# 建信高端装备股票型证券投资基金
# 招募说明书（更新）

基金管理人：建信基金管理有限责任公司

基金托管人：光大证券股份有限公司

二〇二六年九月

【重要提示】

本基金经中国证券监督管理委员会 2021 年 1 月 26 日证监许可[2021]266 号文注册募集。本基金的基金合同于 2021 年 4 月 27 日正式生效。

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

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

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资人在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资人连续大量赎回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，本基金的特定风险等。

本基金为股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

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

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。

投资有风险，投资人在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的招募说明书、基金合同、基金产品资料概要等信息披露文件，了解基金的风险收益特征，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断本基金是否和自身的风险承受能力相适应。投资者承诺不使用贷款、发行债券等筹集的非自有资金投资本基金。

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不构成对本基金业绩表现的保证。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引致的投资风险，由投资者自行负责。

本招募说明书所载内容截止日为 2026 年 8 月 31 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2026 年 6 月 30 日（财务数据未经审计）。本招募说明书已经基金托管人复核。

# 目 录

第一部分 前言 ..... 2
第二部分 释义 ..... 3
第三部分 基金管理人 ..... 9
第四部分 基金托管人 ..... 17
第五部分 相关服务机构 ..... 22
第六部分 基金份额的发售 ..... 40
第七部分 基金合同的生效 ..... 45
第八部分 基金份额的申购与赎回 ..... 46
第九部分 基金的投资 ..... 58
第十部分 基金的业绩 ..... 72
第十一部分 基金的财产 ..... 72
第十二部分 基金资产估值 ..... 75
第十三部分 基金的收益与分配 ..... 82
第十四部分 基金费用与税收 ..... 84
第十五部分 基金的会计与审计 ..... 87
第十六部分 基金的信息披露 ..... 88
第十七部分 侧袋机制 ..... 96
第十八部分 风险揭示 ..... 99
第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算 ..... 108
第二十部分 《基金合同》的内容摘要 ..... 110
第二十一部分 《托管协议》的内容摘要 ..... 127
第二十二部分 对基金份额持有人的服务 ..... 145
第二十三部分 其他应披露事项 ..... 148
第二十四部分 招募说明书的存放及查阅方式 ..... 149
第二十五部分 备查文件 ..... 150

# 第一部分 前言

《建信高端装备股票型证券投资基金招募说明书》（以下简称“本招募说明书”）依据《中华人民共和国民法典》（以下简称“《民法典》”）、《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的规定以及《建信高端装备股票型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”或“《基金合同》”）编写。

本招募说明书阐述了建信高端装备股票型证券投资基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资人投资决策有关的全部必要事项，投资人在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、误导性陈述或者重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本招募说明书由建信基金管理有限责任公司负责解释。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任何解释或者说明。

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

# 第二部分 释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

1、基金或本基金：指建信高端装备股票型证券投资基金

2、基金管理人：指建信基金管理有限责任公司

3、基金托管人：指光大证券股份有限公司

4、基金合同：指《建信高端装备股票型证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充

5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《建信高端装备股票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、招募说明书或本招募说明书：指《建信高端装备股票型证券投资基金招募说明书》及其更新

7、基金份额发售公告：指《建信高端装备股票型证券投资基金基金份额发售公告》

8、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等

9、《基金法》：指2003年10月28日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，经2012年12月28日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自2013年6月1日起实施，并经2015年4月24日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改<中华人民共和国港口法>等七部法律的决定》修正的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订

10、《销售办法》：指中国证监会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

11、《信息披露办法》：指中国证监会2019年7月26日颁布、同年9月1日实施的，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

12、《运作办法》：指中国证监会 2014 年 7 月 7 日颁布、同年 8 月 8 日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

13、《流动性风险管理规定》：指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订

14、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

15、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行保险监督管理委员会

16、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

17、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

18、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

19、合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者境内证券期货投资管理办法》（包括颁布机关对其不时做出的修订）及相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者

20、人民币合格境外机构投资者：指按照《合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者境内证券期货投资管理办法》（包括颁布机关对其不时做出的修订）及相关法律法规规定，运用来自境外的人民币资金进行境内证券投资的境外法人

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

22、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

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

24、销售机构：指建信基金管理有限责任公司以及符合《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

25、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

26、登记机构：指办理登记业务的机构。基金的登记机构为建信基金管理有限责任公司或接受建信基金管理有限责任公司委托代为办理登记业务的机构

27、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

28、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

29、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

30、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

31、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

32、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

33、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

34、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

35、T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日(不包含 T 日)

36、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，但若本基金参与港股通交易且该工作日为非港股通交易日时，则基金管理人可

根据实际情况决定本基金是否开放申购、赎回及转换业务，具体以届时提前发布的公告为准

37、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

38、《业务规则》：指《建信基金管理有限责任公司开放式基金业务规则》，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人共同遵守

39、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

40、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

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

42、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

43、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

44、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

45、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%

46、元：指人民币元

47、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

48、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

49、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

50、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

51、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

52、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

53、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

54、港股通：指内地投资者委托内地证券公司，经由境内证券交易所设立的证券交易服务公司，向香港联合交易所进行申报，买卖规定范围内的香港联合交易所上市的股票

55、流动性受限资产：指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等

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

57、基金份额类别：指根据认购/申购费用、赎回费用、销售服务费用收取方式等不同将本基金基金份额分为不同的类别，各基金份额类别分别设置代码，并分别计算和公告基金份额净值

58、A 类基金份额：指在投资人认购/申购时收取认购/申购费用但不从本类别基金资产中计提销售服务费、赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额类别

59、C 类基金份额：指从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取认购/申购费用、赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额类别 60、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

61、基金产品资料概要：指《建信高端装备股票型证券投资基金基金产品资料概要》及其更新

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：（1）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；（2）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；（3）其他资产价值存在重大不确定性的资产

# 第三部分 基金管理人

一、基金管理人概况

名称：建信基金管理有限责任公司

住所：北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 16 层

办公地址：北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 16 层

设立日期：2005 年 9 月 19 日

法定代表人：曲寅军

联系人：郭雅莉

电话：010-66228888

注册资本：人民币 2 亿元

建信基金管理有限责任公司经中国证监会证监基金字[2005]158 号文批准设立。公司的股权结构如下：中国建设银行股份有限公司，65%；信安金融服务公司，25%；中国华电集团产融控股有限公司，10%。

本基金管理人公司治理结构完善，经营运作规范，能够切实维护基金投资者的利益。股东会为公司的权力机构，由全体股东组成。公司章程中明确公司股东通过股东会依法行使权利，不以任何形式直接或者间接干预公司的经营管理和基金资产的投资运作。

董事会对股东会负责，并向股东会汇报。公司董事会由 9 名董事组成，其中 3 名为独立董事。根据公司章程的规定，董事会行使《公司法》规定的有关重大事项的决策权、对公司基本制度的制定权和对总裁等高级管理人员的评价和奖惩权。

董事会下设审计委员会，审计委员会按照《公司法》及其他法律法规、监管规定及公司章程的规定行使监督职权，包括检查公司财务并监督公司董事、高级管理人员执行职务等。

二、主要人员情况

1、董事会成员

曲寅军先生，执行董事，现任建信基金管理有限责任公司董事长。毕业于中国人民大学金融学专业，获硕士学位。1999 年 7 月加入中国建设银行，先后在总行审计部、团委、重组改制办公室、行长办公室等部门任职；2005 年 5 月

加入建信基金筹备组，公司开业后历任董事会秘书兼综合管理部总监、投资管理部副总监、专户投资部总监、建信资本总经理、建信基金首席战略官兼建信资本总经理等职务，2015 年 8 月任建信基金首席投资官（副总裁），并继续先后兼任建信资本总经理、董事长；此后历任建信股权投资管理有限责任公司副董事长、总裁，建总行金融同业部总经理等职务；2026 年 3 月任建信基金管理有限责任公司党委书记，2026 年 5 月任建信基金管理有限责任公司党委书记、董事长、执行董事。

谢海玉女士，执行董事，现任建信基金管理有限责任公司总裁。毕业于对外经济贸易大学金融学专业，获博士学位。历任中国建设银行总行资金部科员、香港资金交易室一级业务员、资金交易部业务经理、高级副经理、金融市场部处长等职务；2017 年 7 月起历任建信金融资产投资有限公司首席投资官、副总裁等职务，2018 年 8 月起兼任建信金投私募基金管理（北京）有限公司[原建信金投私募基金管理（天津）有限公司]执行董事（至 2024 年 11 月）、总经理（至 2024 年 1 月）；2024 年 11 月起任建信基金管理有限责任公司党委副书记；2024 年 12 月起任建信基金管理有限责任公司党委副书记、总裁、执行董事。

钟蓉萨女士，董事，现任美国信安金融集团副总裁、中国区负责人。毕业于中国人民大学统计学专业，获经济学学士学位。历任中国证监会信息统计部信息中心主任科员、副处长、处长和机构监管部处长，中国证券业协会党委委员、副秘书长，中国证券投资基金业协会党委委员、副秘书长、副会长。

陈惠燕女士，董事，现任信安亚洲区财务总监。1993 年毕业于新加坡南洋理工大学，获学士学位。2001 年毕业于悉尼理工大学，获硕士学位。2002 年至 2021 年，在英国保诚集团旗下翰亚投资公司工作，历任亚洲总部财务部经理、财务部高级经理、财务部副总监和财务总监。

宋金文先生，董事，现任中国华电集团产融控股有限公司财务资产部总经理，会计学专业学士学位。历任中车投资租赁有限公司资金主管、预算主管、决算主管，中国华电集团产融控股有限公司财务资产部总经理助理、人力资源部主任助理、人力资源部副主任、财务资产部副总经理。

吴岚女士，独立董事，现任北京大学数学科学学院金融数学系主任、教授。1999 年获北京大学理学博士学位。1990 年硕士研究生毕业后在北京大学（原）

概率统计系、数学科学学院金融数学系担任教学科研工作。2003 年至今担任北京大学数学科学学院金融数学系主任。

姚磊先生，独立董事，现任华领私募股权基金管理（北京）有限公司总经理。毕业于对外经济贸易大学，获硕士学位。历任中国国际金融有限公司投资银行部经理、高级经理、副总经理、执行总经理，公司管理部董事总经理，首席财务官；厦门博润资本投资管理有限公司总经理。

王遥女士，独立董事，现任中央财经大学教授，博士生导师。中央财经大学绿色金融国际研究院院长，中央财经大学-北京银行双碳与金融研究中心主任，财经研究院、北京财经研究基地研究员。中国金融学会绿色金融专业委员会副秘书长，中国证券业协会绿色发展委员会顾问。剑桥大学可持续领导力研究院研究员，牛津大学史密斯企业与环境学院可持续金融项目咨询委员会专家，卢森堡证券交易所咨询顾问。2021 担任联合国开发计划署中国生物多样性金融“BIOFIN”项目首席技术顾问；之前任 SDG 影响力融资研究与推广首席顾问。

莫红女士，职工董事，现任建信基金管理有限责任公司副总裁。毕业于四川大学刑事诉讼法证据法学专业，获博士学位。曾在四川省高级人民法院、四川省纪委、四川省纪委监委任职，从事涉及经济、金融方面的法律工作和对金融企业的纪检监察工作。2021 年 8 月任中国建设银行资产保全部负责人。2023 年 6 月起任建信基金管理有限责任公司党委委员，2024 年 2 月起任建信基金管理有限责任公司党委委员、首席运营官，2024 年 10 月任建信基金管理有限责任公司党委委员、副总裁、首席运营官。

2、公司高管人员

谢海玉女士，总裁（简历请参见董事会成员）。

莫红女士，副总裁（简历请参见董事会成员）。

张铮先生，副总裁、财务负责人，硕士。1997 年 4 月加入中国建设银行总行，先后在资金计划部、计划财务部、资金部、资金交易部、金融市场部、香港资金运营中心、财富管理与私人银行部、私人银行部等部门工作，曾长期从事金融市场研究、资金交易、本币投资等业务。2024 年 12 月起任建信基金管理有限责任公司党委委员，2025 年 1 月起任建信基金管理有限责任公司党委委员、副总裁，2025 年 11 月起任建信基金管理有限责任公司党委委员、副总裁、

财务负责人。

刘大超先生，副总裁，硕士。曾在合肥三宇集团工作。2003 年 7 月加入中国建设银行总行，先后在基金托管部、投资托管服务部、资产托管业务部工作，长期从事基金托管业务。2025 年 7 月起任建信基金管理有限责任公司党委委员，2025 年 8 月起任建信基金管理有限责任公司党委委员、副总裁。

吴曙明先生，首席风险官、督察长，硕士。1992 年 7 月至 1996 年 8 月在湖南省物资贸易总公司工作；1999 年 7 月加入中国建设银行，先后在总行营业部、金融机构部、机构业务部从事信贷业务和证券业务，历任科员、副主任科员、主任科员、机构业务部高级副经理等职；2006 年 3 月加入建信基金管理有限责任公司，担任董事会秘书，并兼任综合管理部总经理。2015 年 8 月起任建信基金管理有限责任公司督察长、董事会秘书，2016 年 12 月起任建信基金管理有限责任公司副总裁（首席风险官）、督察长，2017 年 11 月起任建信基金管理有限责任公司党委委员、副总裁（首席风险官）、督察长，2024 年 6 月起任建信基金管理有限责任公司党委委员、副总裁、督察长，2025 年 4 月起任建信基金管理有限责任公司副总裁、督察长，2025 年 11 月起职务名称由副总裁更名为首席风险官，并继续担任督察长。

安晔先生，首席信息官兼信息技术总监，硕士。1995 年 8 月加入中国建设银行，先后在北京分行信息技术部、总行信息技术部北京开发中心任职；2005 年 9 月加入建信基金管理有限责任公司，一直从事信息技术工作，历任基金运营部副总监、信息技术部副总监（主持工作）、信息技术部总监、信息技术部总经理等职务，2017 年 11 月起任建信基金管理有限责任公司信息技术总监，2026 年 1 月起任建信基金管理有限责任公司首席信息官兼信息技术总监。

3、督察长

吴曙明先生，督察长（简历请参见公司高级管理人员）

4、基金经理

黄子凌先生，硕士。2015 年 7 月毕业于清华大学机械工程专业，同年 7 月加入建信基金研究部，历任助理研究员、研究员、高级行业研究员、基金经理。2021 年 4 月 27 日起任建信高端装备股票型证券投资基金的基金经理；2024 年 3 月 29 日起任建信环保产业股票型证券投资基金的基金经理；2025 年 12 月 2

日起任建信科技智选股票型发起式证券投资基金的基金经理。

本基金历任基金经理：

孙晟 ： 2021 年 04 月 27 日 至 2025 年 01 月 21 日

黄子凌 ： 2021 年 04 月 27 日 至今

5、公司投资决策委员会成员

谢海玉女士，总裁。

张 铮先生，副总裁。

吴曙明先生，首席风险官。

陈正宪先生，总裁特别助理。

乔 梁先生，投研总监。

陶 灿先生，权益投资部总经理。

陈建良先生，固定收益投资部总经理。

田元泉先生，研究部总经理。

江 源女士，多元资产投资部副总经理。

叶乐天先生，数量投资部副总经理。

娄晓辰女士，国际投资与业务发展部总经理。

卜 蕊女士，不动产基金管理部总经理。

张铮铮先生，投资风险管理部副总经理。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

三、基金管理人的职责

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

2、办理基金备案手续；

3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；

4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

6、编制季度报告、中期报告和年度报告；

7、计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回价格；

8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；

9、按照规定召集基金份额持有人大会；

10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

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

12、中国证监会规定的其他职责。

四、基金管理人承诺

1、基金管理人承诺严格遵守《基金法》及相关法律法规，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反上述法律法规行为的发生；

