华宝均衡精选主动管理交易型开放式股票证券投资基金

招募说明书（草案）

【重要提示】

本基金经中国证券监督管理委员会2026年10月16日证监许可【2026】2858号文注册，进行募集。

基金管理人保证《华宝均衡精选主动管理交易型开放式股票证券投资基金招募说明书》(以下简称“招募说明书”或“本招募说明书”)的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值及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。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险,包括：本基金特有风险、流动性风险、ETF运作的风险、本基金投资特定品种及参与特定业务的风险、管理风险、操作或技术风险、合规性风险、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等。其中，ETF运作的风险包括基金份额二级市场交易价格折溢价风险、参考IOPV决策和IOPV计算错误的风险、股票停牌的风险、投资者申购失败的风险、投资者赎回失败的风险、申购赎回清单差错风险、申购赎回清单标识设置不合理的风险、基金份额赎回对价的变现风险、套利风险、第三方机构服务的风险、申赎成本增加风险、退市风险、主动管理策略失效的风险、潜在抢先交易风险等。

本基金特有风险包括：（1）采用主动投资策略进行投资管理可能引致的特定风险，包括主动选股策略失效风险、潜在抢先交易风险、投资策略被复制风险等；（2）主动ETF运作的风险，包括基金份额参考净值（IOPV）偏离的风险、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险等。

本基金为主动ETF，可能面临主动选股策略失效风险，即由于采用主动选股策略，可能存在策略失效、实际业绩落后于业绩比较基准的风险；可能面临潜在抢先交易风险，即因执行主动选股策略等原因发生调仓且难以在一个交易日内完成调整，可能出现股票调仓方向暴露、被其他投资者抢先交易组合证券的情形，进而影响基金投资收益；可能面临投资策略被复制风险，即基金每交易日公布基于前一交易日日终的真实投资组合的申购赎回清单，投资组合透明度较高，其他投资者可能据此跟踪、复制基金投资策略和持仓结构，从而可能削弱投资策略的有效性，对基金投资收益产生不利影响。

本基金可能面临基金份额参考净值（IOPV）偏离的风险。基金管理人委托深圳证券信息有限公司在交易时间内根据申购赎回清单和组合证券内各只证券的实时成交数据，计算并发

布基金份额参考净值（IOPV）并通过深圳证券交易所发布，供投资者交易、申购、赎回基金份额时参考。若基金于交易日内调仓，IOPV仅反映申购赎回清单所列组合证券的价值，与实时的基金份额净值可能出现一定偏离，该等偏离并非IOPV计算错误所致。投资者若完全依赖IOPV进行投资决策，可能因上述偏离遭受损失。

基金份额在证券交易所的交易价格受供求关系等诸多因素影响，存在不同于基金份额净值的情形，即存在折溢价的风险。基金管理人将通过采取完善流动性服务等措施降低基金份额折溢价幅度，但基金调仓期间IOPV与基金份额净值的偏离可能加大，套利机制的有效性可能下降，基金折溢价幅度可能较大，折溢价状态的持续时间可能较长。

本基金为主动ETF，在基金运作过程中基于前一交易日日终的真实投资组合制作申购赎回清单，与指数ETF基于标的指数权重文件制作申购赎回清单存在差异。主动ETF的申购赎回清单兼具申赎对价与持仓披露作用，其内容可能因基金管理人主动调整投资组合而变动，且受组合主动投资策略和调仓策略等方面的影响，其变动频率和幅度可能高于指数ETF。

本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

在目前的业务规则下，投资者投资本基金时需具有深圳证券交易所A股账户或基金账户。其中，深圳证券交易所基金账户只能进行基金的现金认购和二级市场交易，如投资人需要参与基金的申购、赎回，则应开立深圳证券交易所A股账户。

在目前结算规则下，投资者申购的基金份额当日起可卖出，投资者赎回获得的股票当日起可卖出。

投资者在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》、基金产品资料概要及《基金合同》等信息披露文件，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资者的风险承受能力相适应，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。

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也不构成对本基金业绩表现的保证。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证投资于本基金一定盈利，也不保证最低收益。

投资有风险，投资者认购（或申购）本基金时应认真阅读本招募说明书。

基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化导致的投资风险，由投资者自行负担。

目　录

一、绪言 4
二、释义 5
三、基金管理人 9
四、基金托管人 16
五、相关服务机构 19
六、基金的募集 21
七、基金备案 25
八、基金份额折算与变更登记 26
九、基金份额的上市交易 27
十、基金份额的申购与赎回 29
十一、基金的投资 41
十二、基金的财产 46
十三、基金资产估值 47
十四、基金的收益分配 52
十五、基金的费用与税收 53
十六、基金的会计与审计 55
十七、基金的信息披露 56
十八、风险揭示 62
十九、基金合同的变更、终止与基金财产的清算 68
二十、基金合同的内容摘要 70
二十一、基金托管协议的内容摘要 83
二十二、对基金份额持有人的服务 96
二十三、其他应披露事项 98
二十四、招募说明书的存放及查阅方式 99
二十五、备查文件 100

一、 绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性风险管理规定》”)、《深圳证券交易所证券投资基金业务指引第5号——主动管理交易型开放式基金》、其他有关规定及《华宝均衡精选主动管理交易型开放式股票证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)编写。

本基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。

本基金是根据本招募说明书所载明资料申请募集的。本招募说明书由本基金管理人解释。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书作出任何解释或者说明。

本招募说明书根据基金合同编写，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。基金投资者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。基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

二、释义

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：指华宝均衡精选主动管理交易型开放式股票证券投资基金

2、基金管理人：指华宝基金管理有限公司

3、基金托管人：指广发证券股份有限公司

4、基金合同：指《华宝均衡精选主动管理交易型开放式股票证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充

5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《华宝均衡精选主动管理交易型开放式股票证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充

6、招募说明书或本招募说明书：指《华宝均衡精选主动管理交易型开放式股票证券投资基金招募说明书》及其更新

7、基金产品资料概要：指《华宝均衡精选主动管理交易型开放式股票证券投资基金基金产品资料概要》及其更新

8、基金份额发售公告：指《华宝均衡精选主动管理交易型开放式股票证券投资基金基金份额发售公告》

9、上市交易公告书：指《华宝均衡精选主动管理交易型开放式股票证券投资基金上市交易公告书》

10、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

11、《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

12、《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

13、《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

14、《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

15、《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

16、ETF：指《深圳证券交易所证券投资基金交易和申购赎回实施细则》定义的“交易型开放式基金”

17、ETF 联接基金、联接基金：指将绝大多数基金财产投资于本基金，与本基金的投资目标类似，采用开放式运作方式的基金

18、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

19、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

20、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

21、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

22、合格境外投资者：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》（及其不时修订）及相关法律法规规定使用来自境外的资金进行境内证券期货投资的境外机构投资者，包括合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者

23、投资者：指个人投资者、机构投资者、合格境外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者的合称

24、特定投资者：指中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司颁布的《中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司交易型开放式基金登记结算业务指南》（及其不时修订）所定义的特定投资者

25、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者

26、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、赎回等业务

27、销售机构：指直销机构及代销机构

28、直销机构：指华宝基金管理有限公司

29、代销机构：指符合《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接受基金管理人委托代为办理基金销售业务的机构，包括发售代理机构和申购赎回代理券商

30、发售代理机构：指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，由基金管理人指定的代理本基金发售业务的机构

31、申购赎回代理券商：指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，由基金管理人指定的办理本基金申购、赎回业务的证券公司，又称为代办证券公司

32、基金销售网点：指直销机构的直销中心及代销机构的代销网点

33、登记业务：指《中国证券登记结算有限责任公司关于交易所交易型开放式证券投资基金登记结算业务实施细则》（及其不时修订）规定的基金登记、存管、结算及相关业务

34、登记机构：指办理登记业务的机构。基金管理人可自行或委托其他机构代为办理登

记业务。本基金的登记机构为中国证券登记结算有限责任公司

35、深圳证券账户：指深圳证券交易所人民币普通股票账户（即 A 股账户）或深圳证券交易所基金账户

36、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

37、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

38、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

39、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

40、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

41、T 日：指销售机构在规定时间受理投资者申购、赎回或其他业务申请的开放日

42、T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日(不包含 T 日)

43、开放日：指为投资者办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

44、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

45、《业务规则》：指深圳证券交易所发布实施的《深圳证券交易所证券投资基金交易和申购赎回实施细则》（包括其不时修订）、中国证券登记结算有限责任公司发布实施的《中国证券登记结算有限责任公司关于交易所交易型开放式证券投资基金登记结算业务实施细则》（包括其不时修订）及中国证券登记结算有限责任公司、深圳证券交易所发布的其他相关规则、规定、通知及指南等

46、认购：指在基金募集期内，投资者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

47、申购：指基金合同生效后，投资者根据基金合同和招募说明书的规定，以申购赎回清单规定的申购对价向基金管理人申请购买基金份额的行为

48、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申购赎回清单规定的赎回对价的行为

49、申购赎回清单：指由基金管理人编制的用以公告申购对价、赎回对价等信息的文件

50、申购对价：指投资者申购基金份额时，按基金合同和招募说明书规定应交付的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价

51、赎回对价：指投资者赎回基金份额时，基金管理人按基金合同和招募说明书规定应交付给赎回人的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价

52、组合证券：指本基金投资组合所包含的全部或部分证券

53、最小申购赎回单位：指本基金申购份额、赎回份额的最低数量，投资者申购或赎回的基金份额数应为最小申购赎回单位的整数倍

54、现金替代：指申购或赎回过程中，投资者按基金合同和招募说明书的规定，用于替代组合证券中部分证券的一定数量的现金

55、现金差额：指最小申购赎回单位的资产净值与按当日收盘价计算的最小申购赎回单位中的组合证券市值和现金替代之差;投资者申购或赎回时应支付或应获得的现金差额根据最小申购赎回单位对应的现金差额、申购或赎回的基金份额数计算

56、元：指人民币元

57、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

58、基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券及票据价值、银行存款本息、基金应收款项及其他资产的价值总和

59、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

60、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

61、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

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、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

64、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

三、基金管理人

（一）基金管理人概况

基金管理人：华宝基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼

法定代表人：夏雪松

总经理：向辉

成立日期：2003 年 03 月 07 日

注册资本：1.5 亿元人民币

电话：021-38505888

联系人：徐蓓蓓

股权结构：中方股东华宝信托有限责任公司持有 51%的股份，外方股东 Warburg Pincus Asset Management, L.P.持有 29%的股份，中方股东江苏省铁路集团有限公司持有 20%的股份。

（二）主要人员情况

1、董事会成员

夏雪松先生，董事长，硕士。曾任职于宝钢集团、宝钢股份、宝信软件。历任上海宝信软件股份有限公司董事会秘书、财务总监兼财务部经理，副总经理兼财务总监，总经理、党委书记、董事长等职务。现任华宝基金管理有限公司董事长、党委书记。

向辉先生，董事，硕士。曾在武汉长江金融审计事务所任副所长、在长盛基金管理有限公司市场部任职。2002 年加入华宝基金管理有限公司，先后担任公司清算登记部总经理、营运副总监、营运总监、副总经理等职务。现任华宝基金管理有限公司总经理。

朱莉丽女士，董事，硕士。曾就职于美林投资银行部、德意志银行投资银行部。现任上海华平私募基金管理有限公司董事总经理，兼任河南中原消费金融股份有限公司董事，神策网络科技（北京）有限公司董事。

卢余权先生，董事，学士。曾任江苏省交通厅公路局副局长、江苏省铁路办公室规划计划处处长。现任江苏省铁路集团有限公司副总经理、党委委员、总法律顾问、首席合规官，新陆桥（连云港）码头有限公司董事、副董事长，江苏省国有企业发展改革研究会常务理事。

王灿先生，独立董事，硕士。曾先后任复星国际有限公司及复星集团执行董事、高级副总裁兼首席发展官(CGO)、首席财务官(CFO)及投资管理中心总经理等职务，并曾任职于金蝶软件（中国）有限公司、普华永道中天会计师事务所、渣打银行（中国）有限公司、华住酒店集团。现任中国总会计师协会副会长，兼任亚朵生活控股有限公司独立董事、重庆小米消费金融有限公司独立非执行董事、清晰医疗集团控股有限公司独立非执行董事。

许多奇女士，独立董事，博士。曾先后任中南财经政法大学法学院助教、讲师，上海交通大学法学院讲师、副教授、教授、博导，美国哈佛大学法学院富布莱特高级访问学者，纽约大学法学院“Hauser”全球研究员，杜克大学、新南威尔士大学等国际顶尖法学院的高级访问学者。现任复旦大学法学院教授、博士生导师，复旦大学数字经济法治研究中心主任和智慧法治重点实验室负责人，上海交通大学上海高级金融学院兼聘教授。兼任桂林银行股份有限公司独立董事、中储发展股份有限公司独立董事、上海羲禾科技股份有限公司独立董事、东方明珠新媒体股份有限公司独立董事，申能财产保险股份有限公司外部监事、同方全球人寿保险公司外部监事，法律与国际事务委员会（FLIA）委员及项目主任、东南大学兼职博导、中国科学技术法学会常务理事、中国法学会财税法学会常务理事、最高人民法院中国司法大数据研究院互联网司法研究中心专家库成员、上海市政府首批立法专家、中共浦东新区委员会法律顾问、中国（上海）自贸试验区管委会法律顾问等职务。

周波女士，独立董事，博士。曾任上海财经大学会计学院助理教授、会计学院院长助理。现任上海财经大学会计学院副教授、博士生导师，会计学院副院长。并为中国总会计师协会财务管理专业委员会委员、中国商业会计学会智能财务分会副会长；兼任上海新相微电子股份有限公司、上海浦东建设股份有限公司等公司独立董事。

徐世磊先生，职工董事，硕士。曾任宝钢集团经营审计处长，中国宝武经营审计处长，华宝证券股份有限公司党委副书记、纪委书记兼工会主席、职工监事、职工董事等职务。现任华宝基金管理有限公司党委副书记、纪委书记兼工会主席。

2、总经理及其他高级管理人员

向辉先生，总经理，简历同上。

夏英先生，常务副总经理，硕士。曾任北京银行支行行长、办公室副主任（主持工作）、资金交易部副总经理，中加基金管理有限公司总经理、董事长等。2025 年 8 月加入华宝基金管理有限公司，现任华宝基金管理有限公司常务副总经理。

