嘉实领航聚优积极配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）更新招募说明书

（2026年10月12日更新）

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

重要提示

嘉实领航聚优积极配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）（以下简称“本基金”）经中国证监会 2022 年 9 月 2 日证监许可[2022]2013 号《关于准予嘉实领航聚优积极配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）注册的批复》注册募集。本基金基金合同于 2022 年 12 月 13 日正式生效，自该日起本基金管理人开始管理本基金。

本招募说明书是对原《嘉实领航聚优积极配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）招募说明书》的更新，原招募说明书与本招募说明书不一致的，以本招募说明书为准。基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值和市场前景作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

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

本基金将 80%以上的基金资产投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集基金，基金净值会因为被投资基金净值波动、证券市场波动等因素而产生波动，投资者在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对本基金及被投资基金所持有的证券价格产生影响而形成的系统性风险，本基金及被投资基金持有的个别证券特有的非系统性风险，本基金及被投资基金因发生巨额赎回导致本基金流动性不足的风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险、操作或技术风险，以及本基金的特有风险等。

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

本基金为混合型基金中基金（FOF），本基金长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、股票型基金中基金（FOF），高于债券型基金、债券型基金中基金（FOF）、货币市场基金和货币型基金中基金（FOF）。

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

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

本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。

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

基金合同生效后，本基金对每一份认购/申购的基金份额分别计算 6 个月的“锁定持有期”，投资者持有的基金份额自锁定到期日的下一工作日起，方可申请赎回。因此基金份额持有人面临在锁定持有期内不能赎回基金份额的风险。

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 万元情形的，基金合同终止，无需召开基金份额持有人大会进行表决。因此，投资者将面临基金合同提前终止的不确定性风险。

当本基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，基金管理人履行相应程序后，可以启用侧袋机制，具体详见本招募说明书“侧袋机制”章节。侧袋机制实施期间，基金管理人将对基金简称进行特殊标识，并不办理侧袋账户的申购赎回。请基金份额持有人仔细阅读相关内容并关注本基金启用侧袋机制时的特定风险。

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

基金管理人深知个人信息对投资者的重要性，致力于投资者个人信息的保护。基金管理人承诺按照法律法规和相关监管要求的规定处理投资者的个人信息，包括通过基金管理人直销、销售机构或场内经纪机构购买嘉实基金管理有限公司旗下基金产品的所有个人投资者。基金管理人需处理的机构投资者信息中可能涉及其法定代表人、受益所有人、经办人等个人信息，也将遵守上述承诺进行处理。详情请关注嘉实基金官网

（http://www.jsfund.cn/main/include/privacy/index.shtml）披露的“嘉实基金隐私政策”及其后续作出的不时修订。

本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为 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(未经审计)，特别事项注明除外。

目录

一、绪言.....5
二、释义.....6
三、基金管理人.....11
四、基金托管人.....20
五、相关服务机构.....22
六、基金的募集.....44
七、基金合同的生效.....48
八、基金份额的申购与赎回.....49
九、基金的投资.....59
十、基金的业绩.....71
十一、基金的财产.....74
十二、基金资产的估值.....75
十三、基金的收益与分配.....81
十四、基金的费用与税收.....83
十五、基金的会计与审计.....86
十六、基金的信息披露.....87
十七、基金持有其他基金的信息披露.....93
十八、侧袋机制.....99
十九、风险揭示.....101
二十、基金合同的变更、终止与基金财产的清算.....109
二十一、基金合同的内容摘要.....111
二十二、基金托管协议的内容摘要.....125
二十三、对基金份额持有人的服务.....135
二十四、其他应披露事项.....137
二十五、招募说明书存放及查阅方式.....138
二十六、备查文件.....139

一、绪言

《嘉实领航聚优积极配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）招募说明书》（以下简称“本招募说明书”）依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集证券投资基金运作指引第 2 号——基金中基金指引》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 5 号<招募说明书的内容与格式>》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）等有关法律法规以及《嘉实领航聚优积极配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

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

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

二、释义

除非文意另有所指，本招募说明书中下列词语或简称具有如下含义：

1、基金/本基金：指嘉实领航聚优积极配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）

2、基金管理人：指嘉实基金管理有限公司

3、基金托管人：指中国银行股份有限公司

4、基金合同/《基金合同》：指《嘉实领航聚优积极配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充

5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《嘉实领航聚优积极配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充

6、招募说明书：指《嘉实领航聚优积极配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）招募说明书》及其更新的版本

7、基金份额发售公告：指《嘉实领航聚优积极配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金份额发售公告》

8、基金产品资料概要：指《嘉实领航聚优积极配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金产品资料概要》及其更新

9、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、司法解释、行政规章、规范性文件以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等，包括颁布机关对前述文件不时做出的修订

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

11、《销售办法》：指中国证监会 2020 年 8 月 28 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

12、《信息披露办法》：指中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1 日实施的，并经 2020 年 3 月 20 日中国证监会《关于修改部分证券期货规章的决定》修订的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

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

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

15、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

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

17、证券交易所：指根据法律法规的规定，由国家决定或批准设立的证券交易场所

18、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

19、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

20、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

21、合格境外投资者：指符合《合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者境内证券期货投资管理办法》及相关法律法规规定，可以使用来自境外的资金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，包括合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者

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

23、基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人

24、销售机构：指基金管理人以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得公开募集证券投资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、登记机构：指办理登记业务的机构。本基金的登记机构为基金管理人或接受基金管理人委托代为办理登记业务的机构

26、基金销售业务：指基金管理人或销售机构开立基金交易账户，宣传推介基金，办理基金份额的发售、申购、赎回、转换、转托管、定期定额投资及提供基金交易账户信息查询等业务

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

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

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

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

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

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

33、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

34、交易日：指证券交易所的正常交易之日

35、工作日：同交易日

36、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

37、T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日(不包含 T 日)

38、开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

39、开放时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

40、锁定持有期：指投资者持有本基金基金份额的最短持有期限，基金合同生效后，本基金对每一份认购/申购的基金份额分别计算 6 个月的“锁定持有期”，有效认购的基金份额的锁定持有期指基金合同生效日（锁定起始日）起至基金合同生效日后第 6 个月度对日的前一日（锁定到期日）之间的区间；有效申购的基金份额的锁定持有期指申购确认日（锁定起始日）起至申购确认日后第 6 个月度对日的前一日（锁定到期日）之间的区间。认购/申购的基金份额自锁定到期日的下一工作日起方可申请赎回

41、月度对日：指某一特定日期在后续日历月度中的对应日期，若该日历月度中不存在对应日期，则顺延至下一日为本月度的月度对日

42、业务规则：指由基金管理人制定并不时修订的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

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

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

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

46、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，申请将其持有的基金管理人管理的某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金基金份额的行为

47、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

48、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

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

50、元：指人民币元

51、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

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

53、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

54、基金份额净值：针对本基金各类基金份额，指计算日某一类基金份额的基金资产净值除以计算日该类基金份额的基金份额总数

55、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各类基金份额净值的过程

56、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

57、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

58、摆动定价机制：指当本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，确保投资人的合法权益不受损害并得到公平对待

59、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

60、特定资产：包括：（一）无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性的资产；（二）按摊余成本计量且计提资产减值准备仍导致资产价值存在重大不确定性的资产；（三）其他资产价值存在重大不确定性的资产

61、基金份额类别：指本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。各基金份额类别分别设置代码，合并投资运作，分别计算和公告各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值

A 类基金份额：指在投资人认购/申购基金份额时收取认购/申购费用，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额

C 类基金份额：指从本类别基金资产中计提销售服务费，并不收取认购/申购费用的基金份额

62、销售服务费：指从相应类别基金份额的基金资产中计提的，用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务的费用

63、不可抗力：指基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

三、基金管理人

（一） 基金管理人基本情况

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

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

（二） 主要人员情况

1、基金管理人董事、监事、总经理及其他高级管理人员基本情况

安国勇先生，董事长，博士研究生，中共党员。曾任中国人民财产保险股份有限公司船舶货运保险部总经理，华夏银行副行长（挂职），中国人保资产管理有限公司党委委员、副总裁，中诚信托有限责任公司党委书记、总裁。

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

Markus Johann Kobler 先生，董事，瑞士、英国及德国国籍。毕业于瑞士巴塞尔大学（University of Basel），获经济学博士学位。加入 DWS Group 前，Markus Johann Kobler 先生于 1993 年至 2023 年期间先后担任学术研究、管理咨询、金融服务及高级管理职务，

曾任职于瑞士巴塞尔大学（University of Basel）、麦肯锡公司（McKinsey & Company）、瑞士宝盛银行（Bank Julius Baer & Co. AG）及安联环球投资（Allianz Global Investors）等机构。Markus Johann Kobler 先生于 2023 年 11 月加入 DWS Group，目前担任管理委员会成员（Member of the Management Board）、首席财务官（Chief Financial Officer）及首席财务官部门负责人（Head of the CFO Division）。

沈铠圻（Heidi Sum）女士，董事，中国香港籍，毕业于香港大学，获工学学士学位，并持有特许金融分析师（CFA）资格及英国皇家特许测量师学会会员（MRICS）资格。沈铠圻女士拥有逾二十年亚太及全球资产管理、房地产投资及实物资产投资经验。加入 DWS Group 前，曾于新鸿基地产发展有限公司、领盛投资管理公司（LaSalle Investment Management）、嘉民集团（Goodman Group）及月桥资本有限公司（Moonbridge Capital）任职，从事房地产投资、私募房地产基金管理及相关投资管理工作。2014 年 9 月加入 DWS Group，先后担任亚太区主动股票及流动实物资产产品专家主管、亚太区产品主管等职务，现任董事总经理、全球流动实物资产产品主管。