2、基金管理人承诺防止以下禁止性行为的发生：

（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）依照法律、行政法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他行为。

3、基金经理承诺

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

（2）不利用职务之便为自己及其代理人、代表人、受雇人或任何第三人谋取利益；

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

（4）不以任何形式为其它组织或个人进行证券交易。

五、基金管理人的内部控制制度

1、内部控制的原则

（1）全面性原则。内部控制制度覆盖公司的各项业务、各个部门和各级人员，并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个经营环节。

（2）独立性原则。公司设立独立的督察长与监察稽核部门，并使它们保持高度的独立性与权威性。

（3）相互制约原则。公司部门和岗位的设置权责分明、相互牵制，并通过切实可行的相互制衡措施来消除内部控制中的盲点。

（4）有效性原则。公司的内部风险控制工作必须从实际出发，主要通过对工作流程的控制，进而实现对各项经营风险的控制。

（5）防火墙原则。公司的投资管理、基金运作、计算机技术系统等相关部门，在物理上和制度上适当隔离。对因业务需要知悉内幕信息的人员，制定严格的批准程序和监督处罚措施。

（6）适时性原则。公司内部风险控制制度的制定，应具有前瞻性，并且必须随着公司经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律、法规、政策制度等外部环境的改变及时进行相应的修改和完善。

2、内部控制的主要内容

（1）控制环境

公司董事会重视建立完善的公司治理结构与内部控制体系。基金管理人在董事会下设立了审计委员会和风险控制委员会，负责对公司在经营管理和基金业务运作的合法性、合规性和风险状况进行检查和评估，对公司监察稽核制度的有效性进行评价，监督公司的财务状况，审计公司的财务报表，评价公司的财务表现，保证公司的财务运作符合法律的要求和运行的会计标准。

公司管理层在总裁领导下，认真执行董事会确定的内部控制战略，为了有效贯彻公司董事会制定的经营方针及发展战略，设立了投资决策委员会，就基金投资等发表专业意见及建议。另外，在公司高级管理层下设立了风险管理与内控合规委员会，负责对公司经营管理和基金运作中的风险进行研究，制定相应的控制制度，并实行相关的风险控制措施。

此外，公司设有督察长，全权负责公司的监察与稽核工作，对公司和基金运作的合法性、合规性及合理性进行全面检查与监督，参与公司风险控制工作，发生重大风险事件时向公司董事长和中国证监会报告。

（2）风险评估

公司风险控制人员定期评估公司风险状况，范围包括所有能对经营目标产生负面影响的内部和外部因素，评估这些因素对公司总体经营目标产生影响的程度及可能性，并将评估报告报公司董事会及高层管理人员。

（3）操作控制

公司内部组织结构的设计方面，体现部门之间职责有分工，但部门之间又相互合作与制衡的原则。基金投资管理、基金运作、市场等业务部门有明确的授权分工，各部门的操作相互独立，并且有独立的报告系统。各业务部门之间相互核对、相互牵制。

各业务部门内部工作岗位分工合理、职责明确，形成相互检查、相互制约的关系，以减少舞弊或差错发生的风险，各工作岗位均制定有相应的书面管理制度。

在明确的岗位责任制度基础上，设置科学、合理、标准化的业务操作流程，每项业务操作有清晰、书面化的操作手册，同时，规定完备的处理手续，保存完整的业务记录，制定严格的检查、复核标准。

（4）信息与沟通

公司建立了内部办公自动化信息系统与业务汇报体系，通过建立有效的信息交流渠道，保证公司员工及各级管理人员可以充分了解与其职责相关的信息，保证信息及时送达适当的人员进行处理。

（5）监督与内部稽核

基金管理人设立了独立于各业务部门的风险与合规管理部，履行监督、稽核职能，检查、评价公司内部控制制度合理性、完备性和有效性，监督公司内部控制制度的执行情况，揭示公司内部管理及基金运作中的相关风险，及时提出改进意见，促进公司内部管理制度有效地执行。监察稽核人员具有相对的独立性，定期不定期出具监察稽核报告。

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）基金托管人基本情况

1、基金托管人概况

名称：光大证券股份有限公司（简称“光大证券”）

住所：上海市静安区新闸路 1508 号

法定代表人：刘秋明

成立时间：1996 年 4 月 23 日

批准设立机关和批准设立文号：中国人民银行核发银复［1995］214 号文

组织形式：股份有限公司（台港澳与境内合资、上市）

注册资本：461078.7639 万元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：证监许可〔2020〕1242 号

联系人：窦华宸

通讯地址：上海市静安区新闸路 1508 号

联系电话：021-22167436

光大证券股份有限公司（简称“光大证券”）成立于 1996 年，总部位于上海，是中国证监会批准的首批三家创新试点证券公司之一，也是世界 500 强企业——中国光大集团股份公司（简称“光大集团”）的核心金融服务平台之一。光大证券先后于 2009 年 8 月 18 日和 2016 年 8 月 18 日分别在上海证券交易所及香港联合交易所主板上市（股票代码：601788.SH/06178.HK），是一家 A+H 股上市券商。受益于光大集团的协同效应和品牌优势，光大证券各业务条线均衡发展，各业务板块相互协同，形成了较为完整的产品链，主要业务居行业前列。

2、主要人员情况

光大证券资产托管部具有符合中国证监会规定的、与托管本基金相适应的业务人员。光大证券资产托管部配备有专门的托管运营团队，平均从业年限 12 年以上，本科及以上学历人员占比 100%，其中硕士研究生占比 65%；人员来自托管银行、证券公司、基金公司等专业金融机构，知识结构涉及金融、财会、法律、信息技术、审计等，全员具备基金从业资格，多人具有法律职业资格、注册会计师、经济师、期货从业等资格。

3、基金托管业务经营情况

光大证券于 2020 年 6 月 22 日经中国证监会核准获批证券投资基金托管资格，可为各类公开募集资金设立的证券投资基金提供托管服务。光大证券资产托管部严格遵守国家的有关法律法规和监管机构的有关规定，依靠经验丰富的专业服务团队，安全高效的核心业务系统，科学的内部控制体系，规范的管理运作模式，切实履行托管人职责，保证基金财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时披露，维护基金份额持有人的合法权益，为基金份额持有人提供高质量的托管服务。

（二）基金托管人的内部控制制度

光大证券资产托管部具备完善的内控稽核与风险管理体系和制度：

1、公司根据法律法规的规定，针对基金托管业务建立了科学合理、控制严密、运行高效的基金托管业务内部控制体系，保持托管业务内部控制制度健全、执行有效

（1）资产托管部根据决策科学、运营规范、管理高效的运行机制，遵循职责明确、相互制约的原则，在组织架构和人员设置上保证对基金托管业务运作进行有效控制。

（2）资产托管部各岗位均有明确的职责分工，操作上相互独立，关键业务操作安排专人复核。风险管理岗、合规管理岗、稽核监控岗独立于其他业务岗位，内控监督团队直接向资产托管部负责人汇报，并在需要时可直接向风险管理与内控部和法律合规部汇报，客观、公正地对资产托管业务的合法合规性进行控制和监督，通过健全、有效的内部监督控制体系，确保受托资产的完整和安全，保证资产托管业务的稳健运行。

（3）在严格岗位分离的前提下，资产托管部建立了逐级授权标准和程序，确保员工在规定的授权范围内行使相应的职责，并建立了有效的评价和反馈机制，保持授权的适时性。

（4）公司牢固树立内控优先和风险管理理念，持续教育托管业务员工增强风险防范意识，努力营造遵章守纪、注重管理的内控文化氛围，保证全体员工及时了解国家法律法规和公司规章制度，使风险意识贯穿到各个部门、各个岗位和各个环节。

（5）注重员工的职业道德素质教育，通过强化对托管业务的管理和对全体员工的教育，规范托管业务从业人员言行，使其保持良好的职业道德素质，确保托管业务的规范、合法、健康、稳定运行。

（6）建立科学有效的绩效挂钩、目标考核的人事管理制度，健全激励约束机制。通过聘用、培训、轮岗、考评、晋升、淘汰等形式，促进员工具备和保持正直、诚实、公正、廉洁的品质及优秀的专业素质和业务能力，与岗位要求相适应。

2、资产托管部根据公司整体风险管理策略，建立了完善的基金托管业务风险管理机制，履行风险监控义务，落实风险防范措施，并就识别的风险事件及时报告公司风险管理与内控部和法律合规部

（1）建立了科学严密的风险评估体系，对贯穿托管业务全过程涉及内外部风险进行识别排查、评估和分析。关注对风险源头的管理，判定风险的起源，分析辨别风险形成的原因。

（2）定期衡量托管业务运营风险，对排查出的风险，根据事件发生的可能性和影响程度进行评级，辨别重要的风险点。

（3）对风险情况组织落实风险防范措施，提高风险控制的有效性。

（4）定期评估风险控制政策和防范措施的落实情况。检查风险控制政策、书面记录流程和防范措施，以使风险被控制在可接受的范围内，并使潜在的损失降到最小。

3、公司建立了有效的内部稽核监控制度，形成科学合理的内部控制决策机制、执行机制和监督机制，通过行之有效的控制流程、控制措施，建立合理的内控程序，保障内控管理的有效执行

（1）资产托管部内部设立专门的稽核监控岗，独立于其他业务岗位，内控监督团队直接向资产托管部负责人汇报，客观、公正地对资产托管业务的内部控制制度的执行情况进行持续的监督，以确保受托资产的完整和安全，保证资产托管业务的稳健运行。

（2）稽核监控岗定期评价内部控制的有效性，根据市场环境、新的金融工具、新的技术应用和新的法律法规等情况，适时改进内控措施。

（3）稽核监控岗定期对内部控制进行年度自我评估，包括内部控制体系建

设、内部稽核结果、外部审计结果等内容，检查基金托管业务内部控制的落实执行情况。

（4）公司每年聘请具有证券业务资格的会计师事务所，或者由公司稽核部门组织，针对基金托管业务的内部控制度建设与实施情况，开展相关审查与评估，出具评估报告，由信息披露岗向中国证监会报送。

（三）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

1、监督方法

基金托管人根据《基金法》、《运作办法》等法律法规的规定和基金合同的约定，制定投资监督标准与监督流程，对基金合同生效之后所托管基金的投资范围、投资比例、投资限制等进行监督和核查。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金各项费用的计提与支付情况、基金的申购资金的到账与赎回资金的划付、基金收益分配、信息披露等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

2、监督程序

基金托管人发现基金管理人实际投资运作违反《基金法》、《运作办法》等有关证券法规和《基金合同》的行为，应当及时通知基金管理人予以纠正，基金管理人收到书面通知后应及时核对并以书面形式对基金托管人发出回函确认，在规定期限内及时改正。基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。基金托管人发现基金管理人有重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

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

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

# 第五部分 相关服务机构

一、基金份额发售机构

1、直销机构

本基金直销机构为基金管理人直销柜台以及网上交易平台。

（1）直销柜台

名称：建信基金管理有限责任公司

住所：北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 16 层

办公地址：北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 16 层

法定代表人：曲寅军

联系人：郭雅莉

电话：010-66228800

（2）网上交易平台

投资者可以通过基金管理人网上交易平台办理基金的认购、申购、赎回、定期投资等业务，具体业务办理情况及业务规则请登录基金管理人网站查询。

基金管理人网址：www.ccbfund.cn。

2、其他销售机构

（1）中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 25 号

法定代表人：张金良

客户服务热线：95533

网址：www.ccb.com

（2）兴业银行股份有限公司

注册地址：福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦

法定代表人：吕家进

客户服务热线：95561

网址：www.cib.com.cn

（3）宁波银行股份有限公司

注册地址：浙江省宁东路 345 号

法定代表人：庄灵君

客户服务热线：95574

网址：www.nbcb.com.cn

（4）平安银行股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号

法定代表人：谢永林

客户服务热线：95511

网址：www.bank.pingan.com

（5）招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：缪建民

客户服务热线：95555

网址：www.cmbchina.com

（6）江苏银行股份有限公司

注册地址：南京市中华路 26 号

法定代表人：袁军

客户服务热线：95319

网址：www.jsbchina.cn

（7）渤海银行股份有限公司

注册地址：天津市河东区海河东路 218 号

法定代表人：王锦虹

客户服务热线：95541

网址：www.cbhb.com.cn

（8）和耕传承基金销售有限公司

注册地址：河南自贸试验区郑州片区（郑东）普惠路 55 号 1 号楼 9 层 30-910

法定代表人：温丽燕

客户服务热线：4000-555-671

网址：https://www.hgccpb.com/

（9）宜信普泽（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国路乙 118 号 12 层 01D、02A—02F、03A—03C

法定代表人：赵玉浩

客户服务热线：400-609-9200

网址：https://www.puzefund.com

（10）深圳前海微众银行股份有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区南山街道金港街 88 号微众银行大厦 1 层、7-10 层、12-21 层、23-30 层

法定代表人：顾敏

客户服务热线：400-999-8800

网址：https://www.webank.com/

（11）玄元保险代理有限公司

注册地址：上海市黄浦区广东路 500 号 15 层(实际楼层 11 楼)04 室

法定代表人：卢嘉祺

客户服务热线：400-080-8208

网址：https://www.licaimofang.com

（12）京东肯特瑞基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区知春路 76 号(写字楼)1 号楼 4 层 1-7-2

法定代表人：王珊珊

客户服务热线：400-0988-511

网址：https://kenterui.jd.com/

（13）上海爱建基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区西藏中路 336 号 1806-13 室

法定代表人：吴文新

客户服务热线：021-64382660

网址：https://www.ajwm.com.cn

（14）深圳市排排网基金销售有限责任公司

注册地址：深圳市福田区沙头街道沙嘴社区沙嘴路 8 号红树华府 A 栋 1601

法定代表人：杨柳

客户服务热线：400-666-7388

网址：https://www.ppwfund.com/

（15）博时财富基金销售有限公司

注册地址：深圳市福田区莲花街道福新社区益田路 5999 号基金大厦 19 层

法定代表人：杜松岭

客户服务热线：400-610-5568

网址：https://www.boserawealth.com/

（16）上海万得基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区浦明路 1500 号 8 层 M 座

法定代表人：简梦雯

客户服务热线：021-50712782

网址：http://www.windmoney.com.cn/

（17）上海中欧财富基金销售有限公司

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

法定代表人：郑焰

客户服务热线：400-100-2666

网址：https://www.zocaifu.com/

（18）上海华夏财富投资管理有限公司

注册地址：上海市虹口区东大名路 687 号 1 幢 2 楼 268 室

法定代表人：毛淮平

客户服务热线：400-817-5666

网址：https://www.amcfortune.com/

（19）上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼二层

法定代表人：其实

客户服务热线：95021

网址：https://1234567.com.cn/

（20）上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区东大名路 501 号 6211 单元

法定代表人：陶怡

客户服务热线：400-700-9665

网址：https://www.howbuy.com/fund/

（21）上海挖财基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区锦康路 258 号第 10 层（实际楼层第 9 层）02A 单元

法定代表人：方磊

客户服务热线：021-50810673

网址：https://wacaijijin.com/

（22）上海汇付基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区九江路 769 号 1807-3 室

