

# 中欧基金管理有限公司

## 中欧星耀优选 3 个月持有期混合型基金 中基金（FOF） 更新招募说明书

基金管理人：中欧基金管理有限公司

基金托管人：宁波银行股份有限公司

二〇二三年十一月

本基金经 2021 年 6 月 24 日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）下发的《关于准予中欧星耀优选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）注册的批复》（证监许可[2021]2162 号文）准予募集注册。本基金基金合同于 2022 年 1 月 26 日正式生效。

### 重要提示

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

投资有风险，投资人在认购（或申购）本基金前应认真阅读本基金的招募说明书、基金产品资料概要和基金合同等信息披露文件，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。

证券投资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。基金投资不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具，投资人购买基金，既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益，也可能承担基金投资所带来的损失。

本基金为混合型基金中基金（FOF），风险与预期收益高于债券型基金中基金、债券型基金，高于货币型基金中基金、货币市场基金，低于股票型基金中基金、股票型基金。

投资人购买本基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构。投资人应当认真阅读基金合同、招募说明书、基金产品资料概要等基金信息披露文件，了解基金的风险收益特征，根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和自身的风险承受能力相适应，并通过基金管理人或基金管理人委托的具有基金销售业务资格的其他机构购买基金。投资人在获得基金投资收益的同时，亦承担基金投资中出现的各类风险，可能包括：证券市场整体环境引发的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、大量赎回或暴跌导致的流动性风险、基金管理人在投资经营过程中产生的操作风险以及本基金特有风险

等。

本基金每份基金份额的锁定持有期为 3 个月，基金份额在锁定持有期内不办理赎回及转换转出业务。锁定持有期到期后进入开放持有期，每份基金份额自其开放持有期首日起才能办理赎回及转换转出业务。因此基金份额持有人面临在锁定持有期内不能赎回基金份额的风险。

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

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或选择不将基金资产投资于港股，基金资产并非必然投资港股。

本基金的投资范围包括存托凭证，存托凭证是由存托人签发、以境外证券为基础在中国境内发行，代表境外基础证券权益。存托凭证持有人实际享有的权益与境外基础证券持有人的权益虽然基本相当，但不能等同于直接持有境外基础证券。投资于存托凭证可能会面临由于境内外市场上市交易规则、上市公司治理结构、股东权利等差异带来的相关成本和投资风险。在交易和持有存托凭证过程中需要承担的义务及可能受到的限制，应当关注证券交易普遍具有的宏观经济风险、政策风险、市场风险、不可抗力风险等。

本基金可投资公开募集基础设施证券投资基金（以下简称“公募 REITs”），可能面临以下风险：基金价格波动风险、基础设施项目运营风险、流动性风险、终止上市风险、税收等政策调整风险等。

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资产，但不保证投资于本基金一定盈利，也不保证最低收益，也不保证本金不受损失。基金的过往业绩并不预示其未来表现，基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资人注意基金投资的“买者自负”原则，在作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投

资人自行承担。

本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的 50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过 50%的除外。法律法规、监管机构另有规定的，从其规定。

本基金本次更新招募说明书主要涉及参与公募 REITs 投资相关内容，包括明确投资范围包含公募 REITs、增加公募 REITs 的投资策略、估值方法等，并增加投资公募 REITs 的风险揭示，更新内容及截止日期如下：

序号	更新内容	截止日期
1	基金投资组合报告和基金业绩表现 (财务数据未经审计)	参见相关章节
2	参与公募 REITs 投资相关内容	2023 年 11 月 03 日
3	基金管理人概况及主要人员信息	2023 年 11 月 03 日
4	业绩比较基准	2023 年 05 月 05 日
5	其他文字内容	2022 年 03 月 31 日

## 目 录

第一部分 绪言 .....	6
第二部分 释义 .....	7
第三部分 基金管理人.....	13
第四部分 基金托管人.....	22
第五部分 相关服务机构.....	26
第六部分 基金的募集.....	33
第七部分 基金合同的生效.....	34
第八部分 基金份额的申购与赎回.....	35
第九部分 基金的投资.....	47
第十部分 基金的业绩.....	61
第十一部分 基金的财产.....	62
第十二部分 基金资产的估值.....	63
第十三部分 基金的收益分配.....	71
第十四部分 基金的费用与税收.....	73
第十五部分 基金的会计与审计.....	76
第十六部分 基金的信息披露.....	77
第十七部分 侧袋机制.....	84
第十八部分 风险揭示.....	87
第十九部分 基金的合并、基金合同的变更、终止与基金财产的清算.....	96
第二十部分 基金合同内容摘要.....	98
第二十一部分 基金托管协议内容摘要.....	99
第二十二部分 对基金份额持有人的服务.....	100
第二十三部分 其他应披露事项.....	101
第二十四部分 招募说明书的存放及查阅方式.....	102
第二十五部分 备查文件.....	103
附件一 基金合同内容摘要.....	104
附件二 基金托管协议内容摘要.....	121

## 第一部分 绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《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销售机构监督管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金运作指引第 2 号——基金中基金指引》、《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》”）等有关法律法规及《中欧星耀优选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》（以下简称“基金合同”或“《基金合同》”）编写。

本招募说明书阐述了中欧星耀优选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）（以下简称“本基金”或“基金”）的投资目标、策略、风险、费率等与投资人投资决策有关的全部必要事项，投资人在做出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

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

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权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

## 第二部分 释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

- 1、基金或本基金：指中欧星耀优选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）
- 2、基金管理人：指中欧基金管理有限公司
- 3、基金托管人：指宁波银行股份有限公司
- 4、基金合同：指《中欧星耀优选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）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《中欧星耀优选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）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《中欧星耀优选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）招募说明书》及其更新
- 7、基金产品资料概要：指《中欧星耀优选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金产品资料概要》及其更新
- 8、基金份额发售公告：指《中欧星耀优选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金份额发售公告》
- 9、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
- 10、《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
- 11、《销售办法》：指中国证监会 2020 年 8 月 28 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 12、《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，并经 2020 年 3 月 20 日中国证监会《关于修改部分证券期货规章的决定》修正的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

13、《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

14、《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

15、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

16、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行保险监督管理委员会

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

18、个人投资者：指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和人民币合格境外机构投资者境内证券期货投资管理办法》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《合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者境内证券期货投资管理办法》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、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、定期定额投资及转托管等业务

25、销售机构：指中欧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。基金的登记机构为中欧基金管理有限公司或接受中欧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、转换及转托管等业务而引起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、锁定持有期：对于本基金各类基金份额，每份基金份额的锁定持有期指基金合同生效日（对认购份额而言）、基金份额申购确认日（对申购份额而言）或基金份额转换转入确认日（对转换转入份额而言）起（即锁定持有期起始日），至基金合同生效日、基金份额申购确认日或基金份额转换转入确认日次 3 个月的月度对日的前一日（即锁定持有期到期日）之间的区间，基金份额在锁定持有期内不办理赎回及转换转出业务。若该月度对日为非工作日或不存在对应日期的，

则顺延至下一个工作日

36、开放持有期：对于本基金各类基金份额，每份基金份额自锁定持有期结束后即进入开放持有期，开放持有期首日为锁定持有期到期日的下一个工作日。每份基金份额在开放持有期期间的开放日可以办理赎回及转换转出业务

37、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

38、T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日（不包含 T 日）

39、开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日（若本基金参与港股通交易且该工作日为非港股通交易日，则基金管理人可根据实际情况决定本基金是否开放申购、赎回及转换业务，具体以届时提前发布的公告为准）

40、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

41、《业务规则》：指《中欧基金管理有限公司开放式基金业务规则》，是规范基金管理人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

42、认购：指在基金募集期内，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

43、申购：指基金合同生效后，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

44、赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为

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

46、基金份额类别：指本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别，各基金份额类别分别设置代码，分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值

47、A 类基金份额：指在投资者认购/申购时收取前端认购/申购费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额类别

48、C 类基金份额：指在投资者认购/申购时不收取认购/申购费用，而是从

本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额类别

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

50、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

51、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

52、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%

53、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

54、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

55、元：指人民币元

56、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

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

58、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

59、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

60、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

61、**港股通**：是指内地投资者委托内地证券公司，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股票

62、**规定媒介**：指符合中国证监会规定条件的用以进行信息披露的全国性报刊及《信息披露办法》规定的互联网网站（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

63、**侧袋机制**：指将基金投资组合中的特定资产从原有账户分离至一个专门账户进行处置清算，目的在于有效隔离并化解风险，确保投资者得到公平对待，属于流动性风险管理工具。侧袋机制实施期间，原有账户称为主袋账户，专门账户称为侧袋账户

64、**特定资产**：包括：（一）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的资产；（二）按摊余成本计量且计提资产减值准备仍导致资产价值存在重大不确定性的资产；（三）其他资产价值存在重大不确定性的资产

65、**不可抗力**：指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

以上释义中涉及法律法规的内容，法律法规修订后，如适用本基金，相关内容以修订后法律法规为准。

## 第三部分 基金管理人

### 一、基金管理人概况

- 1、名称：中欧基金管理有限公司
- 2、住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 8 层
- 3、办公地址：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号上海中心大厦 8 层、10 层、16 层
- 4、法定代表人：窦玉明
- 5、组织形式：有限责任公司
- 6、成立日期：2006 年 7 月 19 日
- 7、批准设立机关：中国证监会
- 8、批准设立文号：证监基金字[2006]102 号
- 9、存续期限：持续经营
- 10、电话：021-68609600
- 11、传真：021-33830351
- 12、联系人：马云歌
- 13、客户服务热线：021-68609700，400-700-9700（免长途话费）
- 14、注册资本：2.20 亿元人民币
- 15、股权结构：

序号	股东名称	注册资本 (人民币/万元)	比例 <sup>1</sup>
1	WP Asia Pacific Asset Management LLC 华平亚太资产管理有限公司	5,126	23.3000%
2	窦玉明	4,400	20.0000%
3	国都证券股份有限公司	4,400	20.0000%
4	上海睦亿投资管理合伙企业(有限合伙)	4,400	20.0000%
5	上海穆延投资管理合伙企业(有限合伙)	388	1.7636%
6	周蔚文	792.7580	3.6034%
7	卢纯青	611.7760	2.7808%
8	葛兰	330	1.5000%
9	王培	330	1.5000%
10	于洁	163.8340	0.7447%
11	方伊	117.0180	0.5319%
12	关子阳	117.0180	0.5319%
13	卞玺云	114.4660	0.5203%
14	曲径	100	0.4545%
15	刘伟伟	100	0.4545%
16	袁维德	100	0.4545%
17	郑苏丹	87.7580	0.3989%
18	蓝小康	80	0.3636%
19	许文星	66	0.3000%
20	李维	66	0.3000%
21	黎忆海	64.3720	0.2926%
22	殷姿	45	0.2045%
<b>共 计</b>		<b>22,000</b>	<b>100%</b>

## 二、主要人员情况

### 1、基金管理人董事会成员

窦玉明先生，中国籍。清华大学经济管理学院本科、硕士，美国杜兰大学 MBA。

<sup>1</sup> 因四舍五入，股权比例加总存在尾差。

现任中欧基金管理有限公司董事长，上海盛立公益基金会理事，国寿投资保险资产管理有限公司独立董事。曾任职于君安证券有限公司、大成基金管理有限公司。历任嘉实基金管理有限公司投资总监、总经理助理、副总经理兼基金经理，富国基金管理有限公司总经理、董事。

周朗朗先生，中国香港籍。加拿大西安大略大学本科，清华大学高级管理人员工商管理硕士。现任中欧基金管理有限公司副董事长，美国华平投资集团中国金融服务行业、工业科技投资行业主管、董事总经理，河南中原消费金融股份有限公司董事。历任瑞士信贷第一波士顿（加拿大）银行和花旗银行（香港）投资银行部分析师。

张园园女士，中国籍。毕业于重庆大学本科、硕士。现任中欧基金管理有限公司董事，国都景瑞投资有限公司总经理、董事。历任重庆国际信托股份有限公司北京业务管理总部副总经理、金融市场业务部执行总裁。

刘建平先生，中国籍。北京大学法学学士、法学硕士，美国亚利桑那州立大学凯瑞商学院工商管理博士。现任中欧基金管理有限公司董事、总经理兼首席信息官，中欧基金国际有限公司董事长，中国国际经济贸易仲裁委员会仲裁员。历任北京大学教师，中国证券监督管理委员会基金监管部副处长，上投摩根基金管理有限公司督察长。

樊扬先生，中国籍。澳大利亚麦考里大学经济学硕士，清华大学高级工商管理硕士。现任中欧基金管理有限公司独立董事。历任 CPPIB PE Investment Asia Limited 董事总经理，Citron PE Investment (Hong Kong) 2016 Limited 董事总经理，中信产业基金管理公司投资总监，国际金融公司中国代表处投资官员、高级投资官员，北京鹏联投资顾问有限公司副总裁，德勤咨询（上海）有限公司北京分公司高级咨询顾问、经理，荷兰银行北京分行信贷经理，渣打银行天津分行信贷助理。

钟炜先生，中国籍。毕业于西北政法大学本科。现任中欧基金管理有限公司独立董事，北京市康达（广州）律师事务所律师。历任北京市康达（广州）律师事务所律师、广州分所主任，北京市康达律师事务所律师、高级合伙人，陕西省洋县人民法院副院长。

戴国强先生，中国籍。上海财经大学金融专业硕士，复旦大学国际金融系世

界经济专业博士。现任中欧基金管理有限公司独立董事，上海财经大学金融学教授、上海财经大学青岛财富管理研究院名誉院长，贵阳银行股份有限公司独立董事，中国绿地博大绿泽集团有限公司独立董事，上海袅之文学艺术创作有限公司执行董事，利群商业集团股份有限公司独立董事，江苏昆山农村商业银行股份有限公司独立董事。历任上海财经大学金融系副主任，上海财经大学财务金融学院副院长，上海财经大学金融学院常务副院长、院长、党委书记，上海财经大学 MBA 学院院长兼书记，上海财经大学商学院直属党支部书记兼副院长。

## 2、基金管理人监事会成员

连勃先生，中国籍。中国人民大学金融学专业硕士。现任中欧基金管理有限公司监事，美国华平投资集团股权投资部执行董事。历任瑞士信贷（香港）有限责任公司投资银行部副总裁，高盛高华证券有限公司环球银行及市场部经理，泰康资产管理有限责任公司股票研究部高级经理，中国国际金融股份有限公司研究部经理。

李琛女士，中国籍。同济大学计算机应用专业学士。现任中欧基金管理有限公司监事、理财规划总监。历任大连证券上海番禺路营业部系统管理员，大通证券上海番禺路营业部客户服务部主管。

刘京鹏先生，中国籍。复旦大学金融学硕士。现任中欧基金管理有限公司监事、产品副总监。历任华宸未来基金管理有限公司产品与金融工程部产品经理。

## 3、基金管理人高级管理人员

刘建平先生，中欧基金管理有限公司总经理，中国籍。简历同上。

卢纯青女士，中欧基金管理有限公司副总经理、权益投决会委员、投资总监、基金经理，中国籍。加拿大圣玛丽大学金融学硕士。历任北京毕马威华振会计师事务所审计，中信基金管理有限责任公司研究员，银华基金管理有限公司研究员、行业主管、研究总监助理、研究副总监。