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

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

汤欣先生，独立董事，法学博士，清华大学法学院教授、博士生导师，清华大学商法研究中心主任、清华大学全球私募股权研究院副院长。曾兼任中国证监会第一、二届并购重组审核委员会委员，中国上市公司协会第一、二届独立董事委员会主任委员、上海证券交易所第四、五届上市委员会委员。现兼任最高人民法院执行特邀咨询专家、深圳证券交易所法律专业咨询委员会委员、中国证券投资基金业协会法制工作委员会委员、中国上市公司协会学术顾问委员会委员、银行间市场交易商协会法律专业委员会委员。

陈重先生，独立董事，博士，中共党员，现任明石创新技术集团股份有限公司董事。曾任中国企业联合会研究部副主任、主任，常务副理事长、党委副书记；重庆市人民政府副秘书长（分管金融工作）；新华基金管理股份有限公司董事长。现兼任重庆国际信托股份

有限公司独立董事、中国人寿养老保险股份有限公司独立董事、深圳光韵达光电科技股份有限公司独立董事、赞同科技股份有限公司独立董事、爱美客技术发展股份有限公司董事。

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

经雷先生，董事，总经理，财务负责人，美国佩斯大学金融学和财会专业毕业，双学士，特许金融分析师（CFA）。1998 年 6 月至 2008 年 5 月在美国国际集团（AIG）国际投资公司美国纽约总部从事研究投资工作；2008 年 5 月至 2013 年 9 月，历任友邦保险中国区资产管理中心副总监、首席投资总监及资产管理中心负责人；2013 年 10 月入职嘉实基金管理有限公司，2013 年 10 月至 2018 年 3 月任机构投资和固定收益业务首席投资官；2018 年 3 月至今任嘉实基金管理有限公司总经理；2018 年 10 月至今任嘉实基金管理有限公司董事、总经理。

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

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

高华女士，监事，法学硕士，中共党员。2006 年 9 月至 2010 年 7 月任安永华明会计师事务所高级审计师，2010 年 7 月至 2011 年 1 月任联想（北京）有限公司流程分析师，2011 年 1 月至 2013 年 11 月任银华基金管理有限公司监察稽核部内审主管。2013 年 11 月加入嘉实基金管理有限公司，曾任合规管理部稽核组总监，现任人力资源总监兼董事会办公室主任。

马莲女士，监事，法学博士，中共党员。曾任北京市竞天公诚律师事务所律师，法国基德律师事务所北京代表处法律顾问，北京天驰律师事务所律师、合伙人。2013 年 9 月加入嘉实资本管理有限公司，历任法律合规总监、首席风控官。2020 年 6 月至 2025 年 7 月任嘉实财富管理有限公司副总经理、风控合规负责人。现任嘉实基金管理有限公司审计部总监。

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

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

鲁令飞先生，副总经理，硕士研究生。2000 年 10 月加入嘉实基金管理有限公司，历任机构业务部机构销售、保险业务部总监、机构销售业务板块负责人，现任公司副总经理、首席市场官。

张敏女士，副总经理，博士研究生。2010 年 3 月加入嘉实基金管理有限公司，历任风险管理部副总监、总监、首席风险官，现任公司副总经理、养老首席投资官。

刘伟先生，首席信息官，硕士研究生。2010 年 4 月加入嘉实基金管理有限公司，历任信息技术部高级软件工程师、C-Lab 科技总监、数字业务部总监，现任公司首席信息官。

张丹华先生，副总经理，博士研究生。2011 年 7 月加入嘉实基金管理有限公司，历任研究部行业研究组研究员、研究部副总监、研究部总监、科技行业投资总监、AI Lab 负责人，现任公司副总经理、股票投资首席投资官。

2、投资总监

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

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

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

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

3、基金经理

（1）现任基金经理

钟景先生，硕士研究生，5 年证券从业经历，FRM，具有基金从业资格，中国国籍。曾任毕马威企业咨询（中国）有限公司金融风险管理咨询部咨询顾问。2020 年 11 月加入嘉实基金管理有限公司，历任风险管理部量化风控研究员、多元资产配置部分析师。2026 年 3 月 12 日至今任嘉实领航聚优积极配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金经理。

（2）历任基金经理

姜玉雯女士，管理时间为 2022 年 12 月 13 日至 2024 年 3 月 29 日；唐棠先生，管理时间为 2024 年 1 月 25 日至 2026 年 4 月 9 日。

4、养老金投资委员会

养老金投资委员会的成员包括：公司副总经理、养老首席投资官张敏女士，基金经理梁铭超先生、张庆平先生、端时立先生、雍大为先生、刘晗竹先生、李卓锴先生、赵国英女士、胡永青先生、李曈先生，投资经理李峻峰先生、单金萍女士、蒋宏民先生，股票研究部总监刘杰先生，策略研究总监方晗先生，多元资产配置总监李健津先生，风险管理部总监武雪冬先生。

5、上述人员之间均不存在近亲属关系。

（三） 基金管理人的职责

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

2、办理基金备案手续；

3、对所管理的不同基金资产分别管理、分别记账，进行证券投资；

4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

6、编制季度报告、中期报告和年度报告；

7、计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回价格；

8、办理与基金资产管理业务活动有关的信息披露事项；

9、召集基金份额持有人大会；

10、保存基金资产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

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

12、有关法律法规和中国证监会规定的其他职责。

（四）基金管理人的承诺

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

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

（1）将其固有财产或者他人财产混同于基金资产从事证券投资；

（2）不公平地对待其管理的不同基金资产；

（3）利用基金资产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；

（4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；

（5）法律法规或中国证监会规定禁止的其他行为。

3、本基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不得将基金资产用于以下投资或活动：

（1）承销证券；

（2）违反规定向他人贷款或者提供担保；

（3）从事承担无限责任的投资；

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

（5）向其基金管理人、基金托管人出资；

（6）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

（7）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

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

4、基金经理承诺

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

（2）不利用职务之便为自己及其代理人、受雇人或任何第三人谋取利益；

（3）不违反现行有效的有关法律法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，泄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）不从事损害基金资产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

（五）基金管理人的内部控制制度

1、内部控制制度概述

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

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

2、内部控制的原则

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

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

（3）独立性原则：公司各机构、部门和岗位在职能上必须保持相对独立；

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

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

3、内部控制组织体系

（1）公司董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任。董事会下设合规与风险控制委员会，督促公司经理层履行职责建立有效的财务控制、内部控制的系统及制度，充分发挥独立董事监督职能，保护投资者利益和公司合法权益。

（2）投资决策委员会为公司投资管理的最高决策机构，由总经理、投资总监及资深基金经理组成，负责指导基金资产的运作、确定基本的投资策略和投资组合的原则。

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

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

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

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

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

4、内部控制措施

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

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

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

（3）公司设立了顺序递进、权责统一、严密有效的内控防线：

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

②建立重要业务处理凭据传递和信息沟通制度，相关部门和岗位之间相互监督制衡。

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

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

（6）授权控制应当贯穿于公司经营活动的始终，授权控制的主要内容包括：

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

②公司各部门、分公司及员工在规定授权范围内行使相应的职责；

③重大业务授权采取书面形式，授权书应当明确授权内容和时效；

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

5、基金管理人关于内部控制的声明

（1）基金管理人承诺以上关于内部控制的披露真实、准确；

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

四、基金托管人

（一）基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

首次注册登记日期：1983 年 10 月 31 日

注册资本：人民币叁仟贰佰贰拾贰亿壹仟贰佰肆拾壹万壹仟捌佰壹拾肆元整

法定代表人：葛海蛟

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号

托管部门信息披露联系人：许俊

传真：（010）66594942

中国银行客服电话：95566

（二）基金托管部门及主要人员情况

中国银行资产托管部设立于 1998 年，现有员工 130 余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60％以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

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

（三）证券投资基金托管情况

截至 2026 年 6 月 30 日，中国银行已托管 1250 只证券投资基金，其中境内基金 1181 只，QDII 基金 69 只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型、FOF、REITs 等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

（四）托管业务的内部控制制度

中国银行托管业务风险管理与内部控制纳入中国银行全面风险管理体系。资产托管部作为一道防线部门，承担托管业务风险控制的第一责任；风险管理部门作为第二道防线部门，承担制定风险管理制度和流程，监测和管理风险的责任，对托管业务进行指导、培训、监督检查；审计部门作为第三道防线，负责开展托管业务审计工作，发现问题，揭示风险，提出审计建议。中国银行托管业务风险控制贯穿业务各环节，通过制度建设与执行、风险与控制评估、内外部检查及审计监督等措施，持续完善托管业务全员、全面、全程的风险管理体系。

2007 年起，中国银行开始聘请外部会计师事务所开展托管业务内部控制审阅工作，已连续多年获得基于 “ISAE3402”等国际主流内控审阅准则的无保留意见的内控鉴证报告。中国银行托管业务内控制度完善，内控措施严密，能够有效保证托管资产的安全。

（五）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的,应当及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。

五、相关服务机构

（一） 基金份额发售机构

1、直销机构

（1）嘉实基金管理有限公司直销中心

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

（2）嘉实基金管理有限公司网上直销

具体信息详见本公司网站（www.jsfund.cn）。

2、非直销销售机构

序号	销售机构名称	销售机构信息
1	上海证券有限责任公司 注:只销售 A 份额。	注册地址，办公地址：上海市黄浦区人民路 366 号 住所：上海市黄浦区人民路 366 号 法定代表人：李海超 联系人：邵珍珍 电话：(021)53686888 传真：(021)53686100-7008 客服电话：4008918918 网址：http://www.shzq.com
2	中国工商银行股份有限公司	注册地址，办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号 住所：北京市西城区复兴门内大街 55 号 法定代表人：廖林 联系人：杨菲 客服电话：95588 网址：www.icbc.com.cn
3	中国银行股份有限公司	办公地址：中国北京市复兴门内大街 1 号 注册地址：北京市复兴门内大街 1 号 住所：北京市复兴门内大街 1 号 法定代表人：葛海蛟 联系人：梅非奇 电话：(010)66596688

