

# 安联基金管理有限公司

## 安联中国精选混合型证券投资基金 招募说明书

基金管理人：安联基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

**【重要提示】**

安联中国精选混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）2024年7月26日证监许可【2024】1102号文准予注册募集。

安联基金管理有限公司（以下称“基金管理人”或“管理人”）保证《安联中国精选混合型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和市场前景做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

本基金投资于证券、期货市场，基金净值会因证券、期货市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，应全面认识本基金的风险收益特征，并承担基金投资中出现的各类风险，包括但不限于：因经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响而形成的市场风险，由于基金投资者连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，信用风险，本基金的特有风险，其他风险等。

本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。本基金投资港股通标的股票的，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，还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。

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，包括港股交易失败风险（港股通业务试点期间存在每日额度和总额度限制，本基金将面临不能通过港股通进行买入交易的风险）、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)、其他境外市场的风险等。本基金投资港股的具体风险请参见招募说明书“风险揭示”部分。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。

本基金可投资国内依法发行上市的存托凭证，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，与存托凭证的境外基础证券、境外基础证券的发行人及境内外交易机制相关的风险可能直接或间接成为本基金风险。本基金可根据投资策略需要或市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于存托凭证或选择不将基金资产投资于存托凭证，基金资产并非必然投资存托凭证。

本基金可投资资产支持证券，可能面临信用风险、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。

本基金可投资股指期货，股指期货采用保证金交易制度，由于保证金交易具有杠杆性，当出现不利行情时，股价指数微小的变动就可能会使投资人权益遭受较大损失。股指期货采用每日无负债结算制度，如果没有在规定的时间内补足保证金，按规定将被强制平仓，可能给投资带来重大损失。

本基金可投资国债期货，可能给本基金带来额外风险，包括杠杆风险、期货价格与基金投资品种价格的相关度降低带来的风险等，由此可能增加本基金净值的波动性。

当本基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，基金管理人履行约定的程序后，可以依照约定启用侧袋机制，具体详见基金合同和招募说明书的有关章节。侧袋机制实施期间，基金管理人将对基金简称进行特殊标识，并不得办理侧袋账户的申购赎回。请基金份额持有人仔细阅读相关内容并关注本基金启用侧袋机制时的特定风险。

基金管理人依据相关法律、法规等，经尽职调查、进行了充分的评估论证、履行了必要的决策程序，现将份额登记、估值核算等业务委托给基金服务机构——国泰君安证券股份有限公司负责日常运营；基金管理人需定期了解基金服务机构的人员配备情况、业务操作的专业能力、业务隔离措施、软硬件设施等基本运作情况，以保证满足业务发展的实际需求；如前述提供份额登记、估值核算的基金服务机构以独资或者控股方式成立具有独立法人资格的基金服务机构，经基金管理人同意，可直接由该新设立的基金服务机构担任本基金的服务

机构，但基金管理人应发布相关公告。除前述另有规定外，基金服务机构发生变更的，基金管理人需另行发布相关公告。若基金份额持有人不同意基金管理人变更基金服务机构的，自公告之日起 10 日内可以赎回其持有的全部基金份额，若基金份额持有人自公告之日起 10 日后继续持有全部或部分基金份额的，视为其同意基金管理人变更基金服务机构。

投资有风险，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》及《基金合同》、《基金产品资料概要》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。

投资者应当通过本基金管理人或其他销售机构认/申购和赎回基金。本基金在募集期内按 1.00 元面值发售并不改变基金的风险收益特征。投资者按 1.00 元面值购买基金份额以后，有可能面临基金份额净值跌破 1.00 元从而遭受损失的风险。

基金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。

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，由投资者自行承担。

基金投资者及基金份额持有人承诺其知悉《中华人民共和国反洗钱法》、《金融机构客户身份识别和客户身份资料及交易记录保存管理办法》、《金融机构大额交易和可疑交易报告管理办法》、《中国人民银行关于加强开户管理及可疑交易报告后续控制措施的通知》、《中国人民银行关于落实执行联合国安理会相关决议的通知》等反洗钱相关法律法规的规定，将严格遵守上述规定，不会违反任何前述规定；承诺用于基金投资的资金来源不属于违法犯罪所得及其收益；承诺出示真实有效的身份证件或者其他身份证明文件，积极履行反洗钱职责。

基金投资者及基金份额持有人承诺，已认真阅读并知悉基金管理人关于可购买本基金的投资者资质的规定（以基金管理人公示的《业务规则》为准），并

---

---

应在认购、申购本基金时及持有本基金期间内持续满足该等资质要求，已知悉本基金为根据中华人民共和国法律注册的公募基金产品，并不适合美国人士投资或持有。

出于反洗钱、反恐怖融资、非居民金融账户涉税信息尽职调查与信息报送等相关的合规要求，本基金基金管理人有权对可购买本基金的投资者资质予以规定并不时调整，具体见《业务规则》、基金份额发售公告以及基金管理人届时发布的开放申购或赎回公告或其他相关公告等。如已持有本基金基金份额，但不再满足本基金的投资者资质要求或基金合同约定的其他条件或出现基金合同约定情形的，基金管理人有权依据基金合同的约定对相应基金份额予以强制赎回或采取其他相应控制措施，提请投资者关注。

---

---

## 目录

第一部分 绪言 .....	1
第二部分 释义 .....	2
第三部分 基金管理人 .....	8
第四部分 基金托管人 .....	17
第五部分 相关服务机构 .....	19
第六部分 基金的募集 .....	21
第七部分 基金合同的生效 .....	26
第八部分 基金份额的申购与赎回 .....	27
第九部分 基金的投资 .....	40
第十部分 基金的财产 .....	49
第十一部分 基金资产估值 .....	50
第十二部分 基金的收益与分配 .....	57
第十三部分 基金费用与税收 .....	59
第十四部分 基金的会计与审计 .....	62
第十五部分 基金的信息披露 .....	63
第十六部分 侧袋机制 .....	71
第十七部分 风险揭示 .....	74
第十八部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算 .....	81
第十九部分 基金合同的内容摘要 .....	83
第二十部分 托管协议的内容摘要 .....	111
第二十一部分 对基金份额持有人的服务 .....	124
第二十二部分 招募说明书的存放及查阅方式 .....	126
第二十三部分 备查文件 .....	127

---

---

## 第一部分 绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国民法典》、《中华人民共和国证券法》（以下简称“《证券法》”）、《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》”）和其他有关法律法规及《安联中国精选混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

本招募说明书阐述了安联中国精选混合型证券投资基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资者投资决策有关的必要事项，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

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。

## 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：指安联中国精选混合型证券投资基金
- 2、基金管理人：指安联基金管理有限公司
- 3、基金托管人：指中国银行股份有限公司
- 4、基金合同、《基金合同》：指《安联中国精选混合型证券投资基金基金合同》及对该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《安联中国精选混合型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
- 6、招募说明书、本招募说明书：指《安联中国精选混合型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《安联中国精选混合型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《安联中国精选混合型证券投资基金基金份额发售公告》
- 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、《证券法》：指 1998 年 12 月 29 日第九届全国人民代表大会常务委员会第六次会议通过，经 2004 年 8 月 28 日第十届全国人民代表大会常务委员会第十一次会议《关于修改〈中华人民共和国证券法〉的决定》第一次修正，2005 年 10 月 27 日第十届全国人民代表大会常务委员会第十八次会议第一次修订，2013 年 6 月 29 日第十二届全国人民代表大会常务委员会第三次会议《关于修改〈中华人民共和国文物保护法〉等十二部法律的决定》第二次修正，2014 年 8 月 31 日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十次会议《关于修改〈中华人民共和国保险法〉等五部法律的决定》第三次修正，2019 年 12 月 28 日第十三届全国人民代表大会常务委员会第十五次会议第二次修订的《中华人民共和国证券法》及颁布机关对其不时做出的修订



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、《涉税尽职调查办法》：指 2017 年 5 月 9 日颁布，同年 7 月 1 日实施的《非居民金融账户涉税信息尽职调查管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

17、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

18、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或国家金融监督管理总局

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》（包括其不时修订）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、基金投资者、投资人、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人的合称，基金管理人有权对可购买本基金的投资者资质予以规定并不时调整，具体见基金管理人于公司网站披露的相关规则，以及基金管理人届时发布的相关公告

**24、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

**25、基金销售业务：**指基金管理人或销售机构为投资人开立基金交易账户，宣传推介基金，办理基金份额发售、申购、赎回、转换、转托管、定期定额投资及提供基金交易账户信息查询等活动

**26、销售机构：**指安联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

**27、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

**28、登记机构：**指办理登记业务的机构。基金的登记机构为安联基金管理有限公司或接受安联基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构

**29、基金服务机构：**指从事基金的销售、销售支付、份额登记、估值等基金服务业务的机构。销售机构、登记机构亦为本基金的基金服务机构

**30、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

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

**32、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

**33、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

**34、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

**35、存续期：**指基金合同生效至终止之间的不定期期限

**36、工作日：**指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

**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），n 为自然数

**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时，则基金管理人有权根据实际情况决定本基金暂停申购、赎回等业务，届时以公告为准）

**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《安联基金管理有限公司开放式基金注册登记及资金清算业务规则》及基金管理人于公司网站披露的相关规则，是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金登记方面的业务规则，由基金管理人和投资者共同遵守

**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规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为

**45、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

**46、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

**47、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

**48、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）超过上一开放日基金总份额的 10%

**49、元：**指人民币元

**50、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

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

**52、基金资产净值：**指基金资产总值减去基金负债后的价值

**53、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

**54、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

**55、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

**56、销售服务费：**指从基金财产中计提的，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（如有）

**57、基金份额类别：**指根据认购费、申购费、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

**58、A 类基金份额：**指在投资者认（申）购时收取认（申）购费，在赎回时根据持有期限收取赎回费，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

**59、C 类基金份额：**指在投资者认（申）购时不收取认（申）购费，在赎回时根据持有期限收取赎回费，并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

**60、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以及法律法规或中国证监会规定的其他流动性受限资产，如届时法律法规变动，基金管理人在履行适当程序后，可对前述流动性受限资产范围进行调整

**61、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

**62、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

**63、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

**64、港股通标的股票：**指内地投资者委托内地证券公司，经由上海证券交易所、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，买卖沪港通、深港通规定范围内的香港联合交易所上市的股票

**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。

**66、中国：**指中华人民共和国。就本招募说明书而言，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区

以上释义中涉及法律法规、业务规则的内容，法律法规、业务规则修订后，如适用本基金，相关内容以修订后法律法规、业务规则为准。

## 第三部分 基金管理人

### 一、基金管理人概况

名称：安联基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区临港新片区环湖西二路 888 号 B 楼 1108 室

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 479 号上海中心大厦 33 层 3301-3304 室

成立日期：2023 年 9 月 13 日

法定代表人：沈良

电话：021-38917777

注册资本：人民币 30000.0000 万

安联基金管理有限公司（以下简称“公司”）经中国证监会证监许可【2023】1888 号文批准设立。公司股权结构如下：

股东名称	股权比例
安联投资有限公司（Allianz Global Investors GmbH）	100%

### 二、主要人员情况

#### 1、基金管理人董事会成员

吴家耀先生：董事长，现任安联投资驻香港的亚太区行政总裁、全球业务委员会主席。吴家耀先生于 2014 年加入安联投资，现负责领导零售及机构业务，列席于安联投资执行委员会，曾担任安联投资的大中华及东南亚区行政总裁和亚太区机构业务总监。吴家耀先生现为安联环球投资亚太有限公司董事，兼任安联寰通管理咨询（上海）有限公司监事，安联寰通海外投资基金管理（上海）有限公司监事，安联投资资产管理（印度尼西亚）有限公司监事会主席。吴家耀先生在金融服务业界累积超过 20 年的经验。加入安联投资前，吴家耀先生曾先后任富林明信托基金高级投资产品分析师，Asia V-Sat 副总裁，摩根资产管理亚洲机构业务主管，景顺资产管理大中华区行政总裁。吴家耀先生拥有美国

---

---

马萨诸塞州克拉克大学的商业管理学士学位和工商管理硕士学位。

**Delia Poon Lang 女士：**董事，现任安联投资全球法务部主管、亚太区法律总顾问，兼任安联证券投资信托股份有限公司监察人。**Delia Poon Lang 女士**负责安联投资的全球法律事务以及亚太区的法律暨合规事务，作为安联投资国际管理小组的成员，她还担任法律合规及风险管理委员会的联合主席，同时为全球产品委员会及审计委员会和亚洲地区的多个委员会和董事会中的成员。**Delia Poon Lang 女士**曾先后任贝克·麦坚时律师事务所的外国法律顾问，美邦律师事务所律师，普衡律师事务所律师，瑞士信贷（香港）有限公司亚洲区资产管理部门法律和合规主管，贝莱德资产管理北亚有限公司的亚洲区（日本除外）合规主管，蒙特利尔银行金融集团亚洲首席法律合规官。**Delia Poon Lang 女士**毕业于莱斯大学及加州大学希斯廷法律学院，拥有法学博士学位，并持有美国加州律师执业资格。