许欣先生，中欧基金管理有限公司副总经理，上海中欧财富基金销售有限公司执行董事，中欧基金国际有限公司董事，中国籍。中国人民大学金融学硕士，中欧国际工商学院 EMBA。历任华安基金管理有限公司北京分公司投资顾问，嘉实基金管理有限公司机构理财部总监，富国基金管理有限公司总经理助理。

卞玺云女士，中欧基金管理有限公司督察长，中欧盛世资产管理(上海)有限



公司董事，兴盛天成投资管理（南平）有限公司董事，中国籍。清华大学五道口金融学院 EMBA。历任毕马威会计师事务所助理审计经理，银华基金管理有限公司投资管理部副总监，中欧基金管理有限公司风控总监。

于岚女士，中欧基金管理有限公司财务负责人/人力资源总监，上海中欧财富基金销售有限公司监事，中国籍。上海财经大学金融学硕士、上海交通大学高级金融学院 EMBA。历任上海证券信息有限公司总裁行政助理，中欧基金管理有限公司总经理助理、运营副总监、行政部总监。

#### 4、本基金基金经理

##### （1）现任基金经理

姓名	侯丹琳	性别	女
国籍	中国	最高学历、学位	研究生、博士
其他公司历任	华夏基金管理有限公司研究员		
本公司历任	研究员		
本公司现任	基金经理		
本基金经理所管理基金具体情况	产品名称	起任日期	离任日期
1	中欧睿智精选一年持有期混合型基金中基金（FOF）	2021 年 11 月 26 日	
2	中欧星耀优选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）	2022 年 07 月 01 日	
3	中欧盈选稳健 6 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）	2023 年 01 月 17 日	

##### （2）历任基金经理

基金经理	起任日期	离任日期
桑磊	2022 年 01 月 26 日	2023 年 03 月 01 日

#### 5、基金管理人投资决策委员会成员

刘建平、周蔚文、王培、蓝小康、卢纯青、卞玺云、葛兰担任权益投资决策委员会委员，负责权益投研领导工作。周蔚文为权益投资决策委员会主席。

卞玺云、黄华、LI TONG、刘建平、桑磊、邵凯担任固定收益投资决策委员会委员，负责固收投研领导工作。邵凯为固收投资决策委员会主席。

6、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、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；

4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

6、编制季度报告、中期报告和年度报告；

7、计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回价格；

8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；

9、按照规定召集基金份额持有人大会；

10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

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

12、法律、行政法规、中国证监会和基金合同规定的其他职责。

#### 四、基金管理人的承诺

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

2、基金管理人承诺不从事违反《基金法》的行为，并承诺建立健全内部风

险控制制度，采取有效措施，防止下列行为的发生：

- （1）将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
- （2）不公平地对待管理的不同基金财产；
- （3）利用基金财产或者职务之便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）侵占、挪用基金财产；
- （6）泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
- （7）玩忽职守，不按照规定履行职责；
- （8）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。

3、基金管理人承诺严格遵守基金合同，并承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反基金合同行为的发生。

4、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。

5、基金管理人承诺不从事其他法规规定禁止从事的行为。

6、基金经理承诺

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

（2）不利用职务之便为自己及其代理人、受雇人或任何第三人牟取利益；

（3）不违反现行有效的有关法律法规、基金合同和中国证监会的有关规定，不泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

（4）不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

五、基金管理人的内部控制制度

1、内部控制的原则

（1）健全性原则。内部控制应当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、部门和岗位职责应当保持相对独立，公司基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离。

（4）相互制约原则。公司内部部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡。

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

## 2、内部控制的体系结构

公司的内部控制体系结构是一个分工明确、相互牵制的组织结构，各个业务部门负责本部门的风险评估和监控，监察稽核部负责监察公司的风险管理措施的执行。具体而言，包括如下组成部分：

（1）董事会：负责制定公司的内部控制政策，对内部控制负完全的和最终的责任。

（2）监事会：对公司的经营情况进行检查，并对董事会和管理层履行职责的情况进行监督。

（3）督察长：独立行使督察权利，直接对董事会负责；就内部控制制度和执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能；向董事会和中国证监会进行定期、不定期报告。

（4）投资决策委员会：负责指导基金财产的运作，对基金投资的所有重大问题进行决策。

（5）风险控制委员会：协助确立公司风险控制的原则、目标和策略，并就风险控制重要事项进行讨论和决策。

（6）监察稽核部：独立于其他部门和业务活动，对内部控制制度的执行情况进行全面及专项检查 and 反馈，使公司在良好的内部控制环境中实现业务目标。

（7）业务部门：具体执行公司各项内部控制制度及政策，确保各项业务活动合法、合规进行。

## 3、内部控制的措施

（1）部门及岗位设置体现了职责明确、相互制约原则。

各部门及岗位均设立明确的授权分工及工作职责，并编制详细的岗位说明书和业务流程；建立重要凭据传递及信息沟通制度，实现相关部门、相关岗位之间

的监督制衡。

（2）严格授权控制。

授权控制贯穿于公司经营活动的始终。公司建立了合理的授权标准和流程，确保授权制度的贯彻执行。重大业务的授权应采取书面形式，明确授权内容和实效，对已获授权的部门和人员应建立有效的评价和反馈机制。

（3）实行恰当的岗位分离。

建立科学的岗位分离制度，各业务部门在适当授权的基础上实行恰当的岗位分离。重要业务和岗位进行物理隔离，投资与交易、交易与清算、基金会计与公司会计等重要岗位不得有人员重叠。

（4）建立完善的资产分离制度。

建立完善的资产分离制度，基金资产与公司资产、不同基金的资产和其他委托资产实行独立运作，分别核算。

（5）建立严密有效的风险管理系统。

风险管理系统包括两方面：一是公司主要业务的风险评估和检测办法、重要部门风险指标考核体系以及业务人员道德风险防范体系等；二是公司灵活有效的应急、应变措施和危机处理机制。通过严密有效的风险管理系统，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）建立完整的信息资料保全系统。

真实、全面、及时、准确地记载每一笔业务，及时准确地进行会计核算和业务记录，完整妥善地保管好会计、统计和各项业务资料档案，确保原始记录、合同契约、各种信息资料数据真实完整。

#### 4、基金管理人关于内部控制制度的声明书

基金管理人确知建立内部控制系统、维持其有效性以及有效执行内部控制制度是基金管理人董事会及管理层的责任，董事会承担最终责任；本基金管理人特别声明以上关于内部控制制度和风险管理的披露真实、准确，并承诺根据市场的变化和基金管理人的发展不断完善风险管理和内部控制制度。

## 第四部分 基金托管人

### 一、基金托管人情况

#### （一）基本情况

名称：宁波银行股份有限公司

住所：浙江省宁波市宁东路 345 号

办公地址：浙江省宁波市宁东路 345 号

法定代表人：陆华裕

注册日期：1997 年 04 月 10 日

批准设立机关和批准设立文号：中国银监会，银监复[2007]64 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：陆拾亿零捌佰零壹万陆仟贰佰捌拾陆人民币元

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：证监许可【2012】1432 号

托管部门联系人：王海燕

电话：0574-89103171

#### （二）主要人员情况

截至 2022 年 3 月底，宁波银行资产托管部共有员工 125 人，100% 以上员工拥有大学本科以上学历。

#### （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，宁波银行自 2012 年获得证券投资基金资产托管的资格以来，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丰富和成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、Q D I I 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、基金公司特定客户资产管理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 2022 年 3 月底，宁波银行共托管 105 只证券投资基金，证券投资基金托管规模 1900.85 亿元。

#### （四）基金托管人的职责

基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种池，以便基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资比例进行监督。

基金托管人通过事后监督方式对基金管理人基金投资禁止行为和关联交易进行监督。根据法律法规有关基金从事关联交易的规定，基金管理人和基金托管人应事先相互提供与本机构有控股关系的股东、与本机构有其他重大利害关系的公司名单及有关关联方发行的证券名单。基金管理人和基金托管人有责任确保关联交易名单的真实性、准确性、完整性，并负责及时将更新后的名单发送给对方。

基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的、经慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手名单，并约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金管理人应严格按照交易对手名单的范围在银行间债券市场选择交易对手。基金托管人监督基金管理人是否按事前提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易。

#### （五）基金托管人的内部控制制度

##### 1、内部风险控制目标

强化内部管理，保障国家的金融方针政策及相关法律法规贯彻执行，保证自觉合规依法经营，形成一个运作规范化、管理科学化、监控制度化的内控体系，保障业务正常运行，维护基金持有人及基金托管人的合法权益。

##### 2、内部风险控制组织结构

由宁波银行总行审计部和资产托管部内设的审计内控部门构成。资产托管部内部设置专门审计内控部门，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，对业务的运行独立行使稽核监察职权。

### 3、内部风险控制原则

（1）合法性原则：必须符合国家及监管部门的法律法规和各项制度并贯穿于托管业务经营管理活动的始终。

（2）完整性原则：一切业务、管理活动的发生都必须有相应的规范程序和监督制约；监督制约必须渗透到托管业务的全过程和各个操作环节，覆盖到基金托管部所有的部门、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：必须实现防范风险、审慎经营，保证基金财产的安全与完整。

（5）有效性原则：必须根据国家政策、法律及宁波银行经营管理的发展变化进行适时修订；必须保证制度的全面落实执行，不得有任何空间、时限及人员的例外。

（6）独立性原则：设立专门履行基金托管人职责的管理部门；直接的操作人员和控制人员必须相对独立、适当分开；基金托管部内部设置独立的负责审计内控部门专责内控制度的检查。

#### （六）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

##### 1、监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。利用“基金投资监督系统”，严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督，并定期编写基金投资运作监督报告，报送中国证监会。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

##### 2、监督流程

（1）每工作日按时通过基金监督子系统，对各基金投资运作比例控制指标进行例行监控，发现投资比例超标等异常情况，向基金管理人发出书面通知，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，并及时报告中国证监会。



（2）收到基金管理人的划款指令后，对涉及各基金的投资范围、投资对象及交易对手等内容进行合法合规性监督。

（3）根据基金投资运作监督情况，定期编写基金投资运作监督报告，对各基金投资运作的合法合规性、投资独立性和风格显著性等方面进行评价，报送中国证监会。

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

## 第五部分 相关服务机构

### 一、直销机构

名称:中欧基金管理有限公司

住所:中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 8 层

办公地址: 中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路上海中心 16 层

法定代表人: 竇玉明

联系人: 马云歌

电话: 021-68609602

传真: 021-68609601

客服热线: 021-68609700, 400-700-9700（免长途话费）

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

### 二、代销机构

1) 名称: 交通银行股份有限公司

注册地址: 上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址: 上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人: 任德奇

客服热线: 95559

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

2) 名称: 上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址: 上海市黄浦区中山东一路 12 号

办公地址: 上海市黄浦区中山东一路 12 号

法定代表人: 郑杨

客服热线: 95528

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

3) 名称: 平安银行股份有限公司

注册地址: 深圳市罗湖区深南东路 5047 号平安银行大厦

办公地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号平安银行大厦，中国广东省深圳市  
福田区益田路 5023 号平安金融中心 B 座

法定代表人：谢永林

客服热线：95511-3

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

4) 名称：宁波银行股份有限公司

注册地址：浙江省宁波市鄞州区宁东路 345 号

办公地址：浙江省宁波市鄞州区宁东路 345 号

法定代表人：陆华裕

客服热线：95574

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

5) 名称：华夏银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

法定代表人：李民吉

客服热线：95577

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

6) 名称：东方财富证券股份有限公司

注册地址：西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城 10 栋楼

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号东方财富大厦

法定代表人：戴彦

客服热线：95357

网址：[www.18.cn](http://www.18.cn)

7) 名称：蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

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

办公地址：浙江省杭州市西湖区西溪路 556 号

法定代表人：王珺

客服热线：95188-8

网址：www.fund123.cn

8) 名称：上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号金座东方财富大厦

法定代表人：其实

客服热线：400-1818-188

网址：www.1234567.com.cn

9) 名称：腾安基金销售（深圳）有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室

办公地址：深圳市南山区海天二路 33 号腾讯滨海大厦 15 层

法定代表人：林海峰

客服热线：95017 转 1 再转 8

网址：www.txfund.com

10) 名称：浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903

办公地址：浙江省杭州市余杭区五常街道同顺街 18 号同花顺大楼 4 层

法定代表人：吴强

客服热线：952555

网址：www.5ifund.com

11) 名称：北京雪球基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区创远路 34 号院 6 号楼 15 层 1501 室

办公地址：北京市朝阳区创远路 34 号院融新科技中心 C 座 17 层

法定代表人：李楠

客服热线：4001599288

网址：danjuanfunds.com

12) 名称：上海陆金所基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区源深路 1088 号 7 层（实际楼层 6 层）

办公地址：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

客服热线：400-821-9031

网址：e.lufunds.com

13) 名称：上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区东大名路 501 号 6211 单元

办公地址：上海市浦东新区张杨路 500 号华润时代广场 12 层

法定代表人：杨文斌

客服热线：400-700-9665

网址：www.howbuy.com

14) 名称：京东肯特瑞基金销售有限公司

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

办公地址：北京市亦庄经济开发区科创十一街 18 号院 A 座京东集团总部

法定代表人：邹保威

客服热线：95118

网址：kenterui.jd.com

15) 名称：诺亚正行基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

办公地址：上海市杨浦区长阳路 1687 号 2 号楼

法定代表人：汪静波

客服热线：400-821-5399

网址：www.noah-fund.com

16) 名称：嘉实财富管理有限公司

注册地址：海南省三亚市天涯区凤凰岛 1 号楼 7 层 710 号

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

法定代表人：张峰

客服热线：010- 85097302

网址：www.harvestwm.cn

17) 名称：上海华夏财富投资管理有限公司

注册地址：上海市虹口区东大名路 687 号 1 幢 2 楼 268 室

办公地址：北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

法定代表人：毛淮平

客服热线：400-817-5666

网址：www.amcfortune.com

18) 名称：南京苏宁基金销售有限公司

注册地址：江苏省南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

办公地址：江苏省南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

法定代表人：钱燕飞

客服热线：95177

网址：www.snjijin.com

19) 名称：北京度小满基金销售有限公司

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

办公地址：北京市海淀区西北旺东路 10 号院西区 4 号楼

法定代表人：盛超

客服热线：95055-4

网址：www.duxiaoman.com

20) 名称：上海挖财基金销售有限公司

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

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 759 号 2 号楼 18 层 03 单元

法定代表人：吕柳霞

客服热线：021-50810673

网址：www.wacaijijin.com

21) 名称：北京中植基金销售有限公司

注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室

办公地址：北京朝阳区大望路金地中心 A 座 28 层

法定代表人：武建华

客服热线：400-8180-888

网址：www.zzfund.com

22) 名称：宜信普泽（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区光华路 7 号楼 20 层 20A1、20A2 单元