欧江洪先生，副总经理，本科。曾在宝钢集团、宝钢股份任职。历任华宝投资董事会秘书、总经理助理兼行政人事部总经理、党委组织部部长、党委办公室主任，华宝基金副总经理兼董事会秘书，党委副书记、纪委书记、工会主席。现任华宝基金管理有限公司副总经理。

周雷先生，督察长，硕士。曾任职于中国机械设备进出口总公司、北京证监局、中国证监会，曾任华宝证券有限责任公司首席风险官、合规总监。现任华宝基金管理有限公司督察长。

李孟恒先生，首席信息官，硕士。曾在 T.A. Consultanted LTD.从事开发及技术管理工作。2002 年参与华宝基金管理有限公司筹备工作，后历任信息技术部资深系统工程师、部门副总经理，营运副总监兼信息技术部总经理，现任华宝基金管理有限公司首席信息官。

周晶先生，首席投资官，博士。先后在德亚投资(美国)、华宝基金、汇丰证券(美国)从事风险管理、投资研究等工作。 2011 年 6 月再次加入华宝基金管理有限公司，历任首

席策略分析师、策略部总经理、海外投资部总经理、公司总经理助理兼国际业务部总经理，现任华宝基金管理有限公司首席投资官。

3、本基金拟任基金经理

丁靖斐，硕士。曾在华泰证券研究所从事研究工作。2014 年 12 月加入华宝基金管理有限公司，先后担任高级分析师、基金经理助理等职务，现任创新研究发展中心副总经理。2019 年 9 月起任华宝资源优选混合型证券投资基金基金经理，2020 年 7 月起任华宝国策导向混合型证券投资基金基金经理，2021 年 12 月至 2022 年 12 月任华宝服务优选混合型证券投资基金基金经理，2022 年 10 月起任华宝多策略增长开放式证券投资基金基金经理，2023 年 12 月至 2025 年 8 月任华宝远恒混合型证券投资基金基金经理。

蒋俊阳，硕士。曾在上海申银万国证券研究所、光大证券研究所从事研究工作。2018 年 10 月加入华宝基金管理有限公司，现任指数研发投资部副总经理。2020 年 7 月至 2026 年 5 月任华宝中证电子 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2020 年 12 月起任华宝中证细分食品饮料产业主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2021 年 3 月至 2022 年 2 月任华宝中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2021 年 6 月至 2025 年 9 月任华宝深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2021 年 7 月起任华宝中证细分食品饮料产业主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，2021 年 7 月至 2026 年 5 月任华宝中证电子 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，2021 年 9 月至 2024 年 9 月任华宝深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，2021 年 11 月起任华宝中证 800 地产交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2024 年 3 月起任华宝中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2024 年 4 月起任华宝中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，2024 年 11 月起任华宝中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2025 年 1 月起任华宝中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2025 年 4 月至 2026 年 4 月任华宝深证 100 指数型发起式证券投资基金基金经理，2025 年 9 月起任华宝深证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2025 年 9 月至 2025 年 11 月任华宝港股通恒生中国(香港上市)30 指数证券投资基金(LOF)基金经理，2025 年 9 月起任华宝港股通恒生中国（香港上市）30 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2025 年 11 月起任华宝港股通恒生中国（香港上市）30 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）基金经理，2025 年 12 月起任华宝北证 50 成份指数型证券投资基金基金经理，2026 年 2 月起任华宝中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金、华宝中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，2026 年 4 月起任华宝创业板人工智能交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、华宝创业板人工智能交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2026 年 4 月起任华宝深证 100 交易型开放式指数证券投资基

金发起式联接基金基金经理，2026 年 8 月起任华宝上证科创板 200 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

4、投资决策委员会成员

周晶先生，华宝基金管理有限公司首席投资官、国际业务部总经理、基金经理。

丁靖斐女士，华宝基金管理有限公司创新研究发展中心副总经理、基金经理。

刘自强先生，华宝基金管理有限公司均衡风格投资总监、基金经理。

钟奇先生，华宝基金管理有限公司成长风格投资总监、基金经理。

贺喆先生，华宝基金管理有限公司权益投资副总监、基金经理。

夏林锋先生，华宝基金管理有限公司权益投资副总监、权益投资部副总经理、基金经理。

5、 上述人员之间不存在近亲属关系。

（三）基金管理人职责

基金管理人应严格依法履行下列职责：

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、 办理本基金备案手续；

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、赎回对价、编制申购赎回清单；

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、 中国证监会规定的其他职责。

（四）基金管理人承诺

1、 基金管理人将遵守《基金法》、《中华人民共和国证券法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》等法律法规的相关规定，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违法违规行为的发生。

2、 基金管理人不从事下列行为：

（1）将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；

（2）不公平地对待其管理的不同基金财产；

（3）利用基金财产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）依照法律、行政法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他行为。

3、 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、代理人、代表人、受雇人或任何其他第三人牟取不当利益；

（3）不泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息，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）不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

（五）基金管理人内部控制制度

1、风险管理体系

本基金在运作过程中面临的风险主要包括市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险、合规性风险、信誉风险和事件风险（如灾难）等。

针对上述各种风险，基金管理人建立了一套完整的风险管理体系，具体包括以下内容：

（1）搭建风险管理环境。具体包括制定风险管理战略、目标，设置相应的组织机构，建立清晰的责任线路和报告渠道、配备适当的人力资源、开发适用的技术支持系统等内容。

（2）识别风险。辨识公司运作和基金管理中存在的风险。

（3）分析风险。检查存在的控制措施，分析风险发生的可能性及其引起的后果并将风险归类。

（4）度量风险。评估风险水平的高低，既有定性的度量手段，也有定量的度量手段。定性的度量是把风险水平划分为若干级别，每一种风险按其发生的可能性与后果的严重程度分别进入相应的级别。定量的方法则是设计一些风险指标，测量其数值的大小。

（5）处理风险。将风险水平与既定的标准相对比，对于那些级别较低、在公司所定标准范围以内的风险，控制相对宽松一点，但仍加以定期监控，以防其超过预定标准；而对较为严重的风险，则制定适当的控制措施；对于一些后果可能极其严重的风险，则除了严格控制以外，还准备了相应的应急处理措施。

（6）监视与检查。对已有的风险管理系统进行实时监视，并定期评价其管理绩效，

在必要时结合新的需求加以改变。

（7）报告与咨询。建立风险管理的报告系统，使公司股东、公司董事会、公司高级管理人员及监管部门及时而有效地了解公司风险管理状况，并寻求咨询意见。

2、内部控制制度

（1）内部风险控制原则

合规性原则。内部控制机制应符合法律和监管要求，规范和促使公司经营管理及公司员工执业行为符合法律法规、行业规范和自律规则，以及行业普遍遵守的职业道德和行为。

健全性原则。内部控制机制必须覆盖公司的各项业务、各个部门和各级岗位，并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个环节。

有效性原则。通过设置科学清晰的操作流程，结合程序控制，建立合理的内控程序，维护内部控制制度的有效执行。

独立性原则。公司必须在精简高效的基础上设立能充分满足公司经营运作需要的部门和岗位，各部门和岗位在职能上保持相对独立性；公司自有资产、各项受托资产分离运作，独立进行。

相互制约原则。部门和岗位的设置必须权责分明、相互制约，并通过切实可行的相互制衡措施来消除内部控制盲点。

防火墙原则。公司基金管理、交易、清算登记、信息技术、研究、市场营销等相关部门，应当在物理上和制度上适当隔离；对因业务需要必须知悉未公开信息或涉及多部门信息的人员，应制定严格的批准程序和监督防范措施。

成本效益原则。公司应当充分发挥各部门及员工的工作积极性，尽量降低经营运作成本，保证以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

合法合规性原则。公司内控制度应当符合国家法律法规、规章制度和各项规定，并在此基础上遵循国际和行业的惯例制订。

全面性原则。内部控制制度必须涵盖公司经营管理的各个环节，不留有制度上的空白或漏洞。

审慎性原则。公司内部控制的核心是风险控制，内部控制制度的制订要以审慎经营、防范和化解风险为出发点。

适时性原则。内部控制制度的制订应当具有前瞻性，并应随着公司经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律法规、政策制度等外部环境的改变，及时修改或完善。

实效性原则。内部控制制度应得到有效执行。公司应当树立和强化管理制度化、制度流程化、流程信息化的内控理念，通过强监管、严问责、加强信息化管理，严格落实各项规章制度。

（2）内部风险控制的要求和内容

内部风险控制要求不相容职务分离、建立完善的岗位责任制和规范的岗位管理措施、建立完整的信息资料保全系统、建立授权控制制度、建立有效的风险防范系统和快速反应机制。

内部风险控制的内容包括投资管理业务控制、市场管理业务控制、信息披露控制、信息技术系统控制、会计系统控制、档案管理控制、合规和法务管理控制、风险管理控制、审计稽核控制，及反洗钱控制等。

（3）督察长制度

公司设督察长，督察长由公司总经理提名，董事会聘任，并应当经全体独立董事同意。

督察长应当定期或者不定期向全体董事报送工作报告，并在董事会及董事会下设的相关专门委员会定期会议上报告基金及公司运作的合法合规情况及公司内部风险控制情况。督察长发现基金及公司运作中存在问题时，应当及时告知公司总经理和相关业务负责人，提出处理意见和整改建议，并监督整改措施的制定和落实；公司总经理对存在问题不整改或者整改未达到要求的，督察长应当向公司董事会、中国证监会及相关派出机构报告。

（4）监察稽核及风险管理制度

合规审计部和风险管理部依据公司的内部控制制度，在所赋予的权限内，按照所规定的程序和适当的方法，进行公正客观的检查和评价。

合规审计部和风险管理部负责调查评价公司内控制度的健全性、合理性；负责调查、评价公司有关部门执行公司各项规章制度的情况；评价各项内控制度执行的有效性，对内控制度的缺失提出补充建议；进行日常风险监控工作；协助评价基金财产风险状况；负责包括基金经理离任审查在内的各项内部审计事务等。

3、基金管理人关于内部控制制度的声明书

（1）基金管理人承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确；

（2）基金管理人承诺根据市场变化和公司发展不断完善内部合规控制制度。

四、基金托管人

（一）基金托管人基本情况

名称：广发证券股份有限公司（以下简称“广发证券”）

住所：广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街 2 号 618 室

办公地址：广东省广州市天河区马场路 26 号广发证券大厦 34 楼

法定代表人：林传辉

成立时间：1994 年 1 月 21 日

基金托管资格批文及文号：证监许可【2014】510 号

注册资本：人民币 7,824,845,511 元

存续期间：长期

联系人：罗琦

联系电话：020-66338888

广发证券是国内首批综合类证券公司，先后于 2010 年和 2015 年分别在深圳证券交易所及香港联合交易所有限公司主板上市（股票代码：000776.SZ，1776.HK）。截至2025 年6 月30 日，公司共设立证券营业部 330 家。

广发证券具有完备的业务体系、均衡的业务结构，突出的核心竞争力。拥有投资银行、财富管理、交易及机构和投资管理四大业务板块，具备全业务牌照。公司锻造综合金融服务实力，主要经营指标连续多年稳居中国券商前列，在多项核心业务领域中形成了领先优势，研究、资产管理、财富管理等位居前列。截至 2025 年 6 月 30 日，集团总资产8,158.39 亿元，归属于上市公司股东的所有者权益为 1,509.47 亿元，2025 年上半年营业收入为153.98 亿元，营业利润为 83.37 亿元，归属于上市公司股东的净利润为64.70 亿元。

2、主要人员情况

刘洋先生现任广发证券资产托管部总经理。曾就职于大成基金管理有限公司、招商银行股份有限公司、浦银安盛基金管理有限公司、上海银行股份有限公司、美国道富银行。刘洋先生于 2000 年 7 月获得北京大学理学学士，并于 2003 年 7 月获得北京大学经济学硕士学位。

广发证券资产托管部主要人员均具备多年基金、证券、银行等金融机构从业经历或会计师事务所审计经验，从业经验丰富，具备基金从业资格，熟悉基金托管工作。资产托管部员工学历均在本科以上，专业背景涵盖了金融、法律、会计、统计、计算机等领域，是一支诚实勤勉、积极进取的专业从业人员队伍。

3、基金托管业务经营情况

广发证券于 2014 年 5 月取得中国证监会核准证券投资基金托管资格。广发证券严格

履行基金托管人的各项职责，不断加强风险管理和内部控制，确保基金资产的完整性和独立性，切实维护基金份额持有人的合法权益，提供高质量的基金托管服务。截至2025 年6月 30日，广发证券托管的公开募集证券投资基金共 97 只。

（二）基金托管人的风险管理原则和内部控制制度

广发证券开展基金托管业务遵循以下风险管理原则：

1、合规性原则。保持风险管理政策与监管部门要求相一致，并把监管规定作为业务开展和风险管理应遵从的最基本要求。

2、全面性原则。资产托管业务风险管理应涵盖可能出现的所有风险类型，应渗透到决策、执行、监督、反馈等各个环节，风险控制应落实到业务涉及的所有岗位、所有环节，包含事前风险控制、事中风险监控、事后风险报告和处理。

3、制衡性原则。资产托管业务各级业务部门和岗位的设置应当权责分明、相互制约，建立不同部门、不同岗位之间的制衡体系。

4、独立性原则。公司的风险控制相关部门，包括合规与法律事务部、风险管理部、稽核部等，均应保持高度的独立性，各自从独立的风险控制角度出发，对资产托管业务的风险进行管理。

5、持续性原则。公司对资产托管业务开展持续的风险管理工作，根据实际情况动态调整风控措施和风控手段，并通过顺畅的风险报告和传导机制，及时有效地处理各种风险事项，确保风险管理政策和措施的贯彻实施。广发证券根据相关法律法规和公司制度的相关要求，制定了完善的内部控制制度，具体包括《广发证券资产托管业务管理办法》、《广发证券资产托管业务信息披露管理规定》、《广发证券资产托管业务账户管理规定》、《广发证券资产托管产品估值核算管理规定》、《广发证券资产托管业务资金清算管理规定》、《广发证券公募基金投资监督管理规定》、《广发证券资产托管部业务信息保密与业务档案管理规定》、《广发证券资产托管业务应急管理规定》、《广发证券资产托管部从业人员管理规定》、《广发证券股份有限公司资产托管业务公开募集证券投资基金风险准备金管理规定》等，囊括了基金托管业务的账户管理、估值核算、资金清算、投资监督、内部控制、风险管理、业务系统管理、保密和档案管理、应急处理、从业人员管理等全部业务环节。

