭州)基金销售有限公司	办公地址：浙江省杭州市西湖区西溪路556号蚂蚁元空间 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 住所：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 法定代表人：王珺 联系人：韩爱彬 电话：021-60897840 传真：0571-26697013 客服电话：95188-8 网址： <a href="http://www.antfortune.com">www.antfortune.com</a>
117	浙江同花顺基金销售有限公司	办公地址：浙江省杭州市余杭区同顺街18号同花

		<p>顺大厦  注册地址：浙江省杭州市文二西路1号903室  住所：浙江省杭州市文二西路1号903室  法定代表人：吴强  联系人：林海明  电话：0571-88920897  传真：0571-86800423  客服电话：952555  网址：<a href="http://www.5ifund.com">http://www.5ifund.com</a></p>
118	泛华普益基金销售有限公司	<p>办公地址：四川省成都市成华区建设路9号高地中心1101室  注册地址：成都市成华区建设路9号高地中心1101室  住所：成都市成华区建设路9号高地中心1101室  法定代表人：杨远芬  联系人：史若芬  电话：028-86645380  传真：028-82000996-805  客服电话：400-080-3388  网址：<a href="https://www.puyifund.com">https://www.puyifund.com</a></p>
119	南京苏宁基金销售有限公司	<p>注册地址，办公地址：南京市玄武区苏宁大道1-5号  住所：南京市玄武区苏宁大道1-5号  法定代表人：钱燕飞  联系人：冯鹏鹏  电话：025-66996699-887226  传真：025-66996699-887226  客服电话：95177  网址：<a href="http://www.snjjjin.com/">http://www.snjjjin.com/</a></p>
120	上海大智慧基金销售有限公司	<p>注册地址，办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102单元  住所：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102单元  法定代表人：张俊  联系人：张蜓  电话：021-20219988-37492  传真：021-20219923  客服电话：021-20292031  网址：<a href="https://www.wg.com.cn/">https://www.wg.com.cn/</a></p>
121	北京新浪仓石基金销售有限公司	<p>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7层  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</p>

		住所：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2 地块新浪总部科研楼 5 层 518 室 法定代表人：李柳娜 联系人：邵文静 电话：010-62675768 传真：010-62676582 客服电话：010-6267 5369 网址：www.xincai.com
122	上海万得基金销售有限公司	办公地址：上海市浦东新区浦明路 1500 号万得大厦 11 楼 注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座 住所：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座 法定代表人：黄玮 联系人：徐亚丹 电话：021-68882280 传真：021-68882281 客服电话：400-799-1888 网址： <a href="https://www.520fund.com.cn/">https://www.520fund.com.cn/</a>
123	上海陆金所基金销售有限公司	办公地址：上海市浦东新区源深路 1088 号平安财富大厦 7 楼 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） 住所：中国（上海）自由贸易试验区源深路 1088 号 7 层（实际楼层 6 层） 法定代表人：陈祎彬 联系人：汤艳丽 电话：021-20665952 传真：021-22066653 客服电话：4008219031 网址： <a href="http://www.lufunds.com">http://www.lufunds.com</a>
124	珠海盈米基金销售有限公司	注册地址，办公地址：珠海市横琴新区环岛东路 3000 号 2719 室 住所：珠海市横琴新区环岛东路 3000 号 2719 室 法定代表人：肖雯 联系人：邱湘湘 电话：020-89629019 传真：020-89629011 客服电话：020-89629099 网址： <a href="http://www.yingmi.com">http://www.yingmi.com</a>
125	和耕传承基金销售有限公司	注册地址，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

		住所：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：高培 电话：0371-85518395 传真：0371-85518397 客服电话：4000-555-671 网址： <a href="https://www.hgccpb.com/">https://www.hgccpb.com/</a>
126	京东肯特瑞基金销售有限公司	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 注册地址：北京市海淀区知春路76号（写字楼）1号楼4层1-7-2 住所：北京市海淀区知春路76号（写字楼）1号楼4层1-7-2 法定代表人：邹保威 联系人：李丹 电话：4000988511 传真：010-89188000 客服电话：010-89187658 网址： <a href="http://kenterui.jd.com">kenterui.jd.com</a>
127	北京雪球基金销售有限公司	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 注册地址：北京市朝阳区创远路34号院6号楼15层1501室 住所：北京市朝阳区创远路34号院6号楼15层1501室 法定代表人：李楠 联系人：吴迪 电话：010-57319532 传真：010-61840699 客服电话：400-159-9288 网址： <a href="https://danjuanfunds.com/">https://danjuanfunds.com/</a>
128	深圳市前海排排网基金销售有限责任公司	办公地址：深圳市福田区新洲南路2008号新洲同创汇3层D303号 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） 住所：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） 法定代表人：杨柳 联系人：周圆圆 电话：400-666-7388 传真：400-666-7388 客服电话：400-666-7388

		网址： <a href="http://ppwfund.com">ppwfund.com</a>
129	华瑞保险销售有限公司	办公地址：上海市浦东新区向城路288号8楼 注册地址：上海市嘉定区南翔镇众仁路399号运通星财富广场1号楼B座13、14层 住所：上海市嘉定区南翔镇众仁路399号运通星财富广场1号楼B座13、14层 法定代表人：杨新章 联系人：张爽爽 电话：021-68595976 传真：021-68595766 客服电话：952303 网址： <a href="http://www.huaruisales.com">http://www.huaruisales.com</a>
130	玄元保险代理有限公司	注册地址，办公地址：中国（上海）自由贸易试验区张杨路707号1105室 住所：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：姜帅伯 电话：021-50701003 传真：021-50701053 客服电话：021-50701003 网址： <a href="http://www.licaimofang.com">www.licaimofang.com</a>
131	深圳前海微众银行股份有限公司	办公地址：广东省深圳市南山区沙河西路1819号深圳湾科技生态园7栋A座 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） 住所：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） 法定代表人：顾敏 联系人：邹榆 电话：95384 传真：0755-86700688 客服电话：95384 网址： <a href="http://www.webank.com/">http://www.webank.com/</a>

## （二）登记机构

名称	嘉实基金管理有限公司
住所	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1318号1806A单元
办公地址	北京市朝阳区建国门外大街21号北京国际俱乐部C座写字楼12A层

法定代表人	经雷
联系人	梁凯
电话	(010) 65215588
传真	(010) 65185678

（三） 出具法律意见书的律师事务所

名称	上海源泰律师事务所		
住所、办公地址	上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼		
负责人	廖海	联系人	刘佳
电话	(021) 51150298	传真	(021) 51150398
经办律师	廖海、刘佳		

（四） 审计基金财产的会计师事务所

名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）		
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 507 单元 01 室		
办公地址	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场二座普华永道中心 11 楼		
法定代表人	李丹	联系人	张勇
电话	(010) 65338888	传真	(010) 65338800
经办注册会计师	张勇，柴瀚英		

## 六、基金的募集

### （一）基金募集的依据

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定募集。本基金募集申请已经中国证监会2019年8月14日证监许可[1507]号文注册。

### （二）基金类型和存续期间

- 1、基金的类别：混合型证券投资基金。
- 2、基金的运作方式：契约型开放式。
- 3、基金存续期间：不定期。

### （三）基金份额的类别

在不违反法律法规规定且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人与基金托管人协商一致后可根据基金发展需要，为本基金增设新的基金份额类别。新的份额类别可设置不同的申购费、赎回费及销售服务费，而无需召开基金份额持有人大会，基金管理人应在增加新的基金份额类别实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

### （四）基金份额的募集期限、募集方式及场所、募集对象、募集目标

- 1、募集期限：2019年8月26日至2019年9月6日

- 2、募集方式及场所

本基金将通过各销售机构的基金销售网点公开发售，各销售机构的具体名单见基金份额发售公告以及基金管理人届时发布的调整销售机构的相关公告。

- 3、募集对象

符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。

- 4、募集目标

本基金不设募集目标。

### （五）基金的认购

- 1、认购程序：投资者认购时间安排、认购时应提交的文件和办理的手续，详见本基金的份额发售公告。

- 2、本基金认购费率按照认购金额递减，即认购金额越大，所适用的认购费率越低。投

投资者在一天之内如果有多笔认购，适用费率按单笔分别计算。具体认购费率如下：

投资者在认购基金份额时需交纳前端认购费，费率按认购金额递减，具体如下：

认购金额（含认购费）	认购费率
M < 100 万元	1.2%
100 万元 ≤ M < 300 万元	0.8%
300 万元 ≤ M < 500 万元	0.5%
M ≥ 500 万元	按笔收取，1000 元/笔

本基金的认购费用由投资者承担，不列入基金资产，认购费用用于本基金的市场推广、销售、注册登记等募集期间发生的各项费用。

### 3、募集期利息的处理方式

有效认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有，其中利息转份额的数量以登记机构的记录为准。

### 4、认购份额的计算

本基金每份基金份额的初始面值均为人民币 1 元。

认购份数的计算方法如下：

① 认购费用适用比例费率时，认购份额的计算方法如下：

$$\text{净认购金额} = \text{认购金额} / (1 + \text{认购费率})$$

$$\text{认购费用} = \text{认购金额} - \text{净认购金额}$$

$$\text{认购份额} = (\text{净认购金额} + \text{认购资金利息}) / 1 \text{ 元}$$

② 认购费用为固定金额时，认购份额的计算方法如下：

$$\text{认购费用} = \text{固定金额}$$

$$\text{净认购金额} = \text{认购金额} - \text{认购费用}$$

$$\text{认购份额} = (\text{净认购金额} + \text{认购资金利息}) / 1 \text{ 元}$$

其中：认购份额的计算按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

例：某投资人投资 100,000.00 元认购本基金，认购费率为 1.2%，假定募集期产生的利息为 50.50 元，则可认购基金份额的份额为：

$$\text{净认购金额} = 100,000.00 / (1 + 1.2\%) = 98,814.23 \text{ 元}$$

$$\text{认购费用} = 100,000.00 - 98,814.23 = 1185.77 \text{ 元}$$



认购份额= (98,814.23+50.50) /1=98,864.73 份

即：该投资人投资 100,000.00 元认购本基金，募集期产生的利息为 50.50 元，可得 98,864.73 份基金份额。

#### 5、募集资金

基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。

## 七、基金合同的生效

### （一）基金合同生效

本基金基金合同于 2019 年 9 月 10 日正式生效，自该日起本基金管理人开始管理本基金。

### （二）基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

《基金合同》生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人经与基金托管人协商一致，可对本基金进行清算，终止《基金合同》，无需召开基金份额持有人大会进行表决。

法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

## 八、基金份额的申购与赎回

### （一）申购和赎回场所

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

### （二）申购和赎回的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，若该工作日为非港股通交易日，则本基金不开放申购与赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

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

#### 2、申购、赎回开始日及业务办理时间

本基金自2019年11月11日起办理申购与赎回业务。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请，登记机构有权拒绝，如登记机构确认接收的，视为投资人在下一开放日提出的申购、赎回或转换申请，并按照下一开放日的申请处理。

### （三）申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算；

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；

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

5、办理申购、赎回业务时，应当遵循基金份额持有人利益优先原则，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待。

基金管理人可在法律法规允许的情况下，对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

### （四）申购与赎回的程序

### 1、申购和赎回的申请方式

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

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

### 2、申购和赎回的款项支付

投资人申购基金份额时，必须在规定的时间内全额交付申购款项，投资人交付申购款项，申购成立。

基金份额持有人的赎回申请确认成功后，基金管理人将在T+7日(包括该日)内支付赎回款项。遇证券/期货交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障等非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程时，赎回款项的支付相应顺延至该影响因素消除的下一个工作日。在发生巨额赎回或本基金合同载明的其他暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付办法参照本基金合同有关条款处理。

### 3、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T日)，在正常情况下，本基金登记机构在T+1日内对该交易的有效性进行确认。投资人向销售机构交付申购款项，申购成立，投资人向销售机构递交赎回申请，赎回成立；本基金登记机构确认申购或赎回的，申购或赎回生效。T日提交的有效申请，投资人应在T+2日后(包括该日)及时到办理申购、赎回或其他基金业务的销售机构营业网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功，则申购款项(无利息)退还给投资人。

销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购、赎回的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资者应及时查询。