办公地址：北京市朝阳区光华路 7 号楼 20 层 20A1、20A2 单元

法定代表人：才殿阳

客服热线：400-6099-200

网址：www.yixinfund.com

基金管理人可以根据情况变化增加或者减少销售机构，并在基金管理人网站公示。销售机构可以根据情况变化增加或者减少其销售城市、网点，并另行公告。各销售机构提供的基金销售服务可能有所差异，具体请咨询各销售机构。

### 三、登记机构

名称：中欧基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 8 层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路上海中心 10 层

法定代表人：窦玉明

总经理：刘建平

成立日期：2006 年 7 月 19 日

电话：021-68609600

传真：021-68609601

联系人：杨毅

#### 四、出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：韩炯

经办律师：黎明、陈颖华

电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：陈颖华

#### 五、审计基金财产的会计师事务所

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层

办公地址：北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层

执行事务合伙人：毛鞍宁

电话：010-58153000

传真：010-85188298

联系人：陈露

经办会计师：陈露、张亚旒



## 第六部分 基金的募集

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他法律法规的有关规定，经 2021 年 6 月 24 日中国证监会证监许可[2021]2162 号文准予募集。募集期为 2021 年 12 月 23 日至 2022 年 1 月 24 日，经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验资，按照每份基金份额面值人民币 1.00 元计算，募集期共募集 2021 年 12 月 23 日至 2022 年 1 月 24 日 266,218,393.04（含利息）份基金份额，有效认购户数为 2,594 户。

## 第七部分 基金合同的生效

### 一、基金合同的生效

本基金基金合同于 2022 年 1 月 26 日正式生效。

### 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 50 个工作日出现前述情形的，本基金将根据基金合同第十九部分的约定进行基金财产清算并终止，而无须召开基金份额持有人大会。

法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

### 三、基金份额的类别

本基金根据认购/申购费用、销售服务费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资者认购/申购时不收取认购/申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。

本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为：

计算日某类基金份额净值 = 该计算日该类基金份额的基金资产净值 / 该计算日发售在外的该类别基金份额总数。

投资者可自行选择认购/申购的基金份额类别。

在不违反法律法规规定且对已有基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金管理人与基金托管人协商一致并履行适当程序后可以增加新的基金份额类别、调整现有基金份额类别的申购费率、销售服务费率、调低赎回费率或变更收费方式、停止现有基金份额类别的销售等，调整实施前基金管理人需及时公告。

## 第八部分 基金份额的申购与赎回

### 一、基金的运作方式

对于本基金各类基金份额，每份基金份额设定锁定持有期，每份基金份额的锁定持有期为 3 个月，锁定持有期到期后进入开放持有期，每份基金份额自其开放持有期首日起才能办理赎回及转换转出业务。锁定持有期指基金合同生效日（对认购份额而言）、基金份额申购确认日（对申购份额而言）或基金份额转换转入确认日（对转换转入份额而言）起（即锁定持有期起始日），至基金合同生效日、基金份额申购确认日或基金份额转换转入确认日次 3 个月的月度对日前一日（即锁定持有期到期日）止，基金份额在锁定持有期内不办理赎回及转换转出业务，若该月度对日为非工作日或不存在对应日期的，则顺延至下一个工作日。每份基金份额的锁定持有期结束后即进入开放持有期，期间可以办理赎回及转换转出业务，每份基金份额的开放持有期首日为锁定持有期到期日的下一个工作日。

### 二、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。具体的销售网点将由基金管理人在相关公告中列明。基金管理人可根据情况针对某类基金份额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。

### 三、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/或赎回，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。若本基金参与港股通交易且该工作日为非港股通交易日时，则基金管理人可根据实际情况决定本基金是否开放申购、赎回及转换业务，具体以届时提前发布的公告为准。但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

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

#### 2、申购、赎回开始日及业务办理时间

基金管理人自基金合同生效之日起不超过 3 个月开始办理申购，具体业务办理时间详见基金管理人的相关公告。此后的每个工作日为本基金的申购业务开放日。

本基金认购份额的锁定持有期到期后，基金管理人开始办理赎回和转换转出，具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。对于每份基金份额，自其开放持有期首日起才能办理赎回和转换转出。

在确定申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告申购与赎回的开始时间。

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、赎回或转换申请且登记机构确认接受的，其基金份额申购、赎回价格为下一开放日该类基金份额申购、赎回的价格。在申购开放日、赎回开放日以外的日期或时间提出的相关申请，将不予确认。

本基金自 2022 年 4 月 26 日起开放日常申购、赎回及定期定额投资业务。

#### 四、申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日的该类基金份额净值为基准进行计算；

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；

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

5、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》的有关规定在规定媒介上公告。

#### 五、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。

## 2、申购和赎回的款项支付

投资人申购基金份额时，必须全额交付申购款项，投资人交付申购款项，申购成立；基金份额登记机构确认基金份额时，申购生效。

基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；基金份额登记机构确认赎回时，赎回生效。

投资人赎回申请生效后，基金管理人将在 T+10 日(包括该日)内支付赎回款项。在发生巨额赎回或基金合同约定的延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。遇交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其他非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程，则赎回款项划付时间相应顺延。

## 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+3 日内对该交易的有效性进行确认。T 日提交的有效申请，投资人应在 T+4 日后(包括该日)及时到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功，则申购款项本金退还给投资人，不进入锁定持有期。

基金销售机构对申购、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、赎回申请的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利，否则，由此产生的投资人任何损失由投资人自行承担。

## 六、申购和赎回的数量限制

1、其他销售机构的销售网点每个账户单笔申购的最低金额为 1 元（含申购费，下同）。在不违反前述规定的前提下，各销售机构对本基金最低申购金额及交易级差有其他规定的，以各销售机构的业务规定为准。

直销机构每个账户首次申购的最低金额为 10,000 元，追加申购的最低金额为单笔 10,000 元。其他销售机构的销售网点的投资者欲转入直销机构进行交易要受直销机构最低申购金额的限制。投资者当期分配的基金收益转为基金份额时，不受最低申购金额的限制。通过基金管理人网上交易系统办理基金申购业务的不受直销机构单笔申购最低金额的限制，具体规定请至基金管理人网站查询。基金

管理人可根据市场情况，调整本基金首次申购的最低金额和追加申购的最低金额。

投资者可多次申购，对单个投资者的累计持有份额不设上限限制，本招募说明书另有约定的除外。但单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的 50%（在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过 50%的除外）。法律法规、监管机构另有规定的，从其规定。

2、基金份额持有人在销售机构赎回时，每次对本基金的赎回申请不得低于 0.01 份基金份额。若某笔份额减少类业务导致单个基金交易账户的基金份额余额不足 0.01 份的，登记机构有权对该基金份额持有人在該基金交易账户持有的基金份额做全部赎回处理（份额减少类业务指赎回、转换转出、非交易过户等业务，具体种类以相关业务规则为准）。

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等数量限制。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

## 七、申购和赎回的价格、费用及其用途

1、本基金各类基金份额净值的计算，均保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。特殊情况下，基金管理人可与基金托管人、登记机构协商增加基金份额净值计算位数，以维护基金投资人利益。T 日各类基金份额的基金份额净值在 T+2 日内计算，并在 T+3 日内公告。遇特殊情况，经履行适当程序，可以适当延迟计算或公告。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值。

2、申购的有效份额为净申购金额除以当日该类基金份额的基金份额净值，有效份额单位为份，上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。投资人在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。

（1）申购费用

本基金 A 类基金份额在投资人申购时收取申购费。申购费用不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用。C 类基金份额不收取申购费用。

本基金对通过直销中心申购本基金 A 类基金份额的养老金客户实施优惠的申购费率。

养老金客户包括基本养老保险与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金等，具体包括：

- 1) 全国社会保障基金；
- 2) 可以投资基金的地方社会保障基金；
- 3) 企业年金单一计划以及集合计划；
- 4) 企业年金理事会委托的特定客户资产管理计划；
- 5) 企业年金养老金产品；
- 6) 职业年金计划；
- 7) 养老目标基金；
- 8) 个人税收递延型商业养老保险等产品。

如将来出现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。非养老金客户指除养老金客户外的其他投资人。

通过基金管理人的直销中心申购本基金 A 类基金份额的养老金客户的优惠申购费率见下表：

申购金额（M）	费率
M < 100 万元	0.12%
100 万元 ≤ M < 500 万元	0.10%
M ≥ 500 万元	每笔 1000 元

非养老金客户申购本基金 A 类基金份额的申购费率见下表：

申购金额（M）	费率
M < 100 万元	1.20%

100 万元 ≤ M < 500 万元	1.00%
M ≥ 500 万元	每笔 1000 元

（2）申购份额的计算

1) 若投资者选择申购 A 类基金份额，则申购份额的计算公式为：

当申购费用适用比例费率时，申购份额的计算方法如下：

净申购金额 = 申购金额 / (1 + 申购费率)

申购费用 = 申购金额 - 净申购金额

申购份额 = 净申购金额 / 申购当日 A 类基金份额的基金份额净值

当申购费用为固定金额时，申购份额的计算方法如下：

申购费用 = 固定金额

净申购金额 = 申购金额 - 申购费用

申购份额 = 净申购金额 / 申购当日 A 类基金份额的基金份额净值

例：某投资人（非养老金客户）投资 10,000 元申购本基金 A 类基金份额，其对应的申购费率为 1.20%，假设申购当日本基金 A 类基金份额净值为 1.0000 元，则可得到的申购份额为：

净申购金额 = 10,000 / (1 + 1.20%) = 9,881.42 元

申购费用 = 10,000 - 9,881.42 = 118.58 元

申购份额 = 9,881.42 / 1.0000 = 9,881.42 份

即：投资人（非养老金客户）投资 10,000 元申购本基金 A 类基金份额，假设申购当日本基金的 A 类基金份额净值为 1.0000 元，则其可得到 A 类基金份额 9,881.42 份。

2) 若投资者选择申购 C 类基金份额，则申购份额的计算公式为：

申购份额 = 申购金额 / 申购当日 C 类基金份额的基金份额净值

例：某投资人投资 100,000 元申购本基金 C 类基金份额，假设申购当日本基金 C 类基金份额的基金份额净值为 1.0000 元，则可得到的申购份额为：

申购份额 = 100,000 / 1.0000 = 100,000.00 份

即：投资人投资 100,000 元申购本基金 C 类基金份额，假设申购当日本基金 C 类基金份额的基金份额净值为 1.0000 元，则其可得到本基金 C 类基金份额



100,000.00 份。

### 3、赎回费用和赎回份额的计算

#### （1）赎回费用

1) 对于本基金 A 类基金份额，赎回费率见下表：

持有期限（N）	赎回费率
N < 180 天	0.5%
N ≥ 180 天	0

注：赎回份额的持有期限，以该份额在登记机构的登记日开始计算。

2) 对于本基金 C 类基金份额，赎回费率见下表：

持有期限（N）	赎回费率
N < 180 天	0.5%
N ≥ 180 天	0

注：赎回份额的持有期限，以该份额在登记机构的登记日开始计算。

3) 赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。对持有期限不少于 3 个月但少于 6 个月的投资人，将不低于赎回费总额的 50% 计入基金财产；赎回费用未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费（注：1 个月以 30 日计算）。

#### （2）赎回金额的计算

赎回金额 = 赎回份额 × 赎回当日该类基金份额净值

赎回费用 = 赎回份额 × 赎回当日该类基金份额净值 × 赎回费率

净赎回金额 = 赎回金额 - 赎回费用

上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

例：某投资人赎回本基金 10,000 份 A 类基金份额，持有期限为 5 个月，对应的赎回费率为 0.50%，假设赎回当日本基金 A 类基金份额的基金份额净值是 1.0500 元，则其可得到的净赎回金额为：

赎回金额 = 10,000 × 1.0500 = 10,500.00 元

赎回费用 = 10,000 × 1.0500 × 0.50% = 52.50 元

净赎回金额 = 10,500.00 - 52.50 = 10,447.50 元

即：某投资人赎回持有的 10,000 份本基金 A 类基金份额，持有期限为 5 个月，假设赎回当日本基金 A 类基金份额的基金份额净值是 1.0500 元，则其可得

到的净赎回金额为 10,447.50 元。

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

5、当本基金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。

6、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率，并进行公告。

#### 八、拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

- 1、因不可抗力导致基金无法正常运作。
- 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。
- 3、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
- 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、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。
- 7、基金管理人、基金托管人、基金销售机构或登记机构的异常情况导致基金销售系统、基金登记系统或基金会计系统无法正常运行。
- 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基金份额总数的 50%，或者有可能导致投资者变相规避前述 50%比例要求的集中度的情形时。

9、占本基金相当比例的被投资基金暂停估值，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

10、占本基金相当比例的被投资基金暂停申购，基金管理人认为有必要暂停本基金申购的情形。

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

12、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、10、12 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在规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，被拒绝的申购款项本金将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

#### 九、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。

3、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

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

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投资人的赎回申请。

7、占本基金相当比例的被投资基金暂停估值，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

8、占本基金相当比例的被投资基金暂停赎回，基金管理人认为有必要暂停

本基金赎回的情形。

#### 9、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，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，可延期支付。若出现上述第 4 项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

#### 十、巨额赎回的情形及处理方式

##### 1、巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过前一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该类基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

（3）若本基金发生巨额赎回且单个开放日内单个基金份额持有人的赎回申请超过上一工作日基金总份额 40%的，基金管理人有权对该单个基金份额持有人超出该 40%比例的赎回申请实施延期办理，对该单个基金份额持有人剩余赎回申请与其他账户赎回申请按前述条款处理。

（4）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，并应当在规定媒介上进行公告。

### 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 日内在规定媒介上刊登公告。

## 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在规定媒介上刊登暂停公告。

2、基金管理人应于重新开放日，在规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 个估值日各类基金份额的基金份额净值。

## 十二、基金转换

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

## 十三、基金的非交易过户

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

继承是指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；捐赠指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体；司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的

基金份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供基金登记机构要求提供的相关资料，对于符合条件的非交易过户申请按基金登记机构的规定办理，并按基金登记机构规定的标准收费。

#### 十四、基金的转托管

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

#### 十五、定期定额投资计划

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

#### 十六、基金份额的冻结和解冻

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。

#### 十七、基金份额的转让

在法律法规允许且条件具备的情况下，基金管理人可受理基金份额持有人通过中国证监会认可的交易场所或者交易方式进行份额转让的申请并由登记机构办理基金份额的过户登记。基金管理人拟受理基金份额转让业务的，将提前公告，基金份额持有人应根据基金管理人公告的业务规则办理基金份额转让业务。

#### 十八、基金份额的折算

经与基金托管人协商一致，基金管理人有权根据市场情况对本基金进行份额折算，折算前后基金份额持有人持有的基金资产不变。基金管理人将在份额折算前 3 个工作日就折算方案、折算时间等内容进行相应公告。