（三）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《基金法》等有关法律法规规定以及基金合同、基金托管协议相关约定，基金托管人对基金的投资范围和投资对象、基金投资比例、基金投资禁止行为、基金参与银行间债券市场、基金资产净值的计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、信息披露等进行监督。

基金托管人发现基金管理人违反《基金法》等有关法律法规规定或基金合同、基金托管协议相关约定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对，并以书面形式对基金托管人发出回函确认。在限期内，基金托管人有权随时对

通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。基金托管人发现基金管理人有重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

五、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、网下现金发售直销机构

名称：华宝基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道100号上海环球金融中心58楼

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道100号上海环球金融中心58楼

法定代表人：夏雪松

直销柜台电话：021-38505731、021-38505732

直销柜台传真：021-50499663、021-50988055

网址：www.fsfund.com

2、网下现金发售代理机构

详见基金份额发售公告。

3、网上现金发售代理机构

网上现金发售通过具有基金销售业务资格的深圳证券交易所会员单位办理，具体名单可在深圳证券交易所网站查询。

基金管理人可依据实际情况增减、变更发售代理机构，并在基金管理人网站公示。

（二）登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所、办公地址：北京市西城区太平桥大街17号

法定代表人：于文强

联系人：赵亦清

联系电话：010-50938782

传真：010-58598907

（三）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

注册地址：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：陈臻

电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：丁媛

经办律师：丁媛、陈袁春雨

（四）审计基金财产的会计师事务所

名称：容诚会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：北京市西城区阜成门外大街22号1幢10层1001-1至1001-26

办公地址：北京市西城区阜成门外大街22号1幢10层1001-1至1001-26

执行事务合伙人：刘维、肖厚发

电话：010-66001391

传真：010-66001392

业务联系人：林佳璐

经办会计师：薛竞、林佳璐

六、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》、基金合同及其他有关规定募集。

准予注册文件：中国证监会证监许可【2026】2858号

准予注册日期：2026年10月16日

(一) 基金的类别、运作方式与存续期限

1、基金的类别：股票型证券投资基金

2、基金的运作方式：交易型开放式

3、基金存续期限：不定期

(二) 募集期限

自基金份额发售之日起最长不得超过3个月，具体发售时间见基金份额发售公告。

(三) 募集对象

符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、合格境外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者。

(四) 募集方式

投资者可选择网上现金认购、网下现金认购2种方式。

网上现金认购是指投资者通过基金管理人指定的发售代理机构利用深圳证券交易所网上系统以现金进行认购;网下现金认购是指投资者通过基金管理人及其指定的发售代理机构以现金进行认购。

投资者应当在基金管理人及其指定发售代理机构办理基金发售业务的营业场所，或者按基金管理人或发售代理机构提供的方式办理基金份额的认购。基金管理人、发售代理机构接受的认购方式、办理基金发售业务的具体情况和联系方式，请参见基金份额发售公告或相关公告。

发售代理机构的具体名单见基金份额发售公告，基金管理人可依据实际情况增减、变更发售代理机构，并在基金管理人网站公示。销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定生效，而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购的确认以登记机构的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况，投资者应及时查询并妥善行使合法权利。

(五) 基金份额发售面值

本基金基金份额发售面值为人民币1.00元，认购价格为1.00元。

(六) 基金开户

1、投资人认购本基金时需具有深圳证券交易所A股账户（以下简称“深圳A股账户”）或深圳证券交易所证券投资基金账户（以下简称“深圳证券投资基金账户”）。

（1）已有深圳A股账户或深圳证券投资基金账户的投资人不必再办理开户手续。

（2）尚无深圳A股账户或深圳证券投资基金账户的投资者人，需在认购前持本人身份证明文件到中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司的开户代理机构办理深圳A股账户或深圳证券投资基金账户的开户手续。有关开设深圳A股账户和深圳证券投资基金账户的具体程序和办法，请到各开户网点详细咨询有关规定。

2、账户使用注意事项

如投资人需要参与网下现金或网上现金认购，应使用深圳A股账户或深圳证券投资基金账户；深圳证券投资基金账户只能进行本基金的现金认购和二级市场交易。

(七) 认购费用

本基金的认购费用由投资者承担，认购费率如下图表所示：

认购份额（份）	认购费率
小于 100 万	0.8%
100 万（含）以上	每笔 1000 元

基金管理人办理网下现金认购不收取认购费用。发售代理机构办理网上现金认购、网下现金认购时可参照上述费率结构收取一定的佣金。

认购费将用于支付募集期间会计师费、律师费、登记结算费、销售费及市场推广等支出，不计入基金资产。

(八) 网上现金认购

1、认购时间：详见基金份额发售公告。

2、通过发售代理机构进行网上现金认购的投资者，认购以基金份额申请，认购佣金、认购金额的计算公式为：

认购佣金＝认购价格×认购份额×佣金比率

（或若适用固定费用的，认购佣金=固定费用）

认购金额＝认购价格×认购份额×（1＋佣金比率）

（或若适用固定费用的，认购金额＝认购价格×认购份额+固定费用）

认购佣金由发售代理机构在投资者认购确认时收取，投资者需以现金方式交纳认购佣金。

网上现金认购款项在基金募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有。网上现金认购的利息和具体份额以登记结算机构的记录为准。利息折算的基金份额保留至整数位，小数部分舍去，舍去部分计入基金财产。

利息折算的份额＝利息/认购价格。

例：某投资者通过网上现金认购方式认购1,000份本基金，假设发售代理机构确认的佣金比率为0.8%，该笔认购金额产生利息1元，则需准备的资金金额计算如下：

认购佣金＝1.00×1,000×0.8%＝8元

认购金额＝1.00×1,000×(1＋0.8%)＝1,008元

利息折算的份额＝1/1.00＝1份

即投资者需准备1,008元资金，方可认购到1,000份本基金基金份额，假如该笔认购金额产生利息1元，则投资者可得到1,001份本基金基金份额。

3、认购限额：网上现金认购以基金份额申请。单一账户每笔认购份额需为1,000份或其整数倍。投资人可以多次认购，累计认购份额不设上限，但法律法规、监管要求以及本基金发售规模控制方案另有规定的除外。

4、认购申请：投资者在认购本基金时，需按发售代理机构的规定备足认购资金，办理认购手续。投资者可多次申报，不可撤单，申报一经确认，认购资金即被冻结。

5、清算交收：投资者提交的认购委托，由登记机构进行有效认购款项的清算交收。

6、认购确认：在基金合同生效后，投资者应通过其办理认购的销售网点或以其提供的其他方式查询认购确认情况。

（九）网下现金认购

1、认购时间：详见基金份额发售公告。

2、通过基金管理人进行网下现金认购的认购金额的计算：

通过基金管理人进行网下现金认购的投资者，认购以基金份额申请，认购金额的计算公式为：

认购金额＝认购价格×认购份额

净认购份额＝认购份额＋认购金额产生的利息/认购价格

通过基金管理人进行网下现金认购款项在基金募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有，网下现金认购的利息和具体份额以基金管理人的记录为准。利息折算的份额保留至整数位，小数部分舍去，舍去部分计入基金财产。

例：某投资者到基金管理人直销网点以网下现金认购方式认购100,000份基金份额，假定认购金额产生的利息为10元，则需准备的资金金额计算如下：

认购金额＝1.00×100,000＝100,000元

净认购份额=100,000+10/1.00=100,010份

即投资人若通过基金管理人直销网点以网下现金认购方式认购本基金100,000份，需准备100,000元资金，假定该笔认购金额产生利息10元，则投资人可得到100,010份本基金基金份额。

3、通过发售代理机构进行网下现金认购的认购金额的计算：同通过发售代理机构进行网上现金认购的认购金额的计算。

4、认购限额：网下现金认购以基金份额申请。投资人通过发售代理机构办理网下现金认购，每笔认购份额须为1000份或其整数倍。投资者通过基金管理人办理网下现金认购的，每笔认购份额须在10万份以上(含10万份)。投资者可以多次认购，累计认购份额不设上限，但法律法规、监管要求以及本基金发售规模控制方案另有规定的除外。

5、认购手续：投资人在认购本基金时，需按销售机构的规定，到销售网点办理相关认购手续，并备足认购资金。认购一经确认不得撤销。

6、清算交收：通过基金管理人提交的网下现金认购申请，由基金管理人进行有效认购款项的清算交收。通过发售代理机构提交的网下现金认购申请，由登记机构进行有效认购款项的清算交收。

7、认购确认：在基金合同生效后，投资者应通过其办理认购的销售网点或以其提供的其他方式查询认购确认情况。

（十）募集期间认购资金

网上现金认购及网下现金认购的有效认购资金在募集期间产生的利息，将折算为基金份额归投资者所有，其中利息转份额以登记机构的记录为准。

基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。

七、基金备案

（一）基金备案的条件

本基金自基金份额发售之日起 3 个月内，在基金募集份额总额不少于 2 亿份，基金募集金额不少于 2 亿元人民币且基金认购人数不少于 200 人的条件下，基金募集期届满或基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售，并在 10 日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告之日起 10 日内，向中国证监会办理基金备案手续。

基金募集达到基金备案条件的，自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起，《基金合同》生效；否则《基金合同》不生效。基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对《基金合同》生效事宜予以公告。基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。

（二）基金合同不能生效时募集资金的处理方式

如果募集期限届满，未满足基金备案条件，基金管理人应当承担下列责任：

1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用。

2、在基金募集期限届满后 30 日内返还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息。登记机构及发售代理机构将协助基金管理人完成相关资金的退还工作。

3、如基金募集失败，基金管理人、基金托管人及发售代理机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和发售代理机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。

（三）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，基金合同终止，不需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。

八、基金份额折算与变更登记

基金合同生效后，本基金可以进行份额折算。

（一）基金份额折算的时间

基金管理人应事先确定基金份额折算基准日，并依照《信息披露办法》的有关规定进行公告。

（二）基金份额折算的原则

基金份额折算由基金管理人向登记机构申请办理，并由登记机构进行基金份额的变更登记。基金份额折算的比例和具体安排本基金管理人将另行公告。

基金份额折算后，本基金的基金份额总额与基金份额持有人持有的基金份额数额将发生调整，但调整后的基金份额持有人持有的基金份额占基金份额总额的比例不发生变化。基金份额折算对基金份额持有人的权益无实质性影响（因尾数处理而产生的损益不视为实质性影响）。基金份额折算后，基金份额持有人将按照折算后的基金份额享有权利并承担义务。

如果基金份额折算过程中发生不可抗力或登记机构遇特殊情况无法办理，基金管理人可延迟办理基金份额折算。

（三）基金份额折算的方法

基金份额折算的具体方法在份额折算公告中列示。

九、基金份额的上市交易

（一）基金份额的上市

基金合同生效后，具备下列条件的，基金管理人可依据《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》，向深圳证券交易所申请基金份额上市：

1、基金场内基金资产净值不低于2亿元；

2、基金场内份额持有人不少于1,000人；

3、符合深圳证券交易所规定的其他条件。

基金份额上市前，基金管理人应与深圳证券交易所签订上市协议书。基金份额获准在深圳证券交易所上市的，基金管理人应按照相关规定发布基金份额上市交易公告书。

（二）基金份额的上市交易

基金份额在深圳证券交易所的上市交易，应遵照《深圳证券交易所交易规则》、《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》、《深圳证券交易所证券投资基金交易和申购赎回实施细则》等有关规定。

（三）停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市

基金份额在深圳证券交易所的停牌、复牌、暂停上市、恢复上市及终止上市交易，应遵照《深圳证券交易所交易规则》、《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》、《深圳证券交易所证券投资基金交易和申购赎回实施细则》等有关规定。

当本基金发生深圳证券交易所相关规则所规定的不再具备上市条件而应当终止上市的情形时，本基金将由交易型开放式基金变更为非上市的开放式基金，而无需召开基金份额持有人大会。基金终止上市后，场内基金份额的处理规则由基金管理人提前制定并公告。届时，基金管理人可变更本基金的登记机构并相应调整申购赎回等业务规则。

（四）基金份额参考净值的计算与公告

基金管理人或基金管理人委托的机构在交易时间内根据申购赎回清单和组合证券内各只证券的实时成交数据计算基金份额参考净值（IOPV），并通过深圳证券交易所发布，供投资者交易、申购、赎回时参考。IOPV由基金管理人委托的机构计算的，基金管理人应在每一个交易日开市前向基金管理人委托的机构提供当日的申购赎回清单。

1、基金份额参考净值计算公式为：

基金份额参考净值计算公式为：基金份额参考净值＝（申购赎回清单中必须现金替代的替代金额＋申购赎回清单中可以现金替代证券的数量与最新成交价相乘之和+申购赎回清单中禁止现金替代证券的数量与最新成交价相乘之和＋申购赎回清单中的预估现金差额）/最小申购赎回单位对应的基金份额。

2、基金份额参考净值的计算以四舍五入的方法保留小数点后4位。

3、基金管理人可以调整基金份额参考净值计算公式，并予以公告。如深圳证券交易所

对基金份额参考净值的计算方法另有规定的，从其规定。

（五）相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所、登记机构对基金上市交易的规则等相关规定内容进行调整的，本基金按照新规定执行，由此对基金合同进行修订的，无须召开基金份额持有人大会。

（六）若深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司增加了基金上市交易的新功能，基金管理人可以在履行适当的程序后增加相应功能。

（七）在不违反法律法规及不损害基金份额持有人利益的前提下，本基金可以 申请在包括境外交易所在内的其他证券交易所上市交易，而无需召开基金份额持有人大会审议。

十、基金份额的申购与赎回

（一）申购和赎回场所

投资者应当在申购赎回代理券商办理基金申购、赎回业务的营业场所或按申购赎回代理券商提供的其他方式办理本基金的申购和赎回。基金管理人在开始申购、赎回业务前公告申购赎回代理券商的名单，并可依据实际情况变更申购赎回代理券商，在基金管理人网站公示。

在未来条件允许的情况下，基金管理人直销可以开通场外申购赎回业务，具体业务的办理时间及办理方式基金管理人将另行公告。

（二）申购和赎回的开放日及时间

1、开放日及开放时间

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

基金合同生效后，若出现新的证券/期货交易市场、证券/期货交易所交易时间变更、登记机构的业务规则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，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。

基金管理人自基金合同生效之日起不超过 3 个月开始办理赎回，具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。