### 4、如未来法律法规或监管机构对上述内容另有规定，从其规定。

在法律法规允许的范围内，本基金登记机构可根据相关业务规则，对上述业务办理时间进行调整，本基金管理人将于开始实施前按照有关规定予以公告。

#### (五) 申购和赎回的数量限制

##### 1、申请申购基金的金额

投资者通过嘉实基金管理有限公司网上直销或非直销销售机构首次申购单笔最低限额为人民币1元(含申购费)，追加申购单笔最低限额为人民币1元(含申购费)；投资者通过直销中心柜台首次申购单笔最低限额为人民币20,000元(含申购费)，追加申购单笔最低限额为人民币1元(含申购费)。各销售机构对本基金的具体申购最低限额及交易级差有其他规定的，以各销售机构规定为准。

投资者可多次申购，对单个投资者累计持有份额不设上限限制，但单一投资者累计持有份额不得达到或者超过本基金总份额的50%，且不得变相规避50%集中度要求。法律法规、中国证监会或基金合同另有规定的除外。

## 2、申请赎回基金的份额

投资者通过嘉实基金管理有限公司网上直销或非直销销售机构赎回本基金份额时，可申请将其持有的部分或全部基金份额赎回；单笔赎回不得少于1份，每个基金交易账户最低持有基金份额余额为1份，若某笔赎回导致某一销售机构的某一基金交易账户的基金份额余额少于1份时，基金管理人有权将投资者在该销售机构的某一基金交易账户剩余基金份额一次性全部赎回。各销售机构对本基金的具体赎回份额限制有其他规定的，以各销售机构规定为准。

3、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。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。具体见基金管理人相关公告。

4、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。

## （六）申购、赎回的费率

1、本基金采用前端收费模式收取基金申购费用。投资者在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。具体如下：

申购金额（含申购费）	申购费率
M<100 万元	1.5%
100 万元≤M<300 万元	1.0%
300 万元≤M<500 万元	0.6%
M≥500 万元	按笔收取，单笔 1000 元

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

个人投资者通过本基金管理人直销网上交易系统申购本基金业务实行申购费率优惠，其申购费率不按申购金额分档，统一优惠为申购金额的0.6%，但中国银行长城借记卡持卡人，申购本基金的申购费率优惠按照相关公告规定的费率执行；机构投资者通过本基金管理人直销网上交易系统申购本基金，其申购费率不按申购金额分档，统一优惠为申购金额的0.6%。优惠后费率如果低于0.6%，则按0.6%执行。基金招募说明书及相关公告规

定的相应申购费率低于0.6%时，按实际费率收取申购费。个人投资者于本公司网上直销系统通过汇款方式申购本基金的，前端申购费率按照相关公告规定的优惠费率执行。

2020年4月2日，本基金管理人发布了《关于面向养老金客户实施特定申购费率的公告》，自2020年4月3日起，对通过本公司直销中心（包括直销中心柜台及网上直销）申购本基金的养老金客户实施特定申购费率：通过公司直销中心申购本基金的，适用的申购费率为对应申购金额所适用的原申购费率的10%；申购费率为固定金额的，则按原费率执行，不再享有费率折扣。其中，养老金客户包括全国社会保障基金、可以投资基金的地方社会保障基金、企业年金单一计划以及集合计划、企业年金理事会委托的特定客户资产管理计划、基本养老保险基金、符合人社部规定的养老金产品、职业年金计划、养老目标基金。如将来出现可以投资基金的住房公积金、享受税收优惠的个人养老账户、经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，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。

注：2014年9月2日，本基金管理人发布了《嘉实基金管理有限公司关于增加开通后端收费基金产品的公告》，自2019年11月11日起，增加开通本基金在本公司基金网上直销系统的后端收费模式（包括申购、定期定额投资、基金转换等业务）、并对通过本公司基金网上直销系统交易的后端收费进行费率优惠，本基金优惠后的费率见下表：

持有期限 (T)	基金网上直销 后端申购优惠费率
0<T<1年	0.20%
1年≤T<3年	0.10%
T≥3年	0.00%

本公司直销中心柜台和非直销销售机构暂不开通后端收费模式。具体请参见嘉实基金网站刊载的公告。

2、本基金对基金份额收取赎回费，在投资者赎回基金份额时收取。基金份额的赎回费率按照持有时间递减，即相关基金份额持有时间越长，所适用的赎回费率越低。

本基金的赎回费用由基金份额持有人承担。对持续持有期少于30日的投资人收取的赎回费全额计入基金财产；对持续持有期大于等于30天少于90天的投资人，赎回费总额的75%计入基金财产；对持续持有期大于等于90天少于180天的投资人，赎回费总额的50%计入基金财产；未计入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。

本基金基金份额的赎回费率具体如下：

持有期限 (N)	赎回费率
N<7天	1.5%

7天 $\leq$ N $<$ 30天	0.75%
30天 $\leq$ N $<$ 180天	0.5%
180天 $\leq$ N	0

3、基金管理人可以在法律法规和基金合同规定范围内调整申购费率、赎回费率或收费方式。费率或收费方式如发生变更，基金管理人应在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上刊登公告。

4、基金销售机构可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，定期或不定期地开展基金促销活动。

5、当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。

#### （七）申购份额、赎回金额的计算方式

##### 1、申购份额的计算

（1）当投资者选择申购基金份额时，申购份额的计算方法如下：

①申购费用适用比例费率时，申购份额的计算方法如下：

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

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

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

②申购费用为固定金额时，申购份额的计算方法如下：

$$\text{申购费用} = \text{固定金额}$$

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

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

（2）申购份额的计算按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

例一：某投资者投资100,000元申购基金份额，其对应申购费率为1.50%，假设申购当日基金份额净值为1.6280元，则其可得到的申购份额计算如下：

$$\text{净申购金额} = 100,000 / (1 + 1.50\%) = 98,522.17 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 100,000 - 98,522.17 = 1,477.83 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 98,522.17 / 1.6280 = 60,517.30 \text{ 份}$$

即投资者投资100,000元申购基金份额，假设申购当日基金份额净值为1.6280元，则可得60,517.30份基金份额。

##### 2、基金赎回金额的计算

本基金的赎回采用“份额赎回”方式，赎回价格以T日的基金份额净值为基准进行计算，本基金的赎回金额为赎回总额扣减赎回费用。

（1）当投资者赎回基金份额时，赎回金额的计算方法如下：

赎回总额=赎回份额×T日基金份额净值

赎回费用=赎回总额×赎回费率

赎回金额=赎回总额-赎回费用

（2）赎回金额计算按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

例二：某投资人赎回本基金 50,000.00 份基金份额，假设赎回当日基金份额净值 1.2500 元，假设持有时间对应的赎回费率为 0.75%，则其获得的赎回金额计算如下：

赎回金额=50,000.00×1.2500=62,500.00 元

赎回费用=62,500.00×0.75%=468.75 元

净赎回金额=62,500.00-468.75=62,031.25 元

即投资人赎回本基金 50,000.00 份基金份额，假设赎回当日基金份额净值 1.2500 元，假设持有时间对应的赎回费率为 0.75%，则其获得的净赎回金额为 62,031.25 元。

（八）拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

- 1、因不可抗力导致基金无法正常运转。
- 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值的情况。
- 3、证券、期货交易所或外汇市场交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值或者无法办理申购业务。
- 4、接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。
- 5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或发生其他损害现有基金份额持有人利益的情形。
- 6、基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术故障等异常情况导致基金销售系统或基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。
- 7、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。
- 8、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过 50%，或者变相规避 50%集中度的情形。
- 9、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第 1、2、3、5、6、7、9 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受基金投资者的申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的，被拒绝的申购款项（无利息）将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。



#### （九）暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

- 1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。
- 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值的情况。
- 3、证券/期货交易所或外汇市场交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值或者无法办理赎回业务。
- 4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。
- 5、本基金资产组合中的重要部分发生暂停交易或其他重大事件，继续接受赎回会影响或损害基金份额持有人利益时。
- 6、发生继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时，基金管理人可暂停接受基金份额持有人的赎回申请。
- 7、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，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请。
- 8、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形（第 4 项除外）之一且基金管理人决定暂停接受基金份额持有人的赎回申请或延缓支付赎回款项时，基金管理人应及时报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。若出现上述第 4 项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理，并对恢复赎回业务予以公告。

#### （十）巨额赎回的情形及处理方式

##### 1、巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过前一工作日的基金总份额的 10%，即认为是发生了巨额赎回。

##### 2、巨额赎回的处理方式

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

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

（2）部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的全部赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理

人在当日接受赎回比例不低于上一工作日基金总份额的 10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

若基金发生巨额赎回且基金管理人决定部分延期赎回并在当日接受赎回比例不低于上一工作日基金总份额 10%的前提下，如出现单个基金份额持有人超过前一工作日基金总份额 20%的赎回申请（“大额赎回申请人”）的，基金管理人有权按照优先确认其他赎回申请人（“小额赎回申请人”）赎回申请的原则，对当日的赎回申请按照以下原则办理：如小额赎回申请人的赎回申请在当日被全部确认，则在仍可接受赎回申请的范围内对大额赎回申请人的赎回申请按比例（单个大额赎回申请人的赎回申请量/当日大额赎回申请总量）确认，对大额赎回申请人未予确认的赎回申请延期办理；如小额赎回申请人的赎回申请在当日不能被全部确认，则按照单个小额赎回申请人的赎回申请量占当日小额赎回申请总量的比例，确认其当日受理的赎回申请量，对当日全部未确认的赎回申请（含小额赎回申请人的其余赎回申请与大额赎回申请人的全部赎回申请）延期办理。延期办理的具体程序，按照本条规定的延期赎回或取消赎回的方式办理；同时，基金管理人应当对延期办理的事宜在指定媒介上刊登公告。

（3）暂停赎回：连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒介上进行公告。

### 3、巨额赎回的公告

当发生上述巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当通过公告、邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，并在 2 日内在指定媒介上刊登公告。

#### （十一）暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

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

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

3、若暂停时间超过 1 日，基金管理人可以根据《信息披露办法》自行确定公告的增加次数，但基金管理人须依照《信息披露办法》，最迟于重新开放日在指定媒介上刊登重新开

放申购或赎回的公告，或根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间，届时可不再另行发布重新开放的公告。

## （十二） 基金转换

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

本基金自2019年11月11日开始办理基金份额转换业务。本基金在开放日办理基金份额的转换，若该工作日为非港股通交易日，则本基金不开放转换，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回、转换业务时除外。

### 1、可转换基金

本基金开通与嘉实旗下其它开放式基金（由同一注册登记机构办理注册登记的、且已公告开通基金转换业务）之间的转换业务，各基金转换业务的开放状态、交易限制及转换名单可从各基金相关公告或嘉实官网基金详情页面进行查询。

### 2、基金转换费用

本基金转换费用由转出基金赎回费用及基金申购补差费用构成：

#### （1）通过非直销销售机构办理基金转换业务（“前端转前端”的模式）

转出基金有赎回费用的，收取该基金的赎回费用。从低申购费用基金向高申购费用基金转换时，每次收取申购补差费用；从高申购费用基金向低申购费用基金转换时，不收取申购补差费用。申购补差费用按照转换金额对应的转出基金与转入基金的申购费用差额进行补差。

#### （2）通过直销（直销柜台及网上直销）办理基金转换业务（“前端转前端”的模式）

转出基金有赎回费用的，收取该基金的赎回费用。从0申购费用基金向非0申购费用基金转换时，每次按照非0申购费用基金申购费用收取申购补差费；非0申购费用基金互转时，不收取申购补差费用。

通过网上直销办理转换业务的，转入基金适用的申购费率比照该基金网上直销相应优惠费率执行。

#### （3）通过网上直销系统办理基金转换业务（“后端转后端”模式）

（a）若转出基金有赎回费，则仅收取转出基金的赎回费；

（b）若转出基金无赎回费，则不收取转换费用。

#### （4）基金转换份额的计算

基金转换采取未知价法，以申请当日基金份额净值为基础计算。计算公式如下：

转出基金金额=转出份额×转出基金当日基金份额净值

转出基金赎回费用=转出基金金额×转出基金赎回费率

转出基金申购费用=(转出基金金额-转出基金赎回费用)×转出基金申购费率÷(1+转出基金申购费率)

转入基金申购费用=(转出基金金额-转出基金赎回费用)×转入基金申购费率÷(1+转入基金申购费率)