法定代表人：金佶

客户服务热线：021-61764430

网址：https://www.hotjijin.com/

（23）上海联泰基金销售有限公司

注册地址：上海市普陀区兰溪路 900 弄 15 号 526 室

法定代表人：尹彬彬

客户服务热线：400-118-1188

网址：https://www.66liantai.com/

（24）上海长量基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

法定代表人：张跃伟

客户服务热线：400-820-2899

网址：http://www.erichfund.com/

（25）上海陆享基金销售有限公司

注册地址：上海市静安区武宁南路 203 号 4 楼南部 407 室

法定代表人：粟旭

客户服务热线：400-880-8886

网址：https://www.luxxfund.com/

（26）上海陆金所基金销售有限公司

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

法定代表人：陈祎彬

客户服务热线：400-821-9031

网址：https://www.lufunds.com/

（27）北京度小满基金销售有限公司

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

法定代表人：盛超

客户服务热线：95055-4

网址：https://www.duxiaomanfund.com/

（28）北京新浪仓石基金销售有限公司

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

法定代表人：李柳娜

客户服务热线：010-62675369

网址：http://fund.sina.com.cn/fund/web/index

（29）北京虹点基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区东三环北路 38 号院 1 号楼 19 层 2201 内 11 室

法定代表人：邓伟

客户服务热线：400-618-0707

网址：https://www.hongdianfund.com/

（30）北京雪球基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区创远路 34 号院 6 号楼 19 层 1901 内 1903 室

法定代表人：李楠

客户服务热线：400-180-8559

网址：https://danjuanfunds.com/

（31）华瑞保险销售有限公司

注册地址：上海市嘉定区南翔镇众仁路 399 号运通星财富广场 1 号楼 B 座 307-2 室

法定代表人：王树科

客户服务热线：021-60678055

网址：http://www.huaruisales.com/

（32）南京苏宁基金销售有限公司

注册地址：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

法定代表人：钱燕飞

客户服务热线：95177

网址：https://www.snjijin.com/

（33）和讯信息科技有限公司

注册地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号 1002 室

法定代表人：罗佳

客户服务热线：400-920-0022

网址：https://www.licaike.com/

（34）嘉实财富管理有限公司

注册地址：海南省三亚市吉阳区迎宾路 198 号的三亚太平金融产业港项目 2 号楼 13 层 1315 号房

法定代表人：经雷

客户服务热线：400-021-8850

网址：https://www.harvestwm.cn/

（35）大连网金基金销售有限公司

注册地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号诺德大厦 2 层 202 室

法定代表人：樊怀东

客户服务热线：0411-39027807

网址：https://www.yibaijin.com

（36）天津国美基金销售有限公司

注册地址：天津经济技术开发区第一大街 79 号 MSDC1-28 层 2804-2、2805

法定代表人：陈萍

客户服务热线：400-111-0889

网址：https://www.gomefund.com

（37）奕丰基金销售有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司）经营场所：深圳市南山区海德三道航天科技广场 A 座 17 楼 1704 室

法定代表人：TEO WEE HOWE

客户服务热线：400-684-0500

网址：https://www.ifastps.com.cn

（38）易方达财富管理基金销售（广州）有限公司

注册地址：广州市南沙区横沥镇期航二街 2 号 101 房

法定代表人：陈彤

客户服务热线：400-160-8888

网址： http://www.efundcf.com.cn

（39）泛华普益基金销售有限公司

注册地址：成都市成华区建设路 9 号高地中心 1101 室

法定代表人：王建华

客户服务热线：400-080-3388

网址：http://www.puyifund.com/

（40）泰信财富基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国路乙 118 号 10 层 1206

法定代表人：彭浩

客户服务热线：400-666-7388

网址：https://www.taixincf.com

（41）浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市余杭区五常街道同顺街 18 号 401 室

法定代表人：吴强

客户服务热线：952555

网址：http://www.5ifund.com/

（42）深圳众禄基金销售股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区笋岗街道笋西社区梨园路 8 号 HALO 广场一期四层

12-13 室

法定代表人：薛峰

客户服务热线：4006-788-887

网址：https://www.zlfund.cn/, http://www.jjmmw.com/

（43）深圳富济基金销售有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道岗厦社区福华三路 88 号财富大厦 28E

法定代表人：祝中村

客户服务热线：0755-83999907

网址：https://www.fujifund.cn/

（44）深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址：深圳市福田区梅林街道梅都社区中康路 136 号深圳新一代产业园 2 栋 3703-A

法定代表人：张斌

客户服务热线：010-83275199

网址：https://xinlande.com.cn/

（45）珠海盈米基金销售有限公司

注册地址：珠海市横琴新区琴朗道 91 号 1608、1609、1610 办公

法定代表人：肖雯

客户服务热线：020-89629066

网址：https://www.yingmi.cn/

（46）腾安基金销售（深圳）有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区南山街道听海大道 5212 号腾讯数码大厦 2 栋（南塔）L1401-L1501

法定代表人：谭广锋

客户服务热线：4000-890-555

网址：https://www.txfund.com/

（47）蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

注册地址：浙江省五常街道文一西路 969 号 3 幢 5 层 599 室

法定代表人：王珺

客户服务热线：95188-8

网址：http://www.fund123.cn/

（48）诺亚正行基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 6 层（集中登记地）

法定代表人：王强

客户服务热线：400-821-5399

网址：https://www.noah-fund.com/

（49）中国人寿保险股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 1 6 号

法定代表人：利明光

客户服务热线：95519

网址：https://www.e-chinalife.com

（50）北京创金启富基金销售有限公司

注册地址：北京市丰台区金泽路 161 号 1 号楼-4 至 43 层 101 内 3 层 09A

法定代表人：梁蓉

客户服务热线：010-66154828

网址：https://www.5irich.com

（51）上海基煜基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区广东路 500 号 30 层 3001 单元

法定代表人：王翔

客户服务热线：400-820-5369

网址：https://www.jiyufund.com.cn

（52）上海利得基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区临港新片区海基六路 70 弄 1 号 208-36 室

法定代表人：贾志伟

客户服务热线：400-032-5885

网址：https://www.leadfund.com.cn

（53）上海攀赢基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区银城路 116、128 号 7 层（名义楼层，实际楼层 6 层）03 室

法定代表人：郑新林

客户服务热线：021-68889082

网址：http://www.weonefunds.com

（54）北京汇成基金销售有限公司

注册地址：北京市西城区宣武门外大街甲 1 号 4 层 401-2

法定代表人：王伟刚

客户服务热线：010-63158805

网址：http://www.hcfunds.com/

（55）济安财富(北京)基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区太阳宫中路 16 号院 1 号楼 10 层 1005

法定代表人：杨健

客户服务热线：400-673-7010

网址：http://www.jianfortune.com

（56）东北证券股份有限公司

注册地址：长春市生态大街 6666 号

法定代表人：李福春

客户服务热线：0431-96688

网址：www.nesc.cn

（57）东吴证券股份有限公司

注册地址：苏州工业园区星阳街 5 号

法定代表人：范力

客户服务热线：95330

网址：http://www.dwzq.com.cn/

（58）东方财富证券股份有限公司

注册地址：西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城 10 栋楼

法定代表人：戴彦

客户服务热线：95357

网址：https://www.18.com/

（59）中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

法定代表人：刘成

客户服务热线：400-8888-108

网址：www.csc108.com

（60）中信证券华南股份有限公司

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

法定代表人：陈可可

客户服务热线：95548

网址：http://www.gzs.com.cn

（61）中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座

法定代表人：张佑君

客户服务热线：95548

网址：http://www.citics.com/newsite

（62）中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001

法定代表人：肖海峰

客户服务热线：95548

网址：http://sd.citics.com/

（63）中国中金财富证券有限公司

注册地址：深圳市南山区粤海街道海珠社区科苑南路 2666 号中国华润大厦 L4601-L4608

法定代表人：王建力

客户服务热线：95532

网址：http://www.ciccwm.com/

（64）中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市丰台区西营街 8 号院 1 号楼 7 至 18 层 101

法定代表人：王晟

客户服务热线：4008-888-8888

网址：www.chinastock.com.cn

（65）中泰证券股份有限公司

注册地址：济南市高新区经十路 7000 号汉峪金融商务中心五区 3 号楼

法定代表人：王洪

客户服务热线：95538

网址：www.qlzq.com.cn

（66）信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区宣武门西大街甲 127 号 1 幢 5 层

法定代表人：林志忠

客户服务热线：400-800-8899

网址：www.cindasc.com

（67）光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闸路 1508 号

法定代表人：刘秋明

客户服务热线：10108998

网址：www.ebscn.com

（68）兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 268 号

法定代表人：苏军良

客户服务热线：95562

网址：www.xyzq.com.cn

（69）华创证券有限责任公司

注册地址：贵州省贵阳市云岩区中华北路 216 号

法定代表人：陶永泽

客户服务热线：95513

网址：www.hczq.com

（70）华宝证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区浦电路 370 号 2、3、4 层

法定代表人：刘加海

客户服务热线：400-820-9898

网址：http://www.cnhbstock.com

（71）华泰证券股份有限公司

注册地址：南京市江东中路 228 号

法定代表人：王会清

客户服务热线：95597

网址：www.htsc.com.cn

（72）华福证券股份有限公司

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

法定代表人：黄德良

客户服务热线：95547

网址：www.gfhfzq.com.cn

（73）华西证券股份有限公司

注册地址：中国（四川）自由贸易试验区成都市高新区天府二街 198 号

法定代表人：黄明

客户服务热线：95584

网址：http://www.hx168.com.cn/hxzq/

（74）国投证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道福华一路 119 号安信金融大厦

法定代表人：王苏望

客户服务热线：95517

网址：www.sdicsc.com.cn

（75）国泰海通证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号

法定代表人：朱健

客户服务热线：95521

网址：http://www.gtht.com.cn

（76）国金证券股份有限公司

注册地址：成都市青羊区东城根上街 95 号

法定代表人：冉云

客户服务热线：95310

网址：http://www.gjzq.com.cn

（77）天风证券股份有限公司

注册地址：武汉东湖新技术开发区高新大道 446 号天风证券大厦 20 层

法定代表人：庞介民

客户服务热线：95391

网址：http://www.tfzq.com/

（78）平安证券股份有限公司

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

法定代表人：何之江

客户服务热线：4008866338

网址：stock.pingan.com

（79）广发证券股份有限公司

注册地址：广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街 2 号 618 室

法定代表人：林传辉

客户服务热线：95575

网址：http://www.gf.com.cn/

（80）招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道福华一路 111 号

法定代表人：朱江涛

客户服务热线：95565

网址：www.newone.com.cn

（81）江海证券有限公司

注册地址：哈尔滨市香坊区赣水路 5 6 号

法定代表人：赵洪波

客户服务热线：956007

网址：https://www.jhzq.com.cn/

（82）渤海证券股份有限公司

注册地址：天津经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

法定代表人：安志勇

客户服务热线：4006515988

网址：https://www.ewww.com.cn

（83）申万宏源西部证券有限公司

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

法定代表人：王献军

客户服务热线：95523

网址：www.sywg.com

（84）申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人：张剑

客户服务热线：95523

网址：www.sywg.com

（85）财信证券股份有限公司

注册地址：湖南省长沙市岳麓区茶子山东路 112 号滨江金融中心 T2 栋（B 座）26 层

法定代表人：刘宛晨

客户服务热线：0731-4403340

网址：https://stock.hnchasing.com

（86）银泰证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区竹子林四路紫竹七道 18 号光大银行 18 楼

法定代表人：刘强

客户服务热线：95341

网址：https://www.ytzq.com/

（87）长城证券股份有限公司

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

法定代表人：王军

客户服务热线：0755-82288968

网址：www.cc168.com.cn

（88）长江证券股份有限公司

注册地址：湖北省武汉市江汉区淮海路 88 号

法定代表人：刘正斌

客户服务热线：4008-888-999

网址：www.95579.com

（89）中信期货有限公司

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

法定代表人：窦长宏

客户服务热线：400-990-8826

网址：http://citicsf.com/e-futures/

二、基金份额登记机构

名称：建信基金管理有限责任公司

住所：北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 16 层

办公地址：北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 16 层

法定代表人：曲寅军

联系人：丁颖

电话：010-66228888

三、出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：陈臻

电话：021- 31358666

传真：021- 31358600

联系人：陆奇

经办律师：黎明、陆奇

四、审计基金资产的会计师事务所

名称：毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）

住所： 北京市东城区东长安街 1 号东方广场东 2 座办公楼 8 层

办公地址：北京市东城区东长安街 1 号东方广场东 2 座办公楼 8 层

执行事务合伙人：黄文辉

联系电话：010-85085000

传真：010-85185111

联系人：左艳霞、龚凯、楼竹君、谢浩然

经办注册会计师：左艳霞、龚凯、楼竹君、谢浩然

# 第六部分 基金份额的发售

一、基金募集的依据

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《基金合同》及其他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 2021 年 1 月 26 日证监许可[2021]266 号文注册。

二、基金类型

股票型证券投资基金

三、基金的运作方式

契约型开放式

四、基金存续期间

不定期

五、基金份额类别

本基金根据认购/申购费用、赎回费用、销售服务费用收取方式等不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用但不从本类别基金资产中计提销售服务费、赎回时根据持有期限收取赎回费用的，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取认购/申购费用、赎回时根据持有期限收取赎回费用的，称为 C 类基金份额。

本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为：计算日某类别基金份额净值＝该计算日该类别基金份额的基金资产净值/该计算日发售在外的该类别基金份额总数。

投资人可自行选择认购/申购的基金份额类别。

根据基金销售情况，在符合法律法规及中国证监会规定且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金管理人在履行适当程序后可以调整基金份额类别设置、增加新的基金份额类别、调整现有基金份额类别的费率、停止现有基金份额类别的销售或对基金份额分类办法及规则进行调整等，而无需召开基金份额持有人大会，但调整实施前基金管理人需及时公告。

六、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。

七、发售时间

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。

八、发售方式

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

九、发售对象

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

十、认购安排

1、认购时间：本基金向个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人同时发售，具体发售时间由基金管理人根据相关法律法规及本基金基金合同，在基金份额发售公告中确定并披露。

2、投资人认购应提交的文件和办理的手续：详见基金份额发售公告及销售机构发布的相关公告。

3、认购原则和认购限额：认购以金额申请。投资人认购基金份额时，需按销售机构规定的方式全额缴付认购款项。其他销售机构每个基金交易账户每次认购金额不得低于 10 元人民币，其他销售机构另有规定最低单笔认购金额高于 10 元的，从其规定。本基金管理人直销柜台、网上交易平台每个基金交易账户首次认购金额不得低于 10 元人民币，单笔追加认购最低金额为 10 元人民币。

4、募集期内，基金管理人可设置单个投资人的累计认购金额限制，具体见基金管理人届时发布的相关公告。

5、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。

6、投资人在募集期内可以多次认购基金份额，认购申请一经受理不得撤销。

十一、认购费用

募集期投资人可以多次认购本基金，认购费用按累计认购金额确定认购费率，以每笔认购申请单独计算费用。基金投资人认购本基金 A 类基金份额时收取认购费用。C 类基金份额不收取认购费。

| 费用种类 | 认购金额（M） | 认购费率 |
| --- | --- | --- |
| A 类认购费率 | M<100 万 | 1.20% |
| | 100 万≤M<200 万 | 1.00% |
| | 200 万≤M<500 万 | 0.60% |
| | M≥500 万 | 1000/笔 |
| C 类认购费率 | 0 | |