		传真：(010)66594946 客服电话：95566 网址：http://www.boc.cn
4	招商银行股份有限公司	注册地址，办公地址：中国广东省深圳市福田区深南大道 7088 号 住所：中国广东省深圳市福田区深南大道 7088 号 法定代表人：缪建民 联系人：季平伟 电话：（0755）83198888 传真：（0755）83195050 客服电话：95555 网址：http://www.cmbchina.com
5	中信银行股份有限公司	办公地址：北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼中信大厦 注册地址：北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层 住所：北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层 法定代表人：方合英 联系人：丰靖 电话：95558 客服电话：95558 网址：http://www.citicbank.com
6	上海浦东发展银行股份有限公司	办公地址：上海市浦东新区博成路 1306 号 B 栋 注册地址：上海市中山东一路 12 号 住所：上海市中山东一路 12 号 法定代表人：张为忠 联系人：江逸舟、赵守良 电话：(021)61618888 传真：(021)63604199 客服电话：95528 网址：http://www.spdb.com.cn
7	兴业银行股份有限公司	注册地址，办公地址：中国福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦 住所：中国福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦 法定代表人：吕家进 联系人：卞晟煜 电话：（021）52629999 传真：（021）62569070 客服电话：95561 网址：http://www.cib.com.cn
8	中国邮政储蓄银行股份有限公司	办公地址：北京市西城区金融大街 3 号 A 座 注册地址：北京市西城区金融大街 3 号

		住所：北京市西城区金融大街 3 号 法定代表人：郑国雨 联系人：李雪萍 电话：95580 客服电话：95580 网址：www.psbc.com
9	广发银行股份有限公司	注册地址，办公地址：广州市越秀区东风东路 713 号 住所：广州市越秀区东风东路 713 号 法定代表人：林朝晖 联系人：詹全鑫、张扬眉 电话：（020）38322256 传真：（020）87310955 客服电话：400-830-8003 网址：http://www.cgbchina.com.cn
10	平安银行股份有限公司	办公地址：中国广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号;中国广东省深圳市福田区益田路 5023 号平安金融中心 B 座 注册地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号 住所：深圳市罗湖区深南东路 5047 号 法定代表人：谢永林 联系人：张青 电话：0755-22166118 传真：0755-82080406 客服电话：95511-3 网址：http://www.bank.pingan.com
11	宁波银行股份有限公司	注册地址，办公地址：浙江省宁波市鄞州区宁东路 345 号 住所：浙江省宁波市鄞州区宁东路 345 号 法定代表人：庄灵君 联系人：胡技勋 电话：（0574）89068340 传真：（0574）87050024 客服电话：95574 网址：http://www.nbcb.com.cn
12	北京农村商业银行股份有限公司	注册地址，办公地址：北京市西城区月坛南街 1 号院 2 号楼 住所：北京市西城区月坛南街 1 号院 2 号楼 法定代表人：白晓东 联系人：王薇娜 电话：(010)85605006 传真：(010)85605345 客服电话：96198 网址：http://www.bjrcb.com

13	江苏银行股份有限公司	注册地址，办公地址：江苏省南京市中华路 26 号 住所：江苏省南京市中华路 26 号 法定代表人：袁军 联系人：张洪玮 电话：(025)58587036 传真：(025)58587820 客服电话：95319 网址：http://www.jsbchina.cn
14	东莞农村商业银行股份有限公司	注册地址，办公地址：广东省东莞市东城区鸿福东路 2 号 住所：广东省东莞市东城区鸿福东路 2 号 法定代表人：卢国锋 联系人：洪晓琳 电话：0769-22866143 传真：0769-22866282 客服电话：(0769)961122 网址：http://www.drcbank.com/
15	苏州银行股份有限公司	注册地址，办公地址：江苏省苏州工业园区钟园路 728 号 住所：江苏省苏州工业园区钟园路 728 号 法定代表人：崔庆军 联系人：熊志强 电话：0512-69868390 传真：0512-69868370 客服电话：0512-96067 网址：http://www.suzhoubank.com
16	财咨道信息技术有限公司	注册地址，办公地址：辽宁省沈阳市浑南区白塔二南街 18-2 号 B 座 601 住所：辽宁省沈阳市浑南区白塔二南街 18-2 号 B 座 601 法定代表人：张斌 联系人：庞文静 电话：400-003-5811 客服电话：400-003-5811 网址：www.jinjiwo.com
17	众惠基金销售有限公司	注册地址，办公地址：贵州省贵阳市观山湖区长岭北路贵阳国际金融中心二期商务区第 C4 栋 30 层 1 号 住所：贵州省贵阳市观山湖区长岭北路贵阳国际金融中心二期商务区第 C4 栋 30 层 1 号 法定代表人：李春蓉 联系人：许木根 电话：0851-82209888 传真：0851-86909950

		客服电话：400-839-1818 网址：www.hyzhfund.com
18	博时财富基金销售有限公司	办公地址：广东省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 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 住所：深圳市福田区莲花街道福新社区益田路 5999 号基金大厦 19 层 法定代表人：杜松岭 联系人：崔丹 电话：0755-83169999 客服电话：4006105568 网址：www.boserawealth.com
19	诺亚正行基金销售有限公司	办公地址：上海市闵行区申滨南路 1226 号诺亚财富中心 A 栋 3 楼 注册地址：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 6 层 住所：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 6 层 法定代表人：王强 联系人：张裕 电话：021-38509735 传真：021-38509777 客服电话：400-821-5399 网址：http://www.noah-fund.com
20	深圳众禄基金销售股份有限公司	注册地址，办公地址：深圳市罗湖区笋岗街道笋西社区梨园路 8 号 HALO 广场一期四层 12-13 室 住所：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 联系人：童彩平 电话：0755-33227950 传真：0755-33227951 客服电话：4006-788-887 网址：http://www.zlfund.cn
21	上海好买基金销售有限公司	办公地址：上海市浦东新区张杨路 500 号 10 楼 注册地址：上海市虹口区东大名路 501 号 6211 单元 住所：上海市虹口区东大名路 501 号 6211 单元 法定代表人：陶怡 联系人：张茹 电话：021-20613999 传真：021-68596916 客服电话：4007009665 网址：https://www.howbuy.com/
22	上海长量基金销售有限公司	办公地址：上海浦东新区滨江大道 1111 弄 1 号中

		企国际金融中心 A 座 6 层 注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室 住所：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室 法定代表人：张跃伟 联系人：单丙烨 电话：021-20691869 传真：021-20691861 客服电话：400-089-1289 网址：http://www.erichfund.com
23	北京展恒基金销售股份有限公司	注册地址，办公地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼 6 层 601 内 0615A 住所：北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼 6 层 601 内 0615A 法定代表人：闫振杰 联系人：李静如 电话：010-59601366-7024 客服电话：4008886661 网址：http://www.myfund.com
24	上海利得基金销售有限公司	办公地址：上海市虹口区东大名路 1098 号浦江国际金融广场 53 层 注册地址：中国（上海）自由贸易试验区临港新片区海基六路 70 弄 1 号 208-36 室 住所：中国（上海）自由贸易试验区临港新片区海基六路 70 弄 1 号 208-36 室 法定代表人：贾志伟 联系人：曹怡晨 电话：021-50583533 传真：021-50583633 客服电话：400-032-5885 网址：www.leadfund.com.cn
25	嘉实财富管理有限公司	办公地址：北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 11 层(100020) 注册地址：海南省三亚市吉阳区迎宾路 198 号的三亚太平金融产业港项目 2 号楼 13 层 1315 号房 住所：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 联系人：闫欢 电话：400-021-8850 传真：-- 客服电话：400-021-8850 网址：http://www.harvestwm.cn
26	北京创金启富基金销售有限公	注册地址，办公地址：北京市丰台区金泽路 161

	司	号 1 号楼-4 至 43 层 101 内 3 层 09A 住所：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 联系人：魏素清 电话：010-66154828 传真：010-63583991 客服电话：400-6262-818 网址：http://www.5irich.com
27	宜信普泽(北京)基金销售有限公司	注册地址，办公地址：北京市朝阳区建国路乙 118 号 12 层 01D、02A—02F、03A—03C 住所：北京市朝阳区建国路乙 118 号 12 层 01D、02A—02F、03A—03C 法定代表人：汤蕾 联系人：魏晨 电话：010-52413385 传真：010-85894285 客服电话：400-6099-200 网址：http://www.yixinfund.com
28	通华财富(上海)基金销售有限公司	办公地址：上海市浦东新区金沪路 55 号通华科技大厦 注册地址：上海市虹口区同丰路 667 弄 107 号 201 室 住所：上海市虹口区同丰路 667 弄 107 号 201 室 法定代表人：周欣 联系人：褚志朋 电话：021-60818730 传真：021-60818187 客服电话：400-101-9301 网址：www.tonghuafund.com
29	北京汇成基金销售有限公司	办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲 1 号环球财讯中心 D 座 4 层 注册地址：北京市西城区宣武门外大街甲 1 号 4 层 401-2 住所：北京市西城区宣武门外大街甲 1 号 4 层 401-2 法定代表人：王伟刚 联系人：宋子琪 电话：010-62680527 传真：010-62680527 客服电话：400-619-9059 网址：www.hcfunds.com
30	北京济安基金销售有限公司	办公地址：北京市朝阳区太阳宫中路 16 号院冠捷大厦 1105