**龙媛媛女士：**董事，现任安联投资有限公司亚太区财务总监，兼任安联环球投资亚太有限公司董事，安联证券投资信托股份有限公司董事，安联环球投资日本有限公司董事，安联寰通管理咨询（上海）有限公司董事，安联寰通海外投资基金管理（上海）有限公司董事。龙媛媛女士曾先后任邓天锡会计师事务所审计员，香港立信德豪会计师事务所有限公司高级审计员，安永会计师事务所审计经理，安联投资有限公司亚太区财务政策经理，亚太区会计，税务及财务管理主管，亚太区财务策划分析主管，环球财务政策主管和亚太财务部主管。龙媛媛女士拥有英国伦敦大学玛丽皇后学院的金融学学士学位和公共政策硕士学位。

**沈良先生：**董事、总经理、法定代表人、财务负责人，于2021年1月加入安联投资。曾任中宏人寿保险有限公司投资总监，摩根士丹利亚洲有限公司首席行政官（亚太区），摩根士丹利华鑫基金管理有限公司副总经理，摩根士丹利亚洲有限公司亚太区运营部首席运营官（COO），深圳市世纪点金投资咨询管理有限公司执行董事、法定代表人，融通国际资产管理有限公司副总裁，美世（中国）有限公司中国区财富管理业务负责人，美世投资管理（上海）有限公司总经理，安联环球投资亚太有限公司董事总经理、中国资产管理业务兼公募基金管理业务（筹备）负责人，安联寰通资产管理（上海）有限公司（现更名为安联寰通管理咨询（上海）有限公司）董事、副董事长、董事总经理、中国

资产管理业务兼公募基金业务（筹备）负责人，安联寰通海外投资基金管理（上海）有限公司董事、副董事长、董事总经理、中国资产管理业务兼公募基金业务（筹备）负责人。沈良先生还曾供职于普华永道会计师事务所，宏利金融有限公司及宏利人寿保险（国际）有限公司。沈良先生拥有加拿大西安大略大学工商管理专业硕士学位，并持有特许金融分析师（CFA）证书及特许公认会计师（ACCA）证书。

冯博先生：独立董事，现任海南国际清算所股份有限公司董事长。冯博先生曾先后任人民银行计划资金司副主任科员，人民银行货币政策司主任科员，中国外汇交易中心市场二部总经理，上海证券交易所债券基金部总监，中国证监会部门副主任，大连商品交易所总经理，金衍（北京）国际咨询有限公司董事长。冯博先生拥有中国人民大学经济学学士学位和经济学硕士学位。

谢红兵先生：独立董事，已于2010年退休至今。兼任弘康人寿保险股份有限公司监事长，丰田三共（上海）新能源科技有限公司监事。谢红兵先生曾先后任空军第四军排长、队长、干事、营教导员、军直属政治处副主任（主持工作）、主任，交通银行上海杨浦支行/分行营业处/静安支行的处长、行长，交通银行基金托管部总经理，交银施罗德基金管理有限公司董事长，中国交银保险有限公司（香港）副董事长。谢红兵先生毕业于江西师范大学，拥有法学学士学位。

林晨先生：独立董事，现任香港大学宝光基金教授席（金融学）教授、金融学讲座教授以及协理副校长，兼任香港金融管理局金融研究院咨询委员会委员，恒生指数顾问委员会委员，香港证监会金融科技咨询委员会委员，香港特区政府第三代互联网发展专责小组非官方成员，香港金融管理局央行数字货币专家小组成员，招商局置地资管有限公司的独立非执行董事，信银（香港）投资有限公司的独立非执行董事，十月稻田集团股份有限公司的独立非执行董事。林晨先生曾先后任岭南大学金融助理教授，香港城市大学金融助理教授、金融副教授，香港中文大学金融系教授、卓敏金融学讲座教授。林晨先生拥有美国佛罗里达大学的工商管理硕士学位、经济学硕士学位及博士学位。

## 2、基金管理人监事

仇莉莉女士，人力资源部总经理、职工监事，上海师范大学思想政治教育专业学士学位。于2021年6月加入安联投资。曾任国联安基金管理有限公司人



力资源专员、人力资源经理、高级人力资源经理，重庆协信远创商业管理有限公司上海闵行分公司人力资源总监，泰信基金管理有限公司高级人力资源经理，安联寰通资产管理（上海）有限公司（现更名为安联寰通管理咨询（上海）有限公司）基金公司筹备组人力资源部副总监，安联寰通海外投资基金管理（上海）有限公司基金公司筹备组人力资源部副总监。

**Khalil Soubra** 先生，监事，现任安联环球投资亚太有限公司亚太区首席运营官（由安联投资法国分部外派），兼任安联投资（香港分部）的董事及香港获授权代表，安联环球投资亚太有限公司董事，**Allianz Global Investors Nominee Services Limited**（香港分部）的董事及香港获授权代表，**Allianz Global Investors Singapore Limited** 的董事，**Allianz Global Investors Japan Co., Ltd.** 的兼职董事，安联寰通管理咨询（上海）有限公司董事以及安联寰通海外投资基金管理（上海）有限公司董事。**Khalil Soubra** 先生自 2004 年始，其先后在亚创（**Altran**）担任业务分析师，在安联投资有限公司（法国分部）担任数据和定价主管、法国运营主管、欧洲投资运营联席主管、全球中台主管。**Khalil Soubra** 先生拥有黎巴嫩圣约瑟夫大学的商业管理学士学位，巴黎第十二大学的经济学学士学位以及巴黎第二大学的金融硕士学位。

### 3、公司高管人员

沈良先生，董事、总经理、法定代表人、财务负责人。（简历请参见上述董事会成员介绍）

郑宇尘先生，副总经理、首席投资官，同济大学技术经济及管理专业硕士学位，特许金融分析师（**CFA**），金融风险管理师（**FRM**），另类投资分析师（**CAIA**）。于 2022 年 1 月加入安联投资。曾任中德安联人寿保险有限责任公司研究员、组合经理、投资部总监，汇丰晋信基金管理有限公司投资咨询总监、固定收益部总监、基金经理、保险机构资产管理部总监、投资总监，安联寰通资产管理（上海）有限公司（现更名为安联寰通管理咨询（上海）有限公司）基金公司筹备组首席投资官，安联寰通海外投资基金管理（上海）有限公司基金公司筹备组首席投资官。

顾文女士，督察长，英国曼彻斯特大学国际商法专业硕士学位。于 2021 年 8 月加入安联投资。曾任上银基金管理有限公司监察稽核部副总监、监察稽核部总监，中信保诚基金管理有限公司监察稽核部总监，安联寰通资产管理（上

海)有限公司(现更名为安联寰通管理咨询(上海)有限公司)基金公司筹备组督察长,安联寰通海外投资基金管理(上海)有限公司基金公司筹备组督察长。顾文女士还曾供职于广东方源律师事务所,国浩律师(上海)事务所,北京市国枫律师事务所上海分所及北京国枫凯文(上海)律师事务所上海分所。

罗瑞宏先生,首席信息官,上海大学计算机工程与科学学院计算机应用专业硕士学位。于2021年6月加入安联投资。曾任华安基金管理有限公司信息技术部项目经理,华时基金管理有限公司筹备组拟任运营管理部总监,财通基金管理有限公司(筹)拟任运营管理部总监,财通基金管理有限公司运营管理部总监,上银基金管理有限公司运营部总监、副总监,上银瑞金资本管理有限公司副总经理,上银基金管理有限公司信息技术部总监,安联寰通资产管理(上海)有限公司(现更名为安联寰通管理咨询(上海)有限公司)基金公司筹备组首席信息官,安联寰通海外投资基金管理(上海)有限公司基金公司筹备组首席信息官。罗瑞宏先生还曾供职于申银万国证券股份有限公司电脑网络中心项目经理。

#### 4、本基金基金经理

程彧先生,研究部总经理、特许金融分析师(CFA),上海复旦大学国际经济专业学士,加拿大英属哥伦比亚大学国际工商管理硕士。于2023年3月加入安联投资。曾任毕马威华振会计师事务所助理审计经理,摩根士丹利房地产基金投资经理,汇丰晋信基金管理有限公司国际业务及战略伙伴部副总监、国际业务部总监、海外投资部总监、基金经理等职位,安联寰通海外投资基金管理(上海)有限公司基金公司筹备组成员。

#### 5、投资决策委员会成员

郑宇尘先生(副总经理、首席投资官)

程彧先生(研究部总经理)

苏玉平女士(固收投资部总经理)

蔡文星先生(交易部总经理)

#### 6、上述人员之间无近亲属关系。

### 三、基金管理人的职责

按照《基金法》,基金管理人必须履行以下职责:

(一)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、估值核算和登记事宜；

- (二) 办理基金备案手续；
- (三) 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；
- (四) 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；
- (五) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- (六) 编制季度报告、中期报告和年度报告；
- (七) 计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；
- (八) 办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；
- (九) 按照规定召集基金份额持有人大会；
- (十) 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；
- (十一) 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；
- (十二) 国务院证券监督管理机构规定的其他职责。

#### 四、基金管理人承诺

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

2、基金管理人承诺严格遵守《证券法》、《基金法》及有关法律法规，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止下列行为的发生：

- (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、本基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守

---

---

国家有关法律、法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下活动：

- (1) 越权或违规经营；
- (2) 违反基金合同或托管协议；
- (3) 故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益；
- (4) 在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；
- (5) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
- (6) 玩忽职守、滥用职权；
- (7) 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；
- (8) 违反证券交易场所业务规则，利用对敲、对倒、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；
- (9) 贬损同行，以提高自己；
- (10) 以不正当手段谋求业务发展；
- (11) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
- (12) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；
- (13) 法律法规及中国证监会规定禁止的行为。

## 五、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、受雇人或任何第三人谋取不当利益；
- 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。

## 六、基金管理人的内部控制制度

### 1、内部控制的原则

内部控制体系是指公司为防范和化解风险，保证经营运作符合公司的发展规划，在充分考虑内外部环境的基础上，通过建立组织机制、运用管理方法、

实施操作程序与控制措施而形成的系统。公司建立了内部控制体系，内部控制遵循以下原则：

**权威性原则：**公司颁布实施的各项制度具有高度的权威性，是公司所有员工行为及所有经营活动都必须严格遵循的准则。一方面，任何人（包括公司高级管理人员）也不得拥有超越制度约束和违反制度的权力；另一方面，所有业务活动都必须遵循相关制度的规定。

**全面性原则：**内部控制渗透到公司的决策、执行、监督和反馈层次，贯穿了业务流程的所有环节，覆盖了公司所有的部门、岗位和风险点，力争消灭控制盲点。

**有效性原则：**各项内控制度必须符合法律法规的要求，不得与之相抵触；同时必须建立合理的内控程序，具有较强的可操作性，切实可行。

**独立性和相互制约原则：**要做到公司决策、执行、监督体系的独立和分离，公司各职能部门中关键部门、岗位的设置独立和分离，形成权责分明、相互牵制的局面，并通过切实可行的相互制衡措施来降低各种内控风险的发生。

**及时性原则：**公司树立“内控优先”的思想。在发生机构调整、新业务发起等情况时，必须首先建章立制，将其纳入公司内控体系；同时，公司还应根据法律法规和客观情况的变化及时修订、增补和完善各项内控制度。

**防火墙原则：**公司受托资产、自有资产和其他资产的运作严格分离，基金投资、决策、执行、清算、评估等部门和岗位物理上适当隔离。

公司内部控制制度由内部控制大纲、基本管理制度、部门业务规章等部分组成，这些规章共同形成对公司各项日常经营活动的控制。公司章程是公司依法制定的、规定公司组织及活动的基本准则，是公司的宪章。公司内部控制大纲是对公司章程规定的内控原则的细化和展开，是各项基本管理制度的纲要和总揽，内部控制大纲应当明确内控目标、内控原则、控制环境、内控措施等内容。公司基本管理制度包括风险控制制度、投资管理制度、基金会计制度、信息披露制度、监察稽核制度、信息技术管理制度、公司财务制度、资料档案管理制度、业绩评估考核制度和紧急情况处理制度。部门业务规章是在基本管理制度的基础上，对各部门的主要职责、岗位设置、岗位责任、操作守则等的具体说明。

## 2、内部风险控制的三道防线

---

---

公司依据自身经营特点设立顺序递进、权责统一、严密有效的内控防线。公司的内部风险控制，由三条防线组成：

（1）第一道防线：建立以各业务部门和分支机构为基础的第一道内控防线。各部门及分支机构负责人是其部门内控防线的第一责任人，所有员工是本岗位内控防线的直接责任人，负责具体内控防线职责的持续实施；

（2）第二道防线：建立以合规和风险管理部门为保障主体的第二道内控防线，分别对一线部门内控职责履行情况进行定期或不定期的监控和检查；

（3）第三道防线：建立以内部审计岗位为执行全面监督反馈主体的第三道内控防线。内部审计岗位独立对各部门内控职责的履行情况进行稽核审计并向相关委员会进行报告。

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

公司经营管理层牢固树立内部控制优先和风险管理理念，培养全体员工的风险防范意识，营造浓厚的内部控制文化氛围，保证全体员工及时了解国家法律法规和公司规章制度，使风险意识贯穿到公司各个部门、各个岗位和各个环节。公司建立健全的法人治理结构，充分发挥独立董事和监事的监督职能，严禁不正当关联交易、利益输送和内部人控制现象的发生，保护投资者利益和公司合法权益。