A 类基金份额基金认购费用由认购本基金 A 类基金份额的投资人承担，不列入基金财产。认购费用用于本基金的市场推广、销售、注册登记等募集期间发生的各项费用。

十一、募集期利息的处理方式

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

十二、基金认购份额的计算

A 类基金份额的认购份额计算方法为：

（1）认购费用适用比例费率时，计算方法为：

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

（2）认购费为固定金额时，计算方法为：

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

C 类基金份额的认购份额计算方法为：

认购份额＝（认购金额＋认购资金利息）/基金份额发售面值

上述计算结果均保留到小数点后两位，小数点两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。

例：某投资人投资 5 万元认购本基金 A 类基金份额，如果认购期内认购资金获得的利息为 5 元，则可得到的 A 类认购份额为：

净认购金额＝50,000/（1＋1.20%）＝49,407.11 元

认购费用＝50,000－49,407.11＝ 592.89 元

认购份额＝（49,407.11＋5）/1.0000＝49,412.11 份

即：某投资人投资 5 万元认购本基金 A 类基金份额，如果认购期内认购资金获得的利息为 5 元，则其可得到 49,412.11 份本基金 A 类基金份额。

例：某投资人投资 5 万元认购本基金 C 类基金份额，如果认购期内认购资金获得的利息为 5 元，则可得到的 C 类认购份额为：

认购份额＝（50,000＋5）/1.0000＝50,005.00 份

即：某投资人投资 5 万元认购本基金 C 类基金份额，如果认购期内认购资金获得的利息为 5 元，则其可得到 50,005.00 份本基金 C 类基金份额。

十三、认购申请的确认

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。

十四、募集资金

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。

基金募集期间的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用，不得从基金财产中列支。

十五、募集结果

截至 2021 年 4 月 23 日，基金募集工作已经顺利结束。经安永华明会计师事务所验资，本次募集的净认购金额为人民币 291,777,403.44 元。本次募集认购资金在募集期间产生的利息共计人民币 54,309.87 元。本次募集有效认购户数为 8322 户，按照每份基金份额初始面值人民币 1.00 元计算，募集期募集资

金及利息结转的基金份额共计 291,831,713.31 份，已全部计入投资者基金账户，归投资者所有。本次募集所有资金已全额划入本基金在基金托管人光大证券股份有限公司开立的建信高端装备股票型证券投资基金托管专户。

# 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 日内返还投资人已缴纳的款项，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 50 个工作日出现前述情形的，则直接进入基金财产清算程序并终止《基金合同》，无需召开基金份额持有人大会审议。

法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

# 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。基金投资人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，则基金管理人可根据实际情况决定本基金是否开放申购、赎回及转换业务，具体以届时提前发布的公告为准。但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

基金合同生效后，若出现新的证券/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

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

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

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、赎回或转换价格为下一开放

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各类基金份额净值为基准进行计算；

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；

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

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

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

四、申购与赎回的程序

1、申购和赎回的申请方式

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

投资人在提交申购申请时须按销售机构规定的方式备足申购资金，投资人在提交赎回申请时须持有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回申请不成立。

2、申购和赎回的款项支付

投资人申购基金份额时，必须在规定的时间内全额交付申购款项，投资人交付申购款项，申购成立；基金份额登记机构确认基金份额时，申购生效。

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

基金份额持有人赎回申请生效后，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、港股通交易系统或港股通资金交收规则限制或其他非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程时，赎回款项顺延至

上述情形消失的下一个工作日划出。在发生巨额赎回或基金合同载明的延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。

3、申购和赎回申请的确认

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

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。对于申购、赎回申请的确认情况，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。

基金管理人可以在法律法规允许的范围内对上述申购和赎回申请的确认时间进行调整，并必须在调整实施日前按照《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、其他销售机构每个基金账户单笔申购最低金额为 1 元人民币，其他销售机构另有规定单笔申购最低金额高于 1 元人民币的，从其规定；本基金管理人直销柜台每个基金账户首次最低申购金额、单笔追加申购最低金额均为 1 元人民币；通过本基金管理人网上交易平台申购本基金时，单笔申购最低金额、定期定额投资最低金额均为 1 元人民币。转换转入及定投的起点设置与申购相同。

2、基金份额持有人在销售机构赎回时，每次赎回申请不得低于 0.01 份基金份额。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 0.01 份的，在赎回时需一次全部赎回。转换转出下限设置与赎回相同。

3、基金管理人可以规定单个投资人累计持有的基金份额上限，具体规定请参见更新的招募说明书或相关公告。

4、基金管理人可以规定本基金的总规模上限、当日申购金额上限，具体规定请参见更新的招募说明书或相关公告。

5、基金管理人可以规定单个投资人当日申购金额上限，具体规定请参见更新的招募说明书或相关公告。

6、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。

7、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额等数量限制。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

六、申购和赎回的价格、费用及其用途

1、申购费用

投资人在申购 A 类基金份额时支付申购费用。C 类基金份额不收取申购费用。投资人可以多次申购本基金，申购费用按每日累计申购金额确定申购费率，以每笔申购申请单独计算费用。

（1） 本基金 A 类基金份额的申购费率如下：

| 申购金额（M） | 申购费率 |
|---|---|
| M＜100 万元 | 1.50% |
| 100 万元≤M＜200 万元 | 1.20% |
| 200 万元≤M＜500 万元 | 0.80% |
| M≥500 万元 | 每笔 1000 元 |

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，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

（2）C 类基金份额申购费

本基金 C 类基金份额申购费率为 0。

2、赎回费

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取，并按照持有期限的不同将赎回费按照不同比例计入基金财产，赎回费用的其余部分用于支付登记费和其他必要的手续费。

（1）A 类基金份额赎回费

本基金 A 类基金份额的赎回费率按照持有时间递减，即相关基金份额持有时间越长，所适用的赎回费率越低。

本基金 A 类基金份额的赎回费率如下：

| 持有期限（N） | 赎回费率 |
| --- | --- |
| N ＜ 7 日 | 1.5% |
| 7 日≤N＜30 日 | 0.75% |
| 30 日≤N＜180 日 | 0.50% |
| N ≥180 日 | 0 |

投资者可将其持有的全部或部分基金份额赎回。对于持有期少于 30 日的基金份额所收取的赎回费，赎回费用全额归入基金财产；对于持有期不少于 30 日但少于 90 日的基金份额所收取的赎回费，赎回费用 75%归入基金财产；对于持有期不少于 90 日但小于 180 日的基金份额所收取的赎回费，赎回费用 50%归入基金财产。

（2）C 类基金份额赎回费

本基金 C 类基金份额的赎回费率按照持有时间递减，即相关基金份额持有时间越长，所适用的赎回费率越低。

本基金 C 类基金份额的赎回费率如下：

| 持有期限（N） | 赎回费率 |
| --- | --- |
| N<7 日 | 1.5% |
| 7 天≤N<30 日 | 0.50% |
| N≥30 日 | 0 |

投资者可将其持有的全部或部分基金份额赎回。对于持有期少于 30 日的基金份额所收取的赎回费，赎回费用全额归入基金财产.。

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

4、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。

5、基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行相关手续后，基金管理人可以适当调低基金销售费率并另行公告。

七、申购份额与赎回金额的计算方式

1、申购份额的计算

本基金的申购费用采用前端收费模式（即申购基金时缴纳申购费）。

A 类基金份额申购份额的计算方式如下：

（1）申购费用适用比例费率时，计算方法为：

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

（2）申购费用为固定金额时，计算方法为：

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

C 类基金份额申购份额的计算方式如下：

申购份额＝申购金额/申购当日 C 类基金份额净值

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

例：某投资人投资 5 万元申购本基金 A 类基金份额，假设申购当日 A 类基金份额净值为 1.0500 元，则可得到的 A 类基金份额为：

净申购金额=50,000/（1+1.50%）=49,261.08 元

申购费用=50,000-49,261.08 =738.92 元

申购份额=49,261.08/1.0500=46,915.31 份

即：投资人投资 5 万元申购本基金 A 类基金份额，假设申购当日的 A 类基金份额净值为 1.0500 元，则其可得到 46,915.31 份 A 类基金份额。

例：某投资人投资 5 万元申购本基金的 C 类基金份额，假设申购当日 C 类基金份额净值为 1.0500 元，则可得到的 C 类基金份额为：

申购份额=50,000/1.0500=47,619.05 份

即：投资人投资 5 万元申购本基金的 C 类基金份额，假设申购当日 C 类基金份额净值为 1.0500 元，则其可得到 47,619.05 份 C 类基金份额。

2、赎回金额的计算

在基金份额持有人赎回本基金份额时收取赎回费用，基金份额持有人的赎回金额为赎回总金额扣减赎回费用。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

赎回金额=赎回总金额-赎回费用

赎回费用以人民币元为单位，计算结果按照四舍五入方法，保留到小数点后两位；赎回总金额结果按照四舍五入方法，保留到小数点后两位；由此产生的收益或损失由基金财产承担。

例：某投资人赎回本基金 10,000 份 A 类基金份额，持有时间为 20 日，赎回适用费率为 0.75%，假设赎回当日基金份额净值为 1.1480 元，则其可得赎回金额为：

赎回总金额＝10,000×1.1480＝11,480.00 元

赎回费用＝11,480.00×0.75%＝86.10 元

赎回金额＝11,480.00－86.10＝11,393.90 元

即：投资人赎回本基金 10,000 份 A 类基金份额，持有时间为 20 日，赎回适用费率为 0.75%，假设赎回当日 A 类基金份额净值为 1.1480 元，则可得到的赎回金额为 11,393.90 元。

例：某投资人赎回本基金 10,000 份 C 类基金份额，假设持有期大于 30 天，则赎回适用费率为 0，假设赎回当日 C 类基金份额净值为 1.1480 元，则其可得赎回金额为：

赎回总金额＝10,000×1.1480＝11,480.00 元

赎回费用＝11,480.00×0＝0 元

赎回金额＝11,480.00－0＝11,480.00 元

即：投资人赎回本基金 10,000 份 C 类基金份额，假设赎回当日 C 类基金份额净值为 1.1480 元，持有期大于 30 日，赎回适用费率为 0，则可得到的赎

回金额为 11,480.00 元。

3、本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码，分别计算和公告各类基金份额净值。本基金份额净值的计算，保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T 日的各类基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，经履行适当程序，可以适当延迟计算或公告。

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，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；

4、接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时；

5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或发生其他损害现有基金份额持有人利益的情形；

6、申购申请超过基金管理人设定的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情形；

7、基金管理人接受某笔或者某些申购申请或基金转换入申请有可能导致单一投资者持有基金份额数的比例达到或者超过基金份额总数的 50%，或者变相规避前述 50%比例要求的情形时；

8、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；

9、基金销售机构或登记机构的异常情况导致基金销售系统、基金登记系统或基金会计系统无法正常运行；

10、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述（第 4、6、7 项除外）暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在规定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请全部或部分被拒绝的，被拒绝的申购款项将

退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

九、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项；

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

3、证券、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，基金管理人应报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。若出现上述第 4 项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

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该类基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

（3）若本基金发生巨额赎回且在单个基金份额持有人超过上一开放日基金总份额 20%以上的赎回申请的情形下，基金管理人有权对于该基金份额持有人当日超过上一开放日基金总份额 20%以上的那部分赎回申请进行延期办理，对于该基金份额持有人其余赎回申请部分，基金管理人根据前段“（1）全额赎回”或“（2）部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。但是，如该基金份额持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。

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

3、巨额赎回的公告

当发生上述巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，并依据《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、如发生暂停的时间为 1 日，基金管理人应于重新开放日，在规定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近 1 个开放日的各类基金份额净值。

3、如果发生暂停的时间超过 1 日，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，并公告最近 1 个工作日的各类基金份额净值；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。

继承是指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；捐赠指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体；司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供基金登记机构要求提供的相关资料，对于符合条件的非交易过户申请按基金登记机构的规定办理，并按基金登记机构规定的标准收费。

十四、基金的转托管

基金份额持有人可办理已持有基金份额在不同销售机构之间的转托管，基

金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。

十五、定期定额投资计划

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

十六、基金份额的冻结和解冻

基金登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻，以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。基金份额的冻结手续、冻结方式按照基金登记机构的相关规定办理。基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益按照法律法规及国家有权机关的要求以及基金登记机构业务规定来处理。

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、其他业务

在相关法律法规允许的条件下，基金登记机构可依据其业务规则，受理基金份额质押等业务，并收取一定的手续费用。

十九、实施侧袋机制期间本基金的申购与赎回

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

# 第九部分 基金的投资

一、投资目标

本基金重点投资于高端装备主题相关的上市公司，在严格控制风险和保持良好流动性的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。

二、投资范围

本基金的投资范围主要为具有较好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板、存托凭证及其他中国证监会允许基金投资的股票）、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通投资标的股票”）、股指期货、股票期权、债券（包括国债、地方政府债、政府支持机构债券、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、国债期货、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。

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

基金的投资组合比例为：股票资产投资比例为基金资产的 80-95%，其中投资于本基金界定的“高端装备行业股票”的比例不低于非现金资产的 80%；港股通标的股票投资比例不超过全部股票资产的 50%；每个交易日日终在扣除国债期货、股指期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如果法律法规对该比例要求有变更的，基金管理人在履行适当程序后，本基金的投资比例相应调整。本基金可根据法律法规的规定参与融资业务。

三、投资策略

（一）资产配置策略

本基金以追求基金资产收益长期增长为目标，根据宏观经济趋势、市场政策、资产估值水平、外围主要经济体宏观经济和资本市场的运行状况等因素的

变化在本基金的投资范围内进行适度动态配置，力争获得与所承担的风险相匹配的收益。

（二）股票投资策略

1、高端装备行业上市公司的界定

按照申银万国行业分类划分标准，本基金所指的高端装备行业主要包括电气设备、机械设备、国防军工、汽车、家用电器、轻工制造、交通运输、电子、计算机、通信等申万一级行业。如果申银万国行业分类发生调整，行业分类方法发生变更，申银万国停止发布行业分类或基金管理人认为有更适当的行业划分标准，本基金可在履行适当程序后调整上述界定标准。

本基金所指的高端装备行业相关公司主要包括以下三类公司：

（1）主营业务所属行业为上述行业，且产品或服务具有较高技术含量、较高附加值等特点的公司；

（2）围绕上述行业提供服务和产品，或者受益于高端装备产业结构升级的相关上市公司；

（3）对于当前未被归入前述行业，但后续通过引入技术创新、变革运营模式、实施资产并购或重组以及其他途径实现业务转型，转型后提供的产品或服务隶属于上述行业，且这些产品或服务具有较高技术含量、较高附加值等特点，未来有望成为主要收入或利润来源的公司，本基金也可将其纳入高端装备行业相关公司范畴。

未来随着科技进步、政策或市场环境发生变化导致本基金对相关行业的界定范围发生变动，本基金可在履行适当程序后调整上述界定标准，并在更新的招募说明书中进行公告。

2、行业配置策略

本基金在对高端装备相关行业研究的基础上，从行业生命周期、行业景气度、行业竞争格局多个角度综合评估各个行业的投资价值。

（1）行业景气度分析

行业的景气度受到宏观经济形势、国家产业政策、行业自身基本面等多因素的共同影响，本基金将分析经济周期的不同阶段对各行业的影响，并综合考虑国家产业政策、消费者需求变化、行业技术发展趋势等因素，判断各个行业

的景气度。

（2）行业生命周期分析

本基金将分析各行业所处的生命周期阶段，对于行业的各种因素进行研究，考虑的因素包括行业规模、利润率水平、技术进步和技术成熟程度、开工率、从业人员收入水平等。

（3）行业竞争格局

本基金将对各行业的竞争格局进行分析，对于行业的各种因素进行研究，考虑的因素包括行业的产品研发能力、行业进入壁垒、生产厂家的数量及相对规模、购买者的数量及相对规模等。

3、个股投资策略

本基金坚持“自下而上”的个股选择策略，通过广泛选择投资标的，多维度认可标的价值，重点研究具有竞争力比较优势、未来成长空间大、持续经营能力强的上市公司，同时结合定量分析和多种价值评估方法进行多角度投资价值分析。