		注册地址：北京市朝阳区太阳宫中路 16 号院 1 号楼 10 层 1005 住所：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 联系人：李海燕 电话：010-65309516 传真：010-65330699 客服电话：400-673-7010 网址：http://www.jianfortune.com
31	上海联泰基金销售有限公司	办公地址：上海市虹口区溧阳路 735 号 2 幢 3 层 注册地址：上海市普陀区兰溪路 900 弄 15 号 526 室 住所：上海市普陀区兰溪路 900 弄 15 号 526 室 法定代表人：尹彬彬 联系人：兰敏 电话：021-52822063 传真：021-52975270 客服电话：400-118-1188 网址：www.66liantai.com
32	泰信财富基金销售有限公司	办公地址：北京市朝阳区建国路乙 118 号京汇大厦 1206 注册地址：北京市朝阳区建国路乙 118 号 10 层 1206 住所：北京市朝阳区建国路乙 118 号 10 层 1206 法定代表人：彭浩 联系人：孔安琪 电话：010-53579668 客服电话：400-004-8821 网址：http://www.taixincf.com
33	上海基煜基金销售有限公司	办公地址：上海浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 1503 室 注册地址：上海市黄浦区广东路 500 号 30 层 3001 单元 住所：上海市黄浦区广东路 500 号 30 层 3001 单元 法定代表人：王翔 联系人：蓝杰 电话：021-65370077 传真：021-55085991 客服电话：4008-205-369 网址：http://www.jiyufund.com.cn
34	上海中正达广基金销售有限公司	注册地址，办公地址：上海市龙兰路 277 号 1 号楼 1203、1204 室

		住所：上海市龙兰路 277 号 1 号楼 1203、1204 室 法定代表人：黄欣 联系人：戴珉微 电话：021-33768132 传真：021-33768132*802 客服电话：400-6767-523 网址：http://www.zhongzhengmoney.com/web
35	上海攀赢基金销售有限公司	办公地址：上海市浦东新区银城路 116 号大华银行大厦 703 注册地址：中国（上海）自由贸易试验区银城路 116、128 号 7 楼层（名义楼层，实际楼层 6 层）03 室 住所：中国（上海）自由贸易试验区银城路 116、128 号 7 楼层（名义楼层，实际楼层 6 层）03 室 法定代表人：郑新林 联系人：邓琦 电话：021-68889082 客服电话：021-68889082 网址：www.weonefunds.com
36	奕丰基金销售有限公司	办公地址：深圳市南山区海德三道航天科技广场 A 座 17 楼 1704 室 注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司) 住所：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司) 法定代表人：TEO WEE HOWE 联系人：叶健 电话：0755-89460500 传真：0755-21674453 客服电话：400-684-0500 网址：https://www.ifastps.com.cn/
37	大连网金基金销售有限公司	办公地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号 2F 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 住所：辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号诺德大厦 2 层 202 室 法定代表人：樊怀东 联系人：于舒 电话：0411-39027828 传真：0411-39027835 客服电话：4000-899-100 网址：http://www.yibaijin.com/

38	上海证达通基金销售有限公司	办公地址：上海市浦东新区金葵路 118 号(云璟峰汇 G3 栋)3-B 区 注册地址：上海市浦东新区金葵路 118 号 3 层 B 区 住所：上海市浦东新区金葵路 118 号 3 层 B 区 法定代表人：姚杨 联系人：朱翔宇 电话：021-20538888 传真：021-20538999 客服电话：4008201515 网址：zhengtongfunds.com
39	上海华夏财富投资管理有限公司	办公地址：北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 16 层 注册地址：上海市虹口区东大名路 687 号 1 幢 2 楼 268 室 住所：上海市虹口区东大名路 687 号 1 幢 2 楼 268 室 法定代表人：毛淮平 联系人：仲秋玥 电话：010-88066632 传真：010-88066214 客服电话：400-817-5666 网址：www.amcfortune.com
40	阳光人寿保险股份有限公司	办公地址：北京市朝阳区朝外大街乙 12 号 1 号楼昆泰国际大厦 注册地址：海南省三亚市迎宾路 360-1 号三亚阳光金融广场 16 层 住所：海南省三亚市迎宾路 360-1 号三亚阳光金融广场 16 层 法定代表人：李科 联系人：王超 电话：010-59053660 传真：010-59053700 客服电话：95510 网址：http://life.sinosig.com/
41	上海天天基金销售有限公司	办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号金座 注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼二层 住所：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼二层 法定代表人：其实 联系人：潘世友 电话：95021 传真：（021）64385308 客服电话：400-1818-188

		网址：http://www.1234567.com.cn
42	华源证券股份有限公司	办公地址：湖北省武汉市江汉区万松街道青年路 278 号中海中心 32F-34F 注册地址：青海省西宁市南川工业园区创业路 108 号 住所：青海省西宁市南川工业园区创业路 108 号 法定代表人：邓晖 联系人：张晔 电话：95305-8 客服电话：95305-8 网址：www.huayuanstock.com
43	北京雪球基金销售有限公司	办公地址：北京市朝阳区创远路 34 号院融新科技中心 C 座 17 层 注册地址：北京市朝阳区创远路 34 号院 6 号楼 19 层 1901 内 1903 室 住所：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 联系人：吴迪 电话：010-57319532 传真：010-61840699 客服电话：400-159-9288 网址：https://danjuanfunds.com/
44	中信期货有限公司	办公地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1303-1305 室、14 层 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 住所：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305、14 层 法定代表人：王小果(代) 联系人：梁美娜 传真：021-60819988 客服电话：400-990-8826 网址：http://www.citicsf.com/
45	国泰海通证券股份有限公司	办公地址：上海市静安区南京西路 768 号 注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号 住所：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号 法定代表人：朱健 联系人：黄博铭 电话：(021)38676666 传真：(021)38670666 客服电话：95521

		网址：http://www.gtht.com
46	中信建投证券股份有限公司	办公地址：北京市朝阳区光华路 10 号 注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼 住所：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼 法定代表人：刘成 联系人：谢欣然 电话：010-86451810 客服电话：(8610)65608107 网址：http://www.csc108.com
47	国信证券股份有限公司	办公地址：深圳市福田区福华一路 125 号国信金融大厦 注册地址：广东深圳市红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层 住所：广东深圳市红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层 法定代表人：张纳沙 联系人：李颖 电话：0755-81682519 客服电话：95536 网址：http://www.guosen.com.cn
48	中信证券股份有限公司	办公地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号中信证券大厦;北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦 注册地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 住所：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 法定代表人：张佑君 联系人：王一通 电话：010-60838888 客服电话：95548 网址：http://www.citics.com
49	申万宏源证券有限公司	注册地址，办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层 住所：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层 法定代表人：张剑 联系人：王昊洋 电话：021-33389888 传真：021-33388224 客服电话：95523 或 4008895523 网址：http://www.swhysc.com
50	兴业证券股份有限公司	注册地址，办公地址：福建省福州市湖东路 268 号 住所：福建省福州市湖东路 268 号

		法定代表人：苏军良 联系人：乔琳雪 电话：021-38565547 客服电话：95562 网址：http://www.xyzq.com.cn
51	西南证券股份有限公司	注册地址，办公地址：重庆市江北区金沙门路 32 号西南证券总部大楼 住所：重庆市江北区金沙门路 32 号西南证券总部大楼 法定代表人：姜栋林 联系人：冉绪 电话：023-63786145 客服电话：95355 网址：http://www.swsc.com.cn
52	湘财证券股份有限公司	办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 958 号华能联合大厦 5 楼 注册地址：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼 住所：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼 法定代表人：高振营 联系人：江恩前 电话：(021)38784580 客服电话：95351 网址：http://www.xcsc.com
53	万联证券股份有限公司	办公地址：广东省广州市天河区珠江东路 13 号高德置地广场 E 座 12 层 注册地址：广东省广州市天河区珠江东路 11 号 18、19 楼全层 住所：广东省广州市天河区珠江东路 11 号 18、19 楼全层 法定代表人：王达 联系人：丁思 电话：020-83988334 客服电话：95322 网址：http://www.wlzq.cn
54	中信证券（山东）有限责任公司	办公地址：青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座 注册地址：青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001 住所：青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001 法定代表人：肖海峰 联系人：赵如意 电话：0532-85725062

		客服电话：95548 网址：http://sd.citics.com
55	中信证券华南股份有限公司	注册地址，办公地址：广州市天河区临江大道 395 号 901 室 1001 室 住所：广州市天河区临江大道 395 号 901 室 1001 室 法定代表人：陈可可 联系人：郭杏燕 电话：020-88834787 客服电话：95548 网址：http://www.gzs.com.cn
56	南京证券股份有限公司	办公地址：江苏省南京市建邺区江东中路 389 号 注册地址：江苏省南京市江东中路 389 号 住所：江苏省南京市江东中路 389 号 法定代表人：夏宏建 联系人：曹梦媛 电话：025-58519529 客服电话：95386 网址：http://www.njzq.com.cn
57	平安证券股份有限公司	办公地址：深圳市福田区福田街道益田路 5023 号平安金融中心 B 座 22-25 层 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 住所：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 联系人：尹杭婷 传真：021-58991896 客服电话：95511-8 网址：http://www.stock.pingan.com
58	申万宏源西部证券有限公司	注册地址，办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室 住所：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室 法定代表人：王献军 联系人：王昊洋 电话：021-33389888 传真：021-33388224 客服电话：95523 或 4008895523 网址：www.swhysc.com
59	东方财富证券股份有限公司	办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号东方财富大厦 注册地址：西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部