### 3、基金管理人关于内部控制的声明

（1）基金管理人确知建立、实施和维持内部控制制度是基金管理人董事会及管理层的责任；

（2）上述关于内部控制制度的披露真实、准确；

（3）基金管理人承诺将根据市场环境的变化及公司的发展不断完善内部控制制度。

## 第四部分 基金托管人

### 一、基金托管人情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期：1983年10月31日

注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整

法定代表人：葛海蛟

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

托管部门信息披露联系人：许俊

传真：（010）66594942

中国银行客服电话：95566

### 二、基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于1998年，现有员工110余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内，中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。

### 三、证券投资基金托管情况

截至2024年3月31日，中国银行已托管1093只证券投资基金，其中境内基金1032只，QDII基金61只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型、FOF、REITs等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

---

---

#### 四、托管业务的内部控制制度

中国银行托管业务部风险管理与控制工作是中国银行全面风险控制工作的组成部分，秉承中国银行风险控制理念，坚持“规范运作、稳健经营”的原则。中国银行托管业务部风险控制工作贯穿业务各环节，通过风险识别与评估、风险控制措施设定及制度建设、内外部检查及审计等措施强化托管业务全员、全面、全程的风险管控。

2007年起，中国银行连续聘请外部会计会计师事务所开展托管业务内部控制审阅工作。先后获得基于“SAS70”、“AAF01/06”“ISAE3402”和“SSAE16”等国际主流内控审阅准则的无保留意见的审阅报告。2020年，中国银行继续获得了基于“ISAE3402”和“SSAE16”双准则的内部控制审计报告。中国银行托管业务内控制度完善，内控措施严密，能够有效保证托管资产的安全。

#### 五、托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，基金托管人发现基金管理人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，应当拒绝执行，及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如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，应当及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。



## 第五部分 相关服务机构

### 一、销售机构及联系人

#### 1、直销机构

本基金直销机构为基金管理人的直销柜台。

地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 479 号上海中心大厦 33 层 3301-3304 室

邮编：200120

电话：021-38067171/021-38067177

传真：021-38067110

联系人：柏二元

客户服务电话：021-38917777

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

#### 2、其他销售机构

详见基金份额发售公告或其他增加其他销售机构的公告。

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其它符合要求的机构销售本基金或变更上述销售机构，并在基金管理人网站公示。

### 二、基金登记机构

名称：安联基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区临港新片区环湖西二路 888 号 B 楼 1108 室

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 479 号上海中心大厦 33 层 3301-3304 室

法定代表人：沈良

### 三、基金服务机构

名称：国泰君安证券股份有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号

办公地址：上海市静安区新闻路 669 号 19 楼

法定代表人：朱健

联系电话：021-38917599

---

---

联系人：丛艳

四、律师事务所和经办律师

名称：北京市汉坤律师事务所上海分所

住所：上海市静安区石门一路 288 号兴业太古汇香港兴业中心二座 33 层

办公地址：上海市静安区石门一路 288 号兴业太古汇香港兴业中心二座 33 层

负责人：高超

电话：(021) 60800909

传真：(021) 60800999

联系人：徐宇舟

经办律师：徐宇舟、刘璐懿

五、会计师事务所和经办注册会计师

名称：毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：北京市东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层

办公地址：上海市南京西路 1266 号恒隆广场 2 期 25 楼

法人代表或执行事务合伙人：邹俊

经办注册会计师：虞京京、梁潇

电话：+86 (21) 22122888

传真：+86 (21) 62881889

联系人：虞京京、梁潇

## 第六部分 基金的募集

### 一、基金募集的依据

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《流动性风险管理规定》、《基金合同》及其他法律法规的有关规定募集。

本基金募集申请已经中国证监会 2024 年 7 月 26 日证监许可【2024】1102 号文准予注册募集。

### 二、基金类别及存续期限

#### 1、基金类别

混合型证券投资基金

#### 2、基金运作方式

契约型开放式。

#### 3、基金存续期间

不定期。

### 三、基金的募集对象

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人。基金管理人有权对可购买本基金的投资者资质予以规定并不时调整，具体见《业务规则》，以及基金管理人届时发布的相关公告。

### 四、基金的募集期限

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。

### 五、基金的最低募集份额总额和募集金额

本基金的最低募集份额总额为 2 亿份，基金募集金额总额不少于 2 亿元。本基金不设首次募集规模上限。

### 六、本基金的募集方式及场所

通过各销售机构的基金销售网点公开发售，各销售机构的具体名单见基金份额发售公告以及基金管理人的官方网站。

具体销售机构联系方式以及发售方案以基金份额发售公告及后续关于变更或增减本基金销售机构的公告为准，请投资人就募集和认购的具体事宜仔细阅读该等公告。

## 七、基金份额的类别

本基金根据认购/申购费用、销售服务费、赎回费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。

1、在投资者认购或申购时收取认购费或申购费，在投资者赎回时根据持有期限收取赎回费，并不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为A类基金份额；

2、在投资者认购或申购时不收取认购或申购费用，在投资者赎回时根据持有期限收取赎回费，且从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为C类基金份额。

A类基金份额、C类基金份额分别设置代码，分别计算和公告其基金份额净值和其基金份额累计净值。基金份额净值计算公式为计算日该类别基金资产净值除以计算日该类别基金份额总数。

投资者可自行选择认购或申购的基金份额类别。本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。

基金管理人可在符合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，依法履行适当程序后，调整现有基金份额类别的设置及其他具体规则，或者停止现有基金份额类别的销售，该等事项无需召开基金份额持有人大会，但基金管理人必须依照《信息披露办法》的规定在规定媒介上刊登公告。

## 八、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。

## 九、基金份额的认购

### 1、认购时间

投资人可在募集期内前往本基金销售机构办理基金份额认购手续，具体的业务办理时间详见本基金的基金份额发售公告或各销售机构相关业务办理规则。

### 2、认购手续

(1) 投资人认购本基金份额应提交的文件和办理的手续

投资者认购本基金份额应提交的文件和办理的手续详见本基金的基金份额

---

---

发售公告或销售机构的相关业务办理规则。

## （2）认购的确认

销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购申请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，投资人应及时查询并妥善行使合法权利。如投资者怠于履行该项查询等各项义务，因此产生的损失由投资者自行承担。

## 3、认购金额的限制

（1）投资人认购时，需按销售机构规定的方式全额缴款。

（2）投资人在基金募集期内可以多次认购基金份额，但已受理的认购申请不允许撤销。A 类基金份额的认购费用按每笔 A 类基金份额的认购申请单独计算。

（3）投资人在其他销售机构首次单笔认购最低金额为 10 元人民币（含认购费，下同），追加认购的单笔认购最低金额为 1 元人民币。投资人在直销柜台首次单笔认购最低金额为 50,000 元人民币，追加认购的单笔最低金额为 100 元人民币。销售机构另有规定的，从其规定。

（4）如本基金单个投资人累计认购的基金份额数达到或者超过基金总份额的 50%，基金管理人可以采取比例确认等方式对该投资人的认购申请进行限制。基金管理人接受某笔或者某些认购申请有可能导致投资者变相规避前述 50%比例要求的，基金管理人有权拒绝该等全部或者部分认购申请。投资人认购的基金份额数以基金合同生效后登记机构的确认为准。

（5）基金管理人可根据有关法律法规的规定和市场情况，调整认购的金额限制，基金管理人最迟应于调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上予以公告。

（6）具体规则请参照安联基金管理有限公司直销柜台和各基金销售机构的规定。

## 4、基金份额的认购费用

本基金 A 类基金份额在认购时收取基金认购费用，C 类基金份额不收取认购费用。本基金 A 类基金份额的认购费率按认购金额进行分档，认购费率随认购金额的增加而递减，最高认购费率不超过 1.20%，投资人如果有多笔认购，适用费率按单笔分别计算。具体费率如下：

认购金额 M	A 类份额认购费率
M < 100 万元	1.20%
100 万元 ≤ M < 300 万元	0.60%
300 万元 ≤ M < 500 万元	0.20%
M ≥ 500 万元	1000 元/笔

A 类基金份额的认购费用由认购 A 类基金份额的投资者承担，不列入基金财产，主要用于基金的市场推广、销售、注册登记等基金募集期间发生的各项费用。

### 5、认购份额的计算

基金认购采用金额认购的方式。

#### (1) A 类基金份额的认购份额计算

A 类基金份额的认购金额包括认购费用和净认购金额。

当认购费用适用比例费率时，认购份额的计算方法如下：

净认购金额 = 认购金额 / (1 + 认购费率)

认购费用 = 认购金额 - 净认购金额

认购份额 = (净认购金额 + 认购资金利息) / 基金份额发售面值

当认购费用为固定金额时，认购份额的计算方法如下：

认购费用 = 固定金额

净认购金额 = 认购金额 - 认购费用

认购份额 = (净认购金额 + 认购资金利息) / 基金份额发售面值

认购份额的计算保留到小数点后 2 位，小数点 2 位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

举例说明：

假设某投资人认购本基金 A 类基金份额，认购金额 10,000 元，对应的认购费率为 1.20%，假定募集期间认购产生的利息为 5 元且该笔认购全部予以确认，则其可得到的基金份额计算如下：

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

认购费用 = 10,000 - 9,881.42 = 118.58 元

认购份额 = (9,881.42 + 5.00) / 1.00 = 9,886.42 份

即：投资人投资 10,000 元认购本基金 A 类基金份额，假定募集期产生的利

---

---

息为 5 元且该笔认购全部予以确认，可得到 9,886.42 份 A 类基金份额。

## （2）C 类基金份额的认购份额计算

认购本基金 C 类基金份额不收取认购费用，则认购份额的计算方式如下：

认购份额=（认购金额+认购资金利息）/基金份额发售面值

认购份额的计算保留到小数点后 2 位，小数点 2 位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

举例说明：

假设某投资人认购本基金 C 类基金份额，认购金额 100,000 元，假定募集期间认购产生的利息为 50 元且该笔认购全部予以确认，则其可得到的基金份额计算如下：

认购份额=（100,000+50.00）/1.00=100,050.00 份

即：投资人投资 100,000 元认购本基金 C 类基金份额，假定募集期产生的利息为 50 元，可得到的 C 类基金份额为 100,050.00 份。

## 十、募集期利息的处理方式

有效认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额（份额类型为投资者认购时选择的相应类别）归基金份额持有人所有，其中利息转份额的具体数额以登记机构的记录为准。

## 十一、募集资金的管理

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。

## 第七部分 基金合同的生效

### 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 日内退还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息。
- 3、如基金募集失败，基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和销售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 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当在 10 个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并 6 个月内召集基金份额持有人大会进行表决。

法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。



## 第八部分 基金份额的申购与赎回

### 一、申购和赎回场所

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

### 二、申购和赎回的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，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，则基金管理人有权根据实际情况决定本基金暂停申购、赎回等业务并公告），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，若出现不可抗力，或者新的证券/期货交易市场、证券/期货交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

#### 2、申购、赎回开始日及业务办理时间

基金管理人可根据实际情况依法决定本基金开始办理申购的具体日期，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。

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基金

---

---

份额申购、赎回的价格。

### 三、申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的该类别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，在当日业务办理时间结束后不得撤销；

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。

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

7、基金管理人有权对可购买本基金的投资者资质予以规定并不时调整，具体见《业务规则》以及基金管理人届时发布的开放申购或赎回公告或其他相关公告。本基金仅接受符合相关资质条件的基金投资者持有本基金基金份额。

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。

### 四、申购与赎回的程序

#### 1、申购和赎回的申请方式

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

#### 2、申购和赎回的款项支付

投资人申购基金份额时，必须按照销售机构规定的方式在规定时间内全额交付申购款项，否则所提交的申购申请不成立。投资人在规定时间内全额交付申购款项，申购成立；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，必须持有足够的基金份额余额，否则所提交的赎回申请不成立。基金份额持有人在规定时间内递交赎回申请，赎回成

立；登记机构确认赎回时，赎回生效。

投资者 T 日赎回申请生效后，基金管理人将在 T+7 日（包括该日）内支付赎回款项。遇证券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、登记公司系统故障、港股通交易系统或港股通资金交收规则限制或其它非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程时，则赎回款项顺延至上述情形消除后划往投资者银行账户。基金管理人、基金托管人和销售机构等不承担由此顺延造成的损失或不利后果。

在发生巨额赎回或基金合同载明的其他暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。

### 3、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日（T 日），在正常情况下，本基金登记机构在 T+1 日（包括该日）内对该交易的有效性进行确认。T 日提交的有效申请，投资人可在 T+2 日后（包括该日）到销售机构或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功或无效，则申购款项本金无息退还给投资人。

销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申购、赎回申请。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。因投资人怠于履行该项查询等各项义务，致使其相关权益受损的，基金管理人、基金托管人、基金销售机构不承担由此造成的损失或不利后果。

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、申购和赎回的数量限制

### 1、基金申购的限制

投资者通过基金管理人之外的销售机构首次单笔申购本基金的最低金额为 10 元（含申购费，下同），追加申购单笔最低金额为 1 元；通过本基金管理人直销柜台申购，首次最低申购金额为 50,000 元，追加申购单笔最低金额为 100 元。实际操作中，以各销售机构的具体规定为准。

投资人将当期分配的基金收益再投资时，不受最低申购金额的限制。

投资者可多次申购，但单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金总份额的 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% 的情形除外）。