（1）定性选取具备竞争力优势的上市公司

本基金定性分析的因素包括：a、公司所处的产业链地位；b、公司创新能力；c、公司的品牌形象和市场美誉度；d、公司的治理结构；e、公司财务状况等。

（2）定量分析

本基金对按上述步骤定性筛选出来的股票，进一步进行定量分析。本基金采取的指标包括：市值排名、净资产收益率、净资产与市值比率（B/P）、每股盈利/每股市价（E/P）、年现金流/市值（C/P）、销售收入/市值（S/P）、过去 2 年主营业务收入复合增长率、过去 2 年每股收益复合增长率等。

（3）股票价值评估

针对股票所属产业特点的不同，本基金将采取不同的股票估值模型，在综合考虑股票历史的、国内的、国际相对的估值水平的基础上，对企业进行相对价值评估。

4、港股通标的股票投资策略

本基金将通过内地与香港股票市场互联互通机制投资于香港股票市场，将

综合比较并选择港股市场中符合本基金投资主题的优质股票进行投资。

5、存托凭证投资策略

本基金可投资存托凭证，本基金将结合宏观经济状况、市场估值、发行人基本面情况等因素，通过定性分析和定量分析相结合的办法，精选出具有比较优势的存托凭证进行投资。

（三）债券投资策略

本基金债券投资将以优化流动性管理、分散投资风险为主要目标，同时根据需要进行积极操作，以提高基金收益。本基金将主要采取以下积极管理策略：

1、久期调整策略

根据对市场利率水平的预期，在预期利率下降时，提高组合久期，以获得债券价格上升带来的收益；在预期利率上升时，降低组合久期，以规避债券价格下跌的风险。

2、收益率曲线配置策略

在久期确定的基础上，根据对收益率曲线形状变化的预测，采用子弹型策略、哑铃型策略或梯形策略，在长期、中期和短期债券间进行配置，以从长、中、短期债券的相对价格变化中获利。

3、债券类属配置策略

根据国债、金融债、公司债、资产支持证券等不同类属债券之间的相对投资价值分析，增持价值被相对低估的类属债券，减持价值被相对高估的类属债券，借以取得较高收益。并通过信用风险、内含选择权的价值分析和管理，获取适当的收益。

（四）股指期货投资策略

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的。本基金将充分考虑股指期货的流动性及风险收益特征，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约进行多头或空头套期保值等策略操作。法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

（五）国债期货投资策略

国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。本基金将按照相关法律法规的规定，以套期保值为目的，结合对宏

观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。本基金将构建量化分析体系，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的长期稳定增值。国债期货相关投资遵循法律法规及中国证监会的规定。

（六）资产支持证券投资策略

本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益较高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

（七）股票期权投资策略

基金管理人在进行股票期权投资前将建立股票期权投资决策小组，负责股票期权投资管理的相关事项。本基金将按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的参与股票期权交易。本基金将结合投资目标、比例限制、风险收益特征以及法律法规的相关限定和要求，确定参与股票期权交易的投资时机和投资比例。

若相关法律法规发生变化时，基金管理人股票期权投资管理从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。未来如法律法规或监管机构允许基金投资其他期权品种，本基金将在履行适当程序后，纳入投资范围并制定相应投资策略。

（八）融资策略

为了更好地实现投资目标，在综合考虑预期风险、收益、流动性等因素的基础上，本基金可参与融资业务。未来相关法律法规及中国证监会允许本基金参与融券业务的，本基金可在履行适当程序后依照相关规定参与融券业务。

未来，根据市场情况，本基金可在履行适当程序后相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新中公告。

四、投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）股票资产投资比例为基金资产的 80-95%，其中投资于本基金界定的

“高端装备行业股票”的比例不低于非现金资产 80%；港股通标的股票投资比例不超过全部股票资产的 50%；

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

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

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

（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证券投资基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

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

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

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

（12）本基金参与股指期货、国债期货交易依据下列标准建构组合：

1）在任何交易日日终，持有的买入国债期货和股指期货合约价值与有价证券市值之和不得超过基金资产净值的 95%，其中，有价证券指股票、债券（不

含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

2）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%；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%；

3）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%；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%；

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

5）本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；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）基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

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

（15）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过资产净值的 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；

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

（17）本基金参与融资业务后，在任何交易日日终持有的融资买入股票与

其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；

（18）因未平仓的期权合约支付和收取的权利金总额不得超过基金资产净值的 10%；开仓卖出认购期权的，应持有足额标的证券；开仓卖出认沽期权的，应持有合约行权所需的全额现金或交易所规则认可的可冲抵期权保证金的现金等价物；未平仓的期权合约面值不得超过基金资产净值的 20%。其中，合约面值按照行权价乘以合约乘数计算；

（19）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；

（20）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述第（2）、（9）、（15）、（16）项情形之外，因证券、期货市场波动、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。在此期间，基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准。

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。

法律、行政法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金在

履行适当程序后不再受相关限制。

五、业绩比较基准

中证高端装备制造指数收益率*70%+中证港股通工业综合指数（人民币）收益率*15%+中债-综合财富（总值）指数收益率*15%

1、业绩比较基准设定的原因

（1）基于基金投资范围以及预期投资的主要资产类别，本基金主要投资于A 股股票、港股通标的股票、债券等资产，相应选取与之匹配的 A 股指数、港股通指数、债券指数作为基准要素。同时基于本基金股票资产投资比例为基金资产的 80-95%（其中投资于本基金界定的“高端装备行业股票”的比例不低于非现金资产的 80%），港股通标的股票投资比例不超过全部股票资产的 50%等投资比例限制，以及预期的资产配置比例中枢，本基金将股票资产和债券资产所对应的基准要素权重分别设置为 85%与 15%，其中将股票资产中的 A 股股票与港股通标的股票所对应的基准要素权重分别设置为 70%与 15%。

（2）基于基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金坚持“自下而上”的个股选择策略，通过广泛选择投资标的，多维度认可标的价值，重点研究具有竞争力比较优势、未来成长空间大、持续经营能力强的上市公司，同时结合定量分析和多种价值评估方法进行多角度投资价值分析。综合考虑基准指数与产品定位、投资风格与主题库的匹配度，同时兼顾考虑基准指数的表征性、认可度，以及指数主题界定、市值覆盖、行业与个股分布等，本基金选取中证高端装备制造指数和中证港股通工业综合指数（人民币）分别作为 A 股股票部分和港股通标的股票部分的业绩比较基准要素。

中证高端装备制造指数从上市公司中，选取通信设备、电力设备、机械制造、航空航天与国防、电子、半导体、乘用车及零部件等行业中具有代表性的公司作为样本，以反映高端装备制造产业公司的整体表现，适合作为本基金 A 股股票部分的业绩比较基准要素。

中证港股通工业综合指数（人民币）在中证港股通综合指数样本中，按中证行业分类标准进行分类，选取工业行业全部证券作为样本，以反映港股通公司中工业行业证券的整体表现，适合作为本基金港股通标的股票部分的业绩比较基准要素。

（3）基于基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金债券投资将以优化流动性管理、分散投资风险为主要目标，同时根据需要进行积极操作，采取久期调整、收益率曲线配置、债券类属配置等策略以提高基金收益。综合考虑基准指数与产品定位和投资风格的匹配度，同时兼顾考虑基准指数的表征性、认可度，以及基准指数券种、久期、信用等级分布特征等，选取中债-综合财富（总值）指数作为债券部分的业绩比较基准要素。

中债-综合财富（总值）指数旨在综合反映债券全市场整体价格和投资回报情况，是具有代表性的债券市场指数，适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

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

2、业绩比较基准要素的基本信息

中证高端装备制造指数由中证指数有限公司编制发布，指数代码为930599，具体信息详见中证指数有限公司官方网站，网址：www.csindex.com.cn。

中证港股通工业综合指数（人民币）由中证指数有限公司编制发布，指数代码为930972，具体信息详见中证指数有限公司官方网站，网址：www.csindex.com.cn。

中债-综合财富（总值）指数由中债金融估值中心有限公司编制发布，指数代码为CBA00201，具体信息详见中国债券信息网，网址：www.chinabond.com.cn。

3、业绩比较基准的计算方法

本基金业绩比较基准收益率的计算方法以每日收益率为基础，以时间加权为计算原则。本基金先分别计算业绩比较基准中中证高端装备制造指数、中证港股通工业综合指数（人民币）、中债-综合财富（总值）指数的每日收益率，再按照预设权重比例计算当日组合要素基准的日收益率，并连乘每日收益率。

4、管理投资偏离业绩比较基准的定性或定量方法

本基金管理人对基金实际投资与业绩比较基准的偏离情况进行动态跟踪与监测评估，监测指标主要包括超额收益、大类资产配置比例等指标，以更好地管理基金实际投资与业绩比较基准的偏离情况，从而在控制风险的基础上追求

超越业绩比较基准的投资回报。

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

5、未来可能变更业绩比较基准的情况和程序

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

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

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

（3）中国证监会认可的其他情形。

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

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

（2）其他对基金份额持有人利益产生重大实质性影响的情形。

六、风险收益特征

本基金为股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金的基金资产如投资于港股，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。

七、关联交易

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。

八、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。

九、侧袋机制的实施和投资运作安排

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

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

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

十、基金的投资组合报告

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

基金托管人光大证券股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 7 月

16 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至 2026 年 6 月 30 日止，本报告中财务资料未经审计。

1、报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 677,982,606.49 | 93.83 |
| | 其中：股票 | 677,982,606.49 | 93.83 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 42,288,558.75 | 5.85 |
| 8 | 其他资产 | 2,256,483.08 | 0.31 |
| 9 | 合计 | 722,527,648.32 | 100.00 |

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 58,097,222.65 元，占期末基金资产净值比例为 8.09%。

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

（1）报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 523,678,497.81 | 72.94 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息 | 96,206,886.03 | 13.40 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | 技术服务业 | | |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 619,885,383.84 | 86.35 |

（2）报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别 | 公允价值（人民币） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|
| Materials 材料 | - | - |
| Consumer Staples 日常生活消费品 | - | - |
| Consumer Discretionary 非日常消费品 | - | - |
| Energy 能源 | - | - |
| Financials 金融 | - | - |
| Health Care 医疗保健 | - | - |
| Industrials 工业 | - | - |
| Real Estate 房地产 | - | - |
| Information Technology 信息技术 | 58,097,222.65 | 8.09 |
| Telecommunication Services 通讯服务 | - | - |
| Utilities 公用事业 | - | - |
| 合计 | 58,097,222.65 | 8.09 |

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

3、期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

（1）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 688200 | 华峰测控 | 130,248 | 68,393,224.80 | 9.53 |
| 2 | 300604 | 长川科技 | 188,100 | 64,221,102.00 | 8.95 |
| 3 | 300308 | 中际旭创 | 41,800 | 53,086,000.00 | 7.39 |
| 4 | 600660 | 福耀玻璃 | 947,686 | 47,801,281.84 | 6.66 |
| 5 | 688521 | 芯原股份 | 113,189 | 42,008,965.46 | 5.85 |
| 6 | 00981 | 中芯国际 | 383,500 | 29,778,149.90 | 4.15 |
| 7 | 600031 | 三一重工 | 1,715,400 | 29,642,112.00 | 4.13 |
| 8 | 300502 | 新易盛 | 48,300 | 29,318,100.00 | 4.08 |
| 9 | 688256 | 寒武纪 | 15,911 | 25,386,796.05 | 3.54 |
| 10 | 688041 | 海光信息 | 66,321 | 24,558,666.30 | 3.42 |

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

无。

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

无。

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

（1）报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

（2）本基金投资股指期货的投资政策

无。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

（1）本期国债期货投资政策

无。

（2）报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

（3）本期国债期货投资评价

无。

11、投资组合报告附注

（1）本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金该报告期内投资前十名证券的发行主体未披露被监管部门立案调查和在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

（2）基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

基金投资的前十名股票未超出基金合同约定的投资范围。

（3）其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
| --- | --- | --- |
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 2,256,483.08 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 2,256,483.08 |

（4）报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

（5）报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

（6）投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

# 第十部分 基金的业绩

基金业绩截止日为 2026 年 6 月 30 日

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较。

建信高端装备 A：

| 阶　段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 自基金合同生效-2021 年 12 月 31 日 | 35.23% | 1.57% | 16.93% | 1.11% | 18.30% | 0.46% |
| 2022 年 1 月 1 日—2022 年 12 月 31 日 | -15.15% | 1.89% | -23.91% | 1.42% | 8.76% | 0.47% |
| 2023 年 1 月 1 日—2023 年 12 月 31 日 | -6.99% | 1.14% | -10.83% | 0.89% | 3.84% | 0.25% |
| 2024 年 1 月 1 日—2024 年 12 月 31 日 | 3.70% | 1.73% | 19.22% | 1.51% | -15.52% | 0.22% |
| 2025 年 1 月 1 日—2025 年 12 月 31 日 | 40.16% | 1.82% | 34.30% | 1.31% | 5.86% | 0.51% |
| 2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日 | 47.93% | 2.24% | 30.83% | 1.50% | 17.10% | 0.74% |
| 自基金合同生效-2026 年 6 月 30 日 | 129.45% | 1.72% | 66.17% | 1.30% | 63.28% | 0.42% |

建信高端装备 C：

| 阶　段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 自基金合同生效-2021 年 12 月 31 日 | 34.87% | 1.57% | 16.93% | 1.11% | 17.94% | 0.46% |
| 2022 年 1 月 1 日—2022 年 12 月 31 日 | -15.49% | 1.89% | -23.91% | 1.42% | 8.42% | 0.47% |
| 2023 年 1 月 1 日 | -7.36% | 1.14% | -10.83% | 0.89% | 3.47% | 0.25% |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| —2023 年 12 月 31 日 | | | | | | |
| 2024 年 1 月 1 日—2024 年 12 月 31 日 | 3.29% | 1.73% | 19.22% | 1.51% | -15.93% | 0.22% |
| 2025 年 1 月 1 日—2025 年 12 月 31 日 | 39.66% | 1.82% | 34.30% | 1.31% | 5.36% | 0.51% |
| 2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日 | 47.63% | 2.23% | 30.83% | 1.50% | 16.80% | 0.73% |
| 自基金合同生效-2026 年 6 月 30 日 | 124.85% | 1.72% | 66.17% | 1.30% | 58.68% | 0.42% |

# 第十一部分 基金的财产

一、基金资产总值

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

二、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

三、基金财产的账户

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

四、基金财产的保管和处分

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

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

# 第十二部分 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、股指期货合约、国债期货合约、股票期权合约、资产支持证券和银行存款本息、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。

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

（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、证券交易所上市的有价证券的估值

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

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

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

（4）交易所上市交易的可转换债券以每日收盘价作为估值全价，收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；

（5）交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所市场挂牌转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值；

（6）对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为估值日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表估值日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认估值日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，应采用估值技术确定其公允价值。

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

（2）首次公开发行未上市的股票、债券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

（3）在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的

股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3、对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异，未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。

4、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

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

6、估值计算中涉及港币或其他外币币种对人民币汇率的，将依据下列信息提供机构所提供的汇率为基准：当日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率的中间价。

7、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。

8、其他资产按法律法规或监管机构有关规定进行估值。

9、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方法估值。

10、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以对本基金采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。

11、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。本基金的基金会计主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见，按照基金管理人对基金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估值日闭市后，该类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，小数点后第五位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。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。

基金管理人于每个估值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、基金管理人应每个估值日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个估值日对基金资产估值后，将基金资产净值和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，由基金管理人按约定对外公布。

六、估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后四位以内(含第四位)发生估值错误时，视为基金份额净值错误。

基金合同的当事人应按照以下约定处理：

1、估值错误类型

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

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

2、估值错误处理原则

（1）估值错误已发生，但尚未给当事人造成损失时，估值错误责任方应及

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

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

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

（4）估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

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

4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

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

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

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

（4）前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。如果行业另有通行做法，基金管理人、基金托管人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商。