		城 10 栋楼 住所：西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城 10 栋楼 法定代表人：戴彦 联系人：陈亚男 电话：021-23586583 传真：021-23586789 客服电话：95357 网址：http://www.18.cn
60	国金证券股份有限公司	办公地址：上海市浦东新区芳甸路 1088 号 7 楼 注册地址：成都市青羊区东城根上街 95 号 住所：成都市青羊区东城根上街 95 号 法定代表人：冉云 联系人：郭元媛 电话：15690849268 客服电话：95310 网址：http://www.gjzq.com.cn
61	华宝证券股份有限公司	注册地址，办公地址：中国(上海)自由贸易试验区浦电路 370 号 2、3、4 层 住所：中国(上海)自由贸易试验区浦电路 370 号 2、3、4 层 法定代表人：刘加海 联系人：夏元 电话：（021）68777222 传真：（021）68777822 客服电话：4008209898 网址：http://www.cnhbstock.com
62	开源证券股份有限公司	注册地址，办公地址：陕西省西安市高新区锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层 住所：陕西省西安市高新区锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层 法定代表人：李刚 联系人：张蕊 传真：029-88365835 客服电话：95325 网址：http://www.kysec.cn

63	深圳市新兰德证券投资咨询有限公司	办公地址：北京市丰台区丽泽平安幸福中心 B 座 31 层 注册地址：深圳市福田区梅林街道梅都社区中康路 136 号深圳新一代产业园 2 栋 3401 住所：深圳市福田区梅林街道梅都社区中康路 136 号深圳新一代产业园 2 栋 3401 法定代表人：张斌

		联系人：孙博文 电话：010-83363002 传真：010-83363072 客服电话：400-166-1188-2 网址：http://www.new-rand.cn
64	和讯信息科技有限公司	办公地址：北京市朝阳区朝阳门外泛利大厦 10 层 注册地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号 1002 室 住所：北京市朝阳区朝外大街 22 号 1002 室 法定代表人：罗佳 联系人：陈慧慧 电话：010-85657353 传真：8610-65884788 客服电话：4009200022 网址：http://licaike.hexun.com/
65	上海挖财基金销售有限公司	注册地址，办公地址：中国(上海)自由贸易试验区锦康路 258 号第 10 层(实际楼层第 9 层)02A 单元 住所：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 联系人：毛善波 电话：021-50810687 传真：021-58300279 客服电话：021-50810673 网址：http://www.wacaijijin.com
66	贵州省贵文文化基金销售有限公司	注册地址，办公地址：贵州省贵阳市贵州双龙航空港经济区小碧布依族苗族乡兴业西路 CCDI 项目工作基地 1 层 住所：贵州省贵阳市贵州双龙航空港经济区小碧布依族苗族乡兴业西路 CCDI 项目工作基地 1 层 法定代表人：陈成 联系人：唐宜为 电话：18616726630 客服电话：0851-85407888 网址：http://www.gwcaifu.com
67	腾安基金销售(深圳)有限公司	办公地址：深圳市南山区海天二路 33 号腾讯滨海大厦 15 楼 注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司） 住所：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司） 法定代表人：谭广锋 联系人：谭广锋

		电话：0755-86013388-80618 传真：- 客服电话：95017 网址：http://www.tenganxinxi.com 或 http://www.txfund.com
68	北京百度百盈基金销售有限公司	办公地址：北京市海淀区西北旺东路 10 号院西区 4 号楼 注册地址：北京市海淀区西北旺东路 10 号院西区 4 号楼 1 层 103 室 住所：北京市海淀区西北旺东路 10 号院西区 4 号楼 1 层 103 室 法定代表人：盛超 联系人：林天赐 电话：010-59403028 传真：010-59403027 客服电话：95055 网址：http://www.duxiaomanfund.com
69	易方达财富管理基金销售(广州)有限公司	办公地址：广州市天河区广州银行大厦 40 楼 注册地址：广州市南沙区横沥镇期航二街 2 号 101 房 住所：广州市南沙区横沥镇期航二街 2 号 101 房 法定代表人：陈彤 联系人：吕晋 电话：020-85102688-7498 客服电话：4001608888 网址：www.efundcf.com.cn
70	蚂蚁(杭州)基金销售有限公司	办公地址：浙江省杭州市西湖区西溪路 569 号间 9 号楼小邮局 注册地址：浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路 969 号 3 幢 5 层 599 室 住所：浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路 969 号 3 幢 5 层 599 室 法定代表人：王珺 联系人：韩爱彬 电话：021-60897840 传真：0571-26697013 客服电话：95188-8 网址：www.antfortune.com
71	浙江同花顺基金销售有限公司	办公地址：浙江省杭州市余杭区同顺街 18 号同花顺大厦 注册地址：浙江省杭州市余杭区五常街道同顺街 18 号 401 室 住所：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 联系人：林海明 电话：0571-88920897 传真：0571-86800423 客服电话：952555 网址：http://www.5ifund.com
72	泛华普益基金销售有限公司	办公地址：四川省成都市成华区建设路 9 号高地中心 1101 室 注册地址：成都市成华区建设路 9 号高地中心 1101 室 住所：成都市成华区建设路 9 号高地中心 1101 室 法定代表人：王建华 联系人：史若芬 电话：028-86645380 传真：028-82000996-805 客服电话：400-080-3388 网址：https://www.puyifund.com
73	南京苏宁基金销售有限公司	注册地址，办公地址：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号 住所：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号 法定代表人：钱燕飞 联系人：冯鹏鹏 电话：025-66996699-887226 传真：025-66996699-887226 客服电话：95177 网址：http://www.snjijin.com/
74	北京新浪仓石基金销售有限公司	办公地址：北京市海淀区中关村软件园二期新浪总部科研楼 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 住所：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2 地块新浪总部科研楼 5 层 518 室 法定代表人：李柳娜 联系人：邵文静 电话：010-62675768 传真：010-62676582 客服电话：010-6267 5369 网址：www.xincai.com
75	上海万得基金销售有限公司	办公地址：上海市浦明路 1500 号万得大厦 7 楼 注册地址：中国(上海)自由贸易试验区浦明路 1500 号 8 层 M 座 住所：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 联系人：徐亚丹 电话：021-68882280 传真：021-68882281 客服电话：400-799-1888 网址：https://www.520fund.com.cn/
76	上海国信嘉利基金销售有限公司	办公地址：上海市浦东新区居里路 99 号 注册地址：上海市徐汇区华泾路 507 号 4 幢 2 层 223 室 住所：上海市徐汇区华泾路 507 号 4 幢 2 层 223 室 法定代表人：贺鑫焱 联系人：张力文 电话：021-68770223 传真：021-68770679 客服电话：021-68809999 网址：gxjlcn.com
77	上海陆金所基金销售有限公司	办公地址：中国(上海)自由贸易试验区源深路 1088 号 7 层(实际楼层 6 层) 注册地址：中国（上海）自由贸易试验区源深路 1088 号 7 层（实际楼层 6 层） 住所：中国（上海）自由贸易试验区源深路 1088 号 7 层（实际楼层 6 层） 法定代表人：陈祎彬 联系人：汤艳丽 电话：021-20665952 传真：021-22066653 客服电话：4008219031 网址：http://www.lufunds.com
78	珠海盈米基金销售有限公司	办公地址：珠海市横琴新区琴朗道 91 号 1608、1609、1610 办公 注册地址：珠海市横琴新区环岛东路 3000 号 2719 室 住所：珠海市横琴新区环岛东路 3000 号 2719 室 法定代表人：肖雯 联系人：邱湘湘 电话：020-89629019 传真：020-89629011 客服电话：020-89629099 网址：http://www.yingmi.com
79	和耕传承基金销售有限公司	注册地址，办公地址：河南自贸试验区郑州片区(郑东)普惠路 55 号 1 号楼 9 层 30-910 住所：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 联系人：高培 电话：0371-85518395 传真：0371-85518397 客服电话：4000-555-671 网址：https://www.hgccpb.com/
80	京东肯特瑞基金销售有限公司	办公地址：北京市通州区亦庄经济技术开发区科创十一街 18 号院京东集团总部 A 座 15 层 注册地址：北京市海淀区知春路 76 号（写字楼）1 号楼 4 层 1-7-2 住所：北京市海淀区知春路 76 号（写字楼）1 号楼 4 层 1-7-2 法定代表人：王珊珊 联系人：李丹 电话：4000988511 传真：010-89188000 客服电话：010-89187658 网址：kenterui.jd.com
81	深圳市排排网基金销售有限责任公司	办公地址：深圳市福田区沙嘴路尚美红树湾 1 号 A 座写字楼 16 楼 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 住所：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 联系人：周圆圆 电话：400-666-7388 传真：400-666-7388 客服电话：400-666-7388 网址：ppwfund.com
82	华瑞保险销售有限公司	办公地址：上海市嘉定区众仁路 399 号运通星财富广场 1 号楼 B 座 14 层 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 14 层 住所：上海市嘉定区南翔镇众仁路 399 号运通星财富广场 1 号楼 B 座 14 层 法定代表人：王树科 联系人：张爽爽 电话：021-68595976 传真：021-68595766 客服电话：952303 网址：http://www.huaruisales.com
83	玄元保险代理有限公司	办公地址：上海市嘉定区银翔路 799 号 506-2

		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 住所：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 联系人：姜帅伯 电话：021-50701003 传真：021-50701053 客服电话：021-50701003 网址：www.licaimofang.com
84	深圳前海微众银行股份有限公司	办公地址：广东省深圳市南山区沙河西路 1819 号深圳湾科技生态园 7 栋 A 座 注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司） 住所：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司） 法定代表人：顾敏 联系人：邹榆 电话：95384 传真：0755-86700688 客服电话：95384 网址：https://www.webank.com/