本基金可在基金上市交易之前开始办理申购、赎回，但在基金申请上市期间，可暂停办理申购、赎回。

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。

（三）申购与赎回的原则

1、本基金采用份额申购和份额赎回的方式，即申购、赎回均以份额申请；

2、本基金的申购对价、赎回对价包括组合证券、现金替代、现金差额及其他对价；

3、申购、赎回申请提交后不得撤销；

4、申购、赎回应遵守《业务规则》及其他相关规定；

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，或依据深圳证券交易所或登记机构相关规则及其变更调整上述规则。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。

（四）申购与赎回的程序

1、申购和赎回的申请方式

投资者必须根据申购赎回代理券商或基金管理人规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

投资者交付申购对价，申购成立；登记机构确认申请时，申购生效。投资者在提交赎回申请时持有足够的基金份额余额和现金，则赎回申请成立；登记机构确认赎回时，赎回生效。投资者在提交申购申请时须按申购赎回清单的规定备足申购对价，投资者在提交赎回申请时须持有足够的基金份额余额和现金，否则所提交的申购、赎回申请不成立。

2、申购和赎回申请的确认

本基金份额申购、赎回申请在受理当日进行确认。如投资者未能提供符合要求的申购对价，则申购申请不成立。如投资者持有的符合要求的基金份额不足或未能根据要求准备足额的现金，或本基金投资组合内不具备足额的符合要求的赎回对价或投资人提交的赎回申请超过基金管理人设定的当日净赎回份额上限、当日累计赎回份额上限、单个账户当日净赎回份额上限或单个账户当日累计赎回份额上限，则赎回申请不成立。

申购赎回代理券商对申购、赎回申请的受理并不代表该申请一定生效，而仅代表申购赎回代理券商确实接收到该申请。申购、赎回的确认以登记机构的确认结果为准。对于申购、赎回申请的确认情况，投资者应及时查询并妥善行使合法权利。

3、申购和赎回的清算交收与登记

本基金申购和赎回过程中涉及的申购赎回对价和基金份额的清算交收适用《业务规则》的规定。

投资者T日申购成功后，登记机构在T日收市后为投资者办理基金份额的登记与深交所上市的股票的交收以及现金替代的清算；在T+1日办理现金替代的交收以及现金差额的清算，在T+2日办理现金差额的交收，并将结果发送给申购赎回代理机构、基金管理人和基金托管人。

投资者T日赎回成功后，登记机构在T日收市后为投资者办理基金份额的注销与深交所上市的股票的交收以及现金替代的清算；在T+1日办理现金替代的交收以及现金差额的清算，在T+2日办理现金差额的交收，并将结果发送给申购赎回代理机构、基金管理人和基金托管人。

投资者应按照基金合同的约定和申购赎回代理券商的规定按时足额支付应付的现金差额、现金替代和现金替代补款。因投资者原因导致现金差额、现金替代或现金替代补款未能按时足额交收的，基金管理人有权为基金的利益向该投资者追偿，并要求其承担由此导致的其他基金份额持有人或基金资产的损失。

如果登记机构和基金管理人在清算交收时发现不能正常履约的情形，则依据《业务规则》

和参与各方相关协议及其不时修订的有关规定进行处理。

登记机构可在法律法规允许的范围内，对基金份额持有人利益不存在实质不利影响的前提下，对申购赎回的程序、份额清算交收和登记的办理时间、方式、处理规则等进行调整，并提前公告。

（五）申购和赎回的数量限制

1、投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购赎回单位的整数倍。本基金最小申购赎回单位请参考届时发布的申购、赎回相关公告以及申购赎回清单。

2、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，基金管理人可以采取设定单一投资者申购份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。

3、基金管理人可以规定本基金当日申购份额及当日赎回份额上限，具体详见相关公告。

4、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定数量或比例限制。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。

（六）申购和赎回的对价、费用及其用途

1、本基金份额净值的计算，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。T日的基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日内公告。遇特殊情况，经履行适当程序，可以适当延迟计算或公告。

2、申购对价、赎回对价根据申购赎回清单和投资者申购、赎回的基金份额数额确定。申购对价是指投资者申购基金份额时应交付的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。赎回对价是指投资者赎回基金份额时，基金管理人应交付给投资者的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。

3、申购、赎回清单由基金管理人编制。T日的申购、赎回清单在当日证券交易所开市前公告。

4、投资者在申购或赎回本基金时，申购赎回代理券商可按照不超过0.8%的标准收取佣金，其中包含证券交易所、登记机构等收取的相关费用。

基金管理人可以在不违反相关法律法规的情况下对基金份额净值、申购赎回清单计算和公告时间进行调整并提前公告。

（七）申购赎回清单的内容与格式

1、申购赎回清单的内容

T日申购赎回清单公告内容包括最小申购赎回单位所对应的申赎现金、组合证券内各证券数据、现金替代、T日预估现金差额、T-1日现金差额、基金份额净值及其他相关内容。

2、组合证券相关内容

组合证券是指本基金所包含的全部或部分证券。申购赎回清单将公告最小申购、赎回单

位所对应的各证券名称、证券代码及数量。

3、现金替代相关内容

现金替代是指申购、赎回过程中，投资者按基金合同和招募说明书的规定，用于替代组合证券中部分证券的一定数量的现金。

1）现金替代分为3种类型：禁止现金替代（标志为“禁止”）、可以现金替代（标志为“允许”）和必须现金替代（标志为“必须”）。

对于深市证券，现金替代的类型可以设为：“禁止”、“允许”和“必须”。

对于非深市证券，可以设为：“允许”和“必须”。

禁止现金替代适用于深交所上市的股票，是指在申购赎回基金份额时，该证券不允许使用现金作为替代。

可以现金替代适用于所有股票。

当可以现金替代适用于深交所上市的股票时，可以现金替代是指在申购基金份额时，允许使用现金作为全部或部分该证券的替代，但在赎回基金份额时，该证券不允许使用现金作为替代。

当可以现金替代适用于非深交所上市的股票，是指在申购赎回基金份额时，该证券必须使用现金作为替代，根据基金管理人买卖情况，与投资者进行退款或补款。

必须现金替代适用于所有股票，是指在申购赎回基金份额时，该证券必须使用固定现金作为替代。

2）可以现金替代

可以现金替代的组合证券分为：深市证券和非深市证券。

【1】对于深市证券

①适用情形：投资者申购时持仓不足的深市证券。

②替代金额：对于可以现金替代的证券，替代金额的计算公式为：

替代金额＝替代证券数量×该证券参考价格×（1＋申购现金替代保证金率）

其中，“该证券参考价格”为该证券经除权调整的T-1日收盘价。如果深圳证券交易所参考价格确定原则发生变化，以深圳证券交易所通知规定的参考价格为准。

收取申购现金替代保证金的原因是，对于使用现金替代的证券，基金管理人需在证券正常交易后买入，而实际买入价格加上相关交易费用后与申购时的参考价格可能有所差异。为便于操作，基金管理人在申购赎回清单中预先确定申购现金替代保证金率，并据此收取替代金额。如果预先收取的金额高于基金购入该部分证券的实际成本，则基金管理人将退还多收取的差额；如果预先收取的金额低于基金购入该部分证券的实际成本，则基金管理人将向投资者收取欠缺的差额。

③替代金额的处理程序

T日，基金管理人在申购赎回清单中公布申购现金替代保证金率，并据此收取替代金额。

在T日后被替代的证券有正常交易的2个交易日（简称为T+2日）内，基金管理人有权在T+2日内任意时刻以收到的替代金额代投资者买入小于等于被替代证券数量的任意数量的被替代证券，实际买入被替代证券的价格可能处于T+2日内较高的位置或处于最高价格，基金管理人对此不承担责任。基金管理人有权根据基金投资的需要自主决定不买入部分被替 代证券，或者不进行任何买入证券的操作，基金管理人可能不买入被替代证券的情形包括但不限于市场流动性不足、技术系统无法实现以及基金管理人认为不应买入的其他情形。T＋2日日终，若已购入全部被替代的证券，则以替代金额与被替代证券的实际购入成本（包括买入价格与交易费用）的差额，确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项；若未能购入全部被替代的证券，则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本加上按照T+2日收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项。

特例情况：若自T日起，深圳证券交易所正常交易日已达到20日而该证券正常交易日低于2日，则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本加上按照最近一次收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项。

若现金替代日（T日）后至T+2日（若在特例情况下，则为T日起第20个交易日）期间发生除息、送股（转增）、配股等权益变动，则进行相应调整。

T+2日后第1个工作日（若在特例情况下，则为T日起第21个交易日），基金管理人将应退款和补款的明细及汇总数据发送给相关申购赎回代理机构和基金托管人，相关款项的清算交收将于此后3个工作日内完成。

④替代限制：基金管理人可根据基金投资运作情况规定投资者使用可以现金替代的比例合计不得超过申购基金份额资产净值的一定比例。现金替代比例的计算公式为：

$$\text{现金替代比例（\%）}=\frac{\sum_{i=1}^{n}\text{第i只替代证券的数量}\times\text{该证券参考价格}\times 100\%}{\text{申购基金份额}\times\text{参考基金份额净值}}$$

说明：假设当天可以现金替代的股票为n。

该证券参考价格目前为该证券前一交易日除权除息后的收盘价。如果深圳证券交易所对参考价格确定原则进行调整的，以深圳证券交易所调整后的规则为准。

参考基金份额净值为本基金前一交易日除权除息后的收盘价。如果深圳证券交易所对参考基金份额净值计算方式进行调整的，以深圳证券交易所调整后的规则为准。

【2】对于非深市证券

①适用情形：投资者申购和赎回时的非深市证券。

②替代金额：对于可以现金替代的非深市证券，替代金额的计算公式为：

申购替代金额＝替代证券数量×该证券参考价格×（1+申购现金替代保证金率）

赎回替代金额＝替代证券数量×该证券参考价格×（1-赎回现金替代保证金率）

其中，“该证券参考价格”为该证券经除权调整的T-1日收盘价。如果相关证券交易所参考价格确定原则发生变化，以相关证券交易所通知规定的参考价格为准。

申购时收取申购现金替代保证金的原因是，对于使用现金替代的证券，基金管理人将买入该证券，实际买入价格加上相关交易费用后与申购时的参考价格可能有所差异。为便于操作，基金管理人在申购赎回清单中预先确定申购现金替代保证金率，并据此收取申购替代金额。如果预先收取的金额高于基金购入该部分证券的实际成本，则基金管理人将退还多收取的差额；如果预先收取的金额低于基金购入该部分证券的实际成本，则基金管理人将向投资者收取欠缺的差额。

赎回时扣除赎回现金替代保证金的原因是，对于使用现金替代的证券，基金管理人将卖出该证券，实际卖出价格扣除相关交易费用后与赎回时的参考价格可能有所差异。为便于操作，基金管理人在申购赎回清单中预先确定赎回现金替代保证金率，并据此支付赎回替代金额。如果预先支付的金额低于基金卖出该部分证券的实际收入，则基金管理人将退还少支付的差额；如果预先支付的金额高于基金卖出该部分证券的实际收入，则基金管理人将向投资者收取多支付的差额。

③替代金额的处理程序

基金管理人将自T日起在收到申购交易确认后按照“时间优先、实时申报”的原则依次买入申购被替代的部分证券，在收到赎回交易确认后按照“时间优先、实时申报”的原则依次卖出赎回被替代的部分证券。T日未完成的交易，基金管理人在T日后被替代的证券有正常交易的2个交易日（简称为T+2日）内完成上述交易。

时间优先的原则为：申购赎回方向相同的，先确认成交者优先于后确认成交者。先后顺序按照深圳证券交易所确认申购赎回的时间确定。

实时申报的原则为：基金管理人在相关证券交易所连续竞价期间，根据收到的深圳证券交易所申购赎回确认记录，在技术系统允许的情况下实时向相关证券交易所申报被替代证券的交易指令。

T日基金管理人按照“时间优先”的原则依次与申购投资者确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项，即按照申购确认时间顺序，以替代金额与被替代证券的依次实际购入成本（包括买入价格与交易费用）的差额，确定基金应退还申购投资者或申购投资者应补交的款项；按照“时间优先”的原则依次与赎回投资者确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项，即按照赎回确认时间顺序，以替代金额与被替代证券的依次实际卖出收入（卖出价格扣除交易费用）的差额，确定基金应退还赎回投资者或赎回投资者应补交的款项。

对于T日因停牌或流动性不足等原因未购入和未卖出的被替代的部分证券，T日后基金管理人可以继续进行被替代证券的买入和卖出，按照前述原则确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项。

T+2日日终，若已购入全部被替代的证券，则以替代金额与被替代证券的实际购入成本

（包括买入价格与交易费用）的差额，确定基金应退还申购投资者或申购投资者应补交的款项；若未能购入全部被替代的证券，则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本（包括买入价格与交易费用）加上按照T+2日收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还申购投资者或申购投资者应补交的款项。

T+2日日终，若已卖出全部被替代的证券，则以替代金额与被替代证券的实际卖出收入（卖出价格扣除交易费用）的差额，确定基金应退还赎回投资者或赎回投资者应补交的款项；若未能卖出全部被替代的证券，以替代金额与所卖出的部分被替代证券实际卖出收入（卖出价格扣除交易费用）加上按照T+2日收盘价计算的未卖出的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还赎回投资者或赎回投资者应补交的款项。

特殊情况：若自T日起，相关证券交易所正常交易日已达到20日而该证券正常交易日低于2日，则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本（包括买入价格与交易费用）加上按照最近一次收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还申购投资者或申购投资者应补交的款项，以替代金额与所卖出的部分被替代证券实际卖出收入（卖出价格扣除交易费用）加上按照最近一次收盘价计算的未卖出的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还赎回投资者或赎回投资者应补交的款项。

若现金替代日（T日）后至T+2日（若在特例情况下，则为T日起第20个交易日）期间发生除息、送股（转增）、配股权益变动，则进行相应调整。T+2日后第1个工作日（若在特例情况下，则为T日起第21个交易日），基金管理人将应退款和补款的明细及汇总数据发送给相关申购赎回代理机构和基金托管人，相关款项的清算交收将于此后3个工作日内完成。

3）必须现金替代

①适用情形：必须现金替代的证券一般是处于停牌的股票；或因法律法规限制投资的证券；或基金管理人出于保护持有人利益等原因认为有必要实行必须现金替代的证券。

②替代金额：对于必须现金替代的证券，基金管理人将在申购赎回清单中公告替代的一定数量的现金，即“固定替代金额”。 固定替代金额的计算方法为申购赎回清单中该证券的数量乘以其调整后T日开盘参考价。