## 2、基金赎回的限制

通过各销售机构赎回的，每次赎回基金份额不得低于 1 份，投资人全额赎回时不受该限制。基金份额持有人赎回时或赎回后在销售机构保留的基金份额余额不足 1 份的，在赎回时需一次全部赎回。若某笔赎回将导致投资者在销售机构保留的基金余额不足 1 份时，基金管理人有权将投资者在该销售机构保留的剩余基金份额一次性全部赎回。实际操作中，以各销售机构的具体规定为准。

在发生巨额赎回或基金合同载明的其他暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。

3、本基金可以单个投资人累计持有的基金份额设置上限，具体规定请参见招募说明书更新或相关公告。

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

5、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、赎回份额和最低基金份额保留余额等数量限制。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。

## 六、申购和赎回的价格、费用及其用途

### 1、申购费用

本基金 A 类基金份额在申购时收取申购费用，C 类基金份额不收取申购费用。A 类基金份额的申购费率如下表。投资者如果有多笔申购，费率按单笔分别计算。本基金的申购费率表如下：

申购金额 (M)	申购费率
M < 100 万元	1.50%
100 万元 ≤ M < 300 万元	0.80%

300 万元 $\leq$ M<500 万元	0.30%
M $\geq$ 500 万元	1000 元/笔

本基金 A 类基金份额的申购费用由申购本基金 A 类基金份额的投资人承担，不列入基金财产，主要用于本基金 A 类份额的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

## 2、赎回费用

本基金的赎回费率表如下：

持有时间（Y）（日）	A 类	C 类
Y<7	1.50%	1.50%
7 $\leq$ Y<30	0.75%	0.50%
30 $\leq$ Y<180	0.50%	0%
Y $\geq$ 180	0%	

对持续持有期少于 30 日的投资人收取的赎回费，将赎回费总额 100% 计入基金财产；对持续持有期不少于 30 日但少于 90 日的投资人收取的赎回费，将赎回费总额的 75% 计入基金财产；对持续持有期不少于 90 日但少于 180 日的投资人收取的赎回费，将赎回费总额的 50% 计入基金财产；对持续持有期不少于 180 日的投资人收取的赎回费，将赎回费总额的 25% 计入基金财产。

3、基金管理人可以在法律法规规定、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。

4、基金管理人及其他基金销售机构可以在不违背法律法规规定及基金合同约定且对现有基金份额持有人无实质性不利影响的情况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，基金管理人可以按中国证监会要求履行必要手续后，对基金投资者适当调低基金的销售费率，或针对特定渠道、特定投资群体开展有差别的费率优惠活动。

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。

## 七、申购份额、赎回金额与基金份额净值的计算

### 1、本基金申购份额的计算

本基金采用“金额申购”方式，申购的有效份额为净申购金额除以当日的

该类别基金份额净值，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。

#### (1) A 类基金份额的申购份额计算

A 类基金份额的申购金额包括申购费用和净申购金额。

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 类基金份额净值

举例说明：

某投资人投资 10,000 元申购本基金 A 类基金份额，且该申购申请被全额确认，对应的申购费率为 1.50%，假设申购当日 A 类基金份额净值为 1.0500 元，则可得到的申购份额为：

净申购金额 =  $10,000 / (1 + 1.50\%) = 9,852.22$  元

申购费用 =  $10,000 - 9,852.22 = 147.78$  元

申购份额 =  $9,852.22 / 1.0500 = 9,383.07$  份

即：投资人投资 10,000 元申购本基金 A 类基金份额，其对应申购费率为 1.50%，假设申购当日 A 类基金份额净值为 1.0500 元，则其可得到 9,383.07 份 A 类基金份额。

#### (2) C 类基金份额的申购份额计算

申购份额 = 申购金额 / 申购当日 C 类基金份额净值

例：某投资人投资 10,000 元申购本基金 C 类份额，假设申购当日 C 类份额净值为 1.0500 元，则可得到的申购份额为：

申购份额 =  $10,000 / 1.0500 = 9,523.81$  份

即：投资者投资 10,000 元申购本基金 C 类份额，假设申购当日 C 类份额净值为 1.0500 元，则可得到 9,523.81 份 C 类份额。

## 2、本基金赎回金额的计算

本基金采用“份额赎回”方式，赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日该类别基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。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。

赎回金额的计算方法如下：

赎回总金额=赎回份额×赎回当日各类基金份额净值

赎回费用=赎回总金额×赎回费率

净赎回金额=赎回总金额-赎回费用

例：某基金份额持有人在持有基金份额 200 日后赎回本基金 10,000.00 份 A 类基金份额，假设赎回当日 A 类基金份额净值是 1.0500 元，则其可得到的赎回金额为：

赎回金额=10,000.00×1.0500=10,500.00 元

即：基金份额持有人在持有基金份额 200 日后赎回 10,000.00 份 A 类基金份额，假设赎回当日 A 类基金份额净值是 1.0500 元，则其可得到的赎回金额为 10,500.00 元。

### 3、本基金基金份额净值的计算：

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：

T 日某类基金份额净值=T 日该类基金份额的基金资产净值/T 日该类别基金份额的余额数量。

本基金各类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，并按基金合同的约定公告。遇特殊情况，经履行适当程序，可以适当延迟计算或公告。

如按照上述保留位数的基金份额净值对投资者的申购或赎回进行确认可能引起基金份额净值剧烈波动的，为维护基金份额持有人利益，基金管理人与基金托管人协商一致后，可以临时增加基金份额净值的保留位数并以此进行确认，并在确认完成后予以恢复，具体保留位数以届时公告为准。

### 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、期货交易所交易时间非正常停市或港股通临时停市，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或对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时。
- 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、接受某笔或某些申购申请超过基金管理人设定的本基金总规模限额、单日申购金额限制、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。
- 8、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过 50%，或者变相规避 50%集中度的情形。
- 9、基金管理人、基金托管人、基金服务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。
- 10、基金参与港股通交易且港股通交易当日额度使用完毕而暂停或停止接受买入申报，或者发生证券交易服务公司等机构认定的交易异常情况并决定暂停提供部分或者全部港股通服务，或者发生其他影响通过内地与香港股票市场交易互联互通机制进行正常交易的情形。
- 11、基金投资者未向基金管理人提供法律法规要求的反洗钱、反恐怖融资等尽职调查等事项所需的基金投资者信息。
- 12、基金投资者未向基金管理人提供《涉税尽职调查办法》及相关法律法规要求的尽职调查等事项所需的基金投资者信息、有效税收居民身份声明文件及证明文件。
- 13、基金投资者不符合或不遵守《涉税尽职调查办法》或相关法律法规及其他有关规定。



14、基金投资者属于联合国、中国有权机关或其他司法管辖区有权机关制裁名单内的企业或个人或位于被联合国、中国有权机关或者其他司法管辖区有权机关制裁的国家和地区。

15、基金投资者不符合基金管理人规定的投资本基金的基金投资者资质条件。

16、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、16 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。发生上述第 7、8 项情形时，基金管理人可以采取比例确认等方式对该投资人的申购申请进行限制，基金管理人有权拒绝该等全部或者部分申购申请。如果投资人的申购申请全部或部分被拒绝，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，具体时间以基金管理人届时公告为准。

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无法正常运作或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。

3、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。

4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

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。

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，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请。

7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述 1、2、3、5、6、7 项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，基金管理人应按照规定报中国证监会备案，根据有关规定在规定媒介上刊登暂停赎回公告，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分

配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。若出现上述第 4 项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

## 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）超过前一开放日的基金总份额的 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开放日基金总份额的 10% 的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。部分延期赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

（3）如基金发生巨额赎回，在单个开放日内单个基金份额持有人申请赎回的基金份额超过前一开放日的基金总份额的 10% 时，本基金管理人可以对该单个基金份额持有人持有的赎回申请实施延期办理。如基金管理人可以对于其超

过基金总份额 10%以上部分的赎回申请实施延期办理，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；对于基金管理人接受的该持有人的有效赎回申请，基金管理人可以根据前述“（1）全额赎回”或“（2）部分延期赎回”的约定方式对该部分有效赎回申请与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。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；延期部分如选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。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。

基金管理人在履行适当程序后，有权根据当时市场环境调整前述比例和办理措施，并在规定媒介上进行公告。

（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，并应当依照《信息披露办法》的有关规定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，同时依照《信息披露办法》的有关规定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、基金管理人可以根据暂停申购或赎回的时间，依照《信息披露办法》的有关规定，最迟于重新开放日在规定媒介上刊登重新开放申购或赎回的公告；也可以根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间，届时不再另行发布重新开放的公告。

#### 十二、基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及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，或者按照相关法律法规或国家有权机关要求的方式进行处理的行为。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，或者是按照相关法律法规或国家有权机关要求的方式进行处理。

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。基金账户或基金份额被冻结的，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与支付。法律法规或监管部门另有规定的除外。

### 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、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招募说明书“侧袋机制”部分的规定。

十九、依据基金合同的约定，基金管理人可对基金份额持有人持有的基金份额进行强制赎回的，依据本章节关于份额赎回的规定执行。在不违反相关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，基金管理人可根据具体情况对上述申购和赎回以及相关业务的安排进行补充和调整并提前公告，无需召开基金份额持有人大会审议。

#### 二十、其他业务

如相关法律法规允许基金管理人办理基金份额的质押业务或其他基金业务，基金管理人可制定相应的业务规则并开展相关业务，并依照《信息披露办法》的有关规定进行公告。

---

---

## 第九部分 基金的投资

### 一、投资目标

在有效控制投资组合风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报和中长期稳定的资产增值。

### 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,包括国内依法发行或上市的股票（包括主板、创业板和其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、港股通标的股票，债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、证券公司短期公司债券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券），衍生品（包括股指期货、国债期货），资产支持证券，货币市场工具，同业存单，债券回购，银行存款（包括协议存款、定期存款、通知存款和其他银行存款）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。

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。

本基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为**60%-95%**，其中，港股通标的股票投资不超过股票资产的**20%**。每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货需缴纳的交易保证金后，本基金持有不低于基金资产净值的**5%**的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金，存出保证金，应收申购款等。

如果法律法规对上述投资比例要求有变更的，本基金可在履行适当程序后相应调整，并以调整变更后的投资比例为准。

### 三、投资策略

#### 1、大类资产配置策略

本基金将通过对宏观经济、国家政策、市场因素等可能影响证券市场的重要因素的研究和预测，根据各类资产的风险收益特征的相对变化，适度调整基

---

---

金资产在股票、债券、货币市场工具等类别资产间的分配比例。

## 2、股票投资策略

### （1）个股精选策略

本基金将依据对宏观经济政策、行业长期发展空间、行业景气度、行业竞争格局和行业估值比较的研究，结合产业政策变化与行业格局变化等事件，挖掘和配置具有投资机会的行业。

本基金在投资范围内，注重基本面分析和估值分析两部分，对企业的基本面进行综合分析，重点关注公司所处的行业空间、生命周期与渗透率、景气度、竞争格局、公司的核心竞争力、商业模式以及盈利能力等，通过进一步对估值水平合理性的评估，最终选择优质且估值合理的上市公司的股票进行投资。本基金主要从以下维度筛选优质上市公司：

#### 1) 基本面分析

通过深入研究，综合分析行业政策、行业空间、生命周期和渗透率、景气度、竞争格局等因素，挖掘具有较好长期增长前景的行业以及中短期景气度和盈利能力向上的行业。其次，对选出的行业中公司的核心竞争力、商业模式、增长前景、盈利能力以及公司治理等因素重点分析，最大程度地筛选出具有较高可持续盈利能力的上市公司。

#### 2) 估值水平分析

我们将结合 P/E、P/B、P/S、PEG、EV/EBIT、DCF、股息率等多种估值方式对公司的价值进行评估。从估值分析的维度，我们重点关注企业的当前估值与企业可持续盈利能力和企业价值的匹配，从中选择估值合理的上市公司。

### （2）股票组合的构建

本基金主要采用“自上而下”与“自下而上”相结合的方式精选个股来构建股票组合，根据对各行业相对投资价值的评估，适当调整组合的行业分布，以有效降低组合风险。

### （3）港股通投资策略

港股通标的股票投资策略方面，本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场，不使用合格境内机构投资者（QDII）境外投资额度进行境外投资。本基金将遵循上述股票投资策略，通过基本面分析与估值分析两方面，选择优质且估值合理的港股上市公司的股票进行投资。

---

---

#### （4）存托凭证投资策略

在控制风险的前提下，本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，通过基本面分析与估值分析两方面，进行存托凭证的投资。

### 3、债券投资策略

本基金投资固定收益类资产的主要目的是在股票市场风险显著增大时，充分利用固定收益类资产的投资机会，提高基金投资收益，并有效降低基金的整体投资风险。本基金在固定收益类资产的投资上，将采用自上而下的投资策略，通过对未来利率趋势预期、收益率曲线变动、收益率利差和公司基本面的分析，积极投资，获取超额收益：

#### （1）利率趋势预期

准确预测未来利率趋势并相应运用久期管理能为债券投资带来超额收益。本基金将密切关注宏观经济运行状况，全面分析货币政策、财政政策和汇率政策变化情况，把握未来利率走势，在预期利率下降时加大债券投资久期，在预期利率上升时适度缩小久期，规避利率风险，增加投资收益。