（二） 登记机构

名称	嘉实基金管理有限公司
住所	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 1806A 单元
办公地址	北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层
法定代表人	经雷
联系人	梁凯
电话	（010）65215588
传真	（010）65185678

（三） 出具法律意见书的律师事务所

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

（四） 审计基金财产的会计师事务所

名称	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)		
住所	中国上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼		
办公地址	中国上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼		
执行事务合伙人	唐恋炯	联系人	郭新华
电话	+86(21)-6141 8888	传真	+86(21)-6335 0003
经办注册会计师	郭新华、强占新		

六、基金的募集

（一）基金募集的依据

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定募集。本基金募集申请已经中国证监会 2022 年 9 月 2 日证监许可[2022]2013 号文注册。

（二）基金类型、运作方式和存续期间

1、基金的类别：混合型基金中基金（FOF）。

2、基金的运作方式：契约型开放式。

基金合同生效后，本基金对每一份认购/申购的基金份额分别计算 6 个月的“锁定持有期”，投资者持有的基金份额自锁定到期日的下一工作日起，方可申请赎回。

因不可抗力或基金合同约定的其他情形致使基金管理人无法在锁定到期日的下一工作日按时开放该基金份额的赎回业务的，该基金份额自不可抗力或基金合同约定的其他情形的影响因素消除之日的下一个工作日起方可申请赎回。

3、基金存续期间：不定期。

（三）基金份额的锁定持有期

本基金每一份基金份额的“锁定持有期”视投资者认购/申购的时间不同而分别计算，具体规则如下：

有效认购的基金份额的锁定持有期指基金合同生效日（锁定起始日）起至基金合同生效日后第 6 个月度对日的前一日（锁定到期日）之间的区间；有效申购的基金份额的锁定持有期指申购确认日（锁定起始日）起至申购确认日后第 6 个月度对日的前一日（锁定到期日）之间的区间。认购/申购的基金份额自锁定到期日的下一工作日起方可申请赎回。

（四）基金份额类别

本基金根据认购/申购费用、销售服务费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购基金份额时收取认购/申购费用，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费，并不收取认购/申购费用的基金份额，称为 C 类基金份额。相关费率的设置及费率水平在本基金招募说明书、基金产品资料概要或相关公告中列示。

本基金各类基金份额分别设置代码，合并投资运作，分别计算和公告各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值。

投资人在认购/申购基金份额时可自行选择认购/申购的基金份额类别。本基金不同基金份额类别之间不得相互转换。

本基金份额类别的具体设置、费率水平等由基金管理人确定，并在招募说明书、基金产品资料概要或相关公告中列明。

在不违反法律法规规定且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可为本基金增设新的基金份额类别并设置相应费率、减少或调整基金份额类别设置、对基金份额分类办法及规则进行调整，无需召开基金份额持有人大会审议决定。基金管理人应在调整实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

（五）基金份额的发售时间、发售方式、发售对象、募集目标

1、发售时间：2022 年 11 月 1 日至 2022 年 12 月 9 日

2、发售方式

本基金通过销售机构公开发售，销售机构的具体名单见基金份额发售公告或在基金管理人网站列明。基金管理人可不时变更或增减销售机构，并在基金管理人网站公示。

3、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、合格境外投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。

4、募集目标

本基金不设募集目标。

本基金可设置募集规模上限，具体规模上限及规模控制的方案详见基金份额发售公告或其他公告。

（六）基金的认购

1、认购程序

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

2、本基金 A 类基金份额收取认购费用，C 类基金份额不收取认购费用。本基金 A 类基金份额采用前端收费模式收取基金认购费用。投资者在一天之内如果有多笔认购，适用费率按单笔分别计算。本基金 A 类基金份额的具体认购费率如下：

认购金额（M，含认购费）	**认购费率**
M<100万元	1.00%
100万元≤M＜500万元	0.60%

M≥500万元	按笔收取，1000 元/笔

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

本基金 C 类基金份额认购费率为 0。

3、募集资金利息的处理方式

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

4、认购份额的计算

本基金 A 类、C 类基金份额的初始面值均为人民币 1.00 元。

（1）当投资者选择认购 A 类基金份额时，认购份额的计算方法如下：

①认购费用适用比例费率时，认购份额的计算方法如下：

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）/1.00 元

②认购费用为固定金额时，认购份额的计算方法如下：

认购费用＝固定金额

净认购金额＝认购金额－认购费用

认购份额＝（净认购金额＋认购资金利息）/1.00 元

例一：某投资者投资 10,000 元认购本基金 A 类基金份额，如果其认购资金的利息为 10.00 元，则其可得到的 A 类基金份额计算如下：

净认购金额=10,000/(1＋1.00%）= 9,900.99 元

认购费用＝10,000 －9,900.99 = 99.01 元

认购份额＝(9,900.99＋10.00)/1.00 = 9,910.99 份

即投资者投资 10,000 元认购本基金 A 类基金份额，加上募集期间利息后一共可以得到 9,910.99 份 A 类基金份额。

（2）当投资者选择认购 C 类基金份额时，认购份额的计算方法如下：

认购份额＝(认购金额＋认购资金利息)/1.00 元

例二：某投资者投资 10,000 元认购本基金 C 类基金份额，假设这 10,000 元在募集期间产生的利息为 5.00 元，则其可得到的 C 类基金份额计算如下：

认购份额＝(10,000＋5.00)/1.00＝10,005.00 份

即投资者投资 10,000 元认购本基金 C 类基金份额，加上募集期间利息后一共可以得到 10,005.00 份 C 类基金份额。

（3）认购份额的计算结果按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此误差产生的损益归入基金财产。

5、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。

七、基金合同的生效

（一）基金合同生效

本基金基金合同于 2022 年 12 月 13 日正式生效，自该日起本基金管理人开始管理本基金。

（二）基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

基金合同生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 50 个工作日出现前述情形的，基金合同终止，基金管理人应及时通知基金托管人，无需召开基金份额持有人大会进行表决。

法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

八、基金份额的申购与赎回

（一）基金的运作方式

基金合同生效后，本基金对每一份认购/申购的基金份额分别计算 6 个月的“锁定持有期”，投资者持有的基金份额自锁定到期日的下一工作日起，方可申请赎回。

因不可抗力或基金合同约定的其他情形致使基金管理人无法在锁定到期日的下一工作日按时开放该基金份额的赎回业务的，该基金份额自不可抗力或基金合同约定的其他情形的影响因素消除之日的下一个工作日起方可申请赎回。

有效认购的基金份额的锁定持有期指基金合同生效日（锁定起始日）起至基金合同生效日后第 6 个月度对日的前一日（锁定到期日）之间的区间；有效申购的基金份额的锁定持有期指申购确认日（锁定起始日）起至申购确认日后第 6 个月度对日的前一日（锁定到期日）之间的区间。认购/申购的基金份额自锁定到期日的下一工作日起方可申请赎回。

（二）申购和赎回场所

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

（三）申购和赎回的开放日及时间

1、开放日及开放时间

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

基金合同生效后，若证券交易所交易时间变更或有其他特殊情况，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

本基金自 2023 年 3 月 2 日开始办理申购业务，本基金自 2023 年 6 月 13 日开始办理赎回业务。

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

（四）申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日的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、基金份额持有人赎回时，除指定赎回外，基金管理人按先进先出的原则，对该持有人账户在该销售机构托管的基金份额进行处理，即先确认的份额先赎回，后确认的份额后赎回，以确定所适用的赎回费率；

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。

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

（五）申购与赎回的程序

1、申购和赎回的申请方式

投资人应根据销售机构规定的程序，在开放日的开放时间内提出申购或赎回的申请。

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

2、申购和赎回的款项支付

投资人申购基金份额时，必须在规定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。

就锁定持有期届满的基金份额，基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；基金份额登记机构确认赎回时，赎回生效。投资者赎回申请生效后，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等非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程时，赎回款项的支付时间相应顺延。在发生巨额赎回或基金合同载明的其他暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付按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或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+2 日内对该交易的有效性进行确认。本基金基金份额登记机构确认申购或赎回的，申购或赎回生效。T 日提交的有效申请，投资人可在 T+3 日后(包括该日)及时到办理申购或赎回业务的销售机构或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购未被确认，则申购款项（无利息）退还给投资人。

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

4、如未来法律法规或监管机构对上述内容另有规定，从其规定。

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

（六）申购与赎回的数量限制

1、申购金额的限制

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

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

2、赎回份额的限制

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

3、基金管理人有权规定本基金的总规模限额或基金单日净申购比例上限，具体规定请参见更新的招募说明书或相关公告。

4、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述一项或多项措施对基金规模予以控制，具体以基金管理人相关公告为准。

5、基金管理人可在不违反法律法规的情况下，调整上述申购金额和赎回份额的数量限制，或者新增基金申购或赎回的控制措施。基金管理人应在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

（七）申购、赎回的费率

1、本基金 A 类基金份额收取申购费用，C 类基金份额不收取申购费用。A 类基金份额采用前端收费模式收取基金申购费用。投资者在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。本基金 A 类基金份额的申购费率具体如下：