4、预估现金差额相关内容

预估现金差额是指为便于计算基金份额参考净值及申购赎回代理机构预先冻结申请申购赎回的投资者的相应资金，由基金管理人计算的现金数额。T 日申购赎回清单中公告T 日预估现金差额。其计算公式为：

T 日预估现金差额＝T-1 日最小申购赎回单位的基金资产净值-（申购赎回清单中必须现金替代的固定替代金额＋申购赎回清单中可以现金替代证券的数量与T 日经除权调整后的开盘参考价乘积之和＋申购赎回清单中禁止现金替代证券的数量与T 日经除权调整后的开盘参考价乘积之和）

其中，T日经除权调整后的开盘参考价主要根据相关服务机构提供的本基金投资组合中

的证券的调整后开盘参考价确定。另外，若T 日为基金分红除息日，则计算公式中的“T-1日最小申购、赎回单位的基金资产净值”需扣减相应的收益分配数额。预估现金差额的数值可能为正、为负或为零。

5、现金差额相关内容

现金差额指最小申购赎回单位的资产净值与按当日收盘价计算的最小申购赎回单位中的组合证券市值和现金替代之差，T日现金差额在T+1日的申购赎回清单中公告，其计算公式为：

T日现金差额＝T日最小申购、赎回单位的基金资产净值－（申购赎回清单中必须现金替代的固定替代金额＋申购赎回清单中可以现金替代证券的数量与T日收盘价相乘之和+申购赎回清单中禁止现金替代证券的数量与T日收盘价相乘之和）

当现金替代标志为禁止现金替代或可以现金替代时，若T 日为某一股票除息、送股(转增)、配股等发生的权益变动的权益登记日，基金管理人将以该股票经除权调整的T 日收盘价为基础计算T 日现金差额。

T日投资者申购、赎回的基金份额，需按T+1日公告的T日现金差额进行资金的清算交收。

现金差额的数值可能为正、为负或为零。在投资者申购时，如现金差额为正数，则投资者应根据其申购的基金份额支付相应的现金，如现金差额为负数，则投资者将根据其申购的基金份额获得相应的现金；在投资者赎回时，如现金差额为正数，则投资者将根据其赎回的基金份额获得相应的现金，如现金差额为负数，则投资者应根据其赎回的基金份额支付相应的现金。

6、申购赎回清单的格式

申购赎回清单的格式举例如下

基本信息

最新公告日期	
基金名称	华宝均衡精选主动管理交易型开放式股票证券投资基金
基金管理公司名称	华宝基金管理有限公司
基金代码	
基金类型	

T-1日内容信息

现金差额（单位:元）	
最小申购、赎回单位净值（单位:元）	
基金份额净值（单位:元）	

T日内容信息

预估现金差额（单位：元）	
可以现金替代比例上限	
是否需要公布 IOPV	
最小申购、赎回单位	
最小申购赎回单位现金红利	
本市场申购赎回组合证券只数	
全部申购赎回组合证券只数	
是否开放申购	
是否开放赎回	
当天净申购的基金份额上限	
当天净赎回的基金份额上限	
单个证券账户当天净申购的基金份额上限	
单个证券账户当天净赎回的基金份额上限	
当天累计可申购的基金份额上限	
当天累计可赎回的基金份额上限	
单个证券账户当天累计可申购的基金份额上限	
单个证券账户当天累计可赎回的基金份额上限	

组合证券信息内容

证券代码	证券简称	股票数量(股)	现金替代标志	申购现金替代保证金率	赎回现金替代保证金率	申购替代金额	赎回替代金额	挂牌市场

说明:此表仅为示例,申购赎回清单的格式可根据深圳证券交易所的实际情况相应调整,具体以基金管理人届时在深圳证券交易所网站上公布的实际清单为准。

（八）拒绝或暂停申购的情形及处理方式

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资者的申购申请：

1、因不可抗力导致基金无法正常运作；

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

或无法进行证券/期货交易；

3、发生基金合同规定的暂停基金财产估值情况，基金管理人可暂停接受投资者的申购申请。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；

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、在发生基金所投资的投资品种的估值出现重大转变时；

6、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；

7、当日申购申请达到基金管理人设定的申购份额上限的情况；

8、法律法规、中国证监会或深圳证券交易所规定的其他情形。

发生除上述第 4、7 项以外的暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时，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。如果投资者的申购申请被拒绝，被拒绝的申购对价将退还给投资者。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对价的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资者的赎回申请或延缓支付赎回对价：

1、因不可抗力导致基金管理人无法受理或办理基金份额持有人的赎回申请或不能支付赎回对价；

2、证券/期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值或无法进行证券/期货交易；

3、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况，基金管理人可暂停接受投资者的赎回申请或延缓支付赎回对价。当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金赎回申请或延缓支付赎回对价；

4、在发生基金所投资的投资品种的估值出现重大转变时；

5、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者的赎回申请；

6、当日赎回申请达到基金管理人设定的赎回份额上限的情况；

7、法律法规、中国证监会或深圳证券交易所规定的其他情形。

发生上述第6项以外的情形且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回对价时，基金管理人应当及时报中国证监会备案。已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付，如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。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予以

公告。

（十）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证券交易所以外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。

（十一）基金的转托管、非交易过户、冻结、解冻等其他业务

基金的登记机构可依据其业务规则，受理基金的转托管、非交易过户、冻结与解冻等业务，并收取一定的手续费用。

（十二）其他

1、基金管理人可在法律法规允许的范围内，在不影响基金份额持有人实质利益的前提下，根据市场情况对上述申购和赎回的安排进行补充和调整，应在新的申购赎回安排实施前按照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上予以公告。

2、在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金管理人在条件允许时可开放集合申购即允许多个投资者集合其持有的组合证券共同构成最小申购赎回单位或其整数倍进行申购。基金管理人有权制定集合申购业务的相关规则。

3、在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金管理人在条件允许时可开放集中申购，即基金管理人接受投资者用满足条件的部分证券集中申购ETF。

4、在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金管理人可调整基金申购赎回方式或申购赎回对价组成，并提前公告。

5、基金管理人指定的代理机构可依据法律法规和基金合同的规定开展其他服务，双方需签订书面委托代理协议，并报中国证监会备案。

6、对于符合相关法律法规要求的特定投资者，基金管理人可在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，安排专门的申购方式，并于新的申购方式开始执行前另行公告。

7、在条件允许的情况下，基金管理人未来可开通本基金场外份额，也可在目前的申赎方式外，采取其他合理的申赎方式，并于新的申赎方式开始执行前予以公告。基金管理人有权制定相关业务规则。

8、ETF联接基金是指将其绝大部分基金财产投资于本基金，采用开放式运作方式的基金。若基金管理人推出以本基金为目标ETF的联接基金，本基金可根据实际情况需要向本基金的联接基金开通特殊申购，不收取申购费用。

9、基金合同生效后，若深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司针对交易型开放式证券投资基金推出新的清算交收与登记模式并引入新的申购、赎回方式，本基金管理

人有权调整本基金的清算交收与登记模式及申购、赎回方式，或新增本基金的清算交收与登记模式并引入新的申购、赎回方式，届时将发布公告予以披露并对本基金的招募说明书予以更新，无须召开基金份额持有人大会审议。

十一、基金的投资

（一）投资目标

在严格控制风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争实现基金资产的长期稳健增值。

（二）投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、科创板、创业板以及其他经中国证监会允许发行的股票、存托凭证）。为更好地实现基金的投资目标，本基金可能会少量投资于债券、货币市场工具、同业存单、债券回购、资产支持证券、银行存款以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

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

本基金投资于股票（含存托凭证）的资产比例不低于基金资产的80%。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，基金管理人在依法履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

（三）投资策略

1、股票投资策略

本基金采取积极的股票选择策略，充分发挥基金管理人的研究优势，依托本公司的研究平台，精选出具备可持续的竞争优势、杰出的成长潜质、市值属于大中盘风格、同时有合理估值的上市公司，并通过精细化风险管理和组合优化技术,实现行业、风格和个股的均衡配置。在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。

本基金采取“自上而下”的方式，根据宏观经济周期、国家产业政策、行业景气度和行业竞争格局等因素进行深入分析,结合行业盈利趋势预测、行业整体估值水平和市场特征等，进行综合的行业投资价值评估，并动态调整各行业之间的配置比例，实现行业均衡配置。

在行业配置的基础上，本基金将主要从基本面出发，采取均衡的选股策略，注重企业未来成长性与合理价值性之间的均衡，既关注企业中长期的成长性，同时兼顾对企业估值合理性的判断，从上市公司的核心竞争力、盈利能力和盈利质量、公司治理水平、估值水平等方面进行综合评价精选具有较高投资价值的上市公司个股，并注重个股分散，构建基金组合。

2、债券投资策略

本基金将投资于债券，以有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。本基金将运用系统化的定量分析技术和严格的投资管理制度等方法管理风险,通过久期、信用等级等指标，将组合的风险控制在合理的水平。在此基础上，通过各种积极投资策略的实施，追求组合稳健的回报。。

3、资产支持证券投资策略

本基金将通过对宏观经济、资产池结构以及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略，在严格遵守法律法规和基金合同，控制信用风险和流动性风险的前提下，选择经风险调整后相对价值较高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

4、存托凭证投资策略

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

未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，在依法履行适当程序后，本基金可相应调整和更新相关投资策略，并在基金合同中公告。

（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）本基金投资于股票（含存托凭证）的资产比例不低于基金资产的80%；

（2）本基金持有证券数量不低于30只，前10大持仓证券权重合计占比不超过基金资产净值的60%；基金投资组合持有的股票最近1年日均成交金额位于其所在证券交易所全部上市股票的前80%；如果未来交易所的相关规则发生变化，本基金可相应修改本条款规定，无需召开基金份额持有人大会；

（3）本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的10%；

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

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

（6）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的20％；

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

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

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

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

（11）本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为1年，债券回购到期

后不得展期；

（12）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；

（13）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；

（14）基金资产总值不得超过基金资产净值的140%；

（15）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；

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

（17）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。

除上述第（9）、（12）、（13）项外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，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）买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；

（5）向其基金管理人、基金托管人出资；

（6）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

（7）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益

冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。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变更上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准。

（五）业绩比较基准

中证A500指数收益率。

1、业绩比较基准设定的原因

本基金为主动管理股票型 ETF，基于基金投资范围以及预期投资的主要资产类别，本基金投资于股票（含存托凭证）的资产比例不低于基金资产的80%，本基金将股票资产基准要素权重设置为100%。

基于基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金的股票资产采用全市场选股策略，精选出具备可持续的竞争优势、杰出的成长潜质、市值属于大中盘风格、同时有合理估值的上市公司，构建股票投资组合。综合考虑基准指数与产品定位和投资风格的匹配度，同时兼顾考虑基准指数的表征性、认可度，以及指数盘别/市值覆盖、风格特征、行业与个股分布等，本基金选取中证A500指数作为股票部分的基准要素，具体情况如下：

中证A500指数从各行业选取市值较大、流动性较好的500只证券作为指数样本，以反映各行业最具代表性上市公司证券的整体表现，适合作为本基金股票部分的业绩比较基准要素。

综上，本基金选取的业绩比较基准与基金投资目标、投资范围、投资策略、投资比例限制相匹配。

2、业绩比较基准要素所涉及的发布机构、代码、查询途径

中证A500指数由中证指数有限公司编制发布，指数代码为000510，具体信息详见中证指数有限公司网站，网址：www.csindex.com.cn。

3、业绩比较基准收益率的计算方法

本基金业绩比较基准收益率的计算方法以每日收益率为基础，以时间加权为计算原则。

4、管理投资偏离业绩比较基准的方法

基金管理人对基金实际投资与业绩比较基准的偏离情况进行动态跟踪与监测评估，监测指标主要包括行业集中度及偏离度等，以更好管理基金实际投资与业绩比较基准的偏离情况，从而在控制风险的基础上力争实现基金资产的长期稳健增值。

本基金为主动管理型基金，其业绩比较基准是表征产品风格、衡量产品业绩、约束投资行为的参考标准，并非本基金的跟踪标的。基金管理人在基金合同约定的投资范围、投资限制内享有充分的投资决策自主权，可根据投资策略、市场研判等综合因素，自主构建投资组合，包括酌情投资于业绩比较基准要素成份证券外的证券，本基金投资组合相对业绩比较基

准要素成份证券和权重可能存在偏离。

5、未来可能变更业绩比较基准的情况和程序

业绩比较基准变更符合下列条件之一且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的，基金管理人应当与基金托管人协商，在新业绩比较基准生效前三十日公告并充分说明变更原因、差异及影响，无需召开基金份额持有人大会：

（1）原有业绩比较基准的要素无法持续运作、编制方案发生重大修订等客观因素导致业绩比较基准无法再表征基金产品投资风格，或不再符合基金合同关于投资目标、投资范围、投资策略、投资比例限制等的约定，或与主要的资产类别、国别或地区、市场板块、货币类型等不再匹配；或业绩比较基准的要素不再具备市场代表性；

（2）调整业绩比较基准的要素权重、更换相同或相近特征的要素等，使新业绩比较基准代表性更强，且符合相关法律法规规定的；

（3）中国证监会认可的其他情形。

业绩比较基准变更涉及以下情形的，基金管理人应当按照规定履行变更注册、召开基金份额持有人大会等程序，法律法规、中国证监会另有规定的除外：

（1）基金投资目标、投资范围、投资策略、投资比例等拟进行重大调整，并变更业绩比较基准的；

（2）其他对基金份额持有人利益产生重大实质性影响的情形。

（六）风险收益特征

本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

（七）基金管理人代表基金行使股东或债权人权利的处理原则及方法

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

2、不谋求对上市公司的控股；

3、有利于基金财产的安全与增值；

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

十二、基金的财产

（一）基金资产总值

基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券及票据价值、银行存款本息、基金应收款项以及其他投资所形成的价值总和。

（二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

（三）基金财产的账户

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

（四）基金财产的保管和处分

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

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

十三、基金资产估值

（一）估值日

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

（二）估值对象

基金所拥有的股票、债券、资产支持证券和银行存款本息、应收款项、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。