#### （2）收益率曲线变动分析

收益率曲线反映了债券期限同收益率之间的关系。通过预测收益率曲线形状的变化，调整债券投资组合长短期品种的比例获得投资收益。

#### （3）收益率利差分析

在预测和分析同一市场不同板块之间（比如国债与金融债券）、不同市场的同一品种、不同市场的不同板块之间的收益率利差基础上，采取积极策略选择合适品种进行交易来获取投资收益。在正常条件下它们之间的收益率利差是稳定的，但是在某种情况下，比如某个行业在经济周期的某一时期面临信用风险改变或市场供求发生变化时，这种稳定关系会被打破，若能提前预测并进行利差交易，就可获得超额收益。

#### （4）公司基本面分析

公司基本面分析是公司债（包括可转债）投资决策的重要决定因素。对发行债券公司的财务经营状况、运营能力、管理层信用度、所处行业竞争状况等因素进行“质”和“量”的综合分析，并结合实际调研结果，准确评价该公司债券的信用风险程度，作出价值判断。

#### （5）可转换债券及可交换债券投资策略



可转换债券和可交换债券同时具有固定收益类与权益类证券的双重特性，通过判断正股的价格走势及其与可转换债券间的联动关系，从而判断可转债投资最佳时机。本基金仅投资于入选公司内部可转债库的标的。

#### （6）证券公司短期公司债券投资策略

本基金将根据我司信用债评级入库标准，通过对证券公司短期公司债券发行人基本面的深入调研分析，结合发行人资产负债状况、盈利能力、现金流、经营稳定性、违约风险等做出信用评级、根据评级结果做出是否入库决定。对于已经入库品种，根据市场环境、信用利差分析、流动性分析进行投资决策。

#### 4、资产支持证券投资策略

本基金将在严格遵守相关法律法规和基金合同的前提下，秉持稳健投资原则，综合运用久期管理、收益率曲线变动分析、收益率利差分析和公司基本面分析等积极策略，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益较高的品种进行投资，以期获得基金资产的长期稳健回报。

#### 5、股指期货投资策略

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在控制风险的前提下，谨慎适度参与股指期货的投资。本基金在进行股指期货投资中，将有选择地投资于流动性好、交易活跃的股指期货合约，以对冲投资组合的风险、有效管理现金流量或降低建仓或调仓过程中的冲击成本等。

#### 6、国债期货投资策略

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在控制风险的前提下，谨慎适度参与国债期货的投资。

### 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）本基金股票投资占基金资产的比例为 **60%-95%**，其中，港股通标的股票投资不超过股票资产的 **20%**；

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

（3）本基金持有一家公司发行的证券，其市值（若同时持有一家公司发行

---

---

的 A 股和 H 股，则为 A 股与 H 股合计市值）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的证券（若同时持有一家公司的 A 股和 H 股，则为 A 股与 H 股合计市值），不超过该证券的 10%；

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

（6）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

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

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

（9）本基金应投资于信用评级为 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）本基金持有的单只证券公司短期公司债券，其市值不得超过本基金资产净值的 10%；

（12）本基金参与股指期货、国债期货交易，遵守下列投资比例限制：

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

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

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

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

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

6) 本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的 15%；

7) 本基金在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%；

8) 本基金所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定；

9) 本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 30%；

(13) 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%；

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

(15) 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；

(16) 本基金资产总值不超过基金资产净值的 140%；

(17) 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；

(18) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述（2）、（9）、（15）情形之外，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资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。

如果法律法规或监管部门对上述投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

## 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。如法律、行政法规或监管部门取消或变更上述限制，基金管理人在履行适当程序后，本基金可不受上述规定的限制或以变更后的规定为准。

## 五、业绩比较基准

沪深 300 指数收益率×75%+中债新综合指数全价（总值）指数收益率×25%

沪深 300 指数是由上海和深圳证券交易所中选取 300 只 A 股作为样本编制而成的成份股指数，具有良好的市场代表性和市场流动性。沪深 300 指数与市场

整体表现具有较高的相关性，具有良好的投资价值。该指数由中证指数有限公司在引进国际指数编制和管理经验的基础上编制和维护，编制方法的透明度高，适合作为本基金境内市场股票部分的业绩比较基准。

中债新综合指数全价（总值）指数综合反映债券市场整体价格和投资回报情况。该指数涵盖了银行间市场和交易所市场，具有广泛的市场代表性，能够反映债券市场总体走势。

若未来市场发生变化导致此业绩比较基准不再适用或有更加适合的业绩比较基准，基金管理人有权根据市场发展状况及本基金的投资范围和投资策略，调整本基金的业绩比较基准。业绩基准的变更须经基金管理人和基金托管人协商一致，并在报中国证监会备案后及时公告，而无需召开基金份额持有人大会。

## 六、风险收益特征

本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。

本基金投资港股通标的股票的，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，还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。

## 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。

## 八、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，无需召开基金份额持有人大会审议。

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招募说明书的规定。

---

---

## 第十部分 基金的财产

### 一、基金资产总值

基金资产总值是指购买的各类证券及票据价值、银行存款本息和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、证券经纪机构和基金服务机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

### 四、基金财产的保管和处分

本基金财产独立于基金管理人、基金托管人、证券经纪机构和基金服务机构的财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人、证券经纪机构和基金服务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。

## 第十一部分 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、期货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、股指期货合约、国债期货合约、银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

### 三、估值原则

基金管理人在与其委托的基金服务机构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。

（一）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。

与上述投资品种形同，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。

（二）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、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、处于未上市期间以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和债券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

（3）流通受限股票，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、对于已上市或已挂牌转让的不含权固定收益品种（另有规定的除外），选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的估值全价进行估值。

4、对于已上市或已挂牌转让的含权固定收益品种（另有规定的除外），选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的唯一估值全价或推荐估值全价进行估值。

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选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种的唯一估值全价或推荐估值全价进行估值，同时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，按照长待偿期所对应的价格进行估值。

5、对于在交易所市场上市交易的公开发行的可转换债券等有活跃市场的含转股权的债券，实行全价交易的债券选取估值日收盘价作为估值全价；实行净价交易的债券选取估值日收盘价并加计每百元税前应计利息作为估值全价。

---

6、对于未上市或未挂牌转让且不存在活跃市场的固定收益品种，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其公允价值。

7、同一证券同时在两个或两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。

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

9、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。

10、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。

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

12、持有的银行定期存款或通知存款以本金列示，按协议或合同列示的利息兑额或约定的利率每自然日计提利息。如提前支取或利率发生变化，则按需进行账务调整。

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

14、税收：对于按照中国法律法规和基金投资境内外股票市场交易互联互通机制涉及的境外交易场所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。

15、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，基金托管人承担复核责任，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見，按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。

## 五、估值程序

1、各类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，由此产生的收益或损失由基金资产承担。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。

基金管理人或其委托的基金服务机构每个工作日计算基金资产净值及各类基金份额净值，并按规定公告。

2、基金管理人或其委托的基金服务机构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。基金管理人或其委托的基金服务机构每个工作日对基金资产估值后，将各类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，由基金管理人按规定对外公布。

## 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。当任一类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、或基金服务机构、或销售机构、或投资人自身的过错造成估值错误，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该估值错误遭受损失当事人（“受损方”）的直接损失按下述“估值错误处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

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

### 2、估值错误处理原则

（1）估值错误已发生，但尚未给当事人造成损失时，估值错误责任方应及

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

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

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

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

(5) 按法律法规规定的其他原则处理估值错误。

### 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) 错误偏差达到该类基金份额净值的 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；错误偏差达到该类基金份额净值的 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。

## 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；
- 4、法律法规规定、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

基金资产净值和各类基金份额净值由基金管理人或其委托的基金服务机构负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人或其委托的基金服务机构应于每个工作日交易结束后计算当日的基金资产净值和各类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规定予以公布。

## 九、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资产净值和份额净值，暂停披露侧袋账户份额净值。

## 十、特殊情况的处理

1、基金管理人按本部分第四款有关估值方法规定的第 10 项条款进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

2、由于不可抗力原因，或由于证券交易所、期货交易所、证券经纪机构、期货经纪机构、登记结算机构、第三方估值机构及存款银行等第三方机构发送的数据错误、遗漏，或国家会计政策变更、市场规则变更等非基金管理人与基金托管人原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。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。

---

3、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基金按照权责发生制进行估值的应交税金有差异的，相关估值调整不作为基金资产估值错误处理。

## 第十二部分 基金的收益与分配

### 一、基金利润的构成

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

### 二、基金可供分配利润

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

### 三、基金收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可对本基金进行基金分红，具体分配方案详见届时基金管理人发布的公告；若基金合同生效不满 3 个月，本基金可不进行收益分配。

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可对 A 类、C 类基金份额分别选择不同的分红方式，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。

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

4、同一类别每一基金份额享有同等分配权；由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同。

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在遵守法律法规和监管部门的规定，且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人在与基金托管人协商一致并按照监管部门要求履行适当程序后可对基金收益分配原则和支付方式进行调整，不需召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前依据《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

### 四、收益分配方案

---

---

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

#### 五、收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，依据《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。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。

#### 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。



## 第十三部分 基金费用与税收

### 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、本基金从 C 类基金份额的基金资产中计提的销售服务费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用，但法律法规、中国证监会另有规定的除外；
- 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、期货等交易、结算费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、基金相关账户的开户和维护费用；
- 10、因投资港股通标的股票而产生的各项合理费用；
- 11、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 1.20% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，按照双方约定的时间，自动于次月初五个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

#### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 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

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，按照双方约定的时间，自动于次月初五个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

### 3、C 类基金份额的销售服务费

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 0.40%。

本基金 C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.40% 年费率计提。计算方法如下：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

C 类基金份额的销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，按照双方约定的时间，自动于次月初五个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

上述“一、基金费用的种类”中第 4—11 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、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，详见招募说明书的规定。

#### 五、基金税收

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

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，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。

## 第十四部分 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，基金托管人承担复核责任；
- 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或其委托的基金服务机构就基金的会计核算、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《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。

## 第十五部分 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。相关法律法规关于信息披露的规定发生变化时，本基金从其最新规定。

### 二、信息披露义务人

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

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

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过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、法人或者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两种文本的内容一致。不同文本发生歧义的，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

---

---

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（若遇法定节假日规定报刊休刊，则顺延至法定节假日后首个出报日。下同）在规定媒介上登载《基金合同》生效公告。

基金合同生效公告中将说明基金募集情况及基金管理人、基金管理人高级管理人员、基金经理等人员以及基金管理人股东持有的基金份额、承诺持有的期限等情况。

### （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各类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各类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基金份额发售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《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。

基金管理人应在年度报告、中期报告、季度报告中分别披露基金管理人、基金管理人高级管理人员、基金经理等人员以及基金管理人股东持有基金的份

额、期限及期间的变动情况。

《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。

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

#### （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，中国证监会另有规定的除外；

14、基金收益分配事项；

15、基金管理费、基金托管费、销售服务费、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、任一类基金份额净值计价错误达该类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、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；

22、基金管理人采用摆动定价机制进行估值时；

23、基金推出新业务或服务；

24、增加或调整基金份额类别的设置；

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。

#### （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）实施侧袋机制期间的信息披露

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，详见招募说明书的规定。

#### （十一）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。清算报告应当经过符合《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。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。

#### （十二）基金投资相关品种的信息披露

##### 1、投资资产支持证券的信息披露

本基金投资资产支持证券，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。

##### 2、参与国债期货交易的信息披露

本基金参与国债期货交易，基金管理人应在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露国债期货交易情况，包括交易政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示国债期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的交易政策和交易目标等。

##### 3、参与股指期货交易的信息披露

本基金参与股指期货交易，基金管理人应在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露股指期货交易情况，包括交易政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示股指期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的交易政策和交易目标等。

##### 4、投资港股通标的股票的信息披露

基金管理人应在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露港股通标的股票的投资情况。若法律法规或监管机构对公开募集证券投资基金通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资香港股

---

---

票市场的信息披露另有规定的，从其规定。

#### 5、投资证券公司短期公司债券的信息披露

本基金投资证券公司短期公司债券后，基金管理人应当按届时有效的法律法规披露投资证券公司短期公司债券的情况。

（十三）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、各类基金份额净值、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。

基金管理人、基金托管人除按法律法规要求披露信息外，也可着眼于为投资者决策提供有用信息的角度，在保证公平对待投资者、不误导投资者、不影响基金正常投资操作的前提下，自主提升信息披露服务的质量。具体要求应当符合中国证监会及自律规则的相关规定。前述自主披露如产生信息披露费用，该费用不得从基金财产中列支。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、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）基金投资所涉及的证券、期货交易市场或外汇市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- （3）基金合同约定的发生暂停估值的情形；
- （4）法律法规、基金合同或中国证监会规定的情况。

## 第十六部分 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，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前一开放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，管理费、托管费和销售服务费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份额净值和基金份额累计净值，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、法律法规或监管机构、行业协会对侧袋机制另有规定的，从其规定。本招募说明书中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，在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，可直接对本部分内容进行修改、调整或补充，无需召开基金份额持有人大会审议。

## 第十七部分 风险揭示

### 一、市场风险

证券市场价格受到经济因素、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。因国家宏观政策（如货币政策、财政政策、行业政策、地区发展政策等）发生变化，导致市场价格波动而产生风险；