申购补差费用=MAX(0, 转入基金申购费用-转出基金申购费用)

转换费用=转出基金赎回费用+申购补差费用

净转入金额=转出基金金额-转换费用

转入份额=净转入金额/转入基金当日基金份额净值

转出基金有赎回费用的,收取的赎回费归入基金财产的比例不得低于法律法规、中国证监会规定的比例下限以及该基金基金合同的相关约定。

### 3、其他与转换相关的事项

(1) 基金转换的时间: 投资者需在转出基金和转入基金均有交易的当日, 方可办理基金转换业务。

(2) 基金转换的原则:

①采用份额转换原则, 即基金转换以份额申请;

②当日的转换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;

③基金转换价格以申请转换当日基金份额净值为基础计算;

④投资者可在任一同时销售拟转出基金及转入基金的销售机构处办理基金转换。基金转换只能在同一销售机构进行。转换的两只基金必须都是该销售机构代理的同一基金管理人管理的、在同一基金注册登记机构处注册的基金;

⑤基金管理人可在不损害基金份额持有人权益的情况下更改上述原则, 但应在新的原则实施前在指定媒介公告。

(3) 基金转换的程序

①基金转换的申请方式

基金投资者必须根据基金管理人和基金销售机构规定的手续, 在开放日的业务办理时间提出转换的申请。投资者提交基金转换申请时, 账户中必须有足够可用的转出基金份额余额。

②基金转换申请的确认

基金管理人应以在规定的基金业务办理时间段内收到基金转换申请的当天作为基金转换的申请日(T日), 并在T+1日对该交易的有效性进行确认。投资者可在T+2日及之后查询成交情况。

(4) 基金转换的数额限制

基金转换时，投资者通过销售机构由本基金转换到基金管理人管理的其他开放式基金时，最低转出份额以基金管理人或销售机构发布的公告为准。

基金管理人可根据市场情况制定或调整基金转换的有关限制并及时公告。

#### （5）基金转换的注册登记

投资者申请基金转换成功后，基金注册登记机构在 T+1 日为投资者办理减少转出基金份额、增加转入基金份额的权益登记手续。一般情况下，投资者自 T+2 日起有权赎回转入部分的基金份额。基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，并于开始实施前在指定媒介公告。

#### （6）基金转换与巨额赎回

当发生巨额赎回时，本基金转出与基金赎回具有相同的优先级，基金管理人可根据基金资产组合情况，决定全额转出或部分转出，并且对于本基金转出和基金赎回，将采取相同的比例确认；但基金管理人在当日接受部分转出申请的情况下，对未确认的转换申请将不予顺延。

#### （7）拒绝或暂停基金转换的情形及处理方式

①发生下列情况之一时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的转入申请：

- （a）因不可抗力导致基金无法正常工作；
- （b）发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况；
- （c）证券交易所或期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；
- （d）基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或发生其他损害现有基金份额持有人利益的情形；
- （e）基金管理人、基金托管人、销售机构、登记机构、支付结算机构等因异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系统、基金会计系统等无法正常运行；
- （f）占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转入申请；
- （g）当继续接受转入申请，可能会导致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；或使本基金单日净申购比例超过基金管理人规定的当日净申购比例上限；
- （h）基金管理人接受某笔或者某些转入申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过 50%，或者变相规避 50%集中度的情形时；
- （i）接受某笔或某些转入申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益；
- （j）当接受某笔或某些转入申请，可能会导致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；或该投资人当日转入金额超过单个投资人单日或单笔转入金额上限；

(k) 基金参与港股通交易且港股通交易每日额度不足；

(l) 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

②发生下列情形之一时，基金管理人可暂停接受投资人的转出申请或者延缓支付转出款项：

(a) 因不可抗力导致基金管理人不能支付转出款项；

(b) 发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况；

(c) 证券交易所或期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；

(d) 连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回；

(e) 本基金资产组合中的重要部分发生暂停交易或其他重大事件，继续接受转出会影响或损害基金份额持有人利益时；

(f) 发生继续接受转出申请将损害现有基金份额持有人利益的情形；

(g) 占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，基金管理人应当延缓支付转出款项或暂停接受基金转出申请；

(h) 基金管理人、基金托管人、销售机构、登记机构等因异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系统、基金会计系统等无法正常运行；

(i) 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

③基金转换业务的解释权归基金管理人，基金管理人可以根据市场情况在不违背有关法律、法规和《基金合同》的规定之前提下调整上述转换的收费方式、费率水平、业务规则及有关限制，但应在调整生效前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。投资者到本基金销售机构的销售网点办理本基金转换业务时，其相关具体办理规定以各销售机构的规定为准。

### （十三）基金的非交易过户

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

继承是指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；捐赠指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给公益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和协助执行通知书要求登记机构将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供基金登记机构要求提供的相关资料，对于符合条件的非交易过户申请按基金登记机构的规定办理，并按基金登记机构规定的标准收费。

### （十四）基金的转托管

基金份额持有人可向其销售机构申请办理已持有基金份额在不同销售机构之间的转托管，基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。尽管有前述约定，基金销售机构仍有权决定是否办理基金份额的转托管业务。

#### （十五） 定期定额投资计划

基金管理人可以为投资人办理定期定额投资计划，具体规则由基金管理人另行规定。投资人在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额，每期扣款金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。

#### （十六） 基金份额的冻结和解冻

基金登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻，以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。

基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益一并冻结，被冻结部分份额仍然参与收益分配。法律法规或监管机构另有规定的除外。

## 九、基金的投资

### （一）投资目标

本基金在严格控制风险的前提下，通过积极主动的资产配置和精选个股，力争实现基金资产持续稳定增值。

### （二）投资范围

本基金投资于依法发行上市的股票（包含中小板、创业板、存托凭证及其他依法发行上市的股票），内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许买卖的香港联合交易所上市股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换公司债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、股指期货、现金以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

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

股票资产的比例为基金资产的60%-95%（其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的0-50%），其中投资于价值成长主题相关股票的资产比例不低于非现金基金资产的80%。本基金保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；股指期货及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

如法律法规或中国证监会变更上述投资品种的比例限制，以变更后的比例为准，本基金的投资比例将做相应调整。

### （三）投资策略

#### 1、资产配置策略

本基金通过对国家宏观经济政策的深入分析，在动态跟踪货币政策、财政政策的基础上，判断宏观经济运行所处的经济周期及趋势，分析不同政策对各类资产的市场影响和预期收益风险，评估股票、债券等大类资产的估值水平和投资价值，确定投资组合的资产配置比例，并适时进行调整。

#### 2、股票投资策略



本基金将采用行业配置和个股精选相结合的方法进行股票投资。同时，本基金将根据政策因素、宏观因素、估值因素、市场因素四方面指标，在本合同约定的投资比例范围内制定并适时调整国内 A 股和香港（港股通标的股票）两地股票配置比例及投资策略。

#### （1）、行业配置策略

本基金将依据对宏观经济状况研判、行业长期发展空间、行业景气变化趋势和行业估值比较的研究，跟踪产业政策变化与行业格局变化等事件，结合投资增长率等辅助判断指标，挖掘景气度进入上升周期的行业。在确定周期上升行业的基础上，通过分析行业供需格局的变化程度、量价可能发生的变化趋势、行业历史运行规律等，推断行业的上升空间和持续时间，重点投资拐点行业中景气敏感度高的公司。

#### （2）、个股精选策略

##### 1) 价值成长主题的界定

采用 GARP 策略（价值成长投资策略）选择股票，即以合理价格买入长期优质潜力成长股，选择的投资标的更看重公司质地的优秀、业绩能够保持长期稳定增长预期以及股票估值合理，选择股票强调成长性与合理估值的动态平衡，在追求成长性的同时避免投资标的估值过高的风险。

价值成长是价值和成长的交集，其中价值是指估值与企业自由现金流创造能力相匹配；成长是指这一自由现金流创造能力能够持续增长。

能够创造高 ROE 的公司具备价值成长特征：静态看，企业的 ROE 由其利润率、周转率、杠杆率决定，是对其产品竞争力、行业地位、行业竞争格局、管理效率、上下游议价能力等要素的综合反映，高 ROE 的企业普遍具备高自由现金流创造能力；动态看，随着净资产的持续增长，在既定分红率的前提下，要维持 ROE 水平不下降，需要维持自由现金流创造能力的同时，盈利具备持续成长性。通过对企业核心竞争力做定性和定量的分析，寻找静态高 ROE 并能够持续，或者动态 ROE 能够边际改善的公司，发现价值成长的投资机会。

关注风险收益比。高风险收益比的公司首先具备较高的安全边际，安全边际来自于交易价格与内在价值之差，内在价值来自于自由现金流创造能力。高风险收益比的公司其次具备较大的上行空间，上行空间来自于盈利的超预期空间、市场对公司的未来展望空间，只有成长才能够实现盈利超预期、打开想象空间。

##### 2) 价值成长的兑现

运用 GARP 投资策略，聚焦在成长性被低估的优秀公司，或稳定成长行业中优秀程度未被充分认知的公司，持续跟踪公司和行业基本面及估值，以合理成本投资于内在价值持续增长的企业，分享盈利或估值提升带来的投资机会。

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

#### 3、债券投资策略

债券投资采取“自上而下”的策略，深入分析宏观经济、货币政策和利率变化趋势以及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素，以价值发现为基础，采取以久期管理策略为主，辅以收益率曲线策略等，确定和构造能够提供稳定收益、较高流动性的债券和货币市场工具组合。

#### 4、衍生品投资策略

本基金的衍生品投资将严格遵守证监会及相关法律法规的约束，合理利用股指期货等衍生工具，综合考虑各月份股指期货合约之间的定价关系、套利机会、流动性以及保证金要求等因素，以降低组合的波动率，控制组合的下行风险。本基金参与股指期货投资将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的。

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

基金管理人针对股指期货交易制订严格的授权管理制度和投资决策流程，确保研究分析、投资决策、交易执行及风险控制各环节的独立运作，并明确相关岗位职责。

#### 5、资产支持证券投资策略

本基金将通过宏观经济、提前偿还率、资产池结构及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，预测资产池未来现金流变化；研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响，同时密切关注流动性对标的证券收益率的影响。综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后的收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

#### 6、风险管理策略

本基金将借鉴国外风险管理的成功经验如 Barra 多因子模型、风险预算模型等，并结合公司现有的风险管理流程，在各个投资环节中来识别、度量和控制投资风险，并通过调整投资组合的风险结构，来优化基金的风险收益匹配。

具体而言，在大类资产配置策略的风险控制上，由投资决策委员会及宏观策略研究小组进行监控；在个股投资的风险控制上，本基金将严格遵守公司的内部规章制度，控制单一个股投资风险。

#### 7、投资决策依据和决策程序

##### （1）、投资决策依据

- 法律法规和基金合同。本基金的投资将严格遵守国家有关法律、法规和基金的有关规定。

- 宏观经济和上市公司的基本面数据。

• 投资对象的预期收益和预期风险的匹配关系。本基金将在承受适度风险的范围内，选择预期收益大于预期风险的品种进行投资。

#### （2）、投资决策程序

• 基金管理人的研究部通过内部独立研究，并借鉴其他研究机构的研究成果，形成宏观、政策、投资策略、行业和上市公司等分析报告，为投资决策委员会和基金经理提供决策依据。

• 基金管理人的投资决策委员会定期和不定期召开会议，根据本基金投资目标和对市场的判断决定本计划的总体投资策略，审核并批准基金经理提出的资产配置方案或重大投资决定。

• 在既定的投资目标与原则下，根据分析师基本面研究成果以及定量投资模型，由基金经理选择符合投资策略的品种进行投资。

• 独立的交易执行：本基金管理人通过严格的交易制度和实时的一线监控功能，保证基金经理的投资指令在合法、合规的前提下得到高效地执行。

• 动态的组合管理：基金经理将跟踪证券市场和上市公司的发展变化，结合本基金的现金流量情况，以及组合风险和流动性的评估结果，对投资组合进行动态的调整，使之不断得到优化。

基金管理人的风险管理部根据市场变化对本基金投资组合进行风险评估与监控，并授权风险控制小组进行日常跟踪，出具风险分析报告。基金管理人的合规部对本基金投资过程进行日常监督。