#### 十九、实施侧袋机制期间本基金的申购与赎回

本基金实施侧袋机制的，本基金的申购和赎回安排详见本招募说明书“侧袋机制”部分的规定或相关公告。

## 第九部分 基金的投资

### 一、投资目标

本基金是基金中基金，灵活投资于多种具有不同风险收益特征的基金和其他资产，在严格控制投资组合风险的前提下，寻求基金资产的长期稳健增值。

### 二、投资范围

本基金投资于依法发行或上市的公开募集证券投资基金、股票、债券等金融工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。具体包括：经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金（含 QDII 基金、香港互认基金、公开募集基础设施证券投资基金（以下简称“公募 REITs”）、股票（包含创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、港股通机制下允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、地方政府债、政府支持机构债、政府支持债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具等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。

基金的投资组合比例为：80%以上基金资产投资于其他经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金（含 QDII 基金、香港互认基金、公募 REITs）；本基金对权益类资产的投资合计占基金资产的比例为 60%-95%，其中，本基金投资于港股通标的股票不超过股票资产的 50%；本基金投资的权益类资产包括股票、股票型基金以及至少满足以下一条标准的混合型基金：（1）基金合同约定的股票资产占基金资产的比例不低于 60%；（2）基金最近 4 期季度报告中披露的股票资产占基金资产的比例均不低于 60%。本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履

行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

### 三、投资策略

#### 1、大类资产配置策略

在大类资产配置方面，本基金主要采用战略资产配置策略（SAA）和战术资产配置策略（TAA）。

战略资产配置策略（SAA）是决定基金长期收益率和波动率的关键，也是基金力争实现将基金投资组合长期波动率控制在合适水平这一投资目标的核心。本基金的战略资产配置策略（SAA）将从国内股票和债券市场的风险收益特征出发，通过综合分析宏观政策、经济周期、行业发展趋势、市场流动性水平，投资人风险收益偏好等因素，以分散投资的方式，锚定长期目标波动率，进行有效的长期资产配置。

本基金的战术资产配置策略（TAA）是指会更多着眼于在充分研究分析诸如细分经济周期、各项经济指标、货币政策变化、利率水平、信用利差变化、突发事件性因素等中短期市场变化的基础上，根据具体不同市场形势的具体转变而对基金各类资产组合既定长期投资比例所进行的动态调整，力争使基金投资组合的长期波动率与目标值不发生重大偏离。通过战术资产配置，本基金将在战略资产配置层面实现对长期资产配置的优化，力争获取超额回报。

#### 2、基金投资策略

对于不同类别的公募基金，本基金将分别按照不同的指标进行筛选，其中：对货币型基金，主要从基金规模、流动性、风险、收益率等层面进行评估，以满足流动性管理要求为主。

对于指数基金、ETF、大宗商品基金等被动管理的公募基金，本基金主要通过其配合市场、行业板块轮动等进行优选配置，增强投资回报。本基金使用日最大跟踪偏离度、累计跟踪偏离度、日均跟踪偏离度、跟踪误差等指标评估其投资风格、收益情况、波动性以及回撤等并考虑子基金的基金规模、是否是市场基准指数、是否开放申购赎回等因素，选择优质标的进行投资。

对于主动管理的公募非货币型基金，本基金通过基金评价研究机构推荐、量化指标筛选打分等一种或多种方法，进行初步分析，获得候选基金池。在候选基金池范围内，从多维度对待选投资标的进行定性分析，并做出最终的投资决策。具体来说：



### （1）定量维度

本基金将考察风格稳定性、风险收益有效性、收益性、风险度和回撤控制五大类指标，依据基金在过往选定的时间窗口各项指标的表现，对基金经理的投资能力、业绩持续性以及风格稳定性等进行综合打分。

其中风格稳定性指标主要包含：与业绩基准或市场指数的相关系数、回归系数、滚动相关系数标准差、基金经理管理年限等细分指标。风险收益有效性主要包含：信息比率、夏普比率等细分指标。收益性主要包含年化收益率、特定区间的滚动收益率、相对业绩基准或市场指数的超额收益等细分指标。风险度主要包含年化标准差、跟踪误差等细分指标。回撤控制主要包含最大回撤绝对值以及与业绩基准或市场指数最大回撤的比较等指标。

通过定量维度，本基金将剔除业绩持续性以及风格稳定性均差的基金投资标的，选出本基金拟投资的候选基金池。

### （2）定性维度

在定量维度选出的候选基金池后，本基金将从定性维度进一步判断各基金的投资价值。具体来说，分为以下几个项目：

#### 1) 基金管理人

该项目主要考察基金公司的股东结构，管理层的经营哲学，公司业务拓展目标，以及是否为员工提供合理的激励机制，公司人员流动，员工的素质与从业经历，资源的分配与组织架构等因素。

#### 2) 基金经理

该项目主要考察具体候选基金的基金经理情况，包括基金经理的从业年限，管理单只基金的最长年限，投资风格，从业管理人家数，基金经理历史从业合规情况。

#### 3) 流程

该项目主要考察基金，特别是各混合型基金的风格与策略是否具有 consistency，是否具有特殊的投资策略安排、独特的风险收益特征，投资组合的建构方法是否严谨，基金的运作是否合法合规，是否有适当的风险管理与控制等因素。

#### 4) 业绩

在定量分析的基础上，该项目主要侧重从定性角度考察基金超额收益的来源，

分析历史业绩的优缺点，适合的市场风格，业绩表现的稳定性等因素。

#### 5) 成本

该项目主要考察候选基金的费用情况，包含申购费、管理费、托管费、销售服务费、赎回费等，在同等条件下优选低费率基金产品。

对于公募 REITs，本基金将综合考量宏观经济运行情况、基金资产配置策略、底层资产运营情况、流动性及估值水平等因素，对公募 REITs 的投资价值进行深入研究，精选出具有较高投资价值的公募 REITs 进行投资。本基金根据投资策略需要或市场环境变化，可选择将部分基金资产投资于公募 REITs，但本基金并非必然投资公募 REITs。

### 3、股票投资策略

#### （1）A 股投资策略

本基金主要采取自下而上的主动投资管理策略，精选价值被低估的个股，对公司的历史沿革、财务状况、盈利能力及前景、资产及权益价值等进行全面深入的研究分析，反复推敲测算公司的合理价值；自上而下判断公司所在行业在长周期中所处的位置以配合对公司合理价值的评估，注重安全边际，选择能为投资者持续创造价值的股票；同时辅以合理价值发现和被市场认同的触发因素判断，提高选股的有效性。

对于存托凭证的投资，本基金将依照境内上市交易的股票，通过定性分析和定量分析相结合的方式，精选优质上市公司；并最大限度避免由于存托凭证在交易规则、上市公司治理结构等方面的差异而或有的负面影响。

#### （2）港股投资策略

本基金可通过港股通机制投资港股通机制下允许买卖的规定范围内的香港联交所上市的股票。对于港股通标的股票，本基金主要采用“自下而上”个股研究方式，精选出具有投资价值的优质标的。其筛选维度主要包括但不限于：治理结构与管理层（例如：良好的公司治理结构，优秀、诚信的公司管理层等）、行业集中度及行业地位（例如：具备独特的核心竞争优势，如产品优势、成本优势、技术优势和定价能力等）、公司业绩表现（例如：业绩稳定并持续、具备中长期持续增长的能力等）。

### 4、债券投资策略

本基金考察国内宏观经济景气周期引发的债券市场收益率的变化趋势，采取利率预期、久期管理、收益率曲线策略等积极投资策略，力求获取高于业绩比较基准的回报。

#### 5、可转债和可交债投资策略

本基金将对所有可转换债券所对应的股票进行基本面分析，具体采用定量分析和定性分析相结合的方式，考量包括正股基本面、转股溢价率、纯债溢价率、信用风险及流动性等综合因素判断其债券投资价值。

可交换债券与可转换债券的区别在于换股期间用于交换的股票并非自身新发的股票，而是发行人持有的其他上市公司的股票。可交换债券同样具有股性和债性，其中债性与可转换债券相同，即选择持有可交换债券至到期以获取票面价值和票面利息；而对于股性的分析则需关注目标公司的股票价值。本基金将通过目标公司股票的投资价值分析和可交换债券的纯债部分价值分析综合开展投资决策。

#### 6、资产支持证券投资策略

本基金通过对资产支持证券资产池结构和质量的跟踪考察、分析资产支持证券的发行条款、预估提前偿还率变化对资产支持证券未来现金流的影响，谨慎投资资产支持证券。

### 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）本基金 80%以上基金资产投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金（含 QDII 基金、香港互认基金、公募 REITs）；

（2）本基金对权益类资产的投资合计占基金资产的比例为 60%-95%（其中，本基金投资于港股通标的股票不超过股票资产的 50%，本基金投资的权益类资产包括股票、股票型基金以及至少满足以下一条标准的混合型基金：（1）基金合同约定的股票资产占基金资产的比例不低于 60%；（2）基金最近 4 期季度报告中披露的股票资产占基金资产的比例均不低于 60%；

（3）本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

（4）本基金持有单只基金的市值，不高于本基金资产净值的 20%，且不得持有其他基金中基金；

（5）本基金投资货币市场基金占基金资产的比例不得高于 15%；

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

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

（8）本基金投资于封闭运作基金、定期开放基金等流通受限基金，不得超过基金资产净值的 10%；

（9）本基金持有一家公司发行的证券（不含本基金所投资的基金份额），其市值（同一家公司在境内和香港同时上市的 A+H 股合计计算）不超过基金资产净值的 10%；

（10）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券（不含本基金所投资的基金份额且同一家公司在境内和香港同时上市的 A+H 股合计计算），不超过该证券的 10%，完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金品种可以不受此条款规定的比例限制；

（11）本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述比例限制；

（12）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%；

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

（14）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%；

（15）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%；

（16）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；

（17）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；

（18）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%；本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

（19）本基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

（20）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该比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

（21）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；

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

（23）法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他投资限制。

因证券市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合前款第（4）项、第（7）项规定的投资比例的，基金管理人应当在 20 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。除上述第（3）项、第（4）项、第（7）项、第（16）项、第（20）项、第（21）项外，因证券市场波动、证券发行人合并或基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符

合基金合同的有关约定。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基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或调整上述限制，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或按照调整后的规定执行。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- （1）承销证券；
- （2）违反规定向他人贷款或者提供担保；
- （3）从事承担无限责任的投资；
- （4）向其基金管理人、基金托管人出资；
- （5）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- （6）持有具有复杂、衍生品性质的基金份额，包括分级基金和中国证监会认定的其他基金份额；
- （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。

如法律、行政法规或监管部门取消或调整上述限制，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或调整后的规定执行。

## 五、投资决策

### 1、投资决策依据

投资决策依据包括：国家有关法律、法规、规章和基金合同的有关规定；宏观经济发展趋势、微观企业运行趋势；证券市场走势。

### 2、投资决策原则

合法合规、保密、忠于客户、资产分离、责任分离、谨慎投资、公平交易及严格控制。

### 3、投资决策机制

本基金投资的主要组织机构包括投资决策委员会、投资策略组负责人、基金经理、研究部和中央交易室，投资过程须接受风险管理部、监察稽核部的监督和信息技术部、基金运营部的技术支持。

其中，投资决策委员会作为公司基金投资决策的最高机构，对基金投资的重大问题进行决策，并在必要时做出修改。

投资策略组负责人负责本策略组内投资策略和内外部沟通工作，并监控、审查基金资产的投资业绩和策略风险。

基金经理根据投资决策委员会的原则和决议精神，结合证券池及有关研究报告，负责投资组合的构建和日常管理，向中央交易室下达投资指令并监控组合仓位。

### 4、投资决策程序

本基金通过对不同层次的决策主体明确投资决策权限，建立完善的投资决策体系和投资运作流程：

（1）投资决策委员会会议：由投资决策委员会主席主持，对基金总体投资政策、业绩表现和风险状况、基金投资授权方案等重大投资决策事项进行深入分析、讨论并做出决议。

（2）在借助外部研究成果的基础上，研究部同时进行独立的内部研究。

（3）基金经理根据投资决策委员会授权和会议决议，在研究部的研究支持下，拟定投资计划，并进行投资组合构建或调整。在组合构建和调整的过程中，基金经理必须严格遵守基金合同的投资限制及其他要求。

（4）中央交易室按照有关制度流程负责执行基金经理的投资指令，并担负一线风险监控职责。

### 5、风险分析与绩效评估

研究部负责定期和不定期就投资目标实现情况、业绩归因分析、跟踪误差来源等方面，对基金进行投资绩效评估，并提供相关报告。基金经理可以据此评判投资策略，进而调整投资组合。

## 6、组合监控与调整

基金经理将跟踪宏观经济状况和发展预期以及证券市场的发展变化，结合基金当期的申购和赎回现金流量情况，以及组合风险与绩效评估的结果，对投资组合进行监控和调整。

## 六、业绩比较基准

本基金业绩比较基准：中证偏股型基金指数收益率\*80%+银行活期存款利率（税后）\*20%。

中证偏股型基金指数由中证指数有限公司编制并发布，选取所有股票型基金以及混合型基金中以股票为主要投资对象的基金作为样本，以反映所有偏股型开放式证券投资基金的整体走势。银行活期存款利率由中国人民银行公布，如果活期存款利率或利息税发生调整，则新的业绩比较基准将从调整当日起开始生效。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时，本基金可以在与基金托管人协商一致的情况下，并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，无需召开基金份额持有人大会。如果本基金业绩比较基准所参照的指数在未来不再发布时，基金管理人可以按相关监管部门要求履行相关手续后，依据维护基金份额持有人合法权益的原则，选取相似的或可替代的指数作为业绩比较基准的参照指数，而无需召开基金份额持有人大会，但需在实施日前按照《信息披露办法》的要求在规定媒介公告。

## 七、风险收益特征

本基金为混合型基金中基金(FOF)，风险与预期收益高于债券型基金中基金、债券型基金，高于货币型基金中基金、货币市场基金，低于股票型基金中基金、股票型基金。本基金还可投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

## 八、基金管理人代表基金行使相关权利的处理原则及方法

- 1、不谋求对上市公司的控股；
- 2、有利于基金财产的安全与增值；



3、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东、债权人或被投资基金的基金份额持有人权利，保护本基金基金份额持有人的利益。

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。

#### 九、侧袋机制的实施和投资运作安排

当基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，根据最大限度保护基金份额持有人利益的原则，基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制。

侧袋机制实施期间，本部分约定的投资组合比例、投资策略、组合限制、业绩比较基准、风险收益特征等约定仅适用于主袋账户。

侧袋账户的实施条件、实施程序、运作安排、投资安排、特定资产的处置变现和支付等对投资者权益有重大影响的事项详见本招募说明书“侧袋机制”部分的规定。

#### 十、基金投资组合报告

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

基金托管人根据基金合同规定，复核了本投资组合报告，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取自本基金 2022 年第 1 季度报告，所载数据截至 2022 年 3 月 31 日，本报告中所列财务数据未经审计。