2、经济周期风险。随经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化。基金投资于债券与上市公司的股票，收益水平也会随之变化，从而产生风险；

3、利率风险。金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着债券的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。基金投资于债券和股票，其收益水平会受到利率变化的影响；

4、上市公司经营风险。上市公司的经营好坏受多种因素影响，如管理能力、财务状况、市场前景、行业竞争、人员素质等，这些都会导致企业的盈利发生变化。如果基金所投资的上市公司经营不善，其股票价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，使基金投资收益下降。虽然基金可以通过投资多样化来分散这种非系统风险，但不能完全规避；

5、购买力风险。基金的利润将主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀的影响而导致购买力下降，从而使基金的实际收益下降；

6、债券收益率曲线变动风险。债券收益率曲线变动风险是指与收益率曲线非平行移动有关的风险，单一的久期指标并不能充分反映这一风险的存在；

7、再投资风险。再投资风险反映了利率下降对固定收益证券利息收入再投资收益的影响，这与利率上升所带来的价格风险（即前面所提到的利率风险）互为消长。具体为当利率下降时，基金从投资的固定收益证券所得的利息收入进行再投资时，将获得较少的收益率。

### 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，造成管理风险。基金管理人的管理水平、管理手段和管理技术等对基金收益水平也存在影响。

### 三、流动性风险

流动性风险表现在两个方面。一是在某种情况下因市场交易量不足，某些投资品种的流动性不佳，可能导致证券不能迅速、低成本地转变为现金，进而影响到基金投资收益的实现；二是在本基金的开放日或过渡期内投资人的连续大量赎回将会导致基金的现金支付出现困难，或迫使基金以不适当的价格大量抛售证券，使基金的净值增长率受到不利影响。

#### (1) 投资市场、行业及资产的流动性风险评估

针对投资市场的流动性风险，本基金主要投资于国内依法发行或上市的股票、港股通标的股票，债券、股指期货、国债期货、资产支持证券、货币市场工具、同业存单、债券回购、银行存款等标的。本基金为混合型证券投资基金，股票投资占基金资产的比例范围为**60%-95%**；投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的**20%**。鉴于证券交易所、期货交易所及银行间市场具有交易对手活跃、投资品种丰富、交易规则明确等优势，且相关上市交易品种具有较高的流动性及较强的变现能力，资金调用的灵活程度较高。

针对投资行业的流动性风险方面，本基金在股票投资策略上主要采用“自上而下”与“自下而上”相结合的方式精选个股来构建股票组合，根据对各行业相对投资价值的评估，适当调整组合的行业分布，以有效降低组合风险。本基金在固定收益类资产的投资上，将采用自上而下的投资策略，分析对未来利率趋势预期、收益率曲线变动、收益率利差和公司基本面。

针对投资资产的流动性风险，本基金将通过对宏观经济、国家政策、市场因素等可能影响证券市场的重要因素的研究和预测，根据各类资产的风险收益特征的相对变化，适度调整基金资产在股票、债券、货币市场工具等类别资产间的分配比例。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。

根据《流动性风险管理规定》的相关要求，本基金管理人会审慎评估所投

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。

## （2）巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过前一开放日的基金总份额的 10%，即认为是发生了巨额赎回。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。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，并应当依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上进行公告。

如基金发生巨额赎回，在单个开放日内单个基金份额持有人申请赎回的基金份额超过前一开放日的基金总份额的 10%时，本基金管理人可以对该单个基金份额持有人持有的赎回申请实施延期办理。如基金管理人可以对于其超过基金总份额 10%以上部分的赎回申请实施延期办理，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；对于基金管理人接受的该持有人的有效赎回申请，基金管理人可以根据前述“（1）全额赎回”或“（2）部分延期赎回”的约定方式对该部分有效赎回申请与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。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；延期部分如选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。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。

## （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

本基金在面临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。如果出现流动性风险，基金管理人经与基金托管人协商，在确保投资者得到公平对待的前提下，可实施备用的流动性风险管理工具，作为特定情形下基金管理人流动性风险管理的辅助措施，包括但不限于延期办理巨额赎回申请、暂停接受赎回申请、延缓支付赎回款项、暂停基金估值、摆动定价、实施侧袋机制以及中国证监会认定的其他措施。同时基金管理人应时刻防范可能产生的流动

性风险，对流动性风险进行日常监控，保护持有人的利益。当实施备用的流动性风险管理工具时，有可能无法按合同约定的时限支付赎回款项。

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、信用风险

基金在交易过程中可能发生交收违约或者所投资债券的发行人违约、拒绝支付到期本息的情况，从而导致基金财产损失。

#### 五、本基金特有的风险

1、本基金为混合型基金，本基金股票投资占基金资产的比例范围为 60-95%，投资于港股通标的股票的比例不超过本基金股票资产的 20%。因此，国内和港股通标的股票市场、债券市场的变化均会影响到基金业绩表现，基金净值表现因此可能受到影响。本基金管理人将发挥专业研究优势，加强对市场、上市公司基本面和固定收益类产品的深入研究，持续优化组合配置，以控制特定风险。

#### 2、投资港股通股票的风险

(1) 本基金将通过“港股通”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) 汇率风险

本基金以人民币募集和计价，但本基金通过港股通投资于香港市场。港币相对于人民币的汇率变化将会影响本基金以人民币计价的基金资产价值，从而导致基金资产面临潜在风险。人民币对港币的汇率的波动也可能加大基金净值的波动，从而对基金业绩产生影响。此外，由于基金运作中的汇率取自汇率发布机构，如果汇率发布机构出现汇率发布时间延迟或是汇率数据错误等情况，可能会对基金运作或者投资者的决策产生不利影响。

(3) 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) 香港市场实行 T+0 回转交易，且证券交易价格并无涨跌幅上下限的规定，因此每日涨跌幅空间相对较大，港股股价可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动；

2) 只有内地和香港两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，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、黑色暴雨或者香港联合交易所（以下简称“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；出现境内证券交易服务公司认定的交易异常情况时，境内证券交易服务公司将可能暂且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) 投资者因港股通标的股票权益分派、转换、上市公司被收购等情形或者异常情况，所取得的港股通标的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，证券交易所另有规定的除外；因港股通标的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；因港股通标的股票权益分派、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。

### 3、资产支持证券的投资风险

资产支持证券的投资可能面临的风险领域包括：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，这些风险可能会给基金净值带来一定的负面影响和损失。为了更好的防范资产支持证券交易所面临的各类风险，基金管理人将遵守审慎经营原则，制定科学合理的投资策略和风险管理制度，有效防范和控制风险，切实维护基金财产的安全和基金份额持有人利益。

### 4、股指期货的投资风险

本基金可投资股指期货，股指期货采用保证金交易制度，由于保证金交易具有杠杆性，当出现不利行情时，股价指数微小的变动就可能会使投资人权益遭受较大损失。股指期货采用每日无负债结算制度，如果没有在规定的时间内补足保证金，按规定将被强制平仓，可能给投资带来重大损失。

### 5、国债期货的投资风险

本基金可投资国债期货，可能给本基金带来额外风险，包括杠杆风险、期货价格与基金投资品种价格的相关度降低带来的风险等，由此可能增加本基金净值的波动性。

### 6、投资存托凭证的风险

本基金的投资范围包括存托凭证。存托凭证是新证券品种，本基金投资存托凭证在承担境内上市交易股票投资的共同风险外，还将承担与存托凭证、创新企业发行、境外发行人以及交易机制相关的特有风险。

### 7、证券经纪商交易结算模式的风险

本基金采用证券经纪商交易结算模式，即本基金将通过基金管理人选定的证券经营机构进行场内交易和结算，该种交易结算模式可能存在操作风险、资金使用效率降低的风险、交易结算风险、投资信息安全保密风险、无法完成当日估值等风险。

---

---

## 8、委托基金服务机构提供份额登记、估值与核算等事项的外包风险

基金管理人将本基金份额登记、估值与核算等事项外包给国泰君安证券股份有限公司办理，届时因基金服务机构不符合金融监管部门规定的资质要求或因服务机构经营风险、技术系统故障、操作失误等，可能使得运营服务事项发生差错，给本基金运营带来风险。

## 六、其他风险

1、随着符合本基金投资理念的新投资工具的出现和发展，如果投资于这些工具，基金可能会面临一些特殊的风险；

2、因技术因素而产生的风险，如电脑系统不可靠产生的风险；

3、因基金业务快速发展而在制度建设、环境控制、人员素质等方面不完善而产生的风险；

4、因人为因素而产生的风险，如上市公司治理结构问题、内幕交易、不公正披露等欺诈行为、上市停止交易等产生的风险；

5、对主要业务人员如基金经理的依赖而可能产生的风险；

6、战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金资产的损失，影响基金收益水平，从而带来风险；

7、其他意外导致的风险。

七、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。

## 第十八部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### 一、《基金合同》的变更

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

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效，自生效后方可执行，自决议生效后依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

### 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《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《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，保存期限不少于法律法规规定的最低期限。



## 第十九部分 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) 自行或委托其他符合条件的机构办理基金估值核算业务；

(11) 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；

(12) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回或转换申请；

(13) 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；

(14) 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；

(15) 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；

(16) 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；

(17) 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、转换和定期定额投资计划、非交易过户、转托管和收益分配等业务规则；

(18) 若本基金的证券交易模式采用“券商结算”的，委托证券经纪商在证券交易所进行各类证券交易、证券交收，以及相关证券交易的资金交收等证券经纪服务。证券经纪服务的相关权利、义务，由基金管理人与证券经纪商或其他相关服务机构签订《证券经纪服务协议》进行约定；

(19) 若基金份额持有人出现不符合或不遵守基金份额持有人义务的要求或基金份额持有人不符合基金管理人规定的投资本基金的基金投资者资质条件时，基金管理人或销售机构或其授权的第三方将可能采取相关措施，包括但不限于：1) 不接受该基金份额持有人对基金份额进一步的申购申请；2) 对基金份额持有人持有的基金份额进行强制赎回；

(20) 若基金份额持有人出现不再满足相关法律法规或基金管理人规定的基金份额持有人条件，包括但不限于基金投资者可能为美国人士、违反反洗钱、制裁及打击恐怖融资、反贪污贿赂及其他金融犯罪等法律法规要求，基金管理人有权不接受该基金份额持有人对基金份额进一步的申购申请并对该基金份额持有人持有的基金份额进行强制赎回（基金管理人不会向基金投资者披露违反反洗钱要求等事项的具体细节）；

(21) 对于未向基金管理人或其委托的基金销售机构提供反洗钱、反恐怖融资及《涉税尽职调查办法》等相关尽职调查所需信息的基金投资者，基金管理人或销售机构将不接受该基金投资者对基金份额的认购或申购申请；对于未向基金管理人或销售机构提供上述尽职调查所需信息的基金份额持有人，基金管理人或销售机构将采取措施包括但不限于：1) 不接受该基金份额持有人对基金份额进一步的申购申请；2) 对该基金份额持有人持有的基金份额进行强制赎回（基金管理人不会向基金投资者披露违反反洗钱要求等事项的具体细节）。基金管理人或销售机构有权根据反洗钱规则的要求，根据基金投资者的具体情况采取相应的控制措施；

(22) 如基金投资者或基金份额持有人不符合基金管理人规定的投资本基

金的基金投资者资质条件或违反第一部分“前言”承诺的情形或未能提供《涉税尽职调查办法》或相关法律法规或其他有关规定所需信息及/或文件或因基金份额持有人可能为非中国税收居民或受限于《涉税尽职调查办法》或相关法律法规及其他有关规定的任何报告或扣缴义务而损害基金管理人（或其授权的第三方）、本基金或本基金的其他基金份额持有人，本基金及基金管理人（或其授权的第三方）保留采取任何措施及/或就全部损失进行追偿的权利，包括但不限于拒绝接受投资人或基金份额持有人的认购/申购申请、向基金份额持有人提起诉讼/仲裁、对基金份额持有人持有的基金份额进行强制赎回，并且基金份额持有人不可以就本基金或以本基金名义为遵守任何适用法律法规、财政或税收要求（无论是否为法定的）而采取上述措施或进行上述追偿过程中产生的任何形式的损害或责任向本基金及基金管理人（或其授权的第三方）提出任何要求或追偿，若基金份额持有人有严重违反法律法规的行为，有关金融主管部门可依据相关法律法规进行处罚，涉嫌犯罪的，移送司法机关进行处理；

（23）基金管理人为履行法律、法规、监管规定等要求（包括但不限于反洗钱、投资者适当性、税收居民身份调查等方面的要求）或公司内部控制制度的要求，有权收集基金投资者及其最终受益所有人或控制人的相关信息；

（24）基金管理人或其委托的销售机构或其授权的第三方将遵守《涉税尽职调查办法》及相关法律法规就基金份额持有人（及消极非金融机构的控制人）为非中国税收居民的金融账户资料（包括账户持有人名称、现居地址、出生地点及出生日期（适用于个人及控制人）、税务居民国（地区）、居民国（地区）纳税人识别号、账户余额、投资收入等信息）将可能每年被报送至国家税务总局，继而与相应的税收居民国（地区）的主管机构进行信息交换；