### （四）投资限制

#### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）股票资产占基金资产的比例为 60%–95%（其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0–50%），其中投资于价值成长主题相关股票的资产比例不低于非现金基金资产的 80%；

（2）保持不低于基金资产净值的 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

（3）本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；

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

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

（6）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 15%；

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

（8）本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%；

（9）本基金应投资于信用级别评级为BBB以上（含BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出；

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

（11）本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%；进入全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年，债券回购到期后不得展期；

（12）本基金参与股指期货交易，应当符合下列投资限制：

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

2）本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的95%。其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

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

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

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

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

6）每个交易日日终，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

（13）本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的140%；

（14）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%；

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

（16）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；

（17）本基金投资存托凭证的比例限制依照国内依法发行上市的股票执行，与国内依法发行上市的股票合并计算；

（18）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，为被动超标，不属于基金管理人违反基金合同的情形。基金管理人应当在所涉证券可交易之日起10个交易日内进行调整，上述第（2）、（9）、（15）、（16）项对调整时间另有约定的除外。法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- （1）承销证券；
- （2）违反规定向他人贷款或者提供担保；
- （3）从事承担无限责任的投资；
- （4）买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；
- （5）向其基金管理人、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、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上（含三分之二）的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

3、法律法规或监管部门对基金合同所述投资比例、投资限制、组合限制、禁止行为等作出强制性调整的，本基金应当按照法律法规或监管部门的规定执行；如法律法规或监管

部门修改或调整涉及本基金的投资比例、投资限制、组合限制、禁止行为等，且该等调整或修改属于非强制性的，则基金管理人与基金托管人协商一致后，可按照法律法规或监管部门调整或修改后的规定执行，而无需基金份额持有人大会审议决定，但基金管理人在执行法律法规或监管部门调整或修改后的规定前，应向投资者履行信息披露义务并向监管机关报告或备案或变更注册。

#### （五）业绩比较基准

中证 800 指数收益率×75% +中债综合财富指数收益率×25%

中证 800 指数是由中证指数有限公司编制，其成份股是由中证 500 和沪深 300 成份股一起构成，可以综合反映沪深证券市场内大中小市值公司的整体状况，具有良好的市场代表性和市场影响力。中债综合财富指数为中央国债登记结算有限责任公司编制并发布。该指数的样本券包括了商业银行债券、央行票据、证券公司债、证券公司短期融资券、政策性银行债券、地方企业债、中期票据、记账式国债、国际机构债券、非银行金融机构债、短期融资券、中央企业债等债券，综合反映了债券市场整体价格和回报情况。该指数以债券托管量市值作为样本券的权重因子，每日计算债券市场整体表现，是目前市场上较为权威的反映债券市场整体走势的基准指数之一，适合作为本基金债券部分的业绩比较基准。

如果相关法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，经基金管理人与基金托管人协商一致，本基金可以在按照监管部门要求履行适当程序后变更业绩比较基准并及时公告，而无须召开基金份额持有人大会。

#### （六）风险收益特征

本基金为混合型证券投资基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金将投资港股通标的股票，将承担汇率风险以及因投资环境、投资标的、市场制度、交易规则差异等带来的境外市场的风险。

#### （七）基金管理人代表基金行使相关权利的处理原则及方法

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

2、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；

3、有利于基金财产的安全与增值；

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

## （八）基金投资组合报告

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。

本基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年7月16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2024年6月30日（“报告期末”），本报告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	599,180,841.31	92.94
	其中：股票	599,180,841.31	92.94
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	34,367,480.05	5.33
	其中：债券	34,367,480.05	5.33
	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	6,297,949.37	0.98
8	其他资产	4,829,520.21	0.75
9	合计	644,675,790.94	100.00

注：通过港股通交易机制投资的港股公允价值为164,404,967.43元，占基金资产净值的比例为25.76%。

### 2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### （1）报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	73,666,961.23	11.54
C	制造业	293,906,203.65	46.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	29,173,964.00	4.57

E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	19,992,640.00	3.13
J	金融业	11,709,942.00	1.84
K	房地产业	6,326,163.00	0.99
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	434,775,873.88	68.13

## (2) 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
通信服务	45,953,584.03	7.20
非必需消费品	23,118,914.54	3.62
必需消费品	-	-
能源	20,875,254.13	3.27
金融	6,427,558.02	1.01
医疗保健	13,365,149.02	2.09
工业	-	-
信息技术	-	-
原材料	54,664,507.69	8.57
房地产	-	-
公用事业	-	-
合计	164,404,967.43	25.76

## 3. 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

### (1) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	30,800	45,195,612.00	7.08
2	601899	紫金矿业	2,428,756	42,673,242.92	6.69
3	941 HK	中国移动	311,000	21,855,947.96	3.43
3	600941	中国移动	108,700	11,685,250.00	1.83
4	1818 HK	招金矿业	2,195,500	26,249,635.11	4.11



5	000333	美的集团	385,250	24,848,625.00	3.89
6	700 HK	腾讯控股	70,900	24,097,636.07	3.78
7	3690 HK	美团-W	228,000	23,118,914.54	3.62
8	600690	海尔智家	775,700	22,014,366.00	3.45
9	600989	宝丰能源	1,254,200	21,735,286.00	3.41
10	600809	山西汾酒	101,500	21,404,320.00	3.35

#### 4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	34,367,480.05	5.39
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	34,367,480.05	5.39

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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	019709	23 国债 16	206,000	20,921,670.41	3.28
2	019740	24 国债 09	134,000	13,445,809.64	2.11

注：报告期末，本基金仅持有上述 2 只债券。

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

无。

#### 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

无。

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

无。

#### 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**

无。

**(2) 本基金投资股指期货的投资政策**

无。

**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**

无。

**(2) 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

无。

**(3) 本期国债期货投资评价**

无。

**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本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形**

基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期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是否超出基金合同规定的备选股票库**

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

**(3) 其他资产构成**

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	123,206.78
2	应收证券清算款	3,049,943.68
3	应收股利	1,638,572.40
4	应收利息	-
5	应收申购款	17,797.35
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	4,829,520.21

**(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

无。

**(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

无。

**(6) 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

无。

## 十、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。

### （一）本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
2019年09月10日 （基金合同生效日）至 2019年12月31日	7.73%	0.47%	2.15%	0.58%	5.58%	-0.11%
2020年	58.72%	1.62%	20.27%	1.08%	38.45%	0.54%
2021年	-5.80%	1.43%	0.94%	0.81%	-6.74%	0.62%
2022年	-29.74%	1.53%	-15.46%	0.95%	-14.28%	0.58%
2023年	-20.22%	0.90%	-6.66%	0.61%	-13.56%	0.29%
2024年1月1日至 2024年6月30日	-0.59%	0.99%	-0.29%	0.77%	-0.30%	0.22%

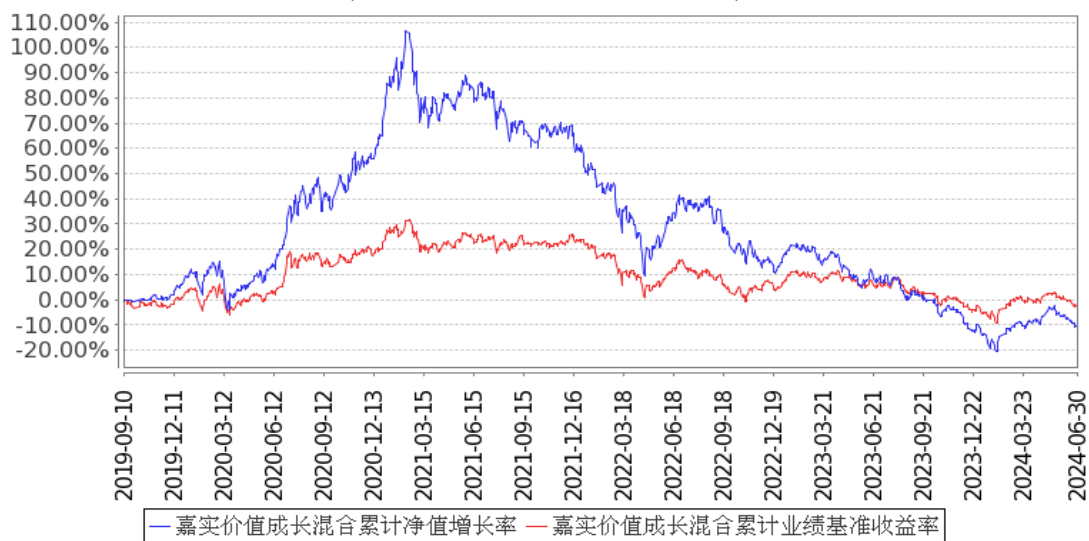
该时间区间历任基金经理

本基金在该时间区间内无历任基金经理。

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

### 嘉实价值成长混合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

（2019年09月10日至2024年06月30日）



注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起6个月为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

## 十一、基金的财产

### （一）基金资产总值

基金资产总值是指购买的各种证券及票据价值、银行存款本息和基金应收款以及其他投资所形成的价值总和。

### （二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### （三）基金财产的账户

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

### （四）基金财产的保管和处分

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

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

## 十二、基金资产的估值

### （一） 估值日

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

### （二） 估值对象

基金所拥有的股票、债券和银行存款本息、应收款项、股指期货、其它投资等资产及负债。

### （三） 估值原则

基金管理人在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，应符合《企业会计准则》、监管部门有关规定。

1、对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会计准则规定的例外情况外，应将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

2、对不存在活跃市场的投资品种，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

3、如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25%以上的，应对估值进行调整并确定公允价值。

### （四） 估值方法

#### 1、 证券交易所上市的有价证券的估值

（1）交易所上市的有价证券（包括股票等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

（2）交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（本合同另有规定的除外），选取估值日第三方估值机构提供的相应品种对应的估值净价估值，具体估值机构由基金管理人与基金托管人另行协商约定。

（3）对在交易所市场上市交易的可转换债券，按照每日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；交易所上市实行全价交易的债券（可转债除外），选取第三方估值机构提供的估值全价减去估值全价中所含的债券（税后）应收利息得到的净价进行估值。

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

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

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

（2）首次公开发行未上市的股票、债券，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）在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

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

4、同一证券同时在两个或两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。

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

6、估值计算中涉及港币对人民币汇率的，将依据下列信息提供机构所提供的汇率为基准：当日中国人民银行公布的人民币与港币的中间价。



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

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

9、本基金投资存托凭证的估值核算，依照国内依法发行上市的股票执行。

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

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

基金管理人作为本基金的会计责任方，负责基金资产净值计算和基金会计核算。就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对于基金资产净值的计算结果对外予以公布。

#### （五） 估值程序

1、基金份额净值是按照每个估值日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到0.0001元，小数点后第5位四舍五入。基金管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人每个估值日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

2、基金管理人应每个估值日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或本基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个估值日对基金资产估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

#### （六） 估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后4位以内(含第4位)发生估值错误时，视为基金份额净值错误。

本基金合同的当事人应按照以下约定处理：

##### 1、估值错误类型

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

上述估值错误的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等。

##### 2、估值错误处理原则

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

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

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

（4）估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

### 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

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

### 4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

（1）基金份额净值计算出现错误时，基金管理人和基金托管人应当立即予以纠正，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，通知基金托管人，并报中国证监会备案。

（3）前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

### 5、特殊情况的处理

（1）基金管理人或基金托管人按本基金合同约定的估值方法第7项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

（2）由于不可抗力原因，或由于证券交易所、期货交易所、第三方估值机构及证券登记结算机构发送的数据错误等原因，或国家会计政策变更、市场规则变更等非基金管理人或基金托管人原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

#### （七） 暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券/期货交易市场或外汇市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

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

4、法律法规、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

#### （八） 基金净值的确认

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

## 十三、基金的收益与分配

### （一） 基金利润的构成

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

### （二） 基金可供分配利润

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

### （三） 基金收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金可以进行收益分配，本基金每年收益分配次数最多为12次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的20%，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

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

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规规定及基金合同约定的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则和支付方式进行调整，不需召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前按照《信息披露办法》的要求在指定媒介公告。

### （四） 收益分配方案

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

### （五） 收益分配方案的确定、公告与实施

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

### （六） 基金收益分配中发生的费用

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

## 十四、基金的费用与税收

### （一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼或仲裁费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券/期货交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、基金的开户费用、账户维护费用；
- 9、因投资港股通标的股票而产生的各项合理费用；
- 10、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