##### 1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	217,723,454.61	86.97
3	固定收益投资	25,036,557.15	10.00
	其中：债券	25,036,557.15	10.00
	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	7,495,660.89	2.99
8	其他资产	87,574.10	0.03
9	合计	250,343,246.75	100.00

## 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

### 2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

### 2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

## 3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

## 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	16,067,002.74	6.42
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）	8,969,554.41	3.59
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	25,036,557.15	10.01

## 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	019666	22 国债 01	160,000	16,067,002.74	6.42
2	110073	国投转债	25,000	2,666,001.37	1.07
3	113052	兴业转债	23,380	2,571,604.63	1.03
4	113053	隆 22 转债	20,400	2,498,545.05	1.00
5	110084	贵燃转债	11,500	1,233,403.36	0.49

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

#### 9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

股指期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

##### 9.2 本基金投资股指期货的投资政策

股指期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

#### 10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 10.1 本期国债期货投资政策

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

##### 10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

### 10.3 本期国债期货投资评价

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

## 11、投资组合报告附注

11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本报告期内没有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。

11.2 截止本报告期末，本基金未涉及股票相关投资。

### 11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	18,910.44
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	68,663.66
7	其他	-
8	合计	87,574.10

### 11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	110073	国投转债	2,666,001.37	1.07

### 11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

### 11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本报告中因四舍五入原因，投资组合报告中市值占总资产或净资产比例的分项之和与合计可能存在尾差。

## 第十部分 基金的业绩

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

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

本基金合同生效日 2022 年 1 月 26 日，本次更新不对业绩进行展示。

## 第十一部分 基金的财产

### 一、基金资产总值

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

### 二、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### 三、基金财产的账户

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

### 四、基金财产的保管和处分

本基金财产独立于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人、基金登记机构和基金销售机构以其自有的财产承担其自身的法律责任，其债权人不得对本基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。除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。

## 第十二部分 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。即本基金的基金份额净值和基金份额累计净值的归属日。

### 二、估值对象

基金所拥有的股票、债券、资产支持证券、基金和银行存款本息、应收款项等其他投资等资产及负债。

### 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。

（三）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、基金估值方法

（1）本基金投资于非上市基金的估值。

1) 本基金投资的境内非货币市场基金，按所投资基金估值日的份额净值估值。

2) 本基金投资的境内货币市场基金，按所投资基金前一估值日后至估值日期间（含节假日）的万份收益计提估值日基金收益。

（2）本基金投资于交易所上市基金的估值。

1) 本基金投资的 ETF 基金，按所投资 ETF 估值日的交易所挂牌收盘价估值。

2) 本基金投资的境内上市开放式基金（LOF），按所投资基金估值日的份额净值估值。

3) 本基金投资的境内上市定期开放式基金、封闭式基金，按所投资基金估值日的交易所挂牌收盘价估值。

4) 本基金投资的境内上市交易型货币市场基金，如所投资基金披露份额净值，则按所投资基金估值日的份额净值估值；如所投资基金披露万份（百份）收益，则按所投资基金前一估值日后至估值日期间（含节假日）的万份（百份）收益计提估值日基金收益。

（3）如遇所投资基金不公布基金份额净值、进行折算或拆分、估值日无交易等特殊情况的，本基金根据以下原则进行估值：

1) 以所投资基金的基金份额净值估值的，若所投资基金与本基金估值频率一致但未公布估值日基金份额净值，按其最新公布的基金份额净值为基础估值；

2) 以所投资基金的收盘价估值的，若估值日无交易，且最近交易日后市场环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后市场环境发生了重大变化的，可使用最新的基金份额净值为基础或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，确定公允价值；

3) 如果所投资基金前一估值日至估值日期间发生分红除权、折算或拆分，本基金根据基金份额净值或收盘价、单位基金份额分红金额、折算拆分比例、持仓份额等因素合理确定公允价值。



（4）当基金管理人认为所投资基金按上述第（1）至第（3）条进行估值存在不公允时，应与基金托管人协商一致采用合理的估值技术或估值标准确定其公允价值。

## 2、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）交易所上市实行净价交易或挂牌转让的固定收益品种（基金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）交易所上市交易的可转换债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

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。

## 3、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。

## 4、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。

5、同一股票或债券同时在两个或两个以上市场交易的，按股票或债券所处的市场分别估值。

6、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，以第三方估值机构提供的估值净价估值；对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券、资产支持证券等固定收益品种，按成本估值。

7、当基金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。

8、汇率：本基金外币资产价值计算中，涉及港币对人民币汇率的，应当以基金估值日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价为准。若本基金现行估值汇率不再发布或发生重大变更，或市场上出现更为公允、更适合本基金的估值汇率时，基金管理人与基金托管人协商一致后可根据实际情况调整本基金的估值汇率，无需召开基金份额持有人大会。

9、税收：对于按照中国法律法规和基金投资所在地的法律法规规定应交纳的各项税金，本基金将按权责发生制原则进行估值；对于因税收规定调整或其他原因导致基金实际交纳税金与估算的应交税金有差异的，基金将在相关税金调整日或实际支付日进行相应的估值调整。

10、本基金投资存托凭证的估值核算，依照境内上市交易的股票执行。

11、如有确凿证据表明按原有方法进行估值不能客观反映上述资产或负债公允价值的，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方法估值。

12、相关法律法规以及监管部门、自律规则另有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会

计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对基金净值信息的计算结果对外予以公布。

## 五、估值程序

1、各类基金份额的基金份额净值是按照估值日该类基金份额的基金资产净值除以该日该类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。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值。

基金管理人应每个估值日计算基金资产净值及各类基金份额的基金份额净值，并按规定公告。

2、基金管理人应每个估值日对各类基金份额的基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个估值日对基金资产估值后，将各类基金份额的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，由基金管理人按约定对外公布。

## 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（含各类基金份额的基金份额净值，下同）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。

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

## 2、估值错误处理原则

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

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

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

（4）估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

## 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

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

## 4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

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

（2）错误偏差达到基金份额净值的 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，并报中国证监会备案。

（3）前述内容如法律法规或者监管部门另有规定的，从其规定。如果行业另有通行做法，基金管理人和基金托管人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商。

#### 七、暂停估值的情形

- 1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 2、因不可抗力或其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、当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上的，经与基金托管人协商一致的，基金管理人应当暂停估值；
- 4、占基金相当比例的被投资基金暂停估值时；
- 5、中国证监会和基金合同认定的其他情形。

#### 八、基金净值的确认

用于基金信息披露的基金资产净值和各类基金份额的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 T+2 日内计算 T 日的基金资产净值和各类基金份额的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按约定于 T+3 日内予以公布。

#### 九、特殊情况的处理

1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 11 项进行估值时，所造成的误差不能作为基金资产估值错误处理。

2、由于不可抗力原因，或证券交易所、登记结算公司等第三方机构发送的数据错误等其他原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误而造成的基金资产估值错误，基金管理人、基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应积极采取必要的措施减

轻或消除由此造成的影响。

#### 十、实施侧袋机制期间的基金资产估值

本基金实施侧袋机制的，应根据本部分的约定对主袋账户资产进行估值并披露主袋账户的基金净值信息，暂停披露侧袋账户基金份额净值。

## 第十三部分 基金的收益分配

### 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、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金份额持有人可对各类基金份额分别选择不同的分红方式。选择采取红利再投资形式的，红利再投资的份额免收申购费；

2、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；

3、同一类别的每份基金份额享有同等分配权；

4、因红利再投资所得的份额与原份额适用相同的锁定持有期；

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，基金管理人可对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

### 四、收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截至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后确定，依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

### 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

投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为相应类别的基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。

#### 七、实施侧袋机制期间的收益分配

本基金实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配。



## 第十四部分 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、基金的销售服务费；
- 4、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券等交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、基金相关账户的开户及维护费用；
- 10、基金投资其他基金产生的其他基金的费用（包括但不限于申购费、赎回费、销售服务费），但法律法规禁止从基金财产中列支的除外；
- 11、因投资港股通标的股票而产生的各项合理费用；
- 12、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

本基金投资于本基金管理人所管理的公开募集证券投资基金的部分不收取管理费。本基金的管理费按前一日基金资产净值中扣除本基金持有的基金管理人自身管理的其他公开募集证券投资基金对应资产净值后剩余部分（若为负数，则取 0）的 1.00% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值中扣除本基金持有的基金管理人自身管理的其他公开募集证券投资基金对应资产净值后剩余部分，若为负数，则 E 取 0。

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人与基金托管人核对一致后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 2

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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

## 2、基金托管人的托管费

本基金投资于本基金托管人所托管的公开募集证券投资基金的部分不收取托管费。本基金的托管费按前一日基金资产净值中扣除本基金持有的基金托管人自身托管的其他公开募集证券投资基金对应资产净值后剩余部分（若为负数，则取 0）的 0.20% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值中扣除本基金持有的基金托管人自身托管的其他公开募集证券投资基金对应资产净值后剩余部分，若为负数，则 E 取 0。

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人与基金托管人核对一致后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

## 3、基金的销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.80%，销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.80% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的销售服务费

E 为前一日基金资产净值

销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，经基金管理人代付给各个基金销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类”中第 4—12 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。

基金管理人运用本基金财产申购自身管理的基金的（ETF 除外），应当通过直销渠道申购且不得收取申购费、赎回费（按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取，并计入基金财产的赎回费用除外）、销售服务费等销售费用。

#### 四、实施侧袋机制期间的基金费用

本基金实施侧袋机制的，与侧袋账户有关的费用可以从侧袋账户中列支，但应待侧袋账户资产变现后方可列支，有关费用可酌情收取或减免，但不得收取管理费，详见本招募说明书“侧袋机制”部分的规定。

#### 五、基金税收

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

## 第十五部分 基金的会计与审计

### 一、基金会计政策

1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；

2、基金的会计年度为公历年度的 1 月 1 日至 12 月 31 日；基金首次募集的会计年度按如下原则：如果基金合同生效少于 2 个月，可以并入下一个会计年度披露；

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或双方约定的其他方式确认。

### 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符合《中华人民共和国证券法》规定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。更换会计师事务所按照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

## 第十六部分 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。

### 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符合中国证监会规定条件的全国性报刊（以下简称“规定报刊”）及《信息披露办法》规定的互联网网站（以下简称“规定网站”）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：

（一）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规定网站上；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，并登载在规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三日前，将基金份额发售公告、基金招募说明书提示性公告和基金合同提示性公告登载在规定报刊上，将基金份额发售公告、基金招募说明书、基金产品资料概要、《基金合同》和基金托管协议登载在规定网站上，并将基金产品资料概要登载在基金销售机构网站或营业网点；基金托管人应当同时将基金合同、基金托管协议登载在规定网站上。

（二）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规定媒介上。

（三）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规定媒介上登载基金合同生效公告。

#### （四）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规定网站披露一次各类基金份额的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后的 3 个工作日，通过规定网站、基金销售机构网站或者营业网点，披露开放日各类基金份额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后的 3 个工作日，在规定网站披露半年度和年度最后一日各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值。

#### （五）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。

#### （六）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，将年度报告登载在规定网站上，并将年度报告提示性公告登载在规定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过符合《中华人民共和国证券法》规定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，将中期报告登载在规定网站上，并将中期报告提示性公告登载在规定报刊上。

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，将季度报告登载在规定网站上，并将季度报告提示性公告登载在规定报刊上。

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

基金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。

报告期内出现单一投资人持有基金份额比例达到或超过 20% 的情形，为保障

其他投资者权益，基金管理人至少应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告文件中“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。

#### （七）临时报告

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

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、基金募集期延长或提前结束募集；
- 9、基金管理人的高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；
- 10、基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十，基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十；
- 11、涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼或仲裁；
- 12、基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；



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

14、基金收益分配事项；

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

16、基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；

17、本基金开始办理申购、赎回；

18、本基金发生巨额赎回并延期办理；

19、本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；

20、本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；

21、调整本基金份额类别设置；

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、基金合同生效后，连续 30 个工作日、40 个工作日、45 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；

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法律法规、中国证监会规定及基金合同约定的其他事项。

#### （八）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。

#### （九）基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

#### （十）资产支持证券的投资情况

基金管理人应在基金年度报告及中期报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细。基金管理人应在基金季度报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券

市值占基金净资产的比例和报告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。

#### （十一）港股通标的股票的投资情况

基金管理人应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露本基金参与港股通交易的相关情况。

#### （十二）证券投资基金的投资情况

本基金在定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露投资于其他基金的相关情况，包括（1）投资政策、持仓情况、损益情况、净值披露时间等；（2）交易及持有基金产生的费用，包括申购费、赎回费、销售服务费、管理费、托管费等，招募说明书中应当列明计算方法并举例说明；（3）本基金持有的基金发生的重大影响事件，如转换运作方式、与其他基金合并、终止基金合同以及召开基金份额持有人大会等；（4）本基金投资于本基金管理人以及基金管理人关联方所管理基金的情况。

#### （十三）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规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

（十四）本基金实施侧袋机制的，相关信息披露义务人应当根据法律法规、基金合同和招募说明书的规定进行信息披露，详见本招募说明书“侧袋机制”部分的规定。

#### （十五）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律法规规定。

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和基金合同的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、各类基金份额的基金份额净值、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、基金托管人应当在规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规定媒介上披露信息外，还可以根据需要其他公共媒介披露信息，但是其他公共媒介不得早于规定媒介披露信息，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。

#### 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

- （1）不可抗力；
- （2）发生暂停估值的情形；
- （3）法律法规、基金合同或中国证监会规定的情况。

## 第十七部分 侧袋机制

### 一、侧袋机制的实施条件和程序

当基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，根据最大限度保护基金份额持有人利益的原则，基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制。

基金管理人应当在启用侧袋机制后及时发布临时公告，并在法律法规规定的时间内聘请侧袋机制启用日发表意见且符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所进行审计并披露专项审计意见。

### 二、实施侧袋机制期间基金份额的申购与赎回

1、启用侧袋机制当日，本基金登记机构以基金份额持有人的原有账户份额为基础，确认相应侧袋账户基金份额持有人名册和份额；当日收到的申购申请，按照启用侧袋机制后的主袋账户份额办理；当日收到的赎回申请，仅办理主袋账户份额的赎回申请并支付赎回款项。

2、实施侧袋机制期间，基金管理人不得办理侧袋账户份额的申购、赎回和转换；同时，基金管理人按照基金合同和招募说明书的约定办理主袋账户份额的赎回，并根据主袋账户运作情况确定是否暂停申购。

3、除基金管理人应按照主袋账户的份额净值办理主袋账户份额的申购和赎回外，本招募说明书“基金份额的申购与赎回”部分的申购、赎回规定适用于主袋账户份额，巨额赎回按照单个开放日内主袋账户份额净赎回申请超过上一工作日主袋账户总份额的 10% 认定。

### 三、实施侧袋机制期间的基金投资

侧袋机制实施期间，招募说明书“基金的投资”部分约定的投资组合比例、投资策略、组合限制、业绩比较基准、风险收益特征等约定仅适用于主袋账户，基金管理人计算各项投资运作指标和基金业绩指标时仅需考虑主袋账户资产。