（25）基金管理人有权在遵守法律法规的前提下及在必要的情况下，向相关接收方（包括但不限于会计师事务所、律师、份额登记机构等第三方服务机构）提供前述条款所涉及的信息，并将要求接收方不得将该等信息用于违法违规之目的；基金投资者（及其控制人）拒绝提供该等信息的，基金管理人及基金管理人委托的销售机构有权拒绝该等基金投资者的认购/申购申请。基金投资者依据《基金合同》取得基金份额，即表示基金投资者自愿接受上述安排。

（26）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资产净值，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，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，保存期限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内发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件；

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

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

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

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

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

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

(24) 基金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》、《托管协议》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、期货交易资金清算。

(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和证券账户等投资所需账户，按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

(7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露，但向监管机构、司法机关或因审计、法律等外部专业顾问提供服务而向其提供的情况除外；

(8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、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，保存期限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业监督管理机构，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定；

(22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

### (三) 基金份额持有人

基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受，基金投资者自依据《基金合同》取得的基金份额，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。

除法律法规另有规定或基金合同另有约定外，同一类别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、基金产品资料概要等信息披露文件及《业务规则》；
- (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定；
- (8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
- (9) 向基金管理人或其委托的销售机构提供法律法规规定的或基金管理人



根据其内部制度要求的真实、准确、完整、充分的信息资料及身份证明文件，配合基金管理人或其委托的销售机构进行的尽职调查工作，包括但不限于反洗钱尽职调查、非居民金融账户涉税信息尽职调查等，并同意基金管理人在遵守法律法规的前提下授权相关第三方（如有）为反洗钱、制裁、反恐怖融资、非居民金融账户涉税信息尽职调查与信息报送等相关的尽职调查之目的、识别基金投资者是否符合基金管理人规定的投资本基金的基金投资者资质条件之目的查阅该等信息资料及身份证明文件；

（10）按《涉税尽职调查办法》及相关法律法规及其他有关规定的要求，向基金管理人或销售机构或其授权的第三方真实、及时、准确、完整、充分地提供有效税收居民声明文件及证明文件，并在税收居民或其他情况于前述资料发生变更的 30 天内提供有效的税收居民声明文件及证明文件，配合基金管理人或销售机构或其委托第三方完成《涉税尽职调查办法》及相关法律法规及其他有关规定要求的尽职调查及信息报送工作；

（11）知悉若出现不符合或不遵守前述条款的要求或基金份额持有人不符合基金管理人规定的投资本基金的基金投资者资质条件时，基金份额持有人持有的基金份额将可能被基金管理人进行强制赎回；

（12）知悉若出现不再满足相关法律法规或不符合基金管理人规定的投资本基金的基金投资者资质条件时，包括但不限于基金投资者可能为美国人士、违反反洗钱、反贪污贿赂及其他金融犯罪等法律法规要求或违反第一部分“前言”中承诺的情形，基金管理人将有权对该基金份额持有人持有的基金份额进行强制赎回（基金管理人不会向基金投资者披露违反反洗钱要求等事项的具体细节）等相应控制措施；

（13）知悉基金管理人将根据《涉税尽职调查办法》等法律法规的规定，定期向国家税务总局等相关监管机构报送非居民金融账户涉税信息；

（14）知悉并同意基金管理人在遵守法律法规的前提下及在必要的情况下，有权向相关接收方（包括但不限于会计师事务所、律师、份额登记机构等第三方服务机构）提供本基金合同“基金合同当事人及权利义务”中“基金管理人的权利”所述的“非中国税收居民的金融账户”相关信息；如果基金投资者拒绝提供该等信息的，基金管理人及基金管理人委托的销售机构有权拒绝该等基金投资者的认购/申购申请。基金投资者依据《基金合同》取得基金份额，即表示基金投

---

---

资者自愿接受上述安排；

(15) 知悉并持续关注基金管理人官方网站不时披露的个人信息处理相关政策；

(16) 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。

### (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：

(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》约定的范围内且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

(1) 法律法规要求增加的基金费用的收取；

(2) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率或调低销售服务费率，或变更收费方式；

(3) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；

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

(5) 基金管理人、基金登记机构在法律法规规定或中国证监会许可的范围内调整或修改《业务规则》，包括但不限于有关基金认购、申购、赎回、转换、定期定额投资计划、基金交易、非交易过户、转托管、转让、质押、收益分配等内容；

(6) 在履行适当程序后，基金推出新业务或服务；

(7) 新增、减少或调整基金份额类别、停止现有基金份额类别的销售或调整基金份额分类办法及规则；

(8) 按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

## (二) 会议召集人及召集方式

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

2、基金管理人未按规定召集或不能召开时，由基金托管人召集；

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

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

金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开。并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

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

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

### （三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

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

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

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

---

---

#### （四）基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式或法律法规、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书面形式或基金合同约定的其他方式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式或基金合同约定的其他方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

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

（3）本人直接出具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、电话或其他方式等其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。基金份额持有人可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式进行表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

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

#### （五）议事内容与程序

##### 1、议事内容及提案权

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

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

##### 2、议事程序

###### （1）现场开会

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

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

## （2）通讯开会

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

## （六）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1、一般决议，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（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。除法律法规另有规定或基金合同另有约定外，转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》、本基金与其他基金合并以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

---

---

基金份额总数。

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

### （七）计票

#### 1、现场开会

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

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

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

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

#### 2、通讯开会

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

### （八）生效与公告

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

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起依照《信息披露办法》的有关规定



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

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

#### （九）实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定

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

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

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

3、通讯开会的直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日相关基金份额的二分之一（含二分之一）；

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

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

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

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

侧袋机制实施期间，基金份额持有人大会审议事项涉及主袋账户和侧袋账

户的，应分别由主袋账户、侧袋账户的基金份额持有人进行表决，同一主侧袋账户内的每份基金份额具有平等的表决权。表决事项未涉及侧袋账户的，侧袋账户份额无表决权。

侧袋机制实施期间，关于基金份额持有人大会的相关规定以本节特殊约定内容为准，本节没有规定的适用本部分的相关规定。

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

### 三、基金收益分配原则、执行方式

#### (一) 基金利润的构成

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，基金管理人可对本基金进行基金分红，具体分配方案详见届时基金管理人发布的公告；若基金合同生效不满 3 个月，本基金可不进行收益分配。

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可对 A 类、C 类基金份额分别选择不同的分红方式，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。

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

4、同一类别每一基金份额享有同等分配权；由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同。

---

---

#### 5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在遵守法律法规和监管部门的规定，且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人在与基金托管人协商一致并按照监管部门要求履行适当程序后可对基金收益分配原则和支付方式进行调整，不需召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前依据《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

#### （四）收益分配方案

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

#### （五）收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，依据《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。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。

#### （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，详见招募说明书的规定。

### 四、与基金财产管理、运作有关费用的提取、支付方式与比例

#### （一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、本基金从 C 类基金份额的基金资产中计提的销售服务费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用，但法律法规、中国证监会另有规定的除外；
- 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、期货等交易、结算费用；

- 
- 
- 8、基金的银行汇划费用；
  - 9、基金相关账户的开户和维护费用；
  - 10、因投资港股通标的股票而产生的各项合理费用；
  - 11、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 1.20% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，按照双方约定的时间，自动于次月初五个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 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

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，按照双方约定的时间，自动于次月初五个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

### 3、C 类基金份额的销售服务费

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 0.40%。

本基金 C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.40% 年费率计提。计算方法如下：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

C 类基金份额的销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，按照双方约定的时间，自动于次月初五个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

上述“一、基金费用的种类”中第 4—11 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。

## 五、基金财产的投资方向和投资限制

### （一）投资目标

在有效控制投资组合风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报和中长期稳定的资产增值。

### （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,包括国内依法发行或上市的股票（包括主板、创业板和其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、港股通标的股票，债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、证券公司短期公司债券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券），衍生品（包括股指期货、国债期货），资产支持证券，货币市场工具，同业存单，债券回购，银行存款（包括协议存款、定期存款、通知存款和其他银行存款）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。

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。

本基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为**60%-95%**，其中，港股通标的股票投资不超过股票资产的**20%**。每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货需缴纳的交易保证金后，本基金持有不低于基金资产净值的**5%**的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金，存出保证金，应收申购款等。

如果法律法规对上述投资比例要求有变更的，本基金可在履行适当程序后相应调整，并以调整变更后的投资比例为准。

### （三）投资限制

#### 1、组合限制

本基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金股票投资占基金资产的比例为**60%-95%**，其中，港股通标的股票投资不超过股票资产的**20%**；

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

（3）本基金持有一家公司发行的证券，其市值（若同时持有一家公司发行的A股和H股，则为A股与H股合计市值）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（若同时持有一家公司发行的A股和H股，则为A股与H股合计市值），不超过该证券的**10%**；

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

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

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

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

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

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

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

(11) 本基金持有的单只证券公司短期公司债券，其市值不得超过本基金资产净值的 10%；

(12) 本基金参与股指期货、国债期货交易，遵守下列投资比例限制：

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

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

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

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

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

6) 本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的 15%；

7) 本基金在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%；

8) 本基金所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定；

9) 本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 30%；

(13) 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

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%；

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

(15) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与本基金合同约定的投资范围保持一致；

(16) 本基金资产总值不超过基金资产净值的 140%；

(17) 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；

(18) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述(2)、(9)、(15)情形之外，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资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本基金合同生效之日起开始。

如果法律法规或监管部门对上述投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

## 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。如法律、行政法规或监管部门取消或变更上述限制，基金管理人在履行适当程序后，本基金可不受上述规定的限制或以变更后的规定为准。

## 六、基金净值信息的计算方法和公告方式

### (一) 计算方法

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

各类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，由此产生的收益或损失由基金资产承担。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。

### (二) 公告方式

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

## 七、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### (一) 《基金合同》的变更

#### 1、变更基金合同涉及法律法规规定或本合同约定应经基金份额持有人大会

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

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效，自生效后方可执行，自决议生效后依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

#### （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《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《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，保存期限不少于法律法规规定的最低期限。

八、争议的处理和适用的法律

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议应通过协商、调解解决，如经友好协商、调解未能解决的，应提交上海国际经济贸易仲裁委员会（上海国际仲裁中心），根据提交仲裁时该会届时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为上海市。仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，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、澳门特别行政区和台湾地区法律）管辖并从其解释。

---

---

## 九、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

## 第二十部分 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（或简称“管理人”）

名称：安联基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区临港新片区环湖西二路 888 号 B 楼  
1108 室

法定代表人：沈良

成立时间：2023 年 9 月 13 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：证监许可【2023】1888 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：人民币 30000.0000 万

经营范围：公开募集证券投资基金管理、基金销售、私募资产管理

存续期间：持续经营

#### (二) 基金托管人（或简称“托管人”）

名称：中国银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：葛海蛟

成立时间：1983 年 10 月 31 日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元  
整

经营范围：吸收人民币存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；从事同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱服务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；发

行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代客外汇买卖；外汇信用卡的发行和代理国外信用卡的发行及付款；资信调查、咨询、见证业务；组织或参加银团贷款；国际贵金属买卖；海外分支机构经营与当地法律许可的一切银行业务；在港澳地区的分行依据当地法令可发行或参与代理发行当地货币；经中国人民银行批准的其他业务。

存续期间：持续经营

## 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对基金管理人的下列投资运作进行监督：

### 1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行或上市的股票（包括主板、创业板和其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、港股通标的股票，债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、证券公司短期公司债券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券），衍生品（包括股指期货、国债期货），资产支持证券，货币市场工具，同业存单，债券回购，银行存款（包括协议存款、定期存款、通知存款和其他银行存款）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。

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。

本基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为**60%-95%**，其中，港股通标的股票投资不超过股票资产的**20%**。每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货需缴纳的交易保证金后，本基金持有不低于基金资产净值的**5%**的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金，存出保证金，应收申购款等。

如果法律法规对上述投资比例要求有变更的，本基金可在履行适当程序后相应调整，并以调整变更后的投资比例为准。

---

---

## 2、对基金投融资比例进行监督；

本基金的投资组合应遵循以下限制：

(1) 本基金股票投资占基金资产的比例为 **60%-95%**，其中，港股通标的股票投资不超过股票资产的 **20%**；

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

(3) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值（若同时持有一家公司发行的 A 股和 H 股，则为 A 股与 H 股合计市值）不超过基金资产净值的 **10%**；

(4) 本基金管理人管理的且在本托管人处托管的全部基金持有一家公司发行的证券（若同时持有一家公司发行的 A 股和 H 股，则为 A 股与 H 股合计市值），不超过该证券的 **10%**；

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

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

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

(8) 本基金管理人管理的且在本托管人处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) 本基金持有的单只证券公司短期公司债券，其市值不得超过本基金资产净值的 **10%**；

(12) 本基金参与股指期货、国债期货交易，遵守下列投资比例限制：

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

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

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

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

5) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值, 合计 (轧差计算) 应当占基金资产的 **60%-95%**, 以符合基金合同关于股票投资比例的有关约定;

6) 本基金在任何交易日日终, 持有的买入国债期货合约价值, 不得超过基金资产净值的 **15%**;

7) 本基金在任何交易日日终, 持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 **30%**;

8) 本基金在任何交易日内交易 (不包括平仓) 的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 **30%**;

(13) 本基金管理人管理的且在本托管人处托管的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票, 不得超过该上市公司可流通股票的 **15%**; 本基金管理人管理的且在本托管人处托管的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票, 不得超过该上市公司可流通股票的 **30%**;