### （二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.2%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.2\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力等，支付日期顺延。费用扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

#### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日或不可抗力等，支付日期顺延。费用扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

上述“一、基金费用的种类”中第3—10项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

（三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

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

（四）基金税收

本基金支付给基金管理人、基金托管人的各项费用均为含税价格，具体税率适用中国税务主管机关的规定。

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

## 十五、基金的会计与审计

### （一）基金会计政策

- 1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；
- 2、基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日；
- 3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
- 4、会计制度执行国家有关会计制度；
- 5、本基金独立建账、独立核算；
- 6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；
- 7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

### （二）基金的年度审计

- 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意。
- 3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所需依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

## 十六、基金的信息披露

（一）本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《流动性风险管理规定》、《基金合同》及其他有关规定。相关法律法规关于信息披露的规定发生变化时，本基金从其最新规定。

### （二）信息披露义务人

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

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

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的全国性报刊（以下简称“指定报刊”）及指定互联网网站（以下简称“指定网站”）等媒介披露，并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

（三）本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

- 1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；
- 2、对证券投资业绩进行预测；
- 3、违规承诺收益或者承担损失；
- 4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构；
- 5、登载任何自然人、法人和非法人组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；
- 6、中国证监会禁止的其他行为。

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

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

### （五）公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

#### 1、基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议、基金产品资料概要

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

（2）、基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。《基金合同》生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理



人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在指定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。

(3)、基金托管协议是界定基金托管人和基金管理人在基金财产保管及基金运作监督等活动中的权利、义务关系的法律文件。

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

基金募集申请经中国证监会注册后，基金管理人在基金份额发售的3日前，将基金招募说明书、《基金合同》摘要登载在指定媒介和网站上；基金管理人、基金托管人应当将《基金合同》、基金托管协议登载在网站上。

## 2、基金份额发售公告

基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于指定媒介和网站上。

## 3、《基金合同》生效公告

基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日在指定媒介和网站上登载《基金合同》生效公告。

## 4、基金净值信息

《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周在指定网站披露一次基金份额净值和基金份额累计净值。

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

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

## 5、基金份额申购、赎回价格

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

## 6、基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告

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

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

基金管理人应当在季度结束之日起15个工作日内，编制完成基金季度报告，将季度报告登载在指定网站上，并将季度报告提示性公告登载在指定报刊上。

《基金合同》生效不足2个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。

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定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本基金的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

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。

## 7、临时报告

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当依照《信息披露办法》的有关规定编制临时报告书，并登载在指定报刊和指定网站上。

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

- （1）、基金份额持有人大会的召开及决定的事项；
- （2）、《基金合同》终止、基金清算；
- （3）、转换基金运作方式、基金合并；
- （4）、更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；
- （5）基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；
- （6）、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- （7）、基金管理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；
- （9）、基金管理人的高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；
- （10）、基金管理人的董事在最近12个月内变更超过百分之五十；
- （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个月内变动超过百分之三十；

(12)、涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼或仲裁；

(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百分之零点五；

(18)、本基金开始办理申购、赎回；

(19)、本基金发生巨额赎回并延期办理；

(20)、本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；

(21)、本基金暂停接受申购、赎回申请或者重新接受申购、赎回申请；

(22)、发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；

(23)、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；

(24)、本基金连续 40 个工作日、50 个工作日、55 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，对基金合同将面临终止的不确定性风险进行提示；

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

## 8、澄清公告

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

## 9、基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决议，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

## 10、清算报告

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

## 11、股指期货的投资情况

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

#### 12、资产支持证券的投资情况

基金管理人应在基金定期报告中披露其持有的资产支持证券总额、占基金总资产的比例，在基金年报及中期报告中披露其期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细，在基金季度报告中披露期末按市值占基金净资产比例大小排序的前10名资产支持证券明细。

#### 13、港股通标的股票的投资情况

基金应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露参与港股通标的股票交易的相关情况。

#### 14、中国证监会规定的其他信息。

##### （六）信息披露事务管理

基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度，指定专门部门及高级管理人员负责管理信息披露事务。

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

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

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

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

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

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

##### （七）信息披露文件的存放与查阅

依法必须披露的信息发布后，基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于各自住所，供社会公众查阅、复制。

（八） 暂停或延迟信息披露的情形

当出现下述情况时，基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金信息：

- 1、基金投资所涉及的证券/期货交易所或外汇市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 2、因不可抗力或其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、法律法规规定、中国证监会或《基金合同》认定的其他情形。

（九） 本基金信息披露事项以法律法规规定及《基金合同》约定的内容为准。

## 十七、风险揭示

### （一）市场风险

证券市场价格因受各种因素的影响而引起的波动，将对本基金资产产生潜在风险，主要包括：

#### 1、政策风险

货币政策、财政政策、产业政策等国家政策的变化对证券市场产生一定的影响，导致市场价格波动，影响基金收益而产生风险。

#### 2、经济周期风险

证券市场是国民经济的晴雨表，而经济运行具有周期性的特点。宏观经济运行状况将对证券市场的收益水平产生影响，从而产生风险。

#### 3、利率风险

金融市场利率波动会导致股票市场及债券市场的价格和收益率的变动，同时直接影响企业的融资成本和利润水平。基金投资于货币市场工具，收益水平会受到利率变化的影响。

#### 4、购买力风险

本基金投资的目的是使基金资产保值增值，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保值增值。

#### 5、上市公司经营风险

上市公司的经营状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务等都会导致公司盈利发生变化，从而导致基金投资收益变化。

### （二）信用风险

指基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资的债券违约，导致基金资产损失。

### （三）流动性风险

指基金资产不能迅速转变成现金，或者不能应付可能出现的投资者大额赎回的风险。在开放式基金交易过程中，可能会发生巨额赎回的情形。巨额赎回可能会产生基金仓位调整的困难，导致流动性风险，甚至影响基金份额净值。

#### 1、拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

##### （1）投资市场的流动性风险

本基金主要投资于国内依法发行上市的股票、港股通标的股票、债券、股指期货、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、现金等。上述资产均存在规范的交易场所，运作时间长，市场透明度较高，运作方式规范，历史流动性状况良好，正常情况下能够及时满足基金变现需求，保证基金按时应对赎回要求。极端市场情况下，上述资产可能出现流动性不足，导致基金资产无法变现，从而影响投资者按时收到赎回款项。根据过往经验统计，绝大部分时间上述资产流动性充裕，流动性风险可控，当遇到极端市场情况时，基

金管理人会按照基金合同及相关法律法规要求，及时启动流动性风险应对措施，保护基金投资者的合法权益。

### （2）投资行业的流动性风险

股票投资方面，本基金将在考虑行业生命周期、景气程度、估值水平以及股票市场行业轮动规律的基础上决定行业的配置，同时本基金将根据宏观经济和证券市场环境的变化，及时对行业配置进行动态调整。

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

因此本基金在投资运作过程中的行业配置较为灵活，在综合考虑宏观因素及行业基本面的前提下进行配置，不以投资于某单一行业为投资目标，行业分散度较高，受到单一行业流动性风险的影响较小。

### （3）投资资产的流动性风险

本基金针对流动性较低资产的投资进行了严格的限制，以降低基金的流动性风险：本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。

本基金绝大部分基金资产投资于7个工作日内可变现资产，包括可在交易所、银行间市场正常交易的股票、债券、非金融企业债务融资工具及同业存单，7个工作日内到期或可支取的逆回购、银行存款，7个工作日内能够确认收到的各类应收款项等，上述资产流动性情况良好。

## 2、巨额赎回措施

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过前一工作日的基金总份额的10%，即认为是发生了巨额赎回。

当本基金发生巨额赎回情形时，基金管理人可能采用以下流动性风险管理措施，以控制因巨额赎回可能产生的流动性风险：

（1）部分延期赎回，并有权对当日申请赎回的份额超过前一工作日基金总份额20%的单个赎回申请人实施部分延期办理；

（2）暂停赎回；

（3）采用摆动定价机制；

（4）中国证监会认定的其他措施。

## 3、实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响：

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

应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金申购赎回申请的措施。基金份额持有人存在不能及时赎回基金份额的风险。

（2）对持续持有期少于7日的投资人，收取1.5%的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产。赎回费在投资人赎回基金份额时收取。

（3）当本基金发生大额申购或赎回情形时，本基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。当日参与申购和赎回交易的投资者存在承担申购或者赎回产生的交易及其他成本的风险。

#### （四）管理风险

在基金管理运作过程中，可能因基金管理人对经济形势和证券市场等判断有误、获取的信息不全等影响基金的收益水平。基金管理人的管理水平、管理手段和管理技术等对基金收益水平存在影响。

#### （五）操作或技术风险

指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投资者的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理公司、登记机构、销售机构、证券交易所、证券登记结算机构等等。

#### （六）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。

#### （七）本基金特有的风险

本基金是混合型基金，基金资产主要投资于股票市场与债券市场，因此股市、债市的变化将影响到基金业绩表现。本基金虽然按照风险收益配比原则，实行动态的资产配置，但并不能完全抵御市场整体下跌风险，基金净值表现因此会可能受到影响。本基金管理人将发挥专业研究优势，加强对市场、上市公司基本面和固定收益类产品的深入研究，持续优化组合配置，以控制特定风险。

##### 1、巨额赎回风险

本基金若单个开放日内发生了巨额赎回，基金管理人有可能采取部分延期赎回或暂停赎回的措施以应对巨额赎回，因此在巨额赎回情形发生时，基金份额持有人存在赎回申请不被接受或不能及时获得赎回款项的风险。

##### 2、基金合同可能终止的不确定性风险

本基金自《基金合同》生效后，连续60个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人经与基金托管人协商一致，可对本基



金进行清算，终止本基金合同，无需召开基金份额持有人大会进行表决。因此，投资者将面临基金合同可能终止的不确定性风险。

### 3、资产支持证券风险

本基金投资资产支持证券，可能面临利率风险、流动性风险、现金流预测风险。利率风险是指市场利率将随宏观经济环境的变化而波动，利率波动可能会影响资产支持证券收益。流动性风险是指在交易对手有限的情况下，资产支持证券持有人将面临无法在合理的时间内以公允价格出售资产支持证券而遭受损失的风险。资产支持证券的还款来源为基础资产未来现金流，现金流预测风险是指由于对基础资产的现金流预测发生偏差导致的资产支持证券本息无法按期或足额偿还的风险。

### 4、港股交易失败风险

港股通业务试点期间存在每日额度限制。在香港联合交易所有限公司开市前阶段，当日额度使用完毕的，新增的买单申报将面临失败的风险；在联交所持续交易时段，当日额度使用完毕的，当日本基金将面临不能通过港股通进行买入交易的风险。

### 5、汇率风险

本基金将投资港股通标的股票，在交易时间内提交订单依据的港币买入参考汇率和卖出参考汇率，并不等于最终结算汇率。港股通交易日日终，中国证券登记结算有限责任公司进行净额换汇，将换汇成本按成交金额分摊至每笔交易，确定交易实际适用的结算汇率。故本基金投资面临汇率风险，汇率波动可能对基金的投资收益造成损失。

### 6、境外市场的风险

（1）本基金的将通过“内地与香港股票市场交易互联互通机制”投资于香港市场，在市场进入、投资额度、可投资对象、税务政策等方面都有一定的限制，而且此类限制可能会不断调整，这些限制因素的变化可能对本基金进入或退出当地市场造成障碍，从而对投资收益以及正常的申购赎回产生直接或间接的影响。

（2）香港市场交易规则有别于内地A股市场规则，此外，在“内地与香港股票市场交易互联互通机制”下参与香港股票投资还将面临包括但不限于如下特殊风险：

1）港股市场实行T+0回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股估价可能表现出比A股更为剧烈的股价波动；

2）只有境内、香港两地均为交易日且能够满足结算安排、开通港股通交易的交易日才为港股通交易日，在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险；

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

4) 投资者因港股通股票权益分派、转换、上市公司被收购等情形或者异常情况，所取得的港股通股票以外的联交所上市证券，只能通过港股通卖出，但不得买入，内地证券交易服务公司另有规定的除外；因港股通股票权益分派或者转换等情形取得的联交所上市股票的认购权利在联交所上市的，可以通过港股通卖出，但不得行权；因港股通股票权益分派、转换或者上市公司被收购等所取得的非联交所上市证券，可以享有相关权益，但不得通过港股通买入或卖出。