基金管理人原则上应当在侧袋机制启用后 20 个交易日内完成对主袋账户投资组合的调整，因资产流动性受限等中国证监会规定的情形除外。

基金管理人不得在侧袋账户中进行除特定资产处置变现以外的其他投资操作。

#### 四、实施侧袋机制期间的基金估值

本基金实施侧袋机制的，基金管理人和基金托管人应对主袋账户资产进行估值并披露主袋账户的基金净值信息，暂停披露侧袋账户份额净值。侧袋账户的会计核算应符合《企业会计准则》的相关要求。

#### 五、实施侧袋账户期间的基金费用

1、本基金实施侧袋机制的，主袋账户的管理费、托管费、销售服务费等费用按主袋账户基金资产净值作为基数计提。

2、与侧袋账户有关的费用可从侧袋账户列支，但应待侧袋账户资产变现后方可列支，有关费用可酌情收取或减免，但不得收取管理费。

#### 六、侧袋账户中特定资产的处置变现和支付

特定资产以可出售、可转让、恢复交易等方式恢复流动性后，基金管理人应当按照基金份额持有人利益最大化原则，采取将特定资产予以处置变现等方式，及时向侧袋账户份额持有人支付对应变现款项。

侧袋机制实施期间，无论侧袋账户资产是否全部完成变现，基金管理人都应当及时向侧袋账户全部份额持有人支付已变现部分对应的款项。若侧袋账户资产无法一次性完成处置变现，基金管理人在每次处置变现后均应按照相关法律法规要求及时发布临时公告。

侧袋账户资产全部完成变现并终止侧袋机制后，基金管理人及时聘请符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所进行审计并披露专项审计意见。

#### 七、侧袋机制的信息披露

##### 1、临时公告

在启用侧袋机制、处置特定资产、终止侧袋机制以及发生其他可能对投资者利益产生重大影响的事项后基金管理人应及时发布临时公告。

##### 2、基金净值信息

基金管理人应按照招募说明书“基金的信息披露”部分规定的基金净值信息披露方式和频率披露主袋账户份额的基金净值信息，实施侧袋机制期间本基金暂停披露侧袋账户份额净值和累计净值。

##### 3、定期报告

侧袋机制实施期间，基金管理人应当在基金定期报告中披露报告期内侧袋账

户相关信息，基金定期报告中的基金会计报表仅需针对主袋账户进行编制。会计师事务所对基金年度报告进行审计时，应对报告期内基金侧袋机制运行相关的会计核算和年度报告披露等发表审计意见。

八、本部分关于侧袋机制的相关规定，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，或将来法律法规或监管规则针对侧袋机制的内容有进一步规定的，基金管理人经与基金托管人协商一致并履行适当程序后，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。

## 第十八部分 风险揭示

本基金为混合型基金中基金(FOF)，风险与预期收益高于债券型基金中基金、债券型基金，高于货币型基金中基金、货币市场基金，低于股票型基金中基金、股票型基金。

### 一、市场风险

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

#### 1、政策风险

货币政策、财政政策、产业政策和证券市场监管政策等国家政策的变化对证券市场产生一定的影响，可能导致市场价格波动，从而影响基金收益。

#### 2、利率风险

金融市场利率波动会导致股票市场及利息收益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。基金投资于股票和债券，收益水平会受到利率变化的影响。

#### 3、信用风险

基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，或者上市公司信息披露不真实、不完整，都可能导致基金资产损失和收益变化。

#### 4、通货膨胀风险

由于通货膨胀率提高，基金的实际投资价值会因此降低。

#### 5、再投资风险

再投资风险反映了利率下降对固定收益证券和回购等利息收入再投资收益的影响。当利率下降时，基金从投资的固定收益证券和回购所得的利息收入进行再投资时，将获得比以前少的收益率。

#### 6、法律风险

由于法律法规方面的原因，某些市场行为受到限制或合同不能正常执行，导致了基金资产损失的风险。

### 二、管理风险

在基金管理运作过程中基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的占有和对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平。因此，本基金可能因为基金管理人和基金托管人的管理水平、管理手段和管理技术等因素影响基金收益水平。

### 三、流动性风险

#### 1、基金申购、赎回安排

投资人在开放日办理基金份额的申购和/或赎回，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。若本基金参与港股通交易且该工作日为非港股通交易日时，则基金管理人可根据实际情况决定本基金是否开放申购、赎回及转换业务，具体以届时提前发布的公告为准。但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。基金管理人自基金合同生效之日起不超过 3 个月开始办理申购，具体业务办理时间详见基金管理人的相关公告。此后的每个工作日为本基金的申购业务开放日。本基金认购份额的锁定持有期到期后，基金管理人开始办理赎回和转换转出，具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。对于每份基金份额，自其开放持有期首日起才能办理赎回和转换转出。

#### 2、拟投资市场的流动性风险评估

本基金以投资公开募集证券投资基金为主，投资比例限制采用分散投资原则，公募基金市场容量较大，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，不会对市场造成冲击。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。此外，根据《流动性风险管理规定》的相关要求，本基金所投资或持有的基金份额的基金管理人实施流动性风险管理，也会审慎评估所投资资产的流动性，并针对性制定流动性风险管理措施，因此本基金流动性风险也可以得到有效控制。

#### 3、巨额赎回下的流动性风险管理措施

基金管理人已建立内部巨额赎回应对机制，对基金巨额赎回情况进行严格的



事前监测、事中管控与事后评估。当基金发生巨额赎回时，基金经理、风险管理部、基金运营部会根据实际情况进行流动性评估，基金管理人最终决定是否接受所有赎回申请。当发现现金类资产不足以支付赎回款项或投资变现赎回款将对基金资产净值造成较大影响时，基金管理人会在充分评估基金组合资产变现能力、投资比例变动与基金份额净值波动的基础上，审慎接受、确认赎回申请。基金管理人可以根据法律法规规定及基金合同的约定采取备用的流动性风险管理应对措施，包括但不限于：（一）延期办理巨额赎回申请；（二）暂停接受赎回申请；（三）延缓支付赎回款项；（四）摆动定价；（五）暂停基金估值；（六）实施侧袋机制；（七）短期赎回费；（八）中国证监会认定的其他措施。

#### 4、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申购和/或赎回基金份额的风险。

此外，当发生招募说明书“第八部分 基金份额的申购与赎回”中“九、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形”约定的情形时，基金管理人亦有权采取延缓支付赎回款项的措施。

（2）若本基金在开放日发生了巨额赎回，基金管理人有可能采取延期赎回的措施以应对巨额赎回，具体措施请见基金合同及招募说明书中“基金份额的申购与赎回”部分“巨额赎回的处理方式”。因此在巨额赎回情形发生时，基金份额持有人可能会遇到赎回申请被延期办理等风险。

（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。

（4）暂停基金估值：当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上的，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停估值。

（5）实施侧袋机制：具体请参见招募说明书“侧袋机制”部分，详细了解本基金实施侧袋机制的情形及程序。

当基金管理人采取上述措施时，投资者将面临无法办理申购业务、赎回申请

被拒绝或延期办理、无法及时获得赎回款项或承担更高的投资成本等风险。

#### 5、实施侧袋机制对投资者的影响

侧袋机制是一种流动性风险管理工具，是将特定资产分离至专门的侧袋账户进行处置清算，并以处置变现后的款项向基金份额持有人进行支付，目的在于有效隔离并化解风险，但基金启用侧袋机制后，侧袋账户份额将停止披露基金份额净值，并不得办理申购、赎回和转换，仅主袋账户份额正常开放赎回，因此启用侧袋机制时持有基金份额的持有人将在启用侧袋机制后同时持有主袋账户份额和侧袋账户份额，侧袋账户份额不能赎回，其对应特定资产的变现时间具有不确定性，最终变现价格也具有不确定性并且有可能大幅低于启用侧袋机制时的特定资产的估值，基金份额持有人可能因此面临损失。

实施侧袋机制期间，因本基金不披露侧袋账户份额的净值，即便基金管理人在基金定期报告中披露报告期末特定资产可变现净值或净值区间的，也不作为特定资产最终变现价格的承诺，因此对于特定资产的公允价值和最终变现价格，基金管理人不承担任何保证和承诺的责任。

基金管理人将根据主袋账户运作情况合理确定申购政策，因此实施侧袋机制后主袋账户份额存在暂停申购的可能。

启用侧袋机制后，基金管理人计算各项投资运作指标和基金业绩指标时仅需考虑主袋账户资产，基金业绩指标应当以主袋账户资产为基准，因此本基金披露的业绩指标不能反映特定资产的真实价值及变化情况。

#### 四、其它风险

##### 1、技术风险

计算机、通讯系统、交易网络等技术保障系统或信息网络支持出现异常情况，可能导致基金日常的申购赎回无法按正常时限完成、注册登记系统瘫痪、核算系统无法按正常时限显示产生净值、基金的投资交易指令无法及时传输等风险。

2、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。

3、金融市场危机、行业竞争、代理机构违约、基金托管人违约等超出基金管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致基金或者基金份额持有人的利益受损。

## 五、特有风险

1、本基金各类基金份额均设置锁定持有期，原则上每份基金份额的锁定持有期为 3 个月，基金份额在锁定持有期内不办理赎回及转换转出业务。锁定持有期到期后进入开放持有期，每份基金份额自其开放持有期首日起才能办理赎回及转换转出业务。因此基金份额持有人面临在锁定持有期内不能赎回基金份额的风险。

2、本基金为基金中基金，基金资产主要投资于其他公开募集证券投资基金的基金份额，因此本基金所持有的基金的业绩表现、持有基金的基金管理人水平等因素将影响到本基金的基金业绩表现。

3、本基金为基金中基金，基金资产主要投资于其他公开募集证券投资基金的基金份额，除了持有的本基金管理人管理的其他基金部分不收取管理费，持有本基金托管人托管的其他基金部分不收取托管费，申购本基金管理人管理的其他基金不收取申购费、赎回费（不包括按照基金合同应归入基金资产的部分）等，基金中基金承担的相关基金费用可能比普通开放式基金高。

4、本基金的主要投资范围为其他公开募集证券投资基金，占本基金相当比例的被投资基金暂停估值、暂停申购/赎回，本基金可能暂停或拒绝申购、暂停或延缓办理赎回业务。

5、本基金投资流通受限基金时，对于封闭式基金而言，当要卖出基金的时候，可能会面临在一定的价格下无法卖出而要降价卖出的风险；对于流通受限基金而言，由于流通受限基金的非流通特性，在本基金参与投资后将在一定的期限内无法流通，在面临基金大规模赎回的情况下有可能因为无法变现造成流动性风险。

6、巨额赎回风险是开放式基金所特有的一种风险，即当单个交易日基金的净赎回申请超过前一工作日基金总份额的百分之十时，本基金将可能无法及时赎回持有的全部基金份额，影响本基金的资金安排。

7、本基金会面临基金价格变动的风险。如果基金价格下降到买入成本之下，在不考虑分红因素影响的情况下，本基金会面临亏损风险。

8、本基金的投资范围包括资产支持证券。基金管理人本着谨慎和控制风险的原则进行资产支持证券投资，但仍或面临信用风险、利率风险、提前偿付风险、

操作风险，所投资的资产支持证券之债务人出现违约，或由于资产支持证券信用质量降低、市场利率波动导致证券价格下降，造成基金财产损失。受资产支持证券市场规模及交易活跃程度的影响，资产支持证券存在一定的流动性风险。

9、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（以下或称“联交所”）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。

10、汇率风险：本基金可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。

11、境外市场的风险。

（1）本基金将通过港股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，在港股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) 港股市场股价波动较大的风险：香港市场证券实行 T+0 回转交易，且对个股交易价格并无涨跌幅上下限的规定，因此港股可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动；

2) 港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险：只有沪港深三地均为交易日且能够满足结算安排的交易日才为港股通交易日，因此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；出现内地证券交易所证券交易服务公司认定的交易异常情况时，内地证券交易所证券交易服务公司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，相关交易所另有规定的除外；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；

6) 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或选择不将基金资产投资于港股，基金资产并非必然投资港股。

12、本基金的投资范围包括存托凭证，存托凭证是由存托人签发、以境外证券为基础在中国境内发行，代表境外基础证券权益。存托凭证持有人实际享有的权益与境外基础证券持有人的权益虽然基本相当，但不能等同于直接持有境外基础证券。投资于存托凭证可能会面临由于境内外市场上市交易规则、上市公司治理结构、股东权利等差异带来的相关成本和投资风险。在交易和持有存托凭证过程中需要承担的义务及可能受到的限制，应当关注证券交易普遍具有的宏观经济风险、政策风险、市场风险、不可抗力风险等。

### 13、基金自动终止的风险

本基金连续 50 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，本基金将根据基金合同的约定进行基金财产清算并终止，而无须召开基金份额持有人大会，因此，本基金面临自动终止的风险。

### 14、投资基础设施基金可能面临以下风险，包括但不限于：

#### (1) 基金价格波动风险。

基础设施基金大部分资产投资于基础设施项目，具有权益属性，受经济环境、运营管理等因素影响，基础设施项目市场价值及现金流情况可能发生变化，可能

引起基础设施基金价格波动，甚至存在基础设施项目遭遇极端事件（如地震、台风等）发生较大损失而影响基金价格的风险。

（2）基础设施项目运营风险。

基础设施基金投资集中度高，收益率很大程度依赖基础设施项目运营情况，基础设施项目可能因经济环境变化或运营不善等因素影响，导致实际现金流大幅低于测算现金流，存在基金收益率不佳的风险，基础设施项目运营过程中租金、收费等收入的波动也将影响基金收益分配水平的稳定。此外，基础设施基金可直接或间接对外借款，存在基础设施项目经营不达预期，基金无法偿还借款的风险。

（3）流动性风险。

基础设施基金采取封闭式运作，不开通申购赎回，只能在二级市场交易，存在流动性不足的风险。

（4）终止上市风险。

基础设施基金运作过程中可能因触发法律法规或交易所规定的终止上市情形而终止上市，导致投资者无法在二级市场交易。

（5）税收等政策调整风险。

基础设施基金运作过程中可能涉及基金持有人、公募基金、资产支持证券、项目公司等多层面税负，如果国家税收等政策发生调整，可能影响投资运作与基金收益。

（6）基础设施基金相关法律、行政法规、部门规章、规范性文件（以下简称法律法规）和交易所业务规则，可能根据市场情况进行修改，或者制定新的法律法规和业务规则，投资者应当及时予以关注和了解。

六、本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险

本基金法律文件投资章节有关风险收益特征的表述是基于投资范围、投资比例、证券市场普遍规律等做出的概述性描述，代表了一般市场情况下本基金的长期风险收益特征。销售机构（包括基金管理人直销机构和其他销售机构）根据相关法律法规对本基金进行风险评价，不同的销售机构采用的评价方法也不同，因此销售机构的风险等级评价与基金法律文件中风险收益特征的表述可能存在不同，投资人在购买本基金时需按照销售机构的要求完成风险承受能力与产品风险之