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

（四）估值方法

（1）证券交易所上市的有价证券的估值

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

大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

②交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值价格进行估值；

③交易所上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值价格或推荐估值价格进行估值；

④交易所上市交易的可转换债券以第三方估值机构提供的价格作为估值全价；

⑤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。交易所市场挂牌转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值。

（2）处于未上市期间及流通受限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，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，如成本能够近似体现公允价值，应持续评估上述做法的适当性，并在情况发生改变时做出适当调整；首次发行未上市债券采用估值技术确定的公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，如成本加上截至估值日的含息能够近似体现公允价值，应持续评估上述做法的适当性，并在情况发生改变时做出适当调整；

③对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为计量日的公允价值进行估值；对于活跃市场报价未能代表计量日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整，确认计量日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，则采用估值技术确定公允价值；

④在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

（3）对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值价格估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值价格或推荐估值价格估值。对于含投资者回售权的固定收益品种，行使回售权的，在回售登记日至实际收款日期间建议选取第三方估值机构提供的相应品种的唯一估值价格或推荐估值价格，同时应充分考虑发行人的信用风险变化对公允价值的影响。回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的建议按照长待偿期所对应的价格进行估值。

（4）存款的估值方法

持有的银行定期存款或通知存款以本金列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入。

（5）同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

（6）本基金可以采用第三方估值机构按照上述公允价值确定原则提供的估值价格数据。

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

（8）本基金投资存托凭证的估值核算，依照境内上市交易的股票执行。

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

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

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致意见的，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、基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入。基金管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人于每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

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

（六）估值错误的处理

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

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、或投资者自身的过错造成估值错误，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该估值错误遭受损失当事人(“受损方”)的直接损失按下述“估值错误处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

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

2、估值错误处理原则

（1）估值错误已发生，但尚未给当事人造成损失时，估值错误责任方应及时协调各方，

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

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

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

（4）估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

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

4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

（1）基金份额净值计算出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，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监管机关另有规定的，从其规定处理。如果行业另有通行做法，基金管理人、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/期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

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

4、法律法规、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

（八）基金净值的确认

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

（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（9）项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

2、由于不可抗力原因，或证券/期货交易所或登记结算公司等机构发送的数据错误、遗漏等原因，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，但是未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任，但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

十四、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、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金可进行收益分配，具体分配方案以公告为准；若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金基金份额的收益分配方式采用现金分红；

3、本基金在基金收益评价日对基金的可供分配利润进行评价，收益评价日核定的基金可供分配利润金额大于零时，基金管理人可进行收益分配；

4、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；

5、本基金的每一基金份额享有同等分配权；

6、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性不利影响的前提下，基金管理人在与基金托管人协商一致后，经履行适当程序，可对基金收益分配的原则和有关业务规则进行调整，并及时公告。

（四）收益分配方案

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

（五）收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，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。

十五、基金的费用与税收

（一）基金费用的种类

1、基金管理人的管理费；

2、基金托管人的托管费；

3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；

4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；

5、基金份额持有人大会费用；

6、基金的证券、期货交易费用；

7、基金的银行汇划费用、账户开户、销户及维护费用；

8、基金上市费、场内注册登记费、IOPV 计算与发布费用、收益分配中发生的费用；

9、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

（二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.0%的年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×1.0%÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性进行资金支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.10%÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

上述“（一）基金费用的种类”中第 3－9 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

（三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、《基金合同》生效前的相关费用；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

（四）基金税收

本基金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。

十六、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。更换会计师事务所需按照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

十七、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。如同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证不同文本的内容一致。不同文本之间发生歧义的，以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

（五）公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

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基金份额净值和基金份额累计净值。

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

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

五）基金份额折算日和折算结果公告

基金管理人确定基金份额折算日后应提前将基金份额折算日公告登载于规定媒介上。

基金份额进行折算并由登记机构完成基金份额的变更登记后，基金管理人应将基金份额折算结果公告登载于规定媒介上。

六）上市交易公告书

基金份额获准在证券交易所上市交易的，基金管理人应当在基金份额上市交易前至少 3

个工作日，将基金份额上市交易公告书登载在规定网站上，并将上市交易公告书提示性公告登载在规定报刊上。

七）申购、赎回清单

在开始办理基金份额申购或者赎回之后，基金管理人应当在每个开放日，通过规定网站、申购赎回代理券商网站或者营业网点公告当日的申购、赎回清单。

八）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。

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

基金管理人应当在基金年度报告和中期报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。

九）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、涉及基金财产、基金管理业务、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、本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；

19、本基金停复牌、暂停上市、恢复上市或终止上市；

20、本基金推出新业务或服务；

21、基金份额的折算；

22、调整最小申购赎回单位、申购赎回方式及申购对价、赎回对价组成；

23、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；

24、基金存续期内，连续 30 个工作日、连续 40 个工作日及连续 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，基金管理人将对可能触发基金合同终止情形发布提示性公告；

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

十）澄清公告

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

十一）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。

十二）基金投资资产支持证券的信息披露

本基金参与资产支持证券的，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。

十三）清算报告

基金合同终止的，基金管理人应当依法组织清算组对基金财产进行清算并作出清算报告。清算报告应当经过符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计，并由律师事务所出具法律意见书。清算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）中国证监会规定的其他信息。

（六）信息披露事务管理

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

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

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回对价、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披露信息的报刊。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，还可以根据需要在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、基金上市交易的证券交易所网站披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

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和基金上市交易的证券交易所，供社会公众查阅、复制。

（八）暂停或延迟信息披露的情形

当出现下述情况时，基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金相关信息：

1、不可抗力；

2、发生基金合同约定的暂停估值的情形；

3、法律法规规定、《基金合同》约定或中国证监会规定的情况。

十八、风险揭示

（一）投资于本基金的风险

1、采用主动投资策略的风险

（1）主动选股策略失效风险

本基金采用主动选股策略，可能存在策略失效、实际业绩落后于业绩比较基准的风险。具体而言，本基金将结合市场环境变化和投资策略运行情况，动态调整组合仓位与持仓结构，力求获取超越业绩比较基准的投资回报。主动选股策略的表现存在不确定性，基金实际投资结果可能落后于业绩比较基准。

（2）潜在抢先交易风险

投资者可能依据每交易日公布的申购赎回清单和组合证券信息分析组合证券买卖情况。若基金因执行主动选股策略等原因发生调仓且难以在一个交易日内完成调整，可能出现股票调仓方向暴露、被其他投资者抢先交易组合证券的情形，进而影响基金投资收益。

（3）投资策略被复制风险

本基金每交易日公布基于前一交易日日终的真实投资组合的申购赎回清单，投资组合透明度较高。其他投资者可能据此跟踪、复制本基金投资策略和持仓结构，形成相近的投资组合，从而可能削弱投资策略的有效性，对基金投资收益产生不利影响。”

2、主动ETF运作的风险

（1）基金份额参考净值（IOPV）偏离的风险

基金管理人委托深圳证券信息有限公司在交易时间内根据申购赎回清单和组合证券内各只证券的实时成交数据，计算并发布基金份额参考净值（IOPV），供投资者交易、申购、赎回基金份额时参考。若基金于交易日内进行调仓，IOPV仅反映申购赎回清单所列组合证券的价值，与实时的基金份额净值可能出现一定偏离，该等偏离并非IOPV计算错误所致。投资者若完全依赖IOPV进行投资决策，可能因上述偏离遭受损失。

IOPV仅供投资者参考，并非实时的基金份额净值，与投资者申购、赎回的实际结算价格也可能存在差异。投资者若依据IOPV进行投资决策，由此产生的损失需自行承担。

（2）基金份额二级市场交易价格折溢价的风险

基金份额在证券交易所的交易价格受供求关系等诸多因素影响，存在不同于基金份额净值的情形，即存在折溢价的风险。基金管理人将通过采取完善流动性服务等措施降低基金份额折溢价幅度，但基金调仓期间IOPV与基金份额净值的偏离可能加大，套利机制的有效性可能下降，基金折溢价幅度可能较大，折溢价状态的持续时间可能较长。

3、流动性风险

在市场或个券流动性不足的情况下，基金管理人可能无法迅速、以合理成本地调整基金投资组合，从而对基金收益造成不利影响。

（1）基金申购、赎回安排

投资人具体请参见基金合同“第八部分 基金份额的申购与赎回”和本招募说明书“十、基金份额的申购与赎回”，详细了解本基金的申购以及赎回安排。

（2）拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、科创板、创业板以及其他经中国证监会允许发行的股票、存托凭证）。为更好地实现基金的投资目标，本基金可能会少量投资于债券、货币市场工具、同业存单、债券回购、资产支持证券、银行存款以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金投资于股票（含存托凭证）的资产比例不低于基金资产的80%。一般情况下本基金拟投资的资产类别具有较好的流动性，但在特殊市场环境下本基金仍有可能出现流动性不足的情形，基金管理人将根据实际情况采取相应的流动性风险管理措施，在保障基金份额持有人利益的基础上，防范流动性风险。

（3）实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响

在市场大幅波动、流动性枯竭等极端情况下发生无法应对投资者赎回的情形时，基金管理人将在确保投资者得到公平对待的前提下，可依照法律法规及基金合同的约定，综合运用暂停接受赎回申请、延缓支付赎回对价、暂停基金估值等流动性风险管理工具，对赎回申请等进行适度调整，作为特定情形下基金管理人流动性风险的辅助措施。对于各类流动性风险管理工具的使用，基金管理人将依照严格审批、审慎决策的原则，及时有效地对风险进行监测和评估，使用前经过内部审批程序并与基金托管人协商一致。在实际运用各类流动性风险管理工具时，可能对投资者有以下潜在影响：

①暂停接受赎回申请

投资人具体请参见基金合同“第八部分 基金份额的申购与赎回”中 “八、暂停赎回或延缓支付赎回对价的情形”，详细了解本基金暂停接受赎回申请的情形及程序。

在此情形下，投资人的赎回申请可能被拒绝。

②延缓支付赎回对价

投资人具体请参见基金合同“第八部分 基金份额的申购与赎回”中“八、暂停赎回或延缓支付赎回对价的情形”，详细了解本基金延缓支付赎回对价的情形及程序。

在此情形下，投资人接收赎回对价的时间将可能比一般正常情形下有所延迟。

③暂停基金估值

投资人具体请参见基金合同“第十六部分 基金资产估值”中“七、暂停估值的情形”，详细了解本基金暂停估值的情形及程序。

在此情形下，投资人没有可供参考的基金份额净值，同时赎回申请可能被暂停接受或延缓支付赎回对价。

（4）二级市场流动性风险

ETF可在二级市场进行买卖，可能面临市场交易量不足，带来基金在二级市场的流动性

风险。

4、ETF运作的风险

（1）基金份额二级市场交易价格折溢价风险

由于基金份额的二级市场交易价格受诸多因素影响，基金份额的二级市场交易价格（实时市价）与一级市场申购赎回价格（当日基金份额净值）之间存在偏离的可能性。

（2）参考IOPV决策和IOPV计算错误的风险

基金管理人或者基金管理人委托的机构在开市后基于申购赎回清单或者深圳证券交易所认可的方式，计算并发布基金份额参考净值（IOPV），供投资者交易、申购、赎回基金份额时参考。由于计算公式数据来源不同，IOPV与实时的基金份额净值可能存在差异，与投资者申购赎回的实际结算价格也可能存在差异，尤其是基金因投资策略调整发生大幅调仓期间，差异可能会进一步加大；IOPV计算还可能出现错误，投资者若参考IOPV进行投资决策可能导致损失，该风险需投资者自行承担。

（3）股票停牌的风险

股票可能因各种原因临时或长期停牌，发生股票停牌时可能面临如下风险：

1）停牌股票可能因其权重占比、市场复牌预期、现金替代标识等因素影响本基金二级市场价格的折溢价水平；

2）若股票停牌时间较长，在约定时间内仍未能及时买入或卖出的，则该部分款项将按照约定方式进行结算（具体见招募说明书“十、基金份额的申购与赎回”之“6、申购赎回清单的格式”相关约定），由此可能影响投资者的投资损益；

3）在极端情况下，股票可能大面积停牌，基金可能无法及时卖出股票以获取足额的符合要求的赎回对价，由此基金管理人可能在申购赎回清单中设置较低的赎回份额上限或者采取暂停赎回的措施，投资者将面临无法赎回全部或部分基金份额的风险。

（4）投资者申购失败的风险

基金管理人有权根据本招募说明书的规定暂停或拒绝接受投资人的申购申请，从而导致申购失败。

基金的申购赎回清单中，可能仅允许对部分股票使用现金替代，且设置现金替代比例上限，因此，投资者在进行申购时，可能存在因个别股票涨停、临时停牌等原因而无法买入申购所需的足够的股票，导致申购失败的风险。

（5）投资者赎回失败的风险

投资者在提出赎回申请时，如基金组合中不具备足额的符合要求的赎回对价，可能导致赎回失败。

基金管理人可能根据股票市值规模变化等因素调整最小申购赎回单位，由此可能导致投资者按原最小申购赎回单位申购并持有的基金份额，可能无法按照新的最小申购赎回单位全部赎回，而只能在二级市场卖出全部或部分基金份额。

（6）申购赎回清单差错风险

本基金为主动管理ETF，不以跟踪特定指数为投资目标。本基金申购赎回清单根据基金的投资组合编制，基金管理人编制每日申购赎回清单的底层逻辑与指数ETF存在核心差异。如果基金管理人提供的当日申购赎回清单内容出现差错，包括组合证券名单、数量、现金替代标志、现金替代比率、替代金额等出错，投资人利益将受损，申购赎回的正常进行将受影响。

（7）申购赎回清单标识设置不合理的风险

基金管理人在进行申购赎回清单的现金替代标识设置时，将充分考虑由此引发的市场套利等行为对基金持有人可能造成的利益损害。但基金管理人不能保证极端情况下申购赎回清单标识设置的完全合理性。

（8）基金份额赎回对价的变现风险

基金赎回对价主要为组合证券，在组合证券变现过程中，由于市场变化、部分股票流动性差等因素，导致投资者变现后的价值与赎回时赎回对价的价值有差异，存在变现风险。

（9）套利风险

由于证券市场的交易机制和技术约束，完成套利需要一定的时间，套利存在一定风险。同时，买卖一篮子股票和ETF存在冲击成本和交易成本，因此折溢价在一定范围之内也不能形成套利机会。另外，当一篮子股票中存在涨停或临时停牌的情况时，也会由于无法买入股票而影响溢价套利，或无法卖出股票而影响折价套利。