5) 代理投票。由于中国结算是在汇总投资者意愿后再向香港结算提交投票意愿，中国结算对投资者设定的意愿征集期比香港结算的征集期稍早结束；投票没有权益登记日的，以投票截止日的持有作为计算基准；投票数量超出持有数量的，按照比例分配持有基数。以上所述因素可能会给本基金投资带来特殊交易风险。

7、本基金还投资于股指期货等金融工具，而股指期货属于高风险投资工具，相应市场的波动也可能给基金财产带来较高风险。

本基金的投资工具股指期货还有可能引发如下风险：

#### （1）卖空风险

本基金可能会采用股指期货来剥离基金的系统性风险，将来会优选做空个股、做空其他衍生工具的方式来实现投资目标。同时持有多头和空头头寸的方式导致本基金存在在特定市场情况下跑不赢普通偏股型基金的风险，同时有可能导致持有本基金在特殊情况下比持有普通偏股型基金蒙受更大损失。

#### （2）基差风险

在使用股指期货对冲市场风险的过程中，基金财产可能因为股指期货合约与标的指数价格波动不一致而遭受基差风险。形成基差风险的潜在原因包括：

1) 需要对冲的风险资产与股指期货标的指数风险收益特征存在明显差异；

2) 因未知因素导致股指期货合约到期时基差严重偏离正常水平；

3) 因存在基差风险，在进行股指期货合约展期的过程中，基金财产可能会承担股指期货合约之间的价差向不利方向变动而导致的展期风险。

#### （3）杠杆风险

因股指期货采用保证金交易而存在杠杆，基金财产可能因此产生更大的收益波动。

#### （4）到期日风险

股指期货合约到期时，基金财产如持有未平仓合约，中金所将按照交割结算价将基金财产持有的合约进行现金交割，基金财产将无法继续持有到期合约，具有到期日风险。

#### （5）对手方风险

基金管理人运用基金财产投资于股指期货时，会尽力选择资信状况优良、风险控制能力强的期货公司作为经纪商，但不能杜绝在极端情况下，所选择的期货公司在交易过程中存在违法、违规经营行为或破产清算导致基金财产遭受损失。

#### （6）盯市结算风险

股指期货采取保证金交易，保证金账户实行当日无负债结算制度，对资金管理要求较高。假如市场走势对本基金财产不利，期货经纪公司会按照期货经纪合同约定的时间和方式通知基金管理人追加保证金，以使基金财产能继续持有未平仓合约。如出现极端行情，市场持续向不利方向波动导致期货保证金不足，又未能在规定时间内补足，按规定保证金账户将被强制平仓，甚至已缴付的所有保证金都不能弥补损失，从而导致超出预期的损失。

#### （7）平仓风险

在某些市场情况下，基金财产可能会难以或无法将持有的未平仓合约平仓，例如，这种情况可能在市场达到涨跌停板时出现。出现这类情况，基金财产缴付的所有保证金有可能无法弥补全部损失，委托人还必须承担由此导致的全部损失。

期货经纪公司或其客户保证金不足，又未能在规定的时间内补足，或因其他原因导致中金所以对期货经纪公司的经纪账户强行平仓，基金财产可能因被连带强行平仓而遭受损失。

#### （8）连带风险

为基金财产进行结算的结算会员或该结算会员下的其他投资者出现保证金不足、又未能在规定的时间内补足，或因其他原因导致中金所对该结算会员下的经纪账户强行平仓时，基金财产的资产可能因被连带强行平仓而遭受损失。

#### （9）基金资产投资特定投资对象的其他风险

如期货经纪公司违反法律法规或中金所交易、结算等规则，可能会导致基金财产受到损失。

由于国家法律、法规、政策的变化、中金所交易规则的修改、紧急措施的出台等原因，基金财产持有的未平仓合约可能无法继续持有，基金财产必须承担由此导致的损失。

### 8、存托凭证的投资风险

本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与中国存托凭证发行机制相关的风险，包括存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险；存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险；存托协议自动约束存托凭证持有人的风险；因多地上市造成存托凭证价格差异以及波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；存托凭证退市的风险；已在境外上市的基础证券发行人，在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险；境内外证券交易机制、法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险。

#### （八）其他风险

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

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

## 十八、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### （一）《基金合同》的变更

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

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自决议通过之日起生效并应报中国证监会备案，基金管理人应在决议生效后按照《信息披露办法》的规定在指定媒介公告。

### （二）《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：

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

### （三）基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起30个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。在基金财产清算小组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券、期货相关业务资格的注册会计师、律师组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

3、在基金财产清算过程中，基金管理人和基金托管人应各自履行职责，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。

4、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。

#### 5、基金财产清算程序：

- （1）基金财产清算小组成立后，由基金财产清算小组统一接管基金；
- （2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- （3）对基金财产进行估值和变现；
- （4）制作清算报告；

（5）聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；

（6）将清算报告报中国证监会备案并公告；

（7）对基金剩余财产进行分配。

6、基金财产清算的期限为6个月，但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现、结算保证金相关规定等客观因素，清算期限相应顺延。

#### （四）清算费用

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

#### （五）基金财产清算剩余资产的分配

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

#### （六）基金财产清算的公告

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

#### （七）基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。

## 十九、基金合同的内容摘要

### （一）基金合同当事人及权利义务

#### A. 基金份额持有人的权利和义务

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

每份基金份额具有同等的合法权益。

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：

- （1）分享基金财产收益；
- （2）参与分配清算后的剩余基金财产；
- （3）依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；
- （4）按照规定要求召开基金份额持有人大会或者自行召集基金份额持有人大会；
- （5）出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- （6）查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- （7）监督基金管理人的投资运作；
- （8）对基金管理人、基金托管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；
- （9）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

- （1）认真阅读并遵守《基金合同》、《招募说明书》、《业务规则》以及基金管理人按照规定就本基金发布的相关公告；
- （2）了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；
- （3）关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；
- （4）交纳基金认购、申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；
- （5）在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；
- （6）不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；
- （7）执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- （8）返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；

（9）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## B. 基金管理人的权利与义务

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

- （1）依法募集资金；
- （2）自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
- （3）依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- （4）销售基金份额；
- （5）按照规定召集基金份额持有人大会；
- （6）依据《基金合同》及有关法律、法规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律、法规规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- （7）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- （8）选择、更换为本基金提供销售、销售支付、份额登记、估值、法律、会计等服务的基金服务机构并确定相关费率，对基金服务机构的相关行为进行监督和处理；
- （9）担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；
- （10）依据《基金合同》及有关法律、法规规定确定基金收益的分配方案；
- （11）在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；
- （12）依照法律法规为基金的利益行使因基金财产投资所产生的权利；
- （13）在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；
- （14）以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- （15）选择、更换证券经纪商、期货经纪商或其他为基金提供服务的外部机构，并确定有关的费率；
- （16）在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整《业务规则》；
- （17）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

- （1）依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
- （2）办理基金备案手续；
- （3）自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；



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

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

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

（7）依法接受基金托管人的监督；

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

（9）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

（10）编制季度报告、中期报告和年度报告；

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

（12）保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定或有权机关另有要求外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露，因向审计、法律等外部专业顾问提供的情况除外；

（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满未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人应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。

### C. 基金托管人的权利和义务

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

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

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

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

(4) 根据相关市场规则，为基金开设或注销证券账户、资金账户等投资所需账户，为基金办理证券交易资金清算；

(5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

(6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

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

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

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

（5）保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

（6）按规定开设或注销基金财产的资金账户和证券账户等投资所需账户，按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

（7）保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定或有权机关另有要求外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露，因向审计、法律等外部专业顾问提供的情况除外；

（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；

（9）办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

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

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

（12）从基金管理人或其委托的登记机构处接收基金份额持有人名册；

（13）按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

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

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

（16）按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；

（17）参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

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

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

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

（21）执行生效的基金份额持有人大会的决议；

（22）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## （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组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。每份基金份额具有同等的合法权益。

### A、召开事由

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

- （1）终止《基金合同》；
- （2）更换基金管理人；
- （3）更换基金托管人；
- （4）转换基金运作方式；
- （5）调整基金管理人、基金托管人的报酬标准；
- （6）变更基金类别；
- （7）本基金与其他基金的合并；
- （8）变更基金投资目标、范围或策略；
- （9）变更基金份额持有人大会程序；
- （10）基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- （11）单独或合计代表基金份额10%以上（含10%，下同）的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；
- （12）对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；
- （13）法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

2、尽管有前述约定，但在不违反法律法规有关规定和监管要求的前提下，在对现有基金份额持有人无实质性不利影响的前提下，以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

- （1）法律法规要求增加的基金费用的收取；
- （2）在《基金合同》规定的范围内，且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，调整本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式、调整本基金的基金份额类别的设置；
- （3）因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；
- （4）对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生变化；
- （5）按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

#### B、会议召集人及召集方式

1、本基金基金份额持有人大会不设日常机构。除法律法规规定或《基金合同》另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集；

2、基金管理人未按规定召集或不能召开时，由基金托管人召集；

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

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

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

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

C、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

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

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

3、如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对表决意

见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。

#### D、基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式或法律法规、监管机构允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

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

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

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

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对审议事项的表决意见以书面形式或基金合同约定的其他方式在收取表决意见截止时间以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式或基金合同约定的其他方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

（1）会议召集人按《基金合同》约定公布会议通知后，在2个工作日内连续公布相关提示性公告；

（2）召集人按基金合同约定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式统计基金份额持有人的书面表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加统计书面表决意见的，不影响表决效力；

（3）本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）；

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

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

4、基金份额持有人授权他人代为出席会议并表决的，授权方式可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式，具体方式在会议通知中列明。

5、若到会者在权益登记日所持有的有效基金份额低于本条第1款第（2）项、第2款第（3）项规定比例的，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会，到会者所持有的基金份额不少于在权益登记日基金份额总数的三分之一（含三分之一）。

#### E、议事内容与程序

##### 1、议事内容及提案权

议事内容为本部分“A、召开事由”中所述应由基金份额持有人大会审议决定的事项。

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

##### 2、议事程序

###### （1）现场开会

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

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

###### （2）通讯开会

在通讯开会的情况下，首先由召集人在收取会议审议事项书面表决意见截止日期前至少提前30日公布提案，在所通知的收取表决意见表决截止日期后2个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

#### F、表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

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

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

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的投资者视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

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

## G、计票

### 1、现场开会

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

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

（3）如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有异议，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。计票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

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

### 2、通讯开会

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



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

#### H、生效与公告

基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。该表决通过之日为基金份额持有人大会计票完成且计票结果符合法律法规和基金合同规定的决议通过条件之日。

基金份额持有人大会决议生效后应按照《信息披露办法》的规定在指定媒介上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

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

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

### （三）基金合同的变更、终止与基金财产的清算

#### A、《基金合同》的变更

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

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自决议通过之日起生效并应报中国证监会备案，基金管理人应在决议生效后按照《信息披露办法》的规定在指定媒介公告。

#### B、《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：

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

#### C、基金财产的清算

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

产清算小组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券、期货相关业务资格的注册会计师、律师组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

3、在基金财产清算过程中，基金管理人和基金托管人应各自履行职责，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。

4、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。

5、基金财产清算程序：

- （1）基金财产清算小组成立后，由基金财产清算小组统一接管基金；
- （2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- （3）对基金财产进行估值和变现；
- （4）制作清算报告；
- （5）聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- （6）将清算报告报中国证监会备案并公告；
- （7）对基金剩余财产进行分配。

6、基金财产清算的期限为6个月，但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现、结算保证金相关规定等客观因素，清算期限相应顺延。

D、清算费用

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

E、基金财产清算剩余资产的分配

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

F、基金财产清算的公告

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

G、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。

（四）争议的处理和适用的法律

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，各方当事人应尽量通过协商、调解解决。协商、调解不能解决的任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。仲裁费用由败诉方承担，除非仲裁裁决另有决定。

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

《基金合同》受中国法律（为本合同之目的，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区法律）管辖。

#### （五）基金合同的效力

《基金合同》是约定基金合同当事人之间权利义务关系的法律文件。

A、《基金合同》经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字/签章并在募集结束后经基金管理人向中国证监会办理基金备案手续，并经中国证监会书面确认后生效。