间的匹配检验。

## 第十九部分 基金的合并、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### 一、基金的合并

本基金与其他基金合并，应当按照法律法规规定的程序进行。

### 二、基金合同的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于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生效后方可执行，并自决议生效后两日内在规定媒介公告。

### 三、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。

### 四、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 个工作日内成立基金财产清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、符合《中华人民共和国证券法》规定的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

### 4、基金财产清算程序：



- (1) 基金合同终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金财产；
- (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。

5、基金财产清算的期限为 6 个月，但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的，清算期限相应顺延。

#### 五、清算费用

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

#### 六、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。

#### 七、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符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告，基金财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

#### 八、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不低于法律法规规定的最低期限。

## 第二十部分 基金合同内容摘要

基金合同内容摘要见附件一。

## 第二十一部分 基金托管协议内容摘要

基金托管协议内容摘要见附件二。

## 第二十二部分 对基金份额持有人的服务

本基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务。以下是主要的服务内容，基金管理人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、基金份额持有人交易资料的寄送服务

每次交易结束后，基金份额持有人应在 T+4 日后及时通过销售机构的网点查询和打印确认单；在每季度结束后的 10 个工作日内，登记机构或基金管理人按基金份额持有人意愿，向在该季度内有交易的基金份额持有人以书面或电子文件形式寄送季度对账单；在每年度结束后 15 个工作日内，登记机构或基金管理人按基金份额持有人意愿，对所有的基金份额持有人以书面或电子文件形式寄送年度对账单。

### 二、在线服务

基金份额持有人可以通过基金管理人的网站 [www.zofund.com](http://www.zofund.com) 订制基金信息资讯、并享受本基金管理人为基金份额持有人提供的投资报告服务。

### 三、查询与咨询服务

基金管理人客服中心为基金份额持有人提供 7×24 小时的电话语音服务，基金份额持有人可通过客户服务热线 021-68609700，400-700-9700（免长途话费）的语音系统或登录基金管理人网站 [www.zofund.com](http://www.zofund.com) 查询基金净值、基金账户信息、基金产品介绍等情况，人工座席在工作时间（周一至周五，9:00-17:00）还将为基金份额持有人提供周到的人工答疑服务。

### 四、投诉受理

基金份额持有人可拨打客户服务热线 021-68609700，400-700-9700（免长途话费）投诉直销机构和其他销售机构的人员及其服务。

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

## 第二十三部分 其他应披露事项

以下为本基金管理人自 2021 年 10 月 1 日至 2022 年 3 月 31 日刊登于中国证监会指定媒介的公告。

序号	公告事项	披露日期
1	中欧星耀优选 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 份额发售公告	2021-12-20
2	中欧星耀优选 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 基金产品资料概要	2021-12-20
3	中欧星耀优选 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 基金合同	2021-12-20
4	中欧星耀优选 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 基金合同及招募说明提示性公告	2021-12-20
5	中欧星耀优选 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 托管协议	2021-12-20
6	中欧星耀优选 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 招募说明书	2021-12-20
7	中欧基金管理有限公司关于中欧星耀优选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）调整募集期限的公告	2022-01-21
8	中欧星耀优选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同生效公告	2022-01-27

## 第二十四部分 招募说明书的存放及查阅方式

招募说明书公布后，应当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，供公众查阅、复制；也可按工本费购买本招募说明书复印件。投资人也可以直接登录基金管理人的网站进行查阅。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

## 第二十五部分 备查文件

（一）备查文件包括：

1. 中国证监会准予中欧星耀优选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）募集注册的文件
2. 《中欧星耀优选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》
3. 《中欧星耀优选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）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
7. 中国证监会规定的其他文件

（二）备查文件的存放地点和投资人查阅方式：

以上备查文件存放在基金管理人的办公场所，在办公时间可供免费查阅。

中欧基金管理有限公司

2023 年 11 月 8 日

## 附件一 基金合同内容摘要

### 一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

#### （一）基金份额持有人的权利与义务

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。

同一类别的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召集基金份额持有人大会；
- （5）出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- （6）查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- （7）监督基金管理人的投资运作；
- （8）对基金管理人、基金托管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；
- （9）法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他权利。

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

- （1）认真阅读并遵守基金合同、招募说明书等信息披露文件；
- （2）了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；
- （3）关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；
- （4）交纳基金认购、申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用；



（5）在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；

（6）不从事任何有损基金及其他基金合同当事人合法权益的活动；

（7）执行生效的基金份额持有人大会的决议；

（8）返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；

（9）法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

## （二）基金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规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

（7）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

（8）选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；

（9）担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得基金合同规定的费用；

（10）依据基金合同及有关法律规规定决定基金收益的分配方案；

（11）在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；

（12）依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利，在遵循基金份额持有人利益优先原则的前提下代表本基金就本基金所持有的基金份额行使相关基金份额持有人权

利；

（13）在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；

（14）以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

（15）选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；

（16）在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换和非交易过户等业务规则；

（17）法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他权利。

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

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

（2）办理基金备案手续；

（3）自基金合同生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；

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

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

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

（7）依法接受基金托管人的监督；

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

（9）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

（10）编制季度报告、中期报告和年度报告；

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

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

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

（14）按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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

（16）按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料不低于法律法规规定的最低期限；

（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条件下得到有关资料的复印件；

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

（19）面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

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

（21）监督基金托管人按法律法规和基金合同规定履行自己的义务，基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

（22）当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；

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

（24）基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，基金合同不能生效，

基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人；

- （25）执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- （26）建立并保存基金份额持有人名册；
- （27）法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

### （三）基金托管人的权利与义务

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

（1）自基金合同生效之日起，依法律法规和基金合同的规定安全保管基金财产；

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

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

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

（5）提议召开或召集基金份额持有人大会；

（6）在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

（7）法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他权利。

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

（1）以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

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

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

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

（5）保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

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

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

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

（9）办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

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

（11）保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料不低于法律法规规定的最低期限；

（12）从基金管理人或其委托的登记机构处接收并保存基金份额持有人名册；

（13）按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

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

（15）依据《基金法》、基金合同及其他有关规定，召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、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召集、议事及表决的程序和规则

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

本基金份额持有人大会不设日常机构。

### （一）召开事由

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

（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或提高销售服务费率；

（6）变更基金类别；

（7）本基金与其他基金的合并；

（8）变更基金投资目标、范围或策略；

（9）变更基金份额持有人大会程序；

（10）基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；

（11）单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；

（12）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、在法律法规规定和《基金合同》约定的范围内且在对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

- （1）法律法规要求增加的基金费用的收取；
- （2）调整本基金的申购费率、调低赎回费率、销售服务费率和变更收费方式；
- （3）调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则；
- （4）增加、减少或调整基金份额类别设置及对基金份额分类办法、规则进行调整；
- （5）因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；
- （6）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重大变化；
- （7）按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

## （二）会议召集人及召集方式

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

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。

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

4、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持

有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起

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

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

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

（三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

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

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

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



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

#### （四）基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式或法律法规和监管机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）。若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效的基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之一（含三分之一）。

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以召集人通知的非现场方式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址或系统。通讯开会应以召集人通知的非现场方式进行表决。

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）到指定地点对表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取表决意见的，不影响表决效力；

（3）本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）；若本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）基金份额的持有人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见；

（4）上述第（3）项中直接出具表决意见的基金份额持有人或受托代表他人出具表决意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具表决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、在不与法律法规冲突的前提下，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。

#### （五）议事内容与程序

##### 1、议事内容及提案权

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

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应

当在基金份额持有人大会召开前及时公告。

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

## 2、议事程序

### （1）现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第（七）条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

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

### （2）通讯开会

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

### （六）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有同等表决权。

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、与其他基金合并、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，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人身份文件的表决视为有效出席的投资人，表面符合会议通知规定的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，但应当计入出具表决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。

在上述规则的前提下，具体规则以召集人发布的基金份额持有人大会通知为准。

## （七）计票

### 1、现场开会

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

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

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

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

### 2、通讯开会

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

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

#### （八）生效与公告

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

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

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

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

（九）基金管理人代表本基金出席本基金投资的基金的基金份额持有人大会并参与表决的特别约定

本基金持有的证券投资基金召开基金份额持有人大会时，本基金基金管理人应当代表其基金份额持有人的利益，根据基金合同的约定参与所持有基金的基金份额持有人大会，并在遵循本基金基金份额持有人利益优先原则的前提下行使相关投票权利。本基金基金管理人需将表决意见事先征求本基金基金托管人的意见，并将表决意见在定期报告中予以披露。

法律法规或监管部门另有规定的从其规定。

#### （十）实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定

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

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

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

3、通讯开会的直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的基金份额

持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日相关基金份额的二分之一（含二分之一）；

4、在参与基金份额持有人大会投票的基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日相关基金份额的二分之一、召集人在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内就原定审议事项重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）相关基金份额的持有人参与或授权他人参与基金份额持有人大会投票；

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

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

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

同一主侧袋账户内的每份基金份额具有平等的表决权。

（十一）本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规的部分，如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人提前公告后，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、基金合同解除和终止的事由、程序

#### （一）基金的合并

本基金与其他基金合并，应当按照法律法规规定的程序进行。

#### （二）基金合同的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于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生效后方可执行，并自决议生效后两日内在规定媒介公告。

#### （三）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。

#### （四）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 个工作日内成立基金财产清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、符合《中华人民共和国证券法》规定的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

#### 4、基金财产清算程序：

- （1）基金合同终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金财产；
- （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。

5、基金财产清算的期限为 6 个月，但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的，清算期限相应顺延。

#### （五）清算费用

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

#### （六）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。

#### （七）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符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告，基金财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

#### （八）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不低于法律法规规定的最低期限。

### 四、争议解决方式

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，应通过友好协商或者调解解决。基金合同当事人不愿通过协商、调解解决或者协商、调解不成的，任何一方当事人均有权将争议提交上海国际经济贸易仲裁委员会，根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点在上海，仲裁裁决是终局的，并对相关各方当事人均有约束力，仲裁费由败诉方承担。

争议处理期间，基金管理人和基金托管人当事人应恪守各自职责，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。

基金合同受中华人民共和国法律（为基金合同之目的，在此不包括香港、澳门特别行政区和台湾地区的有关规定）管辖。

### 五、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

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



## 附件二 基金托管协议内容摘要

### 一、托管协议当事人

#### （一）基金管理人

名称：中欧基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 8 层

法定代表人：竇玉明

设立日期：2006 年 7 月 19 日

组织形式：有限责任公司

注册资本：2.20 亿元

存续期限：持续经营

联系电话：021-68609600

#### （二）基金托管人

名称：宁波银行股份有限公司

住所：浙江省宁波市宁东路 345 号

法定代表人：陆华裕

电话：0574-89103140

传真：0574-89103213

联系人：陶磊

成立时间：1997 年 4 月 10 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：600,801.6286 万元

批准设立机关和设立文号：中国银监会，银监复[2007]64 号

基金托管业务批准文号：证监许可[2012]1432 号

存续期间：永续经营

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券等 有价证券；从事同业拆借；提供信用证服务及担保；从事银行卡服务；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；外汇存、贷款；

经中国银行业监督管理机构等监管部门批准的其他业务。

## 二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

### （一）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及《基金合同》和本协议的约定，对基金的投资范围进行监督。

本基金投资于依法发行或上市的公开募集证券投资基金、股票、债券等金融工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。具体包括：经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金（含 QDII 基金、香港互认基金、公开募集基础设施证券投资基金（以下简称“公募 REITs”）、股票（包含创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、港股通机制下允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、地方政府债、政府支持机构债、政府支持债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具等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。

基金的投资组合比例为：80%以上基金资产投资于其他经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金（含 QDII 基金、香港互认基金、公募 REITs）；本基金对权益类资产的投资合计占基金资产的比例为 60%-95%，其中，本基金投资于港股通标的股票不超过股票资产的 50%；本基金投资的权益类资产包括股票、股票型基金以及至少满足以下一条标准的混合型基金：（1）基金合同约定的股票资产占基金资产的比例不低于 60%；（2）基金最近 4 期季度报告中披露的股票资产占基金资产的比例均不低于 60%。本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。基金托管人对基金管理人业

务进行监督和核查的义务自基金合同生效日起开始履行。

（2）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》和本协议的约定，对基金投资比例进行监督。

根据《基金合同》的约定，本基金投资组合比例应符合以下规定：

1）本基金 80%以上基金资产投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金（含 QDII 基金、香港互认基金、公募 REITs）；

2）本基金对权益类资产的投资合计占基金资产的比例为 60%-95%（其中，本基金投资于港股通标的股票不超过股票资产的 50%，本基金投资的权益类资产包括股票、股票型基金以及至少满足以下一条标准的混合型基金：（1）基金合同约定的股票资产占基金资产的比例不低于 60%；（2）基金最近 4 期季度报告中披露的股票资产占基金资产的比例均不低于 60%；

3）本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

4）本基金持有单只基金的市值，不高于本基金资产净值的 20%，且不得持有其他基金中基金；

5）本基金投资货币市场基金占基金资产的比例不得高于 15%；

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

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

8）本基金投资于封闭运作基金、定期开放基金等流通受限基金，不得超过基金资产净值的 10%；

9）本基金持有一家公司发行的证券（不含本基金所投资的基金份额），其市值（同一家公司在境内和香港同时上市的 A+H 股合计计算）不超过基金资产净值的 10%；

10）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券（不含本基金所投资的基金份额且同一家公司在境内和香港同时上市的 A+H 股合计计算），不超过该证券的 10%，完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金品种可以

不受此条款规定的比例限制；

11) 本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述比例限制；

12) 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%；

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

14) 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%；

15) 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%；

16) 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；

17) 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；

18) 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%；本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

19) 本基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

20) 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该比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

21) 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；

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

23) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他投资限制。

因证券市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合前款第 4) 项、第 7) 项规定的投资比例的，基金管理人应当在 20 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。除上述第 3) 项、第 4) 项、第 7) 项、第 16) 项、第 20) 项、第 21) 项外，因证券市场波动、证券发行人合并或基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

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

法律法规或监管部门取消或调整上述限制，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或按照调整后的规定执行。

基金托管人依照上述规定对本基金的投资组合限制及调整期限进行监督。

(3) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同和本协议的约定，对基金投资禁止行为进行监督。基金财产不得用于下列投资或者活动。

1) 承销证券；

2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；

3) 从事承担无限责任的投资；

4) 向其基金管理人、基金托管人出资；

5) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

6) 持有具有复杂、衍生品性质的基金份额，包括分级基金和中国证监会认定的其他基金份额；

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，应当符合本基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

法律、行政法规或监管部门取消或调整上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资按照取消或调整后的规定执行。

（二）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、各类基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确认、基金收益分配、相关信息披露等进行监督和核查。如果基金管理人未经基金托管人的审核擅自将不实的业绩表现数据印制在宣传推介材料上，则基金托管人对此不承担任何责任，并有权在发现后报告中国证监会。