（10）申赎成本增加风险：本基金因投资运作需要发生大幅调仓时，基金管理人需在短时间内买入或卖出相关证券以调整投资组合。在此情形下，投资者按申购赎回清单所提交的申购/赎回对价可能与基金实际调仓买卖情况存在较大差异。该差异可能导致：

①投资者承担更高的实际交易成本（如冲击成本、市场流动性成本）；

②投资者获得的赎回对价低于其预期；

③投资者投资损益受到不利影响。

特别地，当本基金发生大额申赎、调仓换股、市场剧烈波动等情况时，本基金的申赎成本增加风险将更为突出。

（11）第三方机构服务的风险

基金的多项服务委托第三方机构办理，存在以下风险：

1）申购赎回代理机构因多种原因，导致代理申购、赎回业务受到限制、暂停或终止，由此影响对投资者申购赎回服务的风险。

2）登记机构可能调整结算制度，如实施货银对付制度，对投资者基金份额、组合证券及资金的结算方式发生变化，制度调整可能给投资者带来理解偏差的风险。同样的风险还可能来自于证券交易所及其他代理机构。

3）证券交易所、登记机构、基金托管人、申购赎回代理机构及其他代理机构可能违约，

导致基金或投资者利益受损的风险。

（12）退市风险

因基金不再符合证券交易所上市条件被终止上市，或被基金份额持有人大会决议提前终止上市，导致基金份额不能继续进行二级市场交易的风险。

5、本基金投资特定品种及参与特定业务的风险

（1）资产支持证券投资风险

本基金的投资范围包括资产支持证券。资产支持证券存在信用风险、利率风险、流动性风险、提前偿付风险、操作风险和法律风险等。

（2）存托凭证投资风险

本基金可投资存托凭证，基金净值可能受到存托凭证的境外基础证券价格波动影响，存托凭证的境外基础证券的相关风险可能直接或间接成为本基金的风险。

6、管理风险

在基金管理运作过程中，基金管理人的研究水平、投资管理水平直接影响基金收益水平，如果基金管理人对经济形势和证券市场判断不准确、获取的信息不全、投资操作出现失误，都会影响基金的收益水平。

7、操作或技术风险

在开放式基金的各种交易行为或者后台运作中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致投资人的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理公司、销售机构、证券交易所、证券注册登记机构等。

8、合规性风险

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

9、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，投资者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。

10、其他风险

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

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

（二）声明

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

2、除基金管理人直接办理本基金的销售外，本基金还通过代销机构代理销售，但是，基金并不是代销机构的存款或负债，也没有经代销机构担保或者背书，代销机构并不能保证其收益或本金安全。

十九、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

（一）《基金合同》的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于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，并依据法律法规规定报中国证监会备案。

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，自决议生效后两日内在规定媒介公告。

（二）《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：

1、基金份额持有人大会决定终止的；

2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；

3、《基金合同》约定的其他情形；

4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

（三）基金财产的清算

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

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、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；

（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。

（四）清算费用

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

（五）基金财产清算剩余资产的分配

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

（六）基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经符合《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。

（七）基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存不低于法律法规规定的最低期限。

二十、基金合同的内容摘要

一、基金管理人、基金托管人和基金份额持有人的权利、义务

（一）基金管理人的权利与义务

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

（1）依法募集资金；

（2）自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；

（3）依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；

（4）销售基金份额；

（5）按照规定召集基金份额持有人大会；

（6）依据《基金合同》及有关法律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或债权人权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

（13）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；

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

（15）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、赎回和非交易过户等业务规则；

（16）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价格、申购和赎回对价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、赎回对价，编制申购赎回清单；

（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，但因监管机构、司法机关等有权机关的要求，或因审计、法律等外部专业顾问提供服务需要提供的情况除外；

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

（14）按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回对价；

（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。

（二） 基金托管人的权利与义务

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

（1）自《基金合同》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，如发现基金管理人有违反《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；

（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；如果基金管理人有未执行《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对价的现金部分；

（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，并通知基金管理人；

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

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

（21）执行生效的基金份额持有人大会的决议；

（22）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

（三）基金份额持有人的权利与义务

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，即成为本基金基金份额持有人和《基金合同》的当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为《基金合同》当事人并不以在

《基金合同》上书面签章或签字为必要条件。

每份基金份额具有同等的合法权益。

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

（1）分享基金财产收益；

（2）参与分配清算后的剩余基金财产；

（3）依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；

（4）按照规定要求召开基金份额持有人大会或者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）交纳基金认购款项、申购对价、赎回对价及法律法规和《基金合同》所规定的费用；

（5）在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；

（6）不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；

（7）执行生效的基金份额持有人大会的决议；

（8）返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；

（9）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

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。

若以本基金为目标基金，且基金管理人和基金托管人与本基金基金管理人和基金托管人一致的联接基金的基金合同生效，鉴于本基金和联接基金的相关性，联接基金的基金份额持有人可以凭所持有的联接基金的基金份额直接出席本基金的基金份额持有人大会或者委派

代表出席本基金的基金份额持有人大会并参与表决。在计算参会份额和票数时，联接基金持有人持有的享有表决权的基金份额数和表决票数为：在本基金基金份额持有人大会的权益登记日，联接基金持有本基金份额的总数乘以该基金份额持有人所持有的联接基金份额占联接基金总份额的比例，计算结果按照四舍五入的方法，保留到整数位。联接基金折算为本基金后的每一参会份额和本基金的每一参会份额拥有平等的投票权。

联接基金的基金管理人不应以联接基金的名义代表联接基金的全体基金份额持有人以本基金的基金份额持有人的身份行使表决权，但可接受联接基金的特定基金份额持有人的委托以联接基金的基金份额持有人代理人的身份出席本基金的基金份额持有人大会并参与表决。

联接基金的基金管理人代表联接基金的基金份额持有人提议召开或召集本基金份额持有人大会的，须先遵照联接基金基金合同的约定召开联接基金的基金份额持有人大会，联接基金的基金份额持有人大会决定提议召开或召集本基金份额持有人大会的，由联接基金的基金管理人代表联接基金的基金份额持有人提议召开或召集本基金份额持有人大会。

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；

（6）变更基金类别；

（7）本基金与其他基金的合并；

（8）变更基金投资目标、范围或策略；

（9）变更基金份额持有人大会程序；

（10）基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；

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

（12）终止基金上市，但因基金不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市的情形除外；

（13）对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

（14）法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会

的事项。

2、在法律法规规定和《基金合同》约定的范围内且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，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或变更收费方式、为本基金增设新的份额类别；

（3）因相应的法律法规、深圳证券交易所或者登记机构的相关业务规则发生变动而应当对《基金合同》进行修改；

（4）对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生重大变化；

（5）基金管理人、相关证券交易所和登记机构等调整有关基金认购、申购、赎回、交易、转托管、非交易过户等业务的规则（包括申购赎回清单的调整、开放时间的调整等）；

（6）基金推出新业务或服务；

（7）本基金的联接基金采取其他方式参与本基金的申购赎回；

（8）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；

（9）按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

（二）会议召集人及召集方式

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

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。

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

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

5、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持

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

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

（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、通讯开会方式等法律法规或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会议通知载明的形式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址。

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、在法律法规或监管机构允许的情况下，经会议通知载明，本基金亦可采用网络、电话等其他非现场方式或者以非现场方式与现场方式结合的方式召开基金份额持有人大会，或者采用网络、电话或其他方式授权他人代为出席会议并表决，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。

（五）议事内容与程序

1、议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如《基金合同》的重大修改、决定终止《基金合同》、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及《基金

合同》规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

2、议事程序

（1）现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第（七）条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的50%以上（含50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

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

（2）通讯开会

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

（六）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

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

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

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，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。

在符合上述规则的前提下，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）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

金管理人与基金托管人协商一致并提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

三、基金合同解除和终止的事由、程序

（一）《基金合同》的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本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，并依据法律法规规定报中国证监会备案。

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，自决议生效后两日内在规定媒介公告。

（二）《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：

1、基金份额持有人大会决定终止的；

2、基金管理人、基金托管人职责终止，在6个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；

3、《基金合同》约定的其他情形；

4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

（三）基金财产的清算

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

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、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；

（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。

（四）清算费用

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

（五）基金财产清算剩余资产的分配

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

（六）基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经符合《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。

（七）基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存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》产生的或与《基金合同》有关的一切争议可通过友好协商解决，但若未能以协商方式解决的，则任何一方有权将争议提交上海国际经济贸易仲裁委员会，按照其届时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为上海市。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。除非仲裁裁决另有规定，仲裁费用由败诉方承担。

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

《基金合同》受中国法律（为本基金合同之目的，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区法律和台湾地区的有关规定）管辖并从其解释。

五、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

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

二十一、基金托管协议的内容摘要

（一）基金托管协议当事人

一）基金管理人

名称：华宝基金管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道100号上海环球金融中心58楼

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道100号上海环球金融中心58楼

法定代表人：夏雪松

成立日期：2003年3月7日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2003]19号

组织形式：有限责任公司

注册资本：1.5亿元人民币

存续期间：持续经营

经营范围：公募基金管理，资产管理。

二）基金托管人

名称：广发证券股份有限公司

注册地址：广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街2号618室

办公地址：广州市天河区马场路26号广发证券大厦34楼

法定代表人：林传辉

成立日期：1994年01月21日

批准设立机关和批准设立文号：中国人民银行广东省分行粤银管字【1991】第133号

注册资本：人民币7,824,845,511元

存续期间：长期

基金托管资格批文及文号：证监许可【2014】510号

组织形式：股份有限公司

经营范围：许可项目：证券业务；公募证券投资基金销售；证券公司为期货公司提供中间介绍业务；证券投资基金托管。（依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动，具体经营项目以相关部门批准文件或许可证件为准）。

（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。基金管理人应通过基金管理人公司邮箱或双方共同认可的其他方式向基金托管人提供投资监督联系方式。基金托管人接收基金管理人投资监督联系方式以及向基金管理人发送投资监督提示邮件的邮箱地址为：compliance_zctg@gf.com.cn。

《基金合同》明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应在基金正式投资

运作前向基金托管人提供投资风格库和基金管理人投资风格库管理制度，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》相关约定进行监督，对存在合理疑义的事项进行核查。基金托管人有权向基金管理人获取其投资风格库制定或评审的内部程序。基金管理人如有调整投资风格库的，应确保不影响基金托管人履行投资监督职责，及时通知基金托管人。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、科创板、创业板以及其他经中国证监会允许发行的股票、存托凭证）。为更好地实现基金的投资目标，本基金可能会少量投资于债券、货币市场工具、同业存单、债券回购、资产支持证券、银行存款以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

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

本基金投资于股票（含存托凭证）的资产比例不低于基金资产的80%。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。

二）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金投资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督：

（1）本基金投资于股票（含存托凭证）的资产比例不低于基金资产的80%；

（2）本基金持有证券数量不低于30只，前10大持仓证券权重合计占比不超过基金资产净值的60%;基金投资组合持有的股票最近1年日均成交金额位于其所在证券交易所全部上市股票的前80%；如果未来交易所的相关规则发生变化，本基金可相应修改本条款规定，无需召开基金份额持有人大会；

（3）本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的10%；

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

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

（6）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的20％；

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

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

（9）本基金应投资于信用级别评级为BBB以上(含BBB)的资产支持证券。基金持有资产

支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出；

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

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

（12）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；

（13）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；

（14）基金资产总值不得超过基金资产净值的140%；

（15）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；

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

（17）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。

除上述第（9）、（12）、（13）项外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，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。

三）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对本基金投资禁止行为进行监督。为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

（1）承销证券；

（2）违反规定向他人贷款或者提供担保；

（3）从事承担无限责任的投资；

（4）买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；

（5）向其基金管理人、基金托管人出资；

（6）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

（7）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。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。基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供基金管理人关联方名单和关联交易证券名单。如基金管理人关联方名单和关联交易证券名单发生变化的，基金管理人应确保不影响基金托管人履行投资监督职责，及时将变化情况以书面形式通知基金托管人。

四）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。本基金参与银行间债券交易前，须向基金托管人提供经慎重选择的、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。基金管理人可以定期或不定期对银行间债券市场交易对手名单进行更新，如基金管理人根据市场情况需要临时调整银行间债券市场交易对手名单，应向基金托管人说明理由，在与交易对手发生交易前3个工作日内与基金托管人协商解决。基金管理人收到基金托管人书面确认后，被确认调整的名单开始生效，新名单生效前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。基金管理人负责对交易对手的资信控制，按银行间债券市场的交易规则进行交易，并负责处理因交易对手不履行合同而造成的纠纷，基金托管人不承担由此造成的相应法律责任。若未履约的交易对手在基金托管人与基金管理人确定的时间前仍未承担违约责任及其他相关法律责任的，基金管理人可以对相应损失先行予以承担，然后再向相关交易对手追偿。基金托管人则根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督，但不承担交易对手不履行合同造成的损失。如基金托管人事后发现基金管理人没有按照事先约定的交易对手或交易方式进行交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人，基金托管人不承担由此造成的相应损失和责任。如基金管理人未提供名单，视为可与全市场交易对手进行交易。

五）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金管理人投资银行存款进行监督。

基金投资银行存款的，基金管理人应确定符合条件的所有存款银行的名单，并及时提供给基金托管人，基金托管人对基金投资银行存款的交易对手是否符合有关规定进行监督。基金管理人应根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，建立投资制度、审慎选择存款银行，做好风险控制；并按照基金托管人的要求配合基金托管人完成相关业务办理。

六）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金资产净值计算、

基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据、定期报告有关业绩比较基准的披露内容等进行监督和核查。

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相应责任，并将在发现后立即报告中国证监会。

七）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金投资流通受限证券进行监督。

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

2、流通受限证券，包括由法律法规或中国证监会规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券,不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。本基金不投资有锁定期但锁定期不明确的证券。

本基金投资的流通受限证券限于可由中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中登公司”）或中央国债登记结算有限责任公司负责登记和存管，并可在证券交易所或全国银行间债券市场交易的证券。

本基金投资的流通受限证券应保证登记存管在本基金名下，基金管理人负责相关工作的落实和协调，并确保基金托管人能够正常查询。因基金管理人原因产生的流通受限证券登记存管问题，造成基金托管人无法安全保管本基金资产的责任与损失，及因流通受限证券存管直接影响本基金安全的责任及损失，由基金管理人承担。