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

(15) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的, 可接受质押品的资质要求应当与本基金合同约定的投资范围保持一致;

(16) 本基金资产总值不超过基金资产净值的 **140%**;

(17) 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；

（18）法律法规及中国证监会规定的其他投资比例限制。

除上述（2）、（9）、（15）情形之外，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资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本基金合同生效之日起开始。

如果法律法规或监管部门对上述投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

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变更上述限制，基金管理人在履行适当程序后，本基金可不受上述规定的限制或以变更后的规定为准。

（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、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、相关信息披露登载基金业绩表现数据等进行复核。

（三）基金托管人在上述第（一）、（二）款的监督和核查中发现基金管理人违反上述约定，应及时提示基金管理人，基金管理人收到提示后应及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函并改正。在限期内，基金托管人有权随时对提示事项进行复查。基金管理人对基金托管人提示的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应及时向中国证监会报告。

（四）基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律法规、本协议的规定，应当拒绝执行，及时提示基金管理人，并依照法律法规的规定及时向中国证监会报告。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法规、本协议规定的，应当及时提示基金管理人，并依照法律法规的规定及时向中国证监会报告。

（五）基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查，包括但不限于：在规定时间内答复基金托管人并改正，就基金托管人的疑义进行解释或举证，提供相关数据资料和制度等。

### 三、基金管理人 对基金托管人的业务核查

1、在本协议的有效期内，在不违反公平、合理原则以及不妨碍基金托管人遵守相关法律法规及其行业监管要求的基础上，基金管理人有权对基金托管人履行本协议的情况进行必要的核查，核查事项包括但不限于基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户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。

2、基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、无正当理由未执行或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法律法规、《基金合同》及本协议有关规定时，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，基金管理人应依照法律法规的规定报告中国证监会。

3、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。对基金管理人按照法规要求需向中国证监会提交基金监督报告的，基金托管人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

### 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，未经基金管理人的合法合规指令或法

律法规、《基金合同》及本协议另有规定，不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。

3、基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户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，与基金托管人的其他业务和其他基金的托管业务实行严格的分账管理，独立核算、分账管理，确保基金财产的完整与独立。

5、除依据《基金法》、《运作办法》、《基金合同》及其他有关法律法规规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

## （二）基金合同生效前募集资金的验资和入账

1、募集期内销售机构按销售协议的约定，将认购资金划入基金管理人在具有托管资格的商业银行开设的“基金募集专户”。该账户由基金管理人或其委托的基金服务机构开立并管理。基金募集期满或基金管理人宣布停止募集时，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》等有关规定的，由基金管理人在法定期限内聘请具有从事相关业务资格的会计师事务所对基金进行验资，并出具验资报告，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方为有效。

2、基金管理人应将属于本基金财产的全部资金划入在基金托管人处为本基金开立的托管账户中，并确保划入的资金与验资确认金额相一致。

3、若基金募集期限届满，未能达到《基金合同》生效的条件，由基金管理人按规定办理退款事宜，基金托管人应提供必要协助。

## （三）基金的银行账户的开设和管理

1、基金托管人应负责本基金的银行账户（即“托管账户”）的开设和管理。

2、基金托管人以本基金的名义开设本基金的银行账户。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。本基金除证券交易所场内交易以外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、收取申购款，均需通过本基金的银行账户进行。

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

---

---

#### 4、基金银行账户的开设和管理应符合法律法规的有关规定。

##### （四）基金进行定期存款投资的账户开设和管理

基金管理人以基金名义在基金托管人认可的存款银行的指定营业网点开立存款账户，基金托管人负责该账户银行预留印鉴的保管和使用。在上述账户开立和账户相关信息变更过程中，基金管理人应提前向基金托管人提供开户或账户变更所需的相关资料。

##### （五）基金证券账户、证券资金账户及其他投资账户的开设和管理

1、基金托管人应当代表本基金，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设证券账户。

2、基金管理人为基金财产在证券经纪机构开立证券资金账户，用于基金财产证券交易结算资金的存管、记载交易结算资金的变动明细以及场内证券交易清算，并与基金托管人开立的托管账户建立第三方存管对应关系。

3、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立的证券资金账户中，场内的证券交易资金清算由基金管理人选择的证券经纪机构负责，基金托管人不负责办理场内的证券交易资金清算。

4、本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转让本基金的证券账户，亦不得使用本基金的证券账户进行本基金业务以外的活动。

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的，涉及相关账户的开设、使用的，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。

##### （六）债券托管专户的开设和管理

基金合同生效后，基金管理人负责以基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表基金进行交易；由基金管理人负责向中国人民银行报备，在上述手续办理完毕之后，基金托管人负责以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司和银行间市场清算所股份有限公司开设银行间债券市场债券托管账户和资金结算专户，并代表基金进行银行间债券市场债券和资金的清算。

##### （七）期货账户的开设和管理

基金托管人、基金管理人应当代表本基金，按照相关规定配合期货经纪商开立期货结算账户、期货资金账户，并在中国金融期货交易所获取交易编码。期货结算账户名称、期货资金账户名称及交易编码对应名称应按照规定设立，具体根据签署的《期货投资操作备忘录》开立和管理。

#### （八）基金财产投资的有关有价凭证的保管

基金财产投资的实物证券、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。基金托管人对其以外机构实际有效控制的有价凭证不承担责任。

#### （九）与基金财产有关的重大合同及有关凭证的保管

基金托管人按照法律法规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及有关凭证。基金管理人代表基金签署有关重大合同后应在收到合同正本后 30 日内将一份正本的原件提交给基金托管人。除本协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时应当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。重大合同由基金管理人与基金托管人按规定各自保管期限不少于法律法规的规定。

对于无法取得二份以上的正本的，基金管理人应向基金托管人提供与合同原件核对一致并加盖公章的合同复印件或传真件，未经双方协商一致，合同原件不得转移。

### 五、基金资产净值计算和会计核算

#### （一）基金资产净值的计算和复核

1、基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。各类基金份额净值是指计算日各类基金资产净值除以计算日该类基金份额总数后的价值。本基金各类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计入基金财产。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。

2、基金管理人或其委托的基金服务机构应每个工作日对基金财产估值，但基金管理人根据法律法规或《基金合同》的规定暂停估值时除外。估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算业务指引》及其他法律法规的规定。用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人或其委托的基金服务机构负责计算，基金托管人复核。基金管理人或其委托的基金服务机构应于每个工作日结束后计算得出当日的各类基金份额净值，并以双方约定的方

---

---

式发送给基金托管人。基金托管人应对净值计算结果进行复核，并以双方约定的方式将复核结果传送给基金管理人，由基金管理人对外公布。月末、季末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

3、当相关法律法规或《基金合同》规定的估值方法不能客观反映基金财产公允价值时，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。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，暂停披露侧袋账户份额净值。

4、基金管理人、基金托管人发现基金估值违反《基金合同》订明的估值方法、程序以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，双方应及时进行协商和纠正。

5、当基金资产的估值导致基金份额净值小数点后四位内（含第四位）发生差错时，视为基金份额净值估值错误。当基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当计价错误达到基金份额净值的 0.25%时，基金管理人应当通知基金托管人并报中国证监会备案；当计价错误达到基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当通知基金托管人，在报中国证监会备案的同时及时进行公告。如法律法规或监管机关对前述内容另有规定的，按其规定处理。

6、由于基金管理人对外公布的任何基金净值数据错误，导致该基金财产或基金份额持有人的实际损失，基金管理人应对此承担责任。若基金托管人计算的净值数据正确，则基金托管人对该损失不承担责任；若基金托管人计算的净值数据也不正确，则基金托管人也应承担部分未正确履行复核义务的责任。如果上述错误造成了基金财产或基金份额持有人的不当得利，且基金管理人及基金托管人已各自承担了赔偿责任，则基金管理人应负责向不当得利之主体主张返还不当得利。如果返还金额不足以弥补基金管理人已承担的赔偿金额，则双方按照各自赔偿金额的比例对返还金额进行分配。

7、由于不可抗力原因，或由于证券交易所、期货交易所、证券经纪机构、期货经纪机构、登记结算机构、第三方估值机构及存款银行等第三方机构发送的数据错误、遗漏，或国家会计政策变更、市场规则变更等非基金管理人与基金托管人原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措

施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。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。

8、如果基金托管人的复核结果与基金管理人的计算结果存在差异，且双方经协商未能达成一致，基金管理人可以按照其对基金份额净值的计算结果对外予以公布，基金托管人可以将相关情况报中国证监会备案。

## （二）基金会计核算

### 1、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、登记和保管基金的全套账册，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。

### 2、会计数据和财务指标的核对

基金管理人和基金托管人应定期就会计数据和财务指标进行核对。如发现存在不符，双方应及时查明原因并纠正。

### 3、基金财务报表和定期报告的编制和复核

基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。月度报表的编制，应于每月终了后 5 个工作日内完成；《基金合同》生效后，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，更新招募说明书并登载在规定网站上。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招募说明书和基金产品资料概要。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指定报刊上。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指定报刊上。基金管理人应当在季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，将季度报告登载在规定网站上，并将季度报告提示性公告登载在指定报刊上。基金合同生效不足

两个月的，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部门公章或者出具加盖托管业务部门公章的复核意见书或进行电子确认，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证监会备案。

#### 六、基金份额持有人名册的保管

基金份额持有人名册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基金登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，基金管理人和基金托管人应分别保管基金份额持有人名册，基金登记机构保存期不少于法律法规规定的期限，法律法规另有规定或有权机关另有要求的除外。如不能妥善保管，则按相关法规承担责任。

在基金托管人要求或编制中期报告和年度报告前，基金管理人应将依据法律法规规定或为履行本协议义务应获悉的有关资料送交基金托管人，不得无故拒绝或延误提供，并保证其真实性、准确性和完整性。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。

#### 七、争议解决方式

（一）本协议适用中华人民共和国法律（为本协议之目的，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区法律）并从其解释。

（二）基金管理人与基金托管人之间因本协议产生的或与本协议有关的争议可通过友好协商解决。但若自一方书面提出协商解决争议之日起 60 日内争议未能以协商方式解决的，则任何一方有权将争议提交位于上海的上海国际经济贸易仲裁委员会（上海国际仲裁中心），并按其时有效的仲裁规则进行仲裁。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，仲裁费由败诉方承担。

（三）除争议所涉的内容之外，本协议的当事人仍应履行本协议的其他规定。



---

---

## 八、基金托管协议的变更、终止与基金财产的清算

### （一）托管协议的变更

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

### （二）托管协议的终止

发生以下情况，本托管协议应当终止：

- 1、《基金合同》终止；
- 2、本基金更换基金托管人；
- 3、本基金更换基金管理人；
- 4、发生《基金法》、《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

基金管理人和基金托管人应按照《基金合同》及有关法律法规的规定对本基金的财产进行清算。

## 第二十一部分 对基金份额持有人的服务

对于基金份额持有人，基金管理人将根据具体情况提供以下一系列的服务，并将根据基金份额持有人的需要和市场的变化，增加或变更服务项目。如因系统、第三方或不可抗力等原因，导致下述服务无法提供，基金管理人不承担任何责任。主要服务内容如下：

### 一、查询服务

基金管理人提供 24 小时自助语音服务，每个交易日基金管理人还提供人工热线查询服务。

基金份额持有人可通过以上方式查询所持有的基金份额、交易确认记录等账户信息；持有人和潜在投资者还可通过以上方式及管理人公司官方网站获取基金和基金管理人依法披露的各类信息，包括基金法律文件、基金公告和基金管理人最新动态等各类资料。

基金份额持有人亦可通过销售机构的网点查询和打印确认单。

### 二、信息定制服务

基金份额持有人可以拨打客服热线电话提交信息定制申请。基金管理人通过手机短信、电子邮件或其他方式按基金份额持有人的定制提供信息。基金管理人可以根据实际业务需要，调整定制信息的条件、方式和内容。

### 三、资料寄送服务

基金份额持有人（仅限直销客户）如有需求，可致电基金管理人直销柜台索取基金对账单、产品宣传推介材料等纸质资料。

### 四、投诉及建议受理服务

基金份额持有人可以通过销售机构网点或基金管理人客服热线电话、信函及电子邮件、传真等形式对基金管理人或销售网点所提供的服务进行投诉或提出建议。

### 五、基金管理人客服中心联系方式

客户服务热线：021-38917777

客服邮箱：[customerservice@allianzgi.com.cn](mailto:customerservice@allianzgi.com.cn)

地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 479 号上海中心大厦 33 层 3301-3304 室

---

---

传真：021-38067110

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

六、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。

---

---

## 第二十二部分 招募说明书的存放及查阅方式

### 一、招募说明书的存放地点

本招募说明书存放在基金管理人、基金托管人和销售机构的办公场所，并刊登在基金管理人的网站上。

### 二、招募说明书的查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅本基金的招募说明书，也可按工本费购买本招募说明书的复印件，但应以本基金招募说明书的正本为准。

---

---

## 第二十三部分 备查文件

- 1、中国证监会准予安联中国精选混合型证券投资基金注册的文件
- 2、《安联中国精选混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《安联中国精选混合型证券投资基金托管协议》
- 4、律师事务所法律意见书
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 7、中国证监会要求的其他文件

安联基金管理有限公司

2024年8月7日