（三）基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查，在规定时间内答复并改正，就基金托管人的疑义进行解释或举证。对基金托管人按照法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的投资指令或实际投资运作违反《基金法》及其他有关法规、《基金合同》和本协议规定的行为，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，并以电话或书面形式向基金托管人反馈，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在限期内，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，基金托管人有权报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人在限期内纠正。

基金托管人发现基金管理人的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反《基金合同》约定的，应当视情况暂缓或拒绝执行，立即通知基金管理人，并有权向中国证监会报告。

基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反《基金合同》约定的，应当立即通知基金管理人，并有权向中国证监会报告。

基金管理人应对基金投资的合规性负责，包括但不限于遵守关联关系等外部法律法规的要求。

### 三、基金管理人 对基金托管人的业务核查

根据《基金法》及其他有关法规、《基金合同》和本协议规定，基金管理人 对基金托管人履行托管职责的情况进行核查，核查事项包括但不限于基金托管人 是否安全保管基金财产、是否开立基金财产的资金账户、证券账户及债券托管账 户等投资所需账户，是否及时、准确复核基金管理人计算的基金资产净值和各类 基金份额净值，是否根据基金管理人指令办理清算交收，是否按照法规规定和《基 金合同》规定进行相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

基金管理人定期和不定期地对基金托管人保管的基金资产进行核查。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，在规定时间内答复并改正。

基金管理人发现基金托管人未对基金资产实行分账管理、擅自挪用基金资产、 未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基 金法》、《基金合同》、本协议及其他有关规定的，应及时以书面形式通知基金托 管人在限期内纠正，基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金管理 人发出回函。在限期内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托 管人改正。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金 管理人应报告中国证监会。对基金管理人按照法规要求需向中国证监会报送基金 监督报告的，基金托管人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

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，同时 通知基金托管人在限期内纠正。

### 四、基金财产的保管

#### （一）基金财产保管的原则

（1）基金托管人应安全保管基金财产，未经基金管理人的指令，不得自行

运用、处分、分配基金的任何资产。

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

（3）基金托管人按照规定开立基金财产的资金账户、证券账户和债券托管账户等投资所需账户。

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

（5）对于因为基金投资产生的应收资产和基金申购过程中产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金资产没有到达基金银行存款账户的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失。基金托管人对此不承担任何责任。

（6）除法律法规和基金合同另有规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

## （二）基金募集资产的验证

基金募集期间的资金应存于基金管理人在具备基金销售业务资格的商业银行或者从事客户交易结算交易资金存管的商业银行等营业机构开立的“基金募集专户”。该账户由基金管理人开立并管理。

基金募集期满或基金提前结束募集之日起 10 日内，由基金管理人聘请符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所进行验资，出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的 2 名以上（含 2 名）中国注册会计师签字有效。验资完成，基金管理人应将募集到的全部资金存入基金托管人为基金开立的基金银行存款账户中，基金托管人在收到资金当日出具相关证明文件。

若基金募集期限届满，未能达到基金备案的条件，由基金管理人按规定办理退款等事宜。

## （三）基金的银行存款账户的开立和管理

（1）基金托管人应负责本基金银行存款账户的开立和管理。

（2）基金托管人以本基金的名义在其营业机构开立基金的银行存款账户，并根据中国人民银行规定计息。本基金的银行预留印鉴由基金托管人制作、保管



和使用。本基金的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益，均需通过本基金的银行存款账户进行。

（3） 本基金银行存款账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立其他任何银行存款账户；亦不得使用基金的任何银行存款账户进行本基金业务以外的活动。

（4） 托管账户预留印鉴为基金托管人的托管业务专用章 1 枚以及监管人名章 1 枚。托管账户的开立需遵循宁波银行《单位银行结算账户管理协议》的相关规定。托管账户内的银行存款利率每半年或遇到重大市场调整时，如有需要，基金管理人、基金托管人两方可对账户利率进行重新议价。

（5） 基金银行存款账户的管理应符合《中华人民共和国票据法》、《人民币银行账户结算管理办法》、《现金管理暂行条例实施细则》、《人民币利率管理规定》、《支付结算办法》以及银行业监督管理机构的其他规定。

#### （四）基金证券交收账户、资金交收账户的开立和管理

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开立证券账户。

基金证券账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借和未经对方同意擅自转让基金的任何证券账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

基金管理人不得对基金证券交收账户、资金交收账户进行证券的超卖或超买。

基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户即资金交收账户，用于证券交易资金的结算。

#### （五）债券托管账户的开立和管理

（1） 基金合同生效后，基金托管人负责向中国人民银行进行报备，并在备案通过后在中央国债登记结算有限责任公司、银行间市场清算所股份有限公司以本基金的名义开立债券托管账户，并由基金托管人负责基金的债券及资金的清算。基金管理人负责申请基金进入全国银行间同业拆借市场进行交易，由基金管理人在中国外汇交易中心开设同业拆借市场交易账户。

（2） 基金管理人代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议，协议正本由基金管理人保存。

#### （六）其他账户的开立和管理

若中国证监会或其他监管机构在本托管协议订立日之后允许基金从事其他投资品种的投资业务，涉及相关账户的开立、使用的，由基金管理人协助基金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。

#### （七）基金财产投资的有关实物证券、银行存款定期存单等有价凭证的保管

实物证券由基金托管人存放于基金托管人的保管库。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。基金托管人对由基金托管人以外机构实际有效控制的本基金资产不承担保管责任。

该协议中必须有如下明确条款：“银行存款、定期存单等有价凭证正本由基金托管人负责保管。基金管理人应与存款机构签订定期存款协议，该协议作为划款指令附件，其预留印鉴至少有一枚基金托管人监管印章”“存款证实书、存单不得以任何方式被质押或以任何方式被抵押，并不得用于转让和背书；本息到期归还或提前支取的所有款项必须划至托管账户（明确户名、开户行、账号等），不得划入其他任何账户”。如定期存款协议中未体现前述条款，基金托管人有权拒绝定期存款投资的划款指令。

#### （八）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由基金托管人、基金管理人保管，相关业务程序另有限制除外。除本协议另有规定外，基金管理人在代基金签署与基金有关的重大合同时应尽可能保证持有二份以上的正本，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，基金管理人应及时将正本送达基金托管人处。合同的保管期限按照国家有关规定执行。

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公章的合同传真件或复印件并注明与原件一致，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

#### （一）基金资产净值及基金份额净值的计算与复核

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。各类基金份额的基

基金份额净值是按照估值日该类基金份额的基金资产净值除以当日该类基金份额的余额数量计算，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。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值。

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》、《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》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各类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计算基金资产净值，以约定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，将复核结果反馈给基金管理人，由基金管理人按约定予以公布。

本基金按以下方法估值：

#### 1、基金估值方法

（1）本基金投资于非上市基金的估值。

1) 本基金投资的境内非货币市场基金，按所投资基金估值日的份额净值估值。

2) 本基金投资的境内货币市场基金，按所投资基金前一估值日后至估值日期间（含节假日）的万份收益计提估值日基金收益。

（2）本基金投资于交易所上市基金的估值。

1) 本基金投资的 ETF 基金，按所投资 ETF 估值日的交易所挂牌收盘价估值。

2) 本基金投资的境内上市开放式基金（LOF），按所投资基金估值日的份额净值估值。

3) 本基金投资的境内上市定期开放式基金、封闭式基金，按所投资基金估值日的交易所挂牌收盘价估值。

4) 本基金投资的境内上市交易型货币市场基金，如所投资基金披露份额净值，则按所投资基金估值日的份额净值估值；如所投资基金披露万份（百份）收益，则按所投资基金前一估值日后至估值日期间（含节假日）的万份（百份）收益计提估值日基金收益。

（3）如遇所投资基金不公布基金份额净值、进行折算或拆分、估值日无交

易等特殊情况下，本基金根据以下原则进行估值：

1) 以所投资基金的基金份额净值估值的，若所投资基金与本基金估值频率一致但未公布估值日基金份额净值，按其最新公布的基金份额净值为基础估值；

2) 以所投资基金的收盘价估值的，若估值日无交易，且最近交易日后市场环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后市场环境发生了重大变化的，可使用最新的基金份额净值为基础或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，确定公允价值；

3) 如果所投资基金前一估值日至估值日期间发生分红除权、折算或拆分，本基金根据基金份额净值或收盘价、单位基金份额分红金额、折算拆分比例、持仓份额等因素合理确定公允价值。

(4) 当基金管理人认为所投资基金按上述第（1）至第（3）条进行估值存在不公允时，应与基金托管人协商一致采用合理的估值技术或估值标准确定其公允价值。

## 2、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) 交易所上市实行净价交易或挂牌转让的固定收益品种（基金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) 交易所上市交易的可转换债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

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。

3、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。

4、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。

5、同一股票或债券同时在两个或两个以上市场交易的，按股票或债券所处的市场分别估值。

6、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，以第三方估值机构提供的估值净价估值；对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券、资产支持证券等固定收益品种，按成本估值。

7、当基金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。

8、汇率：本基金外币资产价值计算中，涉及港币对人民币汇率的，应当以基金估值日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价为准。若本基金现行估值汇率不再发布或发生重大变更，或市场上出现更为公允、更适合本基金的估值汇率时，基金管理人与基金托管人协商一致后可根据实际情况调整本基金的估值汇率，无需召开基金份额持有人大会。

9、税收：对于按照中国法律法规和基金投资所在地的法律法规规定应交纳的各项税金，本基金将按权责发生制原则进行估值；对于因税收规定调整或其他原因导致基金实际交纳税金与估算的应交税金有差异的，基金将在相关税金调整日或实际支付日进行相应的估值调整。

10、本基金投资存托凭证的估值核算，依照境内上市交易的股票执行。

11、如有确凿证据表明按原有方法进行估值不能客观反映上述资产或负债公允价值的，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方法估值。

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

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

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

## （二）净值差错处理

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（含各类基金份额的基金份额净值，下同）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。

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

### 2、估值错误处理原则

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

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

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

（4）估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

### 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

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

### 4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

（1）基金份额净值计算出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报

基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

（2）错误偏差达到基金份额净值的 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，并报中国证监会备案。

（3）前述内容如法律法规或者监管部门另有规定的，从其规定。如果行业另有通行做法，基金管理人和基金托管人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商。

### （三）暂停估值的情形

- 1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 2、因不可抗力或其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、当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上的，经与基金托管人协商一致的，基金管理人应当暂停估值；
- 4、占基金相当比例的被投资基金暂停估值时；
- 5、中国证监会和基金合同认定的其他情形。

### （四）基金会计制度

按国家有关部门制定的会计制度执行。

### （五）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，应按照双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，对双方各自的账册定期进行核对，互相监督，以保证基金财产的安全。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。

### （六）会计数据和财务指标的核对

双方应每个交易日核对账目，如发现双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，确保核对一致。若当日核对不符，暂时无法查找到错账的原因而影响到基金资产净值的计算和公告的，以基金管理人的账册为准。

### （七）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。定期报告文件应按中国证监会的要求公告。季度报告的编制，应于季度结束之日起 15 个工作日内完成并公告。中期报告在上半年结束之日起两个月内公告；年度报告在每年结束之日起三个月内公告。

基金管理人在月度报表完成当日，对报表盖章后，以传真方式将有关报表提供基金托管人；基金托管人在 2 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。基金管理人在季度报告完成当日，以约定方式将有关报告提供基金托管人；基金托管人在 5 个工作日内进行复核，并将复核结果反馈给基金管理人。基金管理人在中期报告完成当日，将有关报告提供基金托管人，基金托管人在收到后 20 日内进行复核，并将复核结果反馈给基金管理人。基金管理人在年度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人，基金托管人在收到后 30 日内复核，并将复核结果反馈给基金管理人。基金托管人在复核过程中，发现双方的报表存在不符时，基金管理人和基金托管人应共同查明原因，进行调整，调整以双方认可的账务处理方式为准。如果基金管理人与基金托管人不能于应当发布公告之日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中国证监会备案。

基金托管人在对财务报表、季度报告、中期报告或年度报告复核完毕后，可以出具复核确认书（盖章）或以其他双方约定的方式确认，以备有权机构对相关文件审核检查。

## 六、基金份额持有人名册的保管

基金管理人可委托基金登记机构登记和保管基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容包括但不限于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，包括基金募集期结束时的基金份额持有人名册、基金权益登记日的基金份额持有人名册、基金份额持有人大会权益登记日的基金份额持有人名册、每年最后一个交易日的基金份额持有人名册，由基金登记机构负责编制和保管，并对基金份额持有人名册的真实性、完整性和准确性负责。

基金管理人应根据基金托管人的要求定期和不定期向基金托管人提供基金份额持有人名册。

（一）基金管理人于《基金合同》生效日及《基金合同》终止日后 10 个工作日内向基金托管人提供由登记机构编制的基金份额持有人名册；

（二）基金管理人于基金份额持有人大会权益登记日后 5 个工作日内向基金托管人提供由登记机构编制的基金份额持有人名册；

（三）基金管理人于每年最后一个交易日后 10 个工作日内向基金托管人提供由登记机构编制的基金份额持有人名册；

（四）除上述约定时间外，如果确因业务需要，基金托管人与基金管理人商议一致后，由基金管理人向基金托管人提供由登记机构编制的基金份额持有人名册。

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，保存期限不少于法定最低期限。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

双方当事人同意，因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议，应通过友好协商或者调解解决。托管协议当事人不愿通过协商、调解解决或者协商、调解不成的，任何一方当事人均有权将争议提交上海国际经济贸易仲裁委员会，根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点在上海，仲裁裁决是终局的，并对相关各方当事人均有约束力，仲裁费由败诉方承担。

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

本协议受中华人民共和国法律（为本协议之目的，在此不包括香港、澳门特别行政区和台湾地区的有关规定）管辖。

## 八、基金托管协议的变更、终止与基金财产的清算

### （一）基金托管协议的变更

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

## （二）基金托管协议的终止

（1）《基金合同》终止；

（2）基金托管人解散、依法被撤销、破产，被依法取消基金托管资格或因其他事由造成其他基金托管人接管基金财产；

（3）基金管理人解散、依法被撤销、破产，被依法取消基金管理资格或因其他事由造成其他基金管理人接管基金管理权；

（4）发生《基金法》、《销售办法》、《运作办法》或其他法律法规规定的终止事项。

## （三）基金财产的清算

### （1）基金财产清算小组

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》和本协议的规定继续履行保护基金资产安全的职责。

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，由基金管理人组织成立基金财产清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

2) 基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、符合《中华人民共和国证券法》规定的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

### （2）基金财产清算程序

1) 《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金财产；

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。

基金财产清算的期限为 6 个月，但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的，清算期限相应顺延。

### （3）清算费用

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

### （4）基金剩余财产的分配

基金财产按如下顺序进行清偿：

- 1) 支付基金财产清算费用；
- 2) 缴纳基金所欠税款；
- 3) 清偿基金债务；
- 4) 清算后如有余额，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

### （5）基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告。基金财产清算小组做出的清算报告经符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并公告。

基金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。基金财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

### （6）基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存，保存期限不少于法律法规规定的最低期限。