申购金额（M，含申购费）	申购费率
M<100万元	1.20%
100万元≤M＜500万元	0.80%
M≥500万元	按笔收取，单笔1000元

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

本基金 C 类基金份额申购费率为 0。

个人投资者通过本基金管理人直销网上交易系统申购本基金业务实行申购费率优惠，其申购费率不按申购金额分档，统一优惠为申购金额的 0.6%，但中国银行长城借记卡持卡人，申购本基金的申购费率优惠按照相关公告规定的费率执行；机构投资者通过本基金管理人直销网上交易系统申购本基金，其申购费率不按申购金额分档，统一优惠为申购金额的 0.6%。优惠后费率如果低于 0.6%，则按 0.6%执行。基金招募说明书及相关公告规定的相应申购费率低于 0.6%时，按实际费率收取申购费。个人投资者于本公司网上直销系统通过汇款方式申购本基金的，前端申购费率按照相关公告规定的优惠费率执行。

2、本基金不收取赎回费，对每一份认购/申购的基金份额分别计算 6 个月的“锁定持有期”，投资者持有的基金份额自锁定到期日的下一工作日起，方可申请赎回。

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

（八）申购份额、赎回金额的计算方式

1、基金申购份额的计算

（1）当投资者选择申购 A 类基金份额时，申购份额的计算方法如下：

①申购费用适用比例费率时，申购份额的计算方法如下：

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/T 日 A 类基金份额净值

②申购费用为固定金额时，申购份额的计算方法如下：

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/T 日 A 类基金份额净值

例一：某投资者投资 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，则可得到的申购份额为：

净申购金额＝50,000/（1＋1.20%）＝ 49,407.11 元

申购费用＝50,000－49,407.11＝592.89 元

申购份额＝49,407.11/1.0500＝47,054.39 份

即：投资者投资 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，则其可得到 47,054.39 份 A 类基金份额。

（2）当投资者选择申购 C 类基金份额时，申购份额的计算方法如下：

申购份额＝申购金额/T 日 C 类基金份额净值

例二：某投资者投资 5 万元申购本基金 C 类基金份额，假设申购当日 C 类基金份额净值为 1.0500 元，则可得到的申购份额为：

申购份额＝50,000/1.0500＝47,619.05 份

即：投资人投资 50,000 元申购本基金 C 类基金份额，假设申购当日本基金 C 类基金份额的基金份额净值为 1.0500 元，则其可得到 47,619.05 份本基金 C 类基金份额。

（3）申购份额的计算结果按四舍五入方法，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。

2、基金赎回金额的计算

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

赎回金额的计算方法如下：

赎回总额＝赎回份额×T 日各类基金份额净值

赎回费用＝赎回总额×赎回费率

赎回金额=赎回总额-赎回费用

赎回金额的计算按四舍五入方法，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。

例二：某投资者申请赎回 A 类基金份额为 10,000 份，持有期限为 780 天，假设赎回当日的 A 类基金份额净值为 1.3000，则可得到的赎回金额为：

赎回总额＝10,000×1.3000＝13,000.00 元

赎回费用=13,000.00×0= 0.00 元

赎回金额＝13,000.00-0.00= 13,000.00 元

即：某投资者申请赎回 A 类基金份额为 10,000 份，持有期限为 780 天，假设赎回当日的 A 类基金份额净值为 1.3000，则可得到的赎回金额为 13,000.00 元。

（九）拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况之一时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

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。

3、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

4、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。

5、基金管理人、基金托管人、销售机构、登记机构、支付结算机构等因异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系统、基金会计系统等无法正常运行。

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

7、当继续接受申购申请，可能会导致本基金总规模超过基金管理人规定的本基金总规模上限时；或使本基金单日净申购比例超过基金管理人规定的当日净申购比例上限。

8、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过 50%，或者变相规避 50%集中度的情形。

9、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。

10、当接受某笔或某些申购申请，可能会导致该投资人累计持有的份额超过单个投资人累计持有的份额上限；或该投资人当日申购金额超过单个投资人单日或单笔申购金额上限。

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

12、占本基金相当比例的被投资基金暂停申购，基金管理人可以暂停本基金申购的情形。

13、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第 1 项至第 7 项及第 11 项至 13 项拒绝或暂停申购情形之一且基金管理人决定拒绝或暂停接受投资人的申购申请时，基金管理人应当根据《信息披露办法》的规定在规定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的，被拒绝的申购款项（无利息）将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。发生上述第 8、9、10 项拒绝或暂停申购情形之一的，基金管理人有权按照维护存量基金份额持有人利益的原则，决定拒绝或暂停接受投资人申购申请，或采取部分确认等方式对该投资人的申购申请进行限制。

（十）暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形之一时，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。

3、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

5、接受某笔或某些赎回申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益。

6、发生继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形。

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

8、占本基金相当比例的被投资基金暂停赎回，基金管理人可以暂停本基金赎回的情形。

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

10、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形（第 4、5 项除外）之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时，基金管理人应按规定报中国证监会备案，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（上述第 5 项除外），基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

（十一）巨额赎回的情形及处理方式

1、巨额赎回的认定

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

2、巨额赎回的处理方式

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

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

（2）部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的全部赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一工作日基金总份额的 10%的前提下，可对其余赎回申请

延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的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。

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

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

3、巨额赎回的公告

当发生上述巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真、公告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，并按照《信息披露办法》的规定在规定媒介上刊登公告。

（十二）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，按照《信息披露办法》的规定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的基金份额净值。

3、若暂停时间超过 1 日，基金管理人可以根据《信息披露办法》的规定自行确定增加公告的次数，但基金管理人须依照《信息披露办法》，最迟于重新开放日在规定媒介上刊登

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

（十三）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。

（十四）基金的非交易过户

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

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

（十五）基金的转托管

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

（十六）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。

（十七）基金份额的冻结和解冻

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

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

（十八）实施侧袋机制期间本基金的申购与赎回

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

（十九）基金管理人在不违反法律法规、且对基金份额持有人的利益无实质不利影响的前提下，可对上述申购和赎回安排进行调整，或者安排本基金的一类或多类基金份额在证券交易所上市、申购和赎回，无需召开基金份额持有人大会进行审议。

九、基金的投资

（一） 投资目标

本基金以积极的投资风格进行长期资产配置，通过构建与收益风险水平相匹配的基金组合，在控制投资风险并保持良好流动性的前提下，追求基金资产的长期增值。

（二） 投资范围

本基金的投资范围包括经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金（以下简称“公募基金”，含公开募集基础设施证券投资基金（以下简称“公募 REITs”），不含 QDII 基金、香港互认基金）、国内依法发行上市的股票（包括创业板、存托凭证以及其他依法发行上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换公司债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、现金等资产，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金不投资于分级基金、股指期货、国债期货和股票期权。

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：本基金投资于公募基金的比例不少于基金资产的 80%。基金保留的现金或者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。本基金投资于权益类资产占基金资产的比例为 60%-95%，其中，权益类资产包括股票、股票型基金和满足下述条件之一的混合型基金：

①基金合同约定股票资产投资比例应不低于基金资产的 60%；

②最近四个季度定期报告披露的股票资产投资比例均不低于基金资产的 60%。

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

（三） 投资策略

本基金的主要投资策略包括资产配置策略、基金筛选策略。其中，资产配置策略通过战略资产配置与战术资产配置确定各个大类资产的具体配置比例；基金筛选策略通过全方位的定量和定性分析筛选出符合基金管理人要求的标的基金，并通过基金匹配框架，完成基金组合构建。

1、资产配置策略

（1）战略资产配置策略

战略资产配置策略是决定基金资产长期风险收益特征的关键，本基金在战略资产配置过程中权益类资产的投资比例为 60%-95%。

（2）战术资产配置策略

本基金在目标权益类资产配置比例的约束下，将从基本面、资金面、政策面、情绪面和估值面等五个角度进行综合分析，采用战术资产配置策略进行资产比例的调整。使用的分析方法包括：

1）基本面分析：包括对于宏观经济运行、货币与财政政策、企业库存周期和盈利水平等进行跟踪分析；

2）量化分析：对资金面的供求变化、绝对和相对的估值水平、以及交易情绪等指标进行定量分析。

通过战略资产配置策略与战术资产配置策略，本基金形成目标资产配置比例，指导后续基金配置。

2、基金筛选策略

对于隶属于同资产类别的基金，本基金根据基金历史业绩、基金风险调整后的收益(信息比率、Sharpe 比率）、基金的规模和流动性等一系列量化指标对基金进行初步筛选并确定适选基金。

通过对适选基金的定性及定量分析再次精选基金，力求寻找到投资风格稳定、业绩持续优秀并具有良好风险管理能力的投资品种。具体筛选指标包括但不限于：

基金的表现分析(Performance Analysis)：分析并确认基金绝对和相对表现优于同类基金平均水平；

基金表现的归因分析(Attribution Analysis)：深入了解基金投资流程和分析管理人投资技巧（择时和选股能力）；

基金的风险分析(Risk Analysis)：确认基金总体投资风险水平适当可控，分析风险的来源；

基金的投资风格分析（Style Analysis）：确认基金的投资风格与其宣称的投资风格相符并长期保持一致。

同时，在充分了解基金管理公司、基金产品和投资团队的基础上，最终选择投研团队稳定、投研实力突出、风险内控制度完备和长期可查业绩良好的基金。

基金公司(Organization)：公司历史、规模和管理者，股东结构、产品种类、竞争优势、主要客户和法律纠纷；

基金产品(Fund information)：成立时间、投资理念、费率水平、资产增长、客户分布状况和投资限制等；

投资流程(Investment process)：基金决策机制、业绩增长模式(依靠人员还是依靠流程)、投资人员和研究人员的权责划分、研究优势、信息来源和独立研究机构和卖方机构研究支持等；