B、《基金合同》的有效期自其生效之日起至基金财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止。

C、《基金合同》自生效之日起对包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人在内的《基金合同》各方当事人具有同等的法律约束力。

D、《基金合同》正本一式三份，除上报有关监管机构一式一份外，基金管理人、基金托管人各持有一份，每份具有同等的法律效力。

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

## 二十、基金托管协议的内容摘要

### （一）托管协议当事人

#### A. 基金管理人

名称：嘉实基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1318号1806A单元

法定代表人：经雷

成立时间：1999年3月25日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字【1999】5号

注册资本：1.5亿元人民币

组织形式：有限责任公司（中外合资）

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务

存续期间：持续经营

电话：(010)65215588

传真：(010)65185678

联系人：胡勇钦

#### B. 基金托管人

名称：中国工商银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街55号（100032）

法定代表人：廖林

联系人：郭明

联系电话：010-66105799

成立时间：1985年11月22日

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币35,640,625.7089万元

批准设立机关和设立文号：国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》（国发[1983]146号）

存续期间：持续经营

经营范围：办理人民币存款、贷款、同业拆借业务；国内外结算；办理票据承兑、贴现、转贴现、各类汇兑业务；代理资金清算；提供信用证服务及担保；代理销售业务；代理发行、代理承销、代理兑付政府债券；代收代付业务；代理证券投资基金清算业务（银证转账）；保险代理业务；代理政策性银行、外国政府和国际金融机构贷款业务；保管箱服务；发行金融债券；买卖政府债券、金融债券；证券投资基金、企业年金托管业务；企业年金受托管理服务；年金账户管理服务；开放式基金的注册登记、认购、申购和赎回业务；

资信调查、咨询、见证业务；贷款承诺；企业、个人财务顾问服务；组织或参加银团贷款；外汇存款；外汇贷款；外币兑换；出口托收及进口代收；外汇票据承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；发行、代理发行、买卖或代理买卖股票以外的外币有价证券；自营、代客外汇买卖；外汇金融衍生业务；银行卡业务；电话银行、网上银行、手机银行业务；办理结汇、售汇业务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。

## （二）基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

### A、基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权

1、基金托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定，对下述基金投资范围、投资对象进行监督。

本基金将投资于以下金融工具：

本基金投资于依法发行上市的股票（包含中小板、创业板、存托凭证及其他依法发行上市的股票），内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许买卖的香港联合交易所上市股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换公司债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、股指期货、现金以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

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

2、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投融资比例进行监督：

#### （1）基金的投资组合比例为：

股票资产的比例为基金资产的 60%-95%（其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%），其中投资于价值成长主题相关股票的资产比例不低于非现金基金资产的 80%。本基金保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

如法律法规或中国证监会变更上述投资品种的比例限制，以变更后的比例为准，本基金的投资比例将做相应调整。

#### （2）根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金投资组合遵循以下投资限制：

1）股票资产占基金资产的比例为 60%-95%（其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%），其中投资于价值成长主题相关股票的资产比例不低于非现金基金资产的 80%，基金管理人应将拟投资的股票库的具体范围提供给基金托管人。基金管理人可以根据实际情况的变化，对各投资品种的具体范围予以更新和调整，并通知基金托管人。基金托管人根据上述投资范围对基金的投资进行监督；

2) 保持不低于基金资产净值的 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

3) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；

4) 本基金管理人管理并由本基金托管人托管的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；

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

6) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 15%；

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

8) 本基金管理人管理并由本基金托管人托管的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

9) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

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

11) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；进入全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

12) 本基金参与股指期货交易，应当符合下列投资限制：

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

b. 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%。其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

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

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

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

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

f. 每个交易日日终，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

13) 本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

14) 本基金管理人管理并由本基金托管人托管的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理并由本基金托管人托管的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；

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

16) 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；

17) 本基金投资存托凭证的比例限制依照国内依法发行上市的股票执行，与国内依法发行上市的股票合并计算。

因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，为被动超标，不属于基金管理人违反基金合同的情形。基金管理人应当在所涉证券可交易之日起 10 个工作日内进行调整，上述第（2）、（9）、（15）、（16）项对调整时间另有约定的除外。法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合本基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

对于因法律法规变化导致本基金投资范围及投资限制等事项调整的，基金管理人应提前通知基金托管人。基金管理人知晓基金托管人履行投资监督职责受外部数据来源或系统开发等因素影响，应为基金托管人系统调整预留所需的合理必要时间。

3、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投资禁止行为进行监督：

根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金禁止从事下列行为：

- （1）承销证券；
- （2）违反规定向他人贷款或提供担保；
- （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) 向其基金管理人、基金托管人出资；

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先的原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上（含三分之二）的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

法律法规或监管部门对基金合同所述投资比例、投资限制、组合限制、禁止行为等作出强制性调整的，本基金应当按照法律法规或监管部门的规定执行；如法律法规或监管部门修改或调整涉及本基金的投资比例、投资限制、组合限制、禁止行为等，且该等调整或修改属于非强制性的，则基金管理人与基金托管人协商一致后，可按照法律法规或监管部门调整或修改后的规定执行，而无需基金份额持有人大会审议决定，但基金管理人在执行法律法规或监管部门调整或修改后的规定前，应向投资者履行信息披露义务并向监管机关报告或备案或变更注册。

基金管理人知晓基金托管人投资监督职责的履行受外部数据来源或系统开发等因素影响，基金管理人应为托管人系统调整预留所需的合理必要时间。

4、基金托管人依据有关法律法规的规定和以下约定对基金管理人参与银行间债券市场投资进行监督。

(1) 基金托管人按以下方式对基金管理人参与银行间市场交易的交易对手资信风险控制措施进行监督。

基金管理人向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的银行间市场交易对手的名单，并按照审慎的风险控制原则在该名单中约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金托管人在收到名单后 2 个工作日内回函确认收到该名单。基金管理人应定期或不定期对银行间市场现券及回购交易对手的名单进行更新，名单中增加或减少银行间市场交易对手时须提前书面通知基金托管人，基金托管人于 2 个工作日内回函确认收到后，对名单进行更新。基金管理人收到基金托管人书面确认后，被确认调整的名单开始生效，新名单生效前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。

如果基金托管人发现基金管理人与不在名单内的银行间市场交易对手进行交易，应及时提醒基金管理人撤销交易，经提醒后基金管理人仍执行交易并造成基金资产损失的，基金托管人不承担责任，发生此种情形时，基金托管人有权报告中国证监会。

(2) 基金托管人对于基金管理人参与银行间市场交易的交易方式的控制



基金管理人在银行间市场进行现券买卖和回购交易时，需按交易对手名单中约定的该交易对手所适用的交易结算方式进行交易。如果基金托管人发现基金管理人没有按照事先约定的交易方式进行交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人与交易对手重新确定交易方式，经提醒后仍未改正时造成基金资产损失的，基金托管人不承担责任。

(3) 基金管理人参与银行间市场交易的核心交易对手为中国工商银行、中国银行、中国建设银行、中国农业银行和交通银行，基金管理人在通知基金托管人后，可以根据当时的市场情况调整核心交易对手名单。在与核心交易对手以外的交易对手进行交易时，由于交易对手资信风险引起的损失，基金管理人应要求相关责任人进行赔偿。基金托管人的监督责任仅限于根据已提供的名单，审核交易对手是否在名单内列明。

#### 5、关于银行存款投资。

本基金投资银行存款的信用风险主要包括存款银行的信用等级、存款银行的支付能力等涉及到存款银行选择方面的风险。本基金核心存款银行名单为中国工商银行、中国银行、中国建设银行、中国农业银行和交通银行，本基金投资除核心存款银行以外的银行存款出现由于存款银行信用风险而造成的损失时，基金管理人应要求相关责任人进行赔偿。基金管理人在通知基金托管人后，可以根据当时的市场情况对于核心存款银行名单进行调整。基金托管人的监督责任仅限于根据已提供的名单，审核核心存款银行是否在名单内列明。

#### 6、基金托管人对基金投资流通受限证券的监督

(1) 基金投资流通受限证券，应遵守《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。

(2) 此处的流通受限证券与上文提及的流动性受限资产并不完全一致，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。

(3) 基金管理人应在基金首次投资流通受限证券前，向基金托管人提供经基金管理人董事会批准的有关基金投资流通受限证券的投资决策流程、风险控制制度。基金投资非公开发行股票，基金管理人还应提供基金管理人董事会批准的流动性风险处置预案。上述资料应包括但不限于基金投资流通受限证券的投资额度和投资比例控制情况。

基金管理人应至少于首次执行投资指令之前两个工作日将上述资料书面发至基金托管人，保证基金托管人有足够的时间进行审核。基金托管人应在收到上述资料后两个工作日内，以书面或其他双方认可的方式确认收到上述资料。

(4) 基金投资流通受限证券前，基金管理人应向基金托管人提供符合法律法规要求的有关书面信息，包括但不限于拟发行证券主体的中国证监会批准文件、发行证券数量、发行价格、锁定期，基金拟认购的数量、价格、总成本、总成本占基金资产净值的比例、已持有流通受限证券市值占资产净值的比例、资金划付时间等。基金管理人应保证上述信息

的真实、完整，并应至少于拟执行投资指令前两个工作日将上述信息书面发至基金托管人，保证基金托管人有足够的时间进行审核。

(5) 基金托管人应按照《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》规定，对基金管理人是否遵守法律法规进行监督，并审核基金管理人提供的有关书面信息。基金托管人认为上述资料可能导致基金出现风险的，有权要求基金管理人在投资流通受限证券前就该风险的消除或防范措施进行补充书面说明，并保留查看基金管理人风险管理部门就基金投资流通受限证券出具的风险评估报告等备查资料的权利。否则，基金托管人有权拒绝执行有关指令。因拒绝执行该指令造成基金财产损失的，基金托管人不承担任何责任，并有权报告中国证监会。

如基金管理人和基金托管人无法达成一致，应及时上报中国证监会请求解决。如果基金托管人切实履行监督职责，则不承担任何责任。如果基金托管人没有切实履行监督职责，导致基金出现风险，基金托管人应承担连带责任。

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

C、基金托管人发现基金管理人的投资运作及其他运作违反《基金法》、《基金合同》、基金托管协议有关规定时，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到书面通知后应及时核对，并以书面形式向基金托管人发出回函，就基金托管人的合理疑义进行解释或举证。

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违反《基金合同》而致使投资者遭受的损失。

对于依据交易程序尚未成交的且基金托管人在交易前能够监控的投资指令，基金托管人发现该投资指令违反法律法规规定或者违反《基金合同》约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并向中国证监会报告。

对于必须于估值完成后方可获知的监控指标或依据交易程序已经成交的投资指令，基金托管人发现该投资指令违反法律法规或者违反《基金合同》约定的，应当立即通知基金管理人，并报告中国证监会。

基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查，必须在规定时间内答复基金托管人并改正，就基金托管人的合理疑义进行解释或举证，对基金托管人按照法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

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

基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠基金托管人根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍基金托管人进行有效监督，情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的，基金托管人应报告中国证监会。

### （三）基金管理人 对基金托管人的业务核查

基金管理人 对基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括但不限于基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户、证券账户、期货交易账户及其他投资所需账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值，根据管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、无故未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、《基金合同》、本托管协议及其他有关规定时，基金管理人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确认并以书面形式向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，并予协助配合。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。基金管理人 有义务要求基金托管人赔偿基金因此所遭受的损失。

基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应立即报告中国证监会和银行业监督管理机构，同时通知基金托管人限期纠正。基金托管人应就基金管理人合理的疑义进行解释。

基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复基金管理人并改正。

基金托管人无正当理由，拒绝、阻挠基金管理人根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍基金管理人进行有效监督，情节严重或经基金管理人提出警告仍不改正的，基金管理人应报告中国证监会。

### （四）基金财产的保管

#### A、基金财产保管的原则

- 1、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。
- 2、基金托管人应安全保管基金财产。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。
- 3、基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户、证券账户、期货交易账户及其他投资所需账户。
- 4、基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，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账管理，确保基金财产的完整与独立。
- 5、对于因基金认（申）购、基金投资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账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金托管人处的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金造成损失的，基金管理