七、暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

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

3、当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上的，经与基金托管人协商确认后，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负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个估值日交易结束后计算当日的基金资产净值和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，由基金管理人按规定对各类基金份额净值予以公布。

九、特殊情况的处理

1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 9 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

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

十、实施侧袋机制期间的基金资产估值

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

# 第十三部分 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，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，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，基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若基金份额持有人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

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

4、由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 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收益将有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配的有关业务规则进行调整，此项调整不需要召开基金份额持有人大会，但应于调整实施日前在规定媒介上公告。

四、收益分配方案

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

五、收益分配方案的确定、公告与实施

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

六、基金收益分配中发生的费用

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

七、实施侧袋机制期间的收益分配

本基金实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配。

# 第十四部分 基金费用与税收

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、C 类基金份额的基金销售服务费；

4、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；

5、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费；

6、基金份额持有人大会费用；

7、基金的证券/期货等交易、结算费用；

8、基金的银行汇划费用；

9、基金的账户开户费用、账户维护费用；

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×1.20%÷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，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

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×0.20%÷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，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

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% 。销售服务费的计算方法如下：

H＝E×0.40% ÷当年天数

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为前一日 C 类基金份额基金资产净值

C 类基金份额的销售服务费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性划出，经登记机构分别支付给各个基金销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

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，与侧袋账户资产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“侧袋机制”部分的规定。

五、基金税收

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

# 第十五部分 基金的会计与审计

一、基金会计政策

1、基金管理人为本基金的基金会计责任方，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就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以托管协议约定的方式确认。

二、基金的年度审计

1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。

2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意。

3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所需按照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

# 第十六部分 基金的信息披露

一、本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《流动性风险管理规定》、基金合同及其他有关规定。相关法律法规关于信息披露的披露方式、登载媒介、报备方式等规定发生变化时，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法规和中国证监会规定的自然人、法人和非法人组织。

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

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

三、本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；

2、对证券投资业绩进行预测；

3、违规承诺收益或者承担损失；

4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构；

5、登载任何自然人、法人和非法人组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；

6、中国证监会禁止的其他行为。

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

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

五、公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

（一）基金招募说明书、基金合同、基金托管协议、基金产品资料概要

1、基金合同是界定基金合同当事人的各项权利、义务关系，明确基金份额持有人大会召开的规则及具体程序，说明基金产品的特性等涉及基金投资人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人决策的全部事项，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，基金管理人应当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在规定媒介上登载基金合同生效公告。

（四）基金净值信息

基金合同生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周在规定网站披露一次各类基金份额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，通过其规定网站、基金销售机构网站或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，并保证投资人能够在销售机构网点或营业网点查阅或者复制前述信息资料。

（六）基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告

基金管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成基金年度报告，并将年度报告登载在规定网站上，并将年度报告提示性公告登载在规定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计。

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

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

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

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

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

（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、基金管理人高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；

10、基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十，基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十；

11、涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁；

12、基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；

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

14、基金收益分配事项；

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

16、基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；

17、本基金开始办理申购、赎回；

18、本基金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、本基金推出新业务或服务；

23、本基金管理人采用摆动定价机制进行估值；

24、调整基金份额类别设置；

25、连续 30 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 万元的情形；

26、连续 40 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 万元的情形；

27、连续 45 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元的情形；

28、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

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

（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，并按照《信息披露办法》予以公告。

（十）清算报告

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

（十一）基金投资股指期货的信息披露

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）等文件中披露股指期货交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示股指期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标等。

（十二）投资国债期货的信息披露

基金管理人应当在基金季度报告、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，包括投资政策、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投资政策和投资目标等。

（十三）基金投资资产支持证券的信息披露

基金管理人应在基金年度报告及中期报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细。基金管理人应在基金季度报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期末按市值占基金净资产比例大小排序的前 10 名资产支持证券明细。

（十四）参与融资业务的信息披露

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）等文件中披露参与融资交易的情况，包括投资策略、业务开展情况、损益情况、风险及管理情况。

（十五）投资股票期权的信息披露

基金管理人应在定期信息披露文件中披露参与股票期权交易的有关情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标、估值方法等，并充分揭示股票期权交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标。

（十六）基金投资港股通标的股票的相关公告

基金管理人应当在基金年度报告、中期报告和季度报告等定期报告和招募说明书等文件中披露本基金投资港股通标的股票的投资情况。若法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。（十七）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“侧袋机制”部分的规定。

（十八）中国证监会规定的其他信息。

六、信息披露事务管理

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

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

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

基金管理人、基金托管人应当在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、 暂停或延迟信息披露的情形

当出现下述情况时，基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金相关信息：

1、不可抗力；

2、发生暂停估值的情形；

3、法律法规规定、中国证监会或基金合同认定的其他情形。

# 第十七部分 侧袋机制

一、侧袋机制的实施条件和程序

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

基金管理人应当在启用侧袋机制后及时发布临时公告，并及时聘请符合《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。

二、实施侧袋机制期间基金份额的申购与赎回

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

2、实施侧袋机制期间，基金管理人不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。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。

3、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。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应当以主袋账户资产为基准。

基金管理人原则上应当在侧袋机制启动后 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、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。

五、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资产净值和份额净值，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。

六、实施侧袋账户期间的基金费用

1、本基金实施侧袋机制的，主袋账户的管理费、托管费、销售服务费按主袋账户基金资产净值作为基数计提；侧袋账户的托管费、销售服务费根据法律法规按侧袋账户资产净值为基数计提，法律法规对侧袋账户的计提基数等另有规定的，从其规定。

2、与侧袋账户有关的费用可从侧袋账户中列支，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。

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特定资产处置进展情况，披露报告期末特定资产可变现净值或净值区间的，需同时注明不作为特定资产最终变现价格的承诺。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。

# 第十八部分 风险揭示

一、市场风险

本基金投资于证券市场，由于整体政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响从而形成风险，主要包括：

1、政策风险

货币政策、财政政策、产业政策等国家宏观经济政策和法律法规的变化对证券市场产生一定影响，从而导致市场价格波动，影响基金收益而产生的风险。

2、经济周期风险

经济运行具有周期性的特点，经济运行周期性的变化会对基金所投资的证券的基本面产生影响，从而影响证券的价格而产生风险。

3、利率风险

金融市场利率的波动会直接导致债券市场的价格和收益率变动，同时也影响到证券市场资金供求状况，以及拟投资债券的融资成本和收益率水平。上述变化将直接影响证券价格和本基金的收益。

4、购买力风险

基金收益的一部分将通过现金形式来分配，而现金的购买力可能因为通货膨胀的影响而下降，从而使基金的实际投资收益下降。

二、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。

三、再投资风险

市场利率下降将影响固定收益类证券利息收入的再投资收益率，这与利率上升带来的价格风险互为消长。

四、投资资产支持证券风险

本基金投资资产支持证券，资产支持证券是一种债券性质的金融工具。资产支持证券具有一定的价格波动风险、流动性风险、信用风险等风险。本基金管理人将本着谨慎和控制风险的原则进行资产支持证券投资，请基金份额持有人关注包括投资资产支持证券可能导致的基金净值波动、流动性风险和信用风险在内的各项风险。

五、信用风险

信用风险指债券发行人或存款银行出现违约、拒绝支付到期本息，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下降的风险，信用风险也包括证券交易对手因违约而产生的证券交割风险。

六、流动性风险

本基金的流动性风险主要体现在基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资人赎回款项的风险。

1、拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

本基金拟投资的市场和拟投资的投资标的都具有较高的流动性，在正常情况下，其开放日开放申购赎回的机制安排、分散化投资的制度安排等可以满足本基金日常的投资管理需要及应对赎回的资金调拨需求。但在极端的、特殊的市场情况下，若所投资的市场普遍面临流动性风险，本基金投资标的的流动性风险也将在一定程度上影响本基金的资产变现能力及赎回款项支付能力。

2、巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

巨额赎回为开放式基金特有的风险，在本基金发生巨额赎回时，基金管理人可能采用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、摆动定价等具体措施对赎回申请进行适度调整。

3、实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响等

当本基金发生巨额赎回，且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等情形时，基金管理人可对部分赎回申请延期办理；当本基金发生暂停估值、基金资产估值存在重大不确定性、连续巨额赎回等情形时，基金管理人可暂停赎回或延缓支付赎回款项；当本基金遭遇大额申购赎回时，基金管理人可以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。上述流动性风险管理工具可能导致投资人的赎回申请无法得到及时确认、赎回款项无法得到及时支付、赎回价格因摆动定价机制存在更多的不确定性等情形。

当基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，根据最大限度保护基

金份额持有人利益的原则，基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制。侧袋机制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。

七、基金管理风险

基金管理风险指基金管理人在基金管理实施过程中产生的风险，主要包括以下几种：

1、管理风险

在基金管理运作过程中，由于基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等主观因素的限制而影响其对信息的占有以及对经济形势、证券价格走势的判断而产生的风险。

2、交易风险

由于交易权限或业务流程设置不当导致交易执行流程不畅通，交易指令的执行产生偏差或错误，或者由于故意或重大过失未能及时准确执行交易指令，

事后也未能及时通知相关人员或部门，导致基金利益的直接损失。

3、运营风险

由于运营系统、网络系统、计算机或交易软件等发生技术故障或瘫痪等情况而无法正常完成基金的申购、赎回、注册登记、清算交收等指令而产生的操作风险，或者由于操作过程效率低下或人为疏忽和错误而产生的操作风险。

4、道德风险

因业务人员道德行为违规产生的风险，如内幕交易，欺诈行为等。

八、本基金特有的风险

1、行业股票基金的风险

本基金是股票型基金，重点投资于高端装备主题相关的上市公司，在严格控制风险和保持良好流动性的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。股票市场、债券市场的波动都将影响到本基金的业绩表现。本基金管理人将发挥自身投研优势,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、通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港市场股票的风险

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所（以下简称：“香港联交所”或“联交所”）上市的股票，除与其他投资于内地市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还面临港股通机制下因投资环境、投资者结构、投资标的构成、市场制度以及交易规则等差异所带来的特有风险，包括但不限于：

（1）市场联动的风险

与内地 A 股市场相比，港股市场上外汇资金流动更为自由，海外资金的流动对港股价格的影响巨大，港股价格与海外资金流动表现出高度相关性,本基金在参与港股市场投资时受到全球宏观经济和货币政策变动等因素所导致的系统风险相对更大。

（2）股价波动的风险

港股市场实行 T+0 回转交易机制（即当日买入的股票，在交收前可以于当日卖出），同时对个股不设涨跌幅限制，加之香港市场结构性产品和衍生品种类相对丰富以及做空机制的存在；港股股价受到意外事件影响可能表现出比 A 股

更为剧烈的股价波动，本基金持仓的波动风险可能相对较大。

（3）汇率风险

在现行港股通机制下，港股的买卖是以港币报价，以人民币进行支付，并且资金不留港（港股交易后结算的净资金余额头寸以换汇的方式兑换为人民币），故本基金每日的港股买卖结算将进行相应的港币兑人民币的换汇操作，本基金承担港元对人民币汇率波动的风险，以及因汇率大幅波动引起账户透支的风险。

另外本基金对港股买卖每日结算中所采用的报价汇率可能存在报价差异，本基金可能需额外承担买卖结算汇率报价点差所带来的损失；同时根据港股通的规则设定，本基金在每日买卖港股申请时将参考汇率买入/卖出价冻结相应的资金，该参考汇率买入价和卖出价设定上存在比例差异，以抵御该日汇率波动而带来的结算风险，本基金将因此而遭遇资金被额外占用进而降低基金投资效率的风险。

（4）港股通额度限制

现行的港股通规则，对港股通设有总额度以及每日额度上限的限制；本基金可能因为港股通市场总额度或每日额度不足，而不能买入看好之投资标的进而错失投资机会的风险。

（5）港股通可投资标的范围调整带来的风险

现行的港股通规则，对港股通下可投资的港股范围进行了限制，并定期或不定期根据范围限制规则对具体的可投资标的进行调整，对于调出在投资范围的港股，只能卖出不能买入；本基金可能因为港股通可投资标的范围的调整而不能及时买入看好的投资标的，而错失投资机会的风险。

（6）港股通交易日设定的风险

根据现行的港股通规则，只有沪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，存在港股通交易日不连贯的情形。

如内地市场因放假等原因休市而香港市场照常交易但港股通不能如常进行交易，将导致基金所持的港股组合在后续港股通交易日开市交易中集中体现市场反应而造成其价格波动骤然增大，进而导致本基金所持港股组合在资产估值上出现波动增大的风险。

如在内地市场开市而香港市场休市的情形下，港股通也不能正常交易，本

基金所持港股将不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险等。

（7）交收制度带来的基金流动性风险

由于香港市场实行 T+2 日（T 日买卖股票，资金和股票在 T+2 日才进行交收）的交收安排，本基金在 T 日（港股通交易日）卖出股票，T+2 日（港股通交易日，即为卖出当日之后第二个港股通交易日）才能在香港市场完成清算交收，卖出的资金在 T+3 日才能回到人民币资金账户。因此交收制度的不同以及港股通交易日的设定原因，本基金可能面临卖出港股后资金不能及时到账，而造成支付赎回款日期比正常情况延后而给投资者带来流动性风险，同时也存在不能及时调整基金资产组合中 A 股和港股投资比例，造成比例超标的风险。

（8）港股通下对公司行为的处理规则带来的风险

根据现行的港股通规则，本基金因所持港股通股票权益分派、转换、上市公司被收购等情形或者异常情况，所取得的港股通股票以外的香港联交所上市证券，只能通过港股通卖出，但不得买入；因港股通股票权益分派或者转换等情形取得的香港联交所上市股票的认购权利在联交所上市的，可以通过港股通卖出，但不得行权；因港股通股票权益分派、转换或者上市公司被收购等所取得的非联交所上市证券，可以享有相关权益，但不得通过港股通买入或卖出。

本基金存在因上述规则，利益得不到最大化甚至受损的风险。

（9）香港联合交易所停牌、退市等制度性差异带来的风险

香港联交所规定，在交易所认为所要求的停牌合理而且必要时,上市公司方可采取停牌措施。此外，不同于内地 A 股市场的停牌制度，联交所对停牌的具体时长并没有量化规定，只是确定了“尽量缩短停牌时间”的原则；同时与 A 股市场对存在退市可能的上市公司根据其财务状况在证券简称前加入相应标记(例如，ST 及*ST 等标记)以警示投资者风险的做法不同，在香港联交所市场没有风险警示板,联交所采用非量化的退市标准且在上市公司退市过程中拥有相对较大的主导权，使得联交所上市公司的退市情形较 A 股市场相对复杂。

因该等制度性差异，本基金可能存在因所持个股遭遇非预期性的停牌甚至退市而给基金带来损失的风险。

（10）港股通规则变动带来的风险

本基金是在港股通机制和规则下参与香港联交所证券的投资，受港股通规

则的限制和影响；本基金存在因港股通规则变动而带来基金投资受阻或所持资产组合价值发生波动的风险。

（11）其他可能的风险

除上述显著风险外，本基金参与港股通投资，还可能面临的其他风险，包括但不限于：

①除因股票交易而发生的佣金、交易征费、交易费、交易系统费、印花税、过户费等税费外，在不进行交易时也可能要继续缴纳证券组合费等项费用，本基金存在因费用估算不准而导致账户透支的风险；

②在香港市场，部分中小市值港股成交量则相对较少，流动较为缺乏，本基金投资此类股票可能因缺乏交易对手而面临个股流动性风险；

③在本基金参与港股通交易中若香港联交所与内地交易所的证券交易服务公司之间的报盘系统或者通信链路出现故障，可能导致 15 分钟以上不能申报和撤销申报的交易中断风险；