3、在首次投资流通受限证券之前，基金管理人应当制定相关投资决策流程、风险控制制度、流动性风险控制预案等规章制度。基金管理人应当根据基金流动性的需要合理安排流通受限证券的投资比例，并在风险控制制度中明确具体比例，避免基金出现流动性风险。基金管理人应当将上述规章制度提交给基金托管人。

基金管理人对本基金投资流通受限证券的流动性风险负责，确保对相关风险采取积极有效的措施，在合理的时间内有效解决基金运作的流动性问题。如因基金巨额赎回或市场发生剧烈变动等原因而导致基金现金周转困难时，基金管理人应保证提供足额现金确保基金的支付结算，并承担相应损失。对本基金因投资流通受限证券导致的流动性风险，基金托管人不承担相应责任。如因基金管理人原因导致本基金出现损失致使基金托管人承担连带赔偿责任的，基金管理人应赔偿基金托管人由此遭受的直接损失。

在投资流通受限证券之前，基金管理人应至少提前一个交易日向基金托管人提供有关流通受限证券的相关信息，具体应当包括但不限于如下文件（如有）：

拟发行证券主体的中国证监会批准文件、发行证券数量、发行价格、锁定期、基金拟认购的数量、价格、总成本、总成本占基金资产净值的比例、已持有流通受限证券市值占资产

净值的比例、资金划付时间等。基金管理人应保证上述信息的真实、完整。

基金托管人在监督基金管理人投资流通受限证券的过程中，如认为因市场出现剧烈变化导致基金管理人的具体投资行为可能对基金财产造成较大风险，基金托管人有权要求基金管理人对该风险的消除或防范措施进行补充和整改，并做出书面说明。否则，基金托管人经事先书面告知基金管理人，有权拒绝执行其有关指令。因拒绝执行该指令造成基金财产损失的，基金托管人不承担相应责任，并有权报告中国证监会。

基金管理人应保证基金投资的流通受限证券登记存管在本基金名下，并确保证基金托管人能够正常查询。因基金管理人原因产生的流通受限证券登记存管问题，造成基金财产的损失或基金托管人无法安全保管基金财产的责任与损失，由基金管理人承担。

如果基金管理人未按照本协议的约定向基金托管人报送相关数据或者报送了虚假的数据，导致基金托管人不能履行基金托管人职责的，基金管理人应依法承担相应法律后果。除基金托管人未能依据《基金合同》及本协议履行职责外，因投资流通受限证券产生的损失，基金托管人按照本协议履行监督职责后不承担上述损失。

八）基金托管人发现基金管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作中违反法律法规和《基金合同》的规定，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函，就基金托管人的合理疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、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，并报告中国证监会。

九）基金托管人应当加强对基金合同的审核，对业绩比较基准的选取、变更等进行充分评估，确保基金管理人选取的业绩比较基准符合法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》约定。基金托管人应当对定期报告有关业绩比较基准的披露内容进行复核。

十）基金管理人有义务配合和协助基金托管人依照法律法规、《基金合同》和本托管协议对基金业务执行核查。对基金托管人发出的书面提示，基金管理人应在规定时间内答复并改正，或就基金托管人的合理疑义进行解释或举证；对基金托管人按照法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

十一）基金托管人发现基金管理人有重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的，基金托管人应报告中国证监会。

（三）基金管理人对基金托管人的业务核查

一）基金管理人对基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的托管账户和证券账户等投资所需账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

二）基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、《基金合同》、本协议及其他有关规定时，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正。基金托管人收到通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金管理人发出回函，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查,督促基金托管人改正。基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复基金管理人并改正。

三）基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金托管人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。基金托管人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经基金管理人提出警告仍不改正的，基金管理人应报告中国证监会。

（四）基金财产的保管

一）基金财产保管的原则

1、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人、证券经纪机构的固有财产。

2、基金托管人应安全保管基金财产。未经基金管理人依据合法程序作出的合法合规指令，基金托管人不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。

3、基金托管人按照规定开设基金财产的托管账户和证券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，分账管理，独立核算，确保基金财产的完整与独立。

5、基金托管人根据基金管理人的指令，按照《基金合同》和本协议的约定保管基金财产，如有特殊情况双方可另行协商解决。

6、对于因为基金投资产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金托管账户的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金财产造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金财产的损失，基金托管人对此不承担相应责任，但应予以必要的协助与配合。

7、除依据法律法规和《基金合同》的规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

二）基金募集期间及募集资金的验资

1、基金募集期满或基金停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额

持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，基金管理人应将属于基金财产的全部资金划入基金托管人开立的基金托管账户，同时在规定时间内，聘请符合《中华人民共和国证券法》（以下简称“《证券法》”）规定的会计师事务所进行验资，出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的 2 名或 2 名以上中国注册会计师签字方为有效。

2、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，基金托管人应提供充分协助。

三）基金托管账户的开立和管理

1、基金托管人应负责本基金的托管账户的开设和管理。

2、基金托管人可以本基金的名义在商业银行开设本基金的托管账户，并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。本基金的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回对价、支付基金收益、收取申购对价，均需通过本基金的托管账户进行。

3、基金托管账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立任何其他银行账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

4、基金托管账户应符合相关法律法规的有关规定。

四）基金证券账户和证券资金账户的开立和管理

1、基金托管人在中登公司为基金开立基金托管人与基金联名的证券账户。

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

3、基金管理人以基金名义在基金管理人选择的证券经纪机构营业网点开立证券资金账户。证券经纪机构根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立相关资金账户并按照该证券经纪机构开户的流程和要求与基金管理人签订相关协议。

4、交易所证券交易资金采用第三方存管模式，即用于证券交易结算资金全额存放在基金管理人为基金开设证券资金账户中，场内的证券交易资金清算由基金管理人所选择的证券公司负责。基金托管人不负责办理场内的证券交易资金清算，也不负责保管证券资金账户内存放的资金。

5、在本托管协议生效日之后，本基金被允许从事其他投资品种的投资业务，涉及相关账户的开设、使用的，按有关规定开设、使用并管理；若无相关规定，则基金托管人应当比照并遵守上述关于账户开设、使用的规定。

五）债券托管专户的开设和管理

根据基金管理人的要求，《基金合同》生效后，基金托管人根据中国人民银行、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的有关规定，以基金的名义在中

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开立债券托管与结算账户，并代表基金进行银行间市场债券的结算。基金管理人代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议。回购主协议的签署与基金托管人无关。全国银行间同业拆借市场的交易资格由基金管理人以基金的名义申请，银行间债券市场准入备案由基金管理人和基金托管人共同负责。

六）其他账户的开立和管理

1、因业务发展需要而开立的其他账户，可以根据法律法规和《基金合同》的规定，在基金管理人和基金托管人商议后开立。新账户按有关规则使用并管理。

2、法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

七）基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的有关实物证券、银行定期存款存单等有价凭证由基金托管人负责妥善保管，保管凭证由基金托管人持有。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。属于基金托管人实际有效控制下的实物证券等有价凭证在基金托管人保管期间的损坏、灭失，由此产生的责任应由基金托管人承担。基金托管人对基金托管人以外机构实际有效控制的证券不承担保管责任。

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管理人、基金托管人保管。除协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时应保证基金一方持有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人应在重大合同签署后及时将重大合同扫描件发送给基金托管人，并在三十个工作日内将正本送达基金托管人处。重大合同的保管期限不低于法律法规规定的最低期限。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复印件或扫描件，未经双方协商一致，合同原件不得转移。

（五）基金资产净值计算、估值和会计核算

一）基金资产净值的计算及复核程序

1、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。

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

基金管理人于每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

2、复核程序

基金管理人应每个工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将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，由基金管理人依据《基金合同》和相关法律法规的规定对外公布。

二）基金资产估值方法和特殊情形的处理

1、估值对象

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

2、估值方法

基金管理人与基金托管人应按照《基金合同》约定的估值方法进行估值。

3、特殊情形的处理

基金管理人与基金托管人应当按照《基金合同》的约定处理特殊情况。

三）基金份额净值错误的处理方式

基金管理人与基金托管人应当按照《基金合同》的约定处理基金份额净值错误。

四）暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券/期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

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

4、法律法规、中国证监会和《基金合同》认定的其它情形。

五）基金会计制度

按国家有关部门规定的会计制度执行。

六）基金账册的建立

基金管理人进行基金会计核算并编制基金财务会计报告。基金管理人独立地设置、记录和保管本基金的全套账册。若基金管理人和基金托管人对会计处理方法存在分歧，应以基金管理人的处理方法为准。若当日核对不符，暂时无法查找到错账的原因而影响到基金净值的计算和公告的，以基金管理人的账册为准。

七）基金财务报表与报告的编制和复核

1、财务报表的编制

基金管理人应当及时编制并对外提供真实、完整的基金财务会计报告。月度报表的编制，基金管理人应于每月终了后 5 个工作日内完成。季度报告应在每个季度结束之日起 15 个工作日内编制完毕并予以公告；中期报告在会计年度半年终了后两个月内编制完毕并予以公告；年度报告在会计年度结束后三个月内编制完毕并予以公告。基金年度报告中的财务会计报告应当经过符合《证券法》规定的会计师事务所审计。《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。

2、报表复核

基金管理人在上述财务报表完成后，将报表提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人和基金托管人之间的上述文件往来均以邮件的方式或双方商定的其他方式进行。

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；若双方无法达成一致，以基金管理人的账务处理为准。核对无误后，基金托管人在基金管理人提供的报告上加盖托管业务专用章或者出具加盖托管业务专用章的复核意见书，双方各自留存一份。如果基金管理人与基金托管人不能于应当发布公告之日之前就相关报表达成一致，基金管理人有权按照其编制的报表对外发布公告，基金托管人有权就相关情况报中国证监会备案。

八）基金管理人应每季度向基金托管人提供基金业绩比较基准的基础数据和编制结果。

（六）基金份额持有人名册的登记与保管

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

基金份额持有人名册由登记机构编制，由基金管理人审核并提交基金托管人保管。基金托管人有权要求基金管理人提供任意一个交易日或全部交易日的基金份额持有人名册，基金管理人应及时提供，不得无故拖延或拒绝提供。

基金管理人应及时向基金托管人提交基金份额持有人名册。每年6月30日和12月31日的基金份额持有人名册应于下月前十个工作日内提交；基金合同生效日、基金合同终止日等涉及到基金重要事项日期的基金份额持有人名册应于发生日后十个工作日内提交。

基金管理人和基金托管人应妥善保管基金份额持有人名册，保存期限不少于法律法规规定的最低期限。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，因本协议产生的或与之相关的一切争议可通过友好协商解决，但若未能以协商方式解决的，任何一方均有权将争议提交上海国际经济贸易仲裁委员会，仲裁地点为上海市，按照上海国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对双方当事人均有约束力。除非仲裁裁决另有规定，仲裁费用由败诉方承担。

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

本协议受中国法律（为本协议之目的，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区法律和

台湾地区的有关规定）管辖并从其解释。

（八）托管协议的变更、终止与基金财产的清算

一）托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行修改。修改后的新协议，其内容不得与基金合同的规定有任何冲突。基金托管协议的变更依据法律法规规定报中国证监会备案。

二）基金托管协议终止的情形

1、基金合同终止；

2、基金托管人解散、依法被撤销、破产或由其他基金托管人接管基金资产；

3、基金管理人解散、依法被撤销、破产或由其他基金管理人接管基金管理权；

4、发生法律法规、中国证监会或基金合同规定的终止事项。

三）基金财产的清算

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

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、符合《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；

（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。

6、清算费用

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

7、基金财产清算剩余资产的分配

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

8、基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经符合《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。

9、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存不低于法律法规规定的最低期限。

二十二、对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务。基金管理人有权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及内容。主要服务内容如下：

（一）资料寄送

投资者更改个人信息资料，请及时到原开立华宝基金账户的销售机构更改。

在从销售机构获取准确的客户地址、邮编和电子邮箱地址的前提下，基金管理人将根据投资者的需要寄送以下资料：

1、基金投资者对账单

基金管理人将在每月度结束后的3个工作日内，向已经定制了电子对账单服务的基金份额持有人提供电子对账单。如基金份额持有人因特殊原因需要获取指定期间的纸质对账单，可拨打基金管理人客服电话400-700-5588（免长途话费）、400-820-5050（免长途话费），按“0”转人工服务，提供姓名、开户证件号码或基金账号、邮寄地址、邮政编码、联系电话，客服人员核对信息无误后，为基金份额持有人免费邮寄纸质对账单。

2、其他相关的信息资料

基金管理人以说明或电子形式向投资人寄送基金其他信息资料。

（二）在线服务

基金管理人利用基金管理人的网站（www.fsfund.com）为基金投资者提供网上查询、网上资讯服务。

（三）资讯服务

1、投资者如果想了解申购与赎回的交易情况、基金账户份额、基金产品与服务等信息，可拨打基金管理人如下电话：

电话呼叫中心：4007005588，4008205050，该电话可转人工座席。

直销柜台电话：021-38505731、021-38505732

传真：021－50499663、021-50988055

2、互联网站

网址：www.fsfund.com

电子信箱：fsf@fsfund.com

（四）客户投诉和建议处理

投资者可以通过基金管理人提供的呼叫中心自动语音留言、呼叫中心人工座席、书信、电子邮件、传真等渠道对基金管理人和销售机构所提供的服务进行投诉或提出建议。投资者还可以通过销售机构的服务电话对该销售机构提供的服务进行投诉。

（五）如本招募说明书存在任何您/贵机构无法理解的内容，请联系基金管理人。请确

保投资前，您/贵机构已经全面理解了本招募说明书。

二十三、其他应披露事项

无。

二十四、招募说明书的存放及查阅方式

本招募说明书公布后，分别置备于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的住所，供公众查阅、复制。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与公告的内容完全一致。

二十五、备查文件

以下文件存于基金管理人及基金托管人办公场所备投资者查阅。

（一）中国证监会准予华宝均衡精选主动管理交易型开放式股票证券投资基金募集注册的文件

（二）《华宝均衡精选主动管理交易型开放式股票证券投资基金基金合同》

（三）《华宝均衡精选主动管理交易型开放式股票证券投资基金托管协议》

（四）基金管理人业务资格批件、营业执照

（五）基金托管人业务资格批件、营业执照

（六）法律意见书

（七）注册登记协议

（八）中国证监会要求的其他文件

投资者可以通过基金管理人网站，查阅或下载基金合同、招募说明书、托管协议及基金的各种定期和临时公告。

华宝基金管理有限公司

2026 年 10 月 20 日