人应负责向有关当事人追偿基金的损失，基金托管人应予以必要协助，基金托管人在已履行及时通知义务的情况下对此不承担责任，因管理人原因导致托管人无法履行通知义务的，基金托管人不承担责任。

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。

#### B、基金的银行账户的开立和管理

基金托管人以基金托管人的名义在其营业机构开设资产托管专户，保管基金的银行存款。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资产托管专户进行。

资产托管专户的开立和使用，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其他任何银行账户；亦不得使用基金的任何银行账户进行本基金业务以外的活动。

资产托管专户的管理应符合《人民币银行结算账户管理办法》、《现金管理暂行条例》、《人民币利率管理规定》、《利率管理暂行规定》、《支付结算办法》以及银行业监督管理机构的其他规定。

#### C、基金证券账户与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责任公司上海分公司/深圳分公司开设证券账户。

基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司开立基金证券交易资金账户，用于证券清算。

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。

#### D、债券托管账户的开立和管理

1、《基金合同》生效后，基金管理人负责以基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表基金进行交易；基金托管人负责以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司和银行间市场清算所股份有限公司开设银行间债券市场债券托管账户和资金结算专户，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、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债券市场回购主协议，正本由基金托管人保管，基金管理人保存副本。

#### E、其他账户的开设和管理

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

#### F、基金财产投资的有关银行存款证实书等实物证券的保管

基金财产投资的有关实物证券由基金托管人存放于基金托管人的保管库；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。基金托管人对基金托管人以外机构实际有效控制或保管的证券不承担保管责任。

#### G、与基金财产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同的原件分别应由基金托管人、基金管理人保管。除本协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时，应保证基金一方持有两份以上的正本，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。基金管理人在合同签署后 5 个工作日内通过专人送达、挂号邮寄等安全方式将合同原件送达基金托管人处。合同原件应存放于基金管理人和基金托管人各自文件保管部门 15 年以上，法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。

对于无法取得二份以上的正本的，基金管理人应向基金托管人提供加盖授权业务章的合同传真件，未经双方协商或未在合同约定范围内，合同原件不得转移。

### （五）基金资产净值计算和会计核算

#### A、基金资产净值的计算

##### 1、基金资产净值的计算、复核的时间和程序

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份额总数，精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入。基金管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人应每个估值日对基金资产估值，但基金管理人根据法律法规或基金合同的规定暂停估值时除外。估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算业务指引》及其他法律、法规的规定。用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个估值日交易结束后计算当日的基金资产净值和基金份额净值并以双方认可的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以双方认可的方式发送给基金管理人，由基金管理人按基金净值按规定予以公布。

基金管理人为本基金的会计责任方，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### B、基金资产估值方法

##### 1、估值对象

基金所拥有的股票、债券和银行存款本息、应收款项、股指期货及其它投资等资产及负债。

## 2、估值方法

本基金的估值方法为：

### （1）证券交易所上市的有价证券的估值

1) 交易所上市的有价证券（包括股票等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

2) 交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（本合同另有规定的除外），选取估值日第三方估值机构提供的相应品种对应的估值净价估值，具体估值机构由基金管理人与基金托管人另行协商约定。

3) 对在交易所市场上市交易的可转换债券，按照每日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；交易所上市实行全价交易的债券（可转债除外），选取第三方估值机构提供的估值全价减去估值全价中所含的债券（税后）应收利息得到的净价进行估值。

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

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

### （2）处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

2) 首次公开发行未上市的股票、债券，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) 在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

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

(4) 同一证券同时在两个或两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。

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

(6) 估值计算中涉及港币对人民币汇率的，将依据下列信息提供机构所提供的汇率为基准：当日中国人民银行公布的人民币与港币的中间价。

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

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

(9) 本基金投资存托凭证的估值核算，依照国内依法发行上市的股票执行。

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

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

基金管理人担任本基金的会计责任方，负责基金资产净值计算和基金会计核算，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对本基金资产净值的计算结果对外予以公布。

事后证明基金托管人计算正确的，基金托管人对基金管理人公布的计算结果所造成的损失不负赔偿责任。

### C、估值差错处理

因基金估值错误给投资者造成损失的应按照基金合同和本协议约定的估值差错处理原则进行处理。

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后4位以内(含第4位)发生估值错误时，视为基金份额净值错误。

基金合同的当事人应按照以下约定处理：

#### 1、估值错误类型

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

上述估值错误的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等。

## 2、估值错误处理原则

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

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

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

（4）估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

## 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

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

## 4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

（1）基金份额净值计算出现错误时，基金管理人和基金托管人应当立即予以纠正，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，通知基金托管人，并报中国证监会备案。



（3）前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

#### 5、特殊情况的处理

（1）基金管理人或基金托管人按上述估值方法第（7）项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

（2）由于不可抗力原因，或由于证券交易所、期货交易所、第三方估值机构或登记结算机构发送的数据错误等，或国家会计政策变更、市场规则变更等非基金管理人或基金托管人原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

#### D、基金账册的建立

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账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账册，对相关各方各自的账册定期进行核对，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。

经对账发现相关各方的账目存在不符的，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账册记录完全相符。若当日核对不符，暂时无法查找到错账的原因而影响基金资产净值的计算和公告的，以基金管理人的账册为准。

#### E、基金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。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。

基金管理人在季度结束之日起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5个工作日内完成月度报告，在月度报告完成当日，对报告加盖公章后，以加密传真方式将有关报告提供基金托管人复核；基金托管人在3个工作日内进行复核，并将复核结果及时书面通知基金管理人。基金管理人在7个工作日内完成季度报告，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7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30日内完成中期报告，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30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45日内完成年度报告，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 45 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账务处理方式为准。核对无误后，基金托管人在基金管理人提供的报告上加盖业务印鉴或者出具加盖托管业务部门公章的复核意见书，相关各方各自留存一份。如果基金管理人与基金托管人不能于应当发布公告之日之前就相关报表达成一致，基金管理人有权按照其编制的报表对外发布公告，基金托管人有权就相关情况报证监会备案。

基金托管人在对财务会计报告、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。

#### F、暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券/期货交易市场或外汇市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

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

4、法律法规、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

#### （六）基金份额持有人名册的保管

基金管理人和基金托管人须分别妥善保管的基金份额持有人名册，包括《基金合同》生效日、《基金合同》终止日、基金份额持有人大会权益登记日、每年 6 月 30 日、12 月 31 日的基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容必须包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册由基金的基金登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，基金管理人和基金托管人应按照目前相关规则分别保管基金份额持有人名册。保管方式可以采用电子或文档的形式。登记机构的保存期限自基金账户销户之日起不得少于 20 年。

基金管理人应当及时向基金托管人提交下列日期的基金份额持有人名册：《基金合同》生效日、《基金合同》终止日、基金份额持有人大会权益登记日、每年 6 月 30 日、每年 12 月 31 日的基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容必须包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。其中每年 12 月 31 日的基金份额持有人名册应于下月前十个工作日内提交；《基金合同》生效日、《基金合同》终止日等涉及到基金重要事项日期的基金份额持有人名册应于发生日后十个工作日内提交。

基金托管人以电子版形式妥善保管基金份额持有人名册，并定期刻成光盘备份，保存期限为15年。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。

若基金管理人或基金托管人由于自身原因无法妥善保管基金份额持有人名册，应按有关法规规定各自承担相应的责任。

#### （七）争议解决方式

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，除非仲裁裁决另有决定。

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（为本协议之目的，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区法律）。

#### （八）托管协议的变更、终止与基金财产的清算

##### A、托管协议的变更与终止

##### 1、托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议的内容进行变更。变更后的托管协议，其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突。基金托管协议的变更应当报中国证监会备案。本协议约定事项如与法律法规、《基金合同》的规定相冲突的，应以法律法规及《基金合同》的规定为准。

##### 2、基金托管协议终止的情形

发生以下情况之一的，本托管协议终止：

- （1）《基金合同》终止；
- （2）基金托管人解散、依法被撤销、破产或有其他基金托管人接管基金资产；
- （3）基金管理人解散、依法被撤销、破产或有其他基金管理人接管基金管理权；
- （4）发生法律法规、中国证监会规定或《基金合同》规定的终止事项。

##### B、基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起30个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。在基金财产清算小组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券、期货相关业务资格的注册会计师、律师组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

3、在基金财产清算过程中，基金管理人和基金托管人应各自履行职责，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。

4、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。

5、基金财产清算程序：

(1) 基金财产清算小组成立后，由基金财产清算小组统一接管基金；  
(2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；  
(3) 对基金财产进行估值和变现；  
(4) 制作清算报告；  
(5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；

(6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；

(7) 对基金剩余财产进行分配。

6、基金财产清算的期限为6个月，但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现、结算保证金相关规定等客观因素，清算期限相应顺延。

7、清算费用

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

8、基金财产按下列顺序清偿：

(1) 支付清算费用；

(2) 交纳所欠税款；

(3) 清偿基金债务；

(4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款(1)－(3)项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

C、基金财产清算的公告

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

D、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。

## 二十一、对基金份额持有人的服务

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

### （一）资料寄送/发送

#### 1、开户确认书和交易对账单

首次基金交易（除基金开户外其他交易类型）后的15个工作日内向基金份额持有人寄送或邮件发送开户确认书和交易对账单。

#### 2、基金份额持有人对账单

每月向定制电子对账单服务的份额持有人发送电子对账单。

3、由于投资者提供的邮寄地址、手机号码、电子邮箱不详、错误、未及时变更或邮局投递差错、通讯故障、延误等原因有可能造成对账单无法按时或准确送达。因上述原因无法正常收取对账单的投资者，敬请及时通过本公司网站，或拨打本公司客服热线查询、核对、变更您的预留联系方式。

### （二）定期定额投资计划

基金管理人可通过销售机构为投资者提供定期定额投资服务。通过定期定额投资计划，投资者可以通过销售渠道定期定额申购基金份额。定期定额投资计划的有关规则另行公告。

### （三）在线服务

通过本公司网站 [www.jsfund.cn](http://www.jsfund.cn)，基金份额持有人还可获得如下服务：

#### 1、查询服务

基金份额持有人均可通过基金管理人网站实现基金交易查询、账户信息查询和基金信息查询。

#### 2、信息资讯服务

投资者可以利用基金管理人网站获取基金和基金管理人的各类信息，包括基金的法律文件、业绩报告及基金管理人最新动态等资料。

#### 3、网上交易

本基金管理人已开通个人和机构投资者的网上直销交易业务。个人和机构投资者通过基金管理人网站 [www.jsfund.cn](http://www.jsfund.cn) 可以办理基金认购、申购、赎回、账户资料修改、交易密码修改、交易申请查询和账户资料查询等各类业务。

### （四）咨询服务

1、投资者或基金份额持有人如果了解申购与赎回的交易情况、基金账户余额、基金产品与服务等信息，可拨打基金管理人全国统一客服电话：400-600-8800（免长途话费）、（010）85712266，传真：（010）65215577。

#### 2、网站和电子信箱

公司网址：<http://www.jsfund.cn>

电子信箱：[service@jsfund.cn](mailto:service@jsfund.cn)

## 二十二、其他应披露事项

以下信息披露事项已通过规定媒介（含基金管理人网站）公开披露。

序号	临时报告名称	披露时间
1	嘉实基金管理有限公司关于旗下部分基金 2023 年 9 月 1 日因港股通恶劣天气暂停申购、赎回、转换及定投业务安排的公告	2023 年 9 月 1 日
2	嘉实基金管理有限公司关于旗下部分基金 2023 年 9 月 8 日因港股通恶劣天气暂停申购、赎回、转换及定投业务安排的公告	2023 年 9 月 8 日
3	嘉实基金管理有限公司关于旗下部分基金 2024 年非港股通交易日暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务安排的公告	2024 年 3 月 19 日

## 二十三、招募说明书存放及查阅方式

本基金招募说明书公布后，分别置备于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的住所，投资者可免费查阅。投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件。



## 二十四、备查文件

### （一）备查文件目录

- 1、中国证监会准予嘉实价值成长混合型证券投资基金注册的批复文件。
- 2、《嘉实价值成长混合型证券投资基金基金合同》。
- 3、《嘉实价值成长混合型证券投资基金托管协议》。
- 4、法律意见书。
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照。
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照。

### （二）存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人处。

### （三）查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅备查文件。在支付工本费后，可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

嘉实基金管理有限公司  
2024年08月27日