④存在港股通香港结算机构因极端情况下无法交付证券和资金的结算风险；另外港股通境内结算实施分级结算原则，本基金可能面临以下风险：（一）因结算参与人未完成与中国结算的集中交收，导致本基金应收资金或证券被暂不交付或处置；（二）结算参与人对本基金出现交收违约导致本基金未能取得应收证券或资金；（三）结算参与人向中国结算发送的有关本基金的证券划付指令有误的导致本基金权益受损；（四）其他因结算参与人未遵守相关业务规则导致本基金利益受到损害的情况。

3、股指期货投资风险

本基金投资于股指期货。投资于股指期货需承受市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险和法律风险等。由于股指期货通常具有杠杆效应，价格波动比标的工具更为剧烈，有时候比投资标的资产要承担更高的风险。并且由于股指期货定价复杂，不适当的估值有可能使基金资产面临损失风险。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者权益遭受较大损失。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，可能给投资带来损失。

4、国债期货投资风险

本基金投资于国债期货，国债期货市场的风险类型较为复杂，涉及面广，主要包括：利率波动原因造成的市场价格风险、宏观因素和政策因素变化而引起的系统风险、市场和资金流动性原因引起的流动性风险、交易制度不完善而引发的制度性风险等。

5、股票期权投资风险

本基金投资于股票期权，投资股票期权所面临的主要风险是股票期权价格波动带来的市场风险；因保证金不足、备兑证券数量不足或持仓超限而导致的强行平仓风险；股票期权具有高杠杆性，当出现不利行情时，微小的变动可能会使投资人权益遭受较大损失；包括对手方风险和连带风险在内的第三方风险；以及各类操作风险，极端情况下会给投资组合带来较大损失。

6、融资风险

本基金参与融资业务，在放大收益的同时也放大了风险。类似于期货交易，融资业务在交易过程中需要全程监控其担保金的比例，以保证其不低于所要求的维持担保比率，这种“盯市”的方式对本基金流动性的管理提出了更高的要求。

7、投资存托凭证的风险

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

8、《基金合同》自动终止风险

《基金合同》生效后，连续 50 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元的，则直接进入基金财产清算程序并终止

《基金合同》，无需召开基金份额持有人大会审议。投资人面临《基金合同》自动终止的风险。

九、不可抗力

战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金资产有遭受损失的风险。基金管理人、基金托管人、证券交易所、登记机构和销售代理机构等可能因不可抗力无法正常工作，从而影响基金的各项业务按正常时限完成。

# 第十九部分 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基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于法律法规规定和基金合同约定可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

2、关于基金合同变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，并自决议生效后两日内在规定媒介公告。

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、具有证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

4、基金财产清算程序：

（1）基金合同终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；

（2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；

（3）对基金财产进行估值和变现；

（4）制作清算报告；

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

（6）将清算报告报中国证监会备案并公告；

（7）对基金剩余财产进行分配。

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

四、清算费用

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

五、基金财产清算剩余资产的分配

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

六、基金财产清算的公告

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

七、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存不低于法律法规规定的最低期限。

# 第二十部分 《基金合同》的内容摘要

一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

（一） 基金份额持有人的权利与义务

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

同一类别每份基金份额具有同等的合法权益。

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

（1）分享基金财产收益；

（2）参与分配清算后的剩余基金财产；

（3）依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；

（4）按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会；

（5）出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；

（6）查阅或者复制公开披露的基金信息资料；

（7）监督基金管理人的投资运作；

（8）对基金管理人、基金托管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；

（9）法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他权利。

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

（1）认真阅读并遵守基金合同、招募说明书等信息披露文件；

（2）了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；

（3）关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；

（4）交纳基金认购、申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用；

（5）在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；

（6）不从事任何有损基金及其他基金合同当事人合法权益的活动；

（7）执行生效的基金份额持有人大会的决议；

（8）返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；

（9）法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

（二） 基金管理人的权利与义务

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

（1）依法募集资金；

（2）自基金合同生效之日起，根据法律法规和基金合同独立运用并管理基金财产；

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

（4）销售基金份额；

（5）按照规定召集基金份额持有人大会；

（6）依据基金合同及有关法律规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了基金合同及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资人的利益；

（7）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

（8）选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；

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

（10）依据基金合同及有关法律规定决定基金收益的分配方案；

（11）在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；

（12）依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

（13）在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；

（14）以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或

者实施其他法律行为；

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

（16）在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户和定期定额投资等业务规则；

（17）法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他权利。

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

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

（2）办理基金备案手续；

（3）自基金合同生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；

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

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

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

（7）依法接受基金托管人的监督；

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

（9）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

（10）编制季度报告、中期报告和年度报告；

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

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

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

（14）按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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

（16）按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上；

（17）确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照基金合同规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件；

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

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

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

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

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

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

（24）基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，基金合同不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人；

（25）执行生效的基金份额持有人大会的决议；

（26）建立并保存基金份额持有人名册；

（27）法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

（三） 基金托管人的权利与义务

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

（1）自基金合同生效之日起，依法律法规和基金合同的规定安全保管基金财产；

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

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

（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的其他账户，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、托管协议及其他有关规定外，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、托管协议的约定，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、托管协议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，但向审计、法律等外部专业顾问提供的情况除外；

（8）复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值、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；如果基金管理人有未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

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

（12）从基金管理人或其委托的基金登记机构处接收并保存基金份额持有人名册；

（13）按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

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

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

（16）按照法律法规和基金合同的规定监督基金管理人的投资运作；

（17）参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

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

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

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

基金管理人追偿；

（21）执行生效的基金份额持有人大会的决议；

（22）法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

二、基金份额持有人大会

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同一类别每一基金份额拥有平等的投票权。

本基金份额持有人大会不设日常机构。

（一）召开事由

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

（1）终止基金合同；

（2）更换基金管理人；

（3）更换基金托管人；

（4）转换基金运作方式；

（5）调整基金管理人、基金托管人的报酬标准；

（6）变更基金类别；

（7）本基金与其他基金的合并；

（8）变更基金投资目标、范围或策略；

（9）变更基金份额持有人大会程序；

（10）基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；

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

（12）对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

（13）法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

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

（1）法律法规要求增加的基金费用的收取；

（2）调整本基金的申购费率、调低赎回费率或调整收费方式；

（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重大变化；

（5）本基金推出新业务或服务；

（6）基金管理人、销售机构、基金登记机构等调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则；

（7）基金管理人调整基金份额类别设置、增加新的基金份额类别、停止现有基金份额类别的销售等或对基金份额分类办法及规则进行调整；

（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集时，由基金托管人召集。

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

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

提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

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

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

（三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

（1）会议召开的时间、地点和会议形式；

（2）会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；

（3）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；

（4）授权委托证明的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；

（5）会务常设联系人姓名及联系电话；

（6）出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；

（7）召集人需要通知的其他事项。

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、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）本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）；若本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面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书面意见或授权他人代表出具书面意见；

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

3、在法律法规和监管机关允许的情况下，本基金的基金份额持有人亦可采用其他非书面方式授权其代理人出席基金份额持有人大会，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

4、在会议召开方式上，本基金亦可采用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基金份额持有人大会，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。

（五）议事内容与程序

1、议事内容及提案权

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

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

2、议事程序

（1）现场开会

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

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

（2）通讯开会

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

（六）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

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

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

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

在上述规则的前提下，具体规则以召集人发布的基金份额持有人大会通知为准。

（七）计票

1、现场开会

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

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

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

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

2、通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对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 2 日内在规定媒介上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

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

（九）本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规的部分，如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人在履行适当程序并公告后，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。

（十）实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定

若本基金实施侧袋机制，本部分和“基金管理人、基金托管人的更换条件和程序”部分约定的以下情形中的相关基金份额或表决权的比例均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基金总份额的二分之一、召集人在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内就原定审议事项重新召集的基金份额持

有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）相关基金份额的持有人参与或授权他人参与基金份额持有人大会投票；

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

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

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

同一主侧袋账户内的每份基金份额具有平等的表决权。

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

2、关于基金合同变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，并自决议生效后两日内在规定媒介公告。

（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、具有证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

4、基金财产清算程序：

（1）基金合同终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；

（2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；

（3）对基金财产进行估值和变现；

（4）制作清算报告；

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

（6）将清算报告报中国证监会备案并公告；

（7）对基金剩余财产进行分配。

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

（四）清算费用

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

（五）基金财产清算剩余资产的分配

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

（六）基金财产清算的公告

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

（七）基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存不低于法律法规规定的最低期限。

四、争议的处理

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，如经友好协商未能解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京市，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力。除非仲裁裁决另有规定，仲裁费由败诉方承担。

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

基金合同受中国（为本基金合同之目的，不含台湾、香港、澳门地区）法律管辖并从其解释。

五、基金合同存放地和投资人取得基金合同的方式

基金合同是约定基金合同当事人之间权利义务关系的法律文件。

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

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

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

4、基金合同正本一式六份，除上报有关监管机构一式两份外，基金管理人、基金托管人各持有两份，每份具有同等的法律效力。

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

# 第二十一部分 《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

名称：建信基金管理有限责任公司

注册地址：北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 16 层

办公地址：北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 16 层

法定代表人：曲寅军

成立时间：2005 年 9 月 19 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证券监督管理委员会、中国证监会证监基金字[2005]158 号

经营范围：基金募集；基金销售；资产管理以及中国证监会许可的其它业务（依法须经批准的项目,经相关部门批准后依批准的内容开展经营活动。）

注册资本：人民币 2 亿元

组织形式：有限责任公司

存续期间：持续经营

（二）基金托管人

名称：光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闸路 1508 号

法定代表人：刘秋明

成立时间：1996 年 4 月 23 日

批准设立机关及批准设立文号：中国人民银行核发银复［1995］214 号文

基金托管业务批准文号：证监许可〔2020〕1242 号

经营范围：证券经纪；证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问；证券承销与保荐；证券自营；为期货公司提供中间介绍业务；证券投资基金代销；融资融券业务；代销金融产品业务；股票期权做市业务；证券投资基金托管；中国证监会批准的其他业务。【依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动】

组织形式：股份有限公司（台港澳与境内合资、上市）

注册资本：461078.7639 万元人民币

存续期间：持续经营

联系人：窦华宸

联系电话：021-22167436

二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

（一）基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权

1、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》和本托管协议的约定，对基金的投资范围、投资对象进行监督。

本基金的投资范围主要为具有较好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板、存托凭证及其他中国证监会允许基金投资的股票）、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通投资标的股票”）、股指期货、股票期权、债券（包括国债、地方政府债、政府支持机构债券、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、国债期货、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。

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

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

（1）按法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金的投资资产配置比例为：

基金的投资组合比例为：股票资产投资比例为基金资产的 80-95%，其中投资于本基金界定的“高端装备行业股票”的比例不低于非现金资产的 80%；港股通标的股票投资比例不超过全部股票资产的 50%；每个交易日日终在扣除国债期货、股指期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如果法律法规对该比例要求有变更的，基金管理人在履行适当程序后，本

基金的投资比例相应调整。本基金可根据法律法规的规定参与融资业务。

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

1）股票资产投资比例为基金资产的 80-95%，其中投资于本基金界定的“高端装备行业股票”的比例不低于非现金资产 80%；港股通标的股票投资比例不超过全部股票资产的 50%；

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

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

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

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证券投资基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

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

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

11）本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%，进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为 1 年，

债券回购到期后不得展期；

12）本基金参与股指期货、国债期货交易依据下列标准建构组合：

①在任何交易日日终，持有的买入国债期货和股指期货合约价值与有价证券市值之和不得超过基金资产净值的 95%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

②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%；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%；

③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%；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%；

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

⑤本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；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）基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

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

15）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过资产净值的 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；

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

17）本基金参与融资业务后，在任何交易日日终持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；

18）因未平仓的期权合约支付和收取的权利金总额不得超过基金资产净值的 10%；开仓卖出认购期权的，应持有足额标的证券；开仓卖出认沽期权的，应持有合约行权所需的全额现金或交易所规则认可的可冲抵期权保证金的现金等价物；未平仓的期权合约面值不得超过基金资产净值的 20%。其中，合约面值按照行权价乘以合约乘数计算；

19）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；

20）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述第 2）、9）、15）、16）项情形之外，因证券、期货市场波动、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。在此期间，基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准。

3、为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

（1）承销证券；

（2）违反规定向他人贷款或者提供担保；

（3）从事承担无限责任的投资；

（4）买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；

（5）向其基金管理人、基金托管人出资；

（6）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

（7）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

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

法律、行政法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金在履行适当程序后不再受相关限制。

4、基金托管人根据有关法律法规规定及《基金合同》和本托管协议约定，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。

基金托管人依据有关法律法规规定和《基金合同》约定对基金管理人参与银行间债券市场交易时面临的交易对手资信风险进行监督。

基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的、经慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手的名单，并约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金托管人在收到名单后 2 个工作日内电话或书面回函确认收到该名单。基金托管人监督基金管理人是否按事前提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易。

基金管理人可以定期（每半年）和不定期对银行间债券市场现券及回购交易对手的名单进行更新。基金托管人在收到名单后 2 个工作日内电话或书面回函确认，新名单自基金托管人确认当日生效。新名单生效前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。

基金管理人参与银行间债券市场交易时，应按银行间债券市场的交易规则进行交易，并有责任控制交易对手的资信风险，由于交易对手资信风险引起的损失，基金管理人应当负责向相关责任人追偿。

如基金托管人事后发现基金管理人没有按照事先约定的交易对手进行交易时，基金托管人应及时电话或书面回函提醒基金管理人，经提醒后仍未改正，造成基金财产损失的，基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任。如果基金托管人未能切实履行监督职责，导致基金出现风险或造成基金资产损失的，基金托管人应承担相应责任。

5、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》和本托管协议的约定，对基金管理人选择存款银行进行监督。

基金投资银行存款的，基金管理人应根据法律法规的规定及《基金合同》的约定选择存款银行，做好风险控制；并按照基金托管人的要求配合基金托管人完成相关业务办理。

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

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

（2）流通受限证券，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。本基金不投资有锁定期但锁定期不明确的证券。

（3）基金管理人应保证本基金投资的流通受限证券登记存管在本基金名下，并确保基金托管人能够正常查询。因基金管理人原因产生的流通受限证券登记存管问题，造成基金托管人无法安全保管本基金资产的责任与损失，及基金财产的直接损失，由基金管理人承担。

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

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

（如有）：拟发行数量、定价依据、监管机构的批准证明文件复印件、基金管理人与承销商签订的销售协议复印件、缴款通知书、基金拟认购的数量、价格、总成本、划款账号、划款金额、划款时间文件等。基金管理人应保证上述信息的真实、完整。

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

（7）如果基金管理人未按照本托管协议的约定向基金托管人报送相关数据或者报送了虚假的数据，导致基金托管人不能按照《基金合同》及本托管协议的约定履行基金托管人职责，因投资流通受限证券产生的损失，基金托管人按照本托管协议履行监督职责后不承担上述损失。

（8）基金托管人根据有关规定有权对基金管理人进行以下事项监督：

1）本基金投资流通受限证券时的法律法规遵守情况；

2）在基金投资流通受限证券管理工作方面有关制度、流动性风险处置预案的建立与完善情况；

3）有关比例限制的执行情况；

4）信息披露情况。

（9）相关法律法规对基金投资流通受限证券有新规定的，从其规定。

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

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

基金托管人发现基金管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作违反法律法规、《基金合同》和本托管协议的规定，应及时以书面形式或双方认可的方式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到书面通知后应在三个工作日内及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函，就基金托管人的合理疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。如果基金托管人未能切实履行监督职责，导致基金出现风险或造成基金资产损失的，基金托管人应承担相应责任。

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

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

（四）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，本基金的投资组合比例、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（包括但不限于对基金赎回的影响、信息披露、费用列支等）、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基金合同和招募说明书的规定。

基金托管人依照相关法律法规的规定以及基金合同和招募说明书的约定，对侧袋机制启用、特定资产处置和信息披露等方面进行监督。

三、基金管理人对基金托管人的业务核查

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

基金管理人可以定期（每半年）和不定期地对基金托管人保管的基金资产进行核查。基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复并改正。

基金管理人发现基金托管人未对基金资产实行分账管理、擅自挪用基金资产、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、《基金合同》、本托管协议及其他有关规定的，应及时以书面形式或双方认可的方式通知基金托管人在限期内纠正，基金托管人收到通知后应在下一工作日及时核对并以书面形式对基金管理人发出回函，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在限期内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应报告中国证监会。对基金管理人按照法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的，基金托管人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金托管人在限期内纠正。基金管理人有权利要求基金托管人赔偿基金以及基金管理人因此所遭受的损失。基金托管人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本托管协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经基金管理人提出警告仍不改正的，基金管理人应报告中国证监会。

四、基金财产的保管

（一）基金财产保管的原则

1、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人和证券经纪商的固有财产。

2、基金托管人应安全保管基金财产，未经基金管理人依据合法程序作出的合法合规的指令，基金托管人不得自行运用、处分、分配基金的任何资产，法律法规、基金合同及本托管协议另有规定除外。

3、基金托管人按照规定开立基金财产的基金托管专户、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独立核算和分账管理，确保基金财产的完整和独立。

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

6、对于因为基金投资产生的应收资产和基金认（申）购过程中产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金资产没有到达基金账户的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失。基金托管人对此予以必要的配合与协助，但不承担任何责任。

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

（二）基金募集期间及募集资金的验证

1、基金募集期间募集的资金应存于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开立并管理。

2、基金募集期满或基金管理人依据法律法规及招募说明书决定停止基金发售时，符合《基金法》、《运作办法》等有关规定的，基金管理人应将募集到的属于基金财产的全部资金划入基金托管人为本基金开立的基金托管专户，基金托管人在收到资金当日出具书面文件确认资金到账情况。同时在规定时间内，由基金管理人聘请符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所对基金进行验资，出具验资报告。出具的验资报告应由参加验资的 2 名以上（含 2 名）中国注册会计师签字有效。

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等事宜，基金托管人应提供充分协助。

（三）基金托管专户的开立和管理

1、基金托管人应负责本基金的基金托管专户的开立和管理。

2、基金托管人应以本基金的名义在具有基金托管资格的商业银行开立本基金的基金托管专户，并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。本基金的基金托管专户的银行预留印鉴为基金托管人的托管财务专用章和托管部负责人名章各一枚，由基金托管人制作、保管和使用。本基金的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益、收取申购款，均需通过本基金的基金托管专户进行。

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

4、基金托管人可以通过申请开通本基金基金托管专户的企业网上银行业务进行资金支付，并使用企业网上银行（简称“网银”）办理托管资产的资金结算汇划业务。

5、基金托管专户的开立和管理应符合法律法规以及银行业监督管理机构的其他规定。

（四）基金的证券账户和证券资金账户的开立和管理

1、基金托管人在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司为基金开立基金托管人与基金联名的证券账户。

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

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

4、交易所证券交易资金采用第三方存管模式，即用于证券交易结算资金全

额存放在基金管理人为基金开设的证券资金账户中，场内的证券交易资金清算由基金管理人所选择的证券经营机构负责。本基金通过证券经营机构进行的交易由证券经营机构作为结算参与人代理本基金进行结算。

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

（五）债券托管专户的开立和管理

根据基金管理人的要求，《基金合同》生效后，基金托管人根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司、银行间市场清算所股份有限公司的有关规定，以基金的名义负责在中央国债登记结算有限责任公司及银行间市场清算所股份有限公司开立债券托管专户和资金结算专户，并由基金托管人负责基金的债券及资金的清算。基金管理人代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议。全国银行间同业拆借市场的交易资格由基金管理人以基金的名义申请，银行间债券市场准入备案由基金管理人和基金托管人共同负责。

（六）其他账户的开立和管理

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

2、法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

（七）基金财产投资的有关实物证券、银行存款定期存单等有价凭证的保管

实物证券由基金托管人存放于基金托管人或其他基金管理人与基金托管人协商一致的第三方机构的保管库，保管凭证由基金托管人持有。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。属于基金托管人实际有效控制下的实物证券在基金托管人保管期间的损坏、灭失，由此产生的责任应由基金托管人承担。

银行存款定期存单等有价凭证由基金托管人负责保管。

（八）与基金财产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表本基金签署的与基金有关的重大合同的原件分别由基金

托管人、基金管理人保管，相关业务程序另有限制除外。除本托管协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时应尽可能保证基金一方持有二份及以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件，基金管理人在合同签署后 30 个工作日内通过专人送达、挂号邮寄等安全方式将合同原件送达基金托管人处。重大合同的保管期限不低于法律法规的规定。

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合同复印件，并在复印件上加盖公章，未经双方协商或未在合同约定范围内，合同原件不得转移。

五、基金资产净值计算和会计核算

（一）基金资产净值及基金份额净值的计算与复核

1、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

各类基金份额净值是按照每个工作日闭市后，该类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，由此产生的误差计入基金财产。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。

基金管理人于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、复核程序

基金管理人应每个估值日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或《基金合同》的规定暂停估值时除外。基金管理人每个估值日对基金资产估值后，将基金资产净值和各类基金份额净值结果以双方认可的方式发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人按规定对外公布。

（二）基金资产的估值

基金管理人及基金托管人应当按照《基金合同》的约定进行估值。

（三）基金份额净值错误的处理方式

基金管理人及基金托管人应当按照《基金合同》的约定处理份额净值错误。

（四）暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

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

3、当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上的，经与基金托管人协商确认后，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。

（五）基金会计制度

按国家有关部门制定的会计制度执行。

（六）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、记录和保管本基金的全套账册，对双方各自的账册定期进行核对，互相监督，以保证基金财产的安全。若双方对会计处理方法存在分歧，应以基金管理人的处理方法为准。

（七）会计数据和财务指标的核对

双方应每个交易日核对账目，如发现双方的账目存在不符的，基金管理人和基金托管人必须及时查明原因并纠正，确保核对一致。若当日核对不符，暂时无法查找到错账的原因而影响到基金净值信息的计算和公告的，以基金管理人的账册为准。

（八）基金定期报告的编制和复核

基金财务报表由基金管理人和基金托管人分别独立编制。月度报表的编制，应于每月终了后 5 个工作日内完成。季度报表的编制，应于每季度结束后 15 个工作日内完成；中期报告在上半年结束之日起两个月内完成编制；年度报告在每年结束之日起三个月内完成编制。定期报告（月度报表除外）文件应按中国证监会的要求公告。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。

基金管理人在月度报表完成当日，以约定方式将有关报表提供基金托管人；基金托管人在 2 个工作日内进行复核，并将复核结果反馈给基金管理人。基金管理人在季度报表完成当日，以约定方式将有关报表提供基金托管人，基金托

管人在 5 个工作日内进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在中期报告完成当日，将有关报告提供基金托管人，基金托管人在收到后 20 日内进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在年度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人，基金托管人在收到后 30 日内复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金托管人在复核过程中，发现双方的报表存在不符时，基金管理人和基金托管人应共同查明原因，进行调整，调整以双方认可的账务处理方式为准。如果基金管理人与基金托管人不能于应当发布公告之日前就相关报表达成一致，基金管理人有权按照其编制的报表对外发布公告，基金托管人有权就相关情况报证监会备案。

基金托管人在对财务报表、季度报告、中期报告或年度报告复核完毕后，出具复核确认书（盖章），以备有权机构对相关文件审核检查。

六、基金份额持有人名册的保管

本基金的基金管理人和基金托管人须分别妥善保管基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容包括但不限于基金份额持有人的名称、证件号码和持有的基金份额。

基金份额持有人名册，包括基金合同生效日的基金份额持有人名册、基金合同终止日的基金份额持有人名册、基金权益登记日的基金份额持有人名册、基金份额持有人大会权益登记日的基金份额持有人名册、每年 6 月 30 日、12 月 31 日的基金份额持有人名册，由基金登记机构负责编制和保管。

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

基金管理人和基金托管人应妥善保管基金份额持有人名册，基金份额登记机构的保存期限自基金账户销户之日起不得少于 20 年，法律法规或监管规则另有规定的，从其规定。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。若基金管理人或基金托管人由于自身原因无法妥善保管基金份额持有人名册，应按有关法规规定各自承担相应的责任。

七、争议解决方式

各方当事人同意，因本托管协议而产生的或与本托管协议有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京市，仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。除非仲裁裁决另有规定，仲裁费用由败诉方承担。

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

本托管协议受中国法律（为本托管协议之目的，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区法律）管辖并从其解释。

八、托管协议的变更、终止与基金财产的清算

（一）基金托管协议的变更

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

（二）基金托管协议的终止

1、《基金合同》终止；

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

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

4、发生法律法规、中国证监会或《基金合同》规定的终止事项。

（三）基金财产的清算

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

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员

组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

4、基金财产清算程序：

（1）《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；

（2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；

（3）对基金财产进行估值和变现；

（4）制作清算报告；

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

（6）将清算报告报中国证监会备案并公告；

（7）对基金剩余财产进行分配。

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

6、清算费用

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

7、基金财产清算剩余资产的分配

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

8、基金财产清算的公告

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

9、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存不低于法律法规规定的最

低期限。

# 第二十二部分 对基金份额持有人的服务

基金管理人秉承“持有人利益重于泰山”的经营宗旨，不断完善客户服务体系。公司承诺为客户提供以下服务，并将随着业务发展和客户需求的变化，积极增加服务内容，努力提高服务品质，为客户提供专业、便捷、周到的全方位服务。

一、客户服务电话：400-81-95533（免长途通话费用）

1、自助语音服务

客户服务中心提供每周 7 天，每天 24 小时的自动语音服务，内容包括：基金交易查询、账户资产查询、基金分红查询等。

2、人工咨询服务

客户服务中心提供交易日，9：00～17：30 的人工电话咨询服务。

3、客户留言服务

投资人可通过客户留言服务将其疑问、建议及联系方式告知公司客服中心，客服中心将在两个工作日内给予回复。

二、订制对账单服务

投资者可以通过本公司客户服务电话、电子邮箱、信件等方式订制对账单服务。本公司在准确获得投资者邮寄地址、手机号码及电子邮箱的前提下，将为已订制账单服务的投资者提供电子邮件、短信和纸质对账单：

1、电子邮件对账单

电子对账单是通过电子邮件向基金份额持有人提供交易对账的一种电子化的账单形式。电子对账单的内容包括但不限于：期末基金余额、期末份额市值、期间交易明细、分红信息等。我公司在每月度结束后 10 个工作日内向每位预留了有效电子邮箱并成功订制电子对账单服务的持有人发送电子对账单。

2、短信对账单

短信对账单是通过手机短信向基金份额持有人提供份额对账的一种电子化的账单形式。短信对账单的内容包括但不限于：期末基金余额、期末份额市值等。我公司在每月度结束后 10 个工作日内向每位预留了有效手机号码并成功定制短信对账单服务的持有人发送短信对账单。

3、纸质对账单

如投资者因特殊原因需要获取指定期间的纸质对账单，可拨打本公司客服热线 400-81-95533（免长途话费）按"0"转人工服务，提供姓名、开户证件号码或基金账号、邮寄地址、邮政编码、联系电话，客服人员核对信息无误后，将在 15 个工作日内为投资者免费邮寄纸质对账单。

三、网站服务（www.ccbfund.cn）

1、信息查询：客户可通过网站查询基金净值、产品信息、建信资讯、公司动态及相关信息等。

2、账户查询：投资人可通过官网“个人登录”或“机构登录”服务，查询账户信息，查询内容包括份额查询、交易查询、分红查询、分红方式查询等；同时投资人还可通过“密码管理”自助修改登录密码。

3、投资流程：直销客户可了解直销柜台办理各项业务的具体流程。

4、单据下载：直销客户可方便快捷的下载各类直销表单。

5、销售网点：客户可全面了解基金的销售网点信息。

6、常见问题：汇集了客户经常咨询的一些热点问题，帮助客户更好地了解基金基础知识及相关业务规则。

7、客户留言：通过网上客户留言服务，可将投资人的疑问、建议及联系方式告知客服中心，客服中心将在两个工作日内给予回复。

四、短信服务

若投资人准确完整地预留了手机号码（小灵通用户除外），可获得免费手机短信服务，包括产品信息、公司最新公告等。未预留手机号码的投资人可拨打客服电话或登录公司网站添加后定制此项服务。

五、电子邮件服务

若投资者准确完整的预留了电子邮箱地址，可获得免费电子邮件服务，包括产品信息、月度对账单等。未预留电子邮箱地址的投资者可拨打客服电话或登录公司网站添加后订制此项服务。

六、微信服务

我公司通过官方微信等即时通讯服务平台为投资者提供理财资讯及基金信息查询等服务。投资者可在微信中搜索“建信基金”或者“ccbfund”添加关注。

投资者通过公司官方微信可查询基金净值、产品信息、理财资讯等内容。

已开立建信基金账户的投资者，将微信账号与基金账号绑定后可查询基金份额、交易明细等信息。

七、密码解锁/重置服务

为保证投资人账户信息安全，当拨打客服电话或登录公司网站查询个人账户信息，输入查询密码错误累计达 6 次账户即被锁定。此时可致电客服电话转人工办理查询密码的解锁或重置。

八、客户建议、投诉处理

投资人可以通过网站客户留言、客服中心自动语音留言、客服中心人工坐席、书信等多种方式对基金管理人提出建议或投诉，客服中心将在两个工作日内给予回复。

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

# 第二十三部分 其他应披露事项

自 2025 年 9 月 1 日至 2026 年 8 月 31 日，本基金的临时公告刊登《上海证券报》和基金管理人网站 www.ccbfund.cn 等规定媒介。

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|---|---|---|---|
| 1 | 建信基金管理有限责任公司关于旗下部分基金调整业绩比较基准并修订基金合同等法律文件的公告 | 指定报刊和/或公司网站 | 2026-08-21 |
| 2 | 关于新增华创证券有限责任公司为建信旗下部分基金产品销售机构的公告 | 指定报刊和/或公司网站 | 2026-01-21 |
| 3 | 关于旗下基金改聘会计师事务所的公告 | 指定报刊和/或公司网站 | 2025-12-27 |
| 4 | 建信基金管理有限责任公司关于增加易方达财富管理基金销售（广州）有限公司为旗下销售机构并参加申购费率优惠活动的公告 | 指定报刊和/或公司网站 | 2025-12-11 |
| 5 | 关于新增招商证券股份有限公司为建信旗下部分基金产品销售机构的公告 | 指定报刊和/或公司网站 | 2025-09-02 |

投资者可通过《上海证券报》和基金管理人网站 www.ccbfund.cn 等规定媒介查阅上述公告。

# 第二十四部分 招募说明书的存放及查阅方式

本招募说明书存放在基金管理人、基金托管人、销售机构的住所，投资人可在办公时间免费查阅，也可按工本费购买本招募说明书的复制件或复印件。投资人按上述方式所获得的文件或其复印件。基金管理人和基金托管人应保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

# 第二十五部分 备查文件

1、中国证监会准予建信高端装备股票型证券投资基金注册的文件

2、《建信高端装备股票型证券投资基金基金合同》

3、《建信高端装备股票型证券投资基金托管协议》

4、关于申请募集注册建信高端装备股票型证券投资基金之法律意见书

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

存放地点：基金管理人、基金托管人处。

查阅方式：投资人可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

**建信基金管理有限责任公司**

二〇二六年九月