投资团队(Investment team)：团队结构和稳定性、成员职责和从业经历、团队的绩效、评价体系和备选基金的基金经理管理其它基金的状况；

风险控制（Risk control）：公司风控体系、流程、员工风险意识、风险事故汇报路径和重大事件的应急处理方案。

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

对于精选出的基金，在构建基金组合过程中，会重点关注由同一基金管理人管理的其他基金，和由同一基金托管人托管的其他基金，尽量避免双重收费。

3、股票投资策略

本基金将通过直接投资股票作为投资基金的补充，主要是基于两点考虑：（1）对应资产没有合适基金标的；（2）通过对基础资产的投资可以获取比基金标的更优的风险收益特征。

4、债券投资策略

本基金将通过直接投资债券，作为投资基金的补充。本基金在单个债券选择上，首先，根据个券的剩余期限、久期、信用等级、流动性指标，决定是否将该债券纳入组合的债券备选池；其次，根据个券的收益率（到期收益率、票面利率、利息支付方式、利息税务处理)与剩余期限的配比，对照本基金的收益要求决定是否纳入组合；最后，根据个券的流动性指标（发行总量、流通量、上市时间），决定个券的投资总量。

5、存托凭证投资策略

本基金投资存托凭证的策略依照上述股票投资策略执行。

6、资产支持证券投资策略

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

7、风险管理策略

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

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

8、投资决策依据和决策程序

（1）投资决策依据

1）国家有关法律、法规、基金合同和基金管理人管理制度的有关规定。依法决策是本基金进行投资的前提；

2）宏观经济发展态势、公募基金产品评价体系数据、行业发展变化、微观企业运作状况及证券市场走势。这是本基金投资决策的基础；

3）投资对象收益和风险的配比关系。在充分权衡投资对象的收益和风险的前提下做出投资决策。

（2）投资决策程序

1）决定主要投资原则：投资决策委员会必要时决定基金的主要投资原则，并对资产配置等提出指导性意见。

2）提出投资建议：研究员以内外部研究报告、实地调研以及其他信息来源作为参考，对宏观经济运行状况、公募基金产品、行业发展趋势及个股、个券基本面进行多维度研究，推荐投资标的。

3）制定投资决策：基金经理在遵守投资决策委员会制定的投资原则前提下，根据研究员提供的投资建议以及自己的分析判断，做出具体的投资决策。

4）进行风险评估：风险管理部门对本基金的风险进行监测和评估，并出具风险监控报告。

5）动态的组合管理：基金经理根据证券市场和投资标的基本面的变化，结合本基金的投资目标及流动性管理等因素，对投资组合进行动态调整。

（四） 投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金投资于公募基金的比例不得低于基金资产的 80%；

（2）本基金投资于权益类资产占基金资产的比例为 60%-95%。其中，权益类资产包括股票、股票型基金和满足下述条件之一的混合型基金：

①基金合同约定股票资产投资比例应不低于基金资产的 60%；

②最近四个季度定期报告披露的股票资产投资比例均不低于基金资产的 60%；

（3）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；

（4）本基金持有单只基金市值不得高于基金资产净值的 20%；本基金管理人管理的全部基金（ETF 联接基金除外）持有单只基金不得超过被投资基金净资产的 20%，被投资基金净资产规模以最近定期报告披露的规模为准；

（5）本基金投资于其他基金，被投资基金的运作期限应当不少于 1 年、最近定期报告披露的基金净资产应当不低于 1 亿元；

（6）本基金投资于封闭运作基金、定期开放式基金等流通受限基金的比例不超过基金资产净值的 10%；

（7）本基金投资于货币市场基金的比例不超过基金资产的 15%；

（8）本基金持有一家公司发行的证券（不含本基金所投资的基金份额），其市值不超过基金资产净值的 10%；

（9）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券（不含本基金所投资的基金份额），不超过该证券的 10%；

（10）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%；

（11）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%；

（12）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%；

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

（14）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；

（15）本基金基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

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

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

（18）本基金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%；

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

（20）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；

（21）本基金投资于股票、债券等金融工具的，投资品种和比例应当符合本基金的投资目标和投资策略；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，与国内依法发行上市的股票合并计算；

（22）法律法规或中国证监会或基金合同规定的其他投资限制。

除上述第（3）、（4）、（14）、（19）、（20）项规定外，因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在所涉证券可交易之日起 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。法律法规另有规定的，从其规定。因证券市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述第（4）项时，基金管理人应当在 20 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

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

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

（1）承销证券；

（2）违反规定向他人贷款或者提供担保；

（3）从事承担无限责任的投资；

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

（5）向其基金管理人、基金托管人出资；

（6）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

（7）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

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

人董事会审议，并经过三分之二以上（含三分之二）的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

本基金投资基金管理人或基金管理人关联方管理基金的情况，不属于前述重大关联交易，但是应当按照法律法规或监管规定的要求履行信息披露义务。

3、法律法规或监管部门对基金合同所述投资比例、投资限制、组合限制、禁止行为等作出强制性调整的，本基金应当按照法律法规或监管部门的规定执行；如法律法规或监管部门修改或调整涉及本基金的投资比例、投资限制、组合限制、禁止行为等，且该等调整或修改属于非强制性的，则基金管理人与基金托管人协商一致后，可按照法律法规或监管部门调整或修改后的规定执行。

（五） 业绩比较基准

中证偏股型基金指数收益率*80%+中证纯债债券型基金指数收益率*20%

1、业绩比较基准设定的原因

基于基金投资范围以及预期投资的主要资产类别，本基金主要投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集的权益类基金、固定收益类基金等资产，相应选取与之匹配的中证偏股型基金指数和中证纯债债券型基金指数作为基准要素。同时基于本基金投资于公募基金的比例不少于基金资产的 80%，投资于权益类资产占基金资产的比例为 60%-95%，本基金将中证偏股型基金指数和中证纯债债券型基金指数所对应的基准要素权重分别设置为 80%与 20%。

基于基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金将在全市场范围内进行基金的选择与配置。本基金以积极的投资风格进行长期资产配置，通过构建与收益风险水平相匹配的基金组合，在控制投资风险并保持良好流动性的前提下，追求基金资产的长期增值。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，本基金分别选取中证偏股型基金指数和中证纯债债券型基金指数作为权益类资产和固定收益类资产的基准要素。

（1）中证偏股型基金指数选取内地市场所有股票型基金以及混合型基金中以股票为主要投资对象的基金作为样本，采用净值规模加权，以反映所有偏股型开放式证券投资基金的整体走势，适合作为本基金境内权益类资产部分的业绩比较基准。

（2）中证纯债债券型基金指数选取按基金合同规定只投资债券的基金作为样本，且排除分级基金、可转债基金、定期开放式基金、ETF，采用净值规模加权，以反映所有纯债开放式证券投资基金的整体走势，适合作为本基金固定收益类资产部分的业绩比较基准。

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、本基金业绩比较基准要素的基本信息

中证偏股型基金指数由中证指数有限公司编制发布，指数代码为 930950，指数具体信息详见中证指数有限公司网站，网址：www.csindex.com.cn。

中证纯债债券型基金指数由中证指数有限公司编制发布，指数代码为 930609，指数具体信息详见中证指数有限公司网站，网址：www.csindex.com.cn。

3、业绩比较基准的计算方法

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各构成要素的每日收益率，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。

法律法规、监管机关、登记机构、证券交易所、自律规则另有规定的，从其规定。

4、管理投资偏离业绩比较基准的定性或定量方法

本基金管理人设立独立于投资管理部门的部门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，根据产品类型、投资目标、投资策略等多种因素，审慎选取合适的监测指标，监测指标主要包括业绩风险类指标、投资偏离类指标等，以更好管理基金实际投资与业绩比较基准的偏离情况，从而在控制风险的基础上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

本基金为混合型基金中基金（FOF），本基金长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、股票型基金中基金（FOF），高于债券型基金、债券型基金中基金（FOF）、货币市场基金和货币型基金中基金（FOF）。

（七） 基金管理人代表基金行使相关权利的处理原则及方法

1、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东、债权人或投资其他基金的基金份额持有人权利，保护基金份额持有人的利益；

2、不谋求对上市公司的控股；

3、有利于基金财产的安全与增值；

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

（八） 侧袋机制的实施和投资运作安排

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

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。

（九） 基金投资组合报告

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

本基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 07 月 17 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（“报告期末”），本报告所列财务数据未经审计。

1. 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	37,534,366.30	84.98
3	固定收益投资	2,225,932.99	5.04
	其中：债券	2,225,932.99	5.04
	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	1,373,243.01	3.11
8	其他资产	3,036,760.49	6.88
9	合计	44,170,302.79	100.00

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

无。

(2) 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

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

无。

4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	2,225,932.99	5.58
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-

6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,225,932.99	5.58

5. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	019785	25 国债 13	19,000	1,923,988.41	4.82
2	019827	26 国债 01	3,000	301,944.58	0.76

注：报告期末，本基金仅持有上述 2 只债券。

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

无。

7. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

8. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(1) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

(2) 本基金投资股指期货的投资政策

无。

10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(1) 本期国债期货投资政策

无。

(2) 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

(3) 本期国债期货投资评价

无。

11. 投资组合报告附注

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

基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

(2) 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

(3) 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	15,942.09
2	应收证券清算款	2,802,914.98
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	217,903.42
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	3,036,760.49

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

(6) 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

十、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

（一） 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

嘉实领航聚优积极配置 6 个月持有期混合（FOF）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
2022 年 12 月 13 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日	0.79%	0.40%	-2.20%	0.55%	2.99%	-0.15%
2023 年	-13.05%	0.74%	-8.20%	0.65%	-4.85%	0.09%
2024 年	6.69%	1.23%	10.15%	1.14%	-3.46%	0.09%
2025 年	25.32%	1.08%	16.71%	0.82%	8.61%	0.26%
2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	23.95%	1.49%	8.99%	0.99%	14.96%	0.50%

嘉实领航聚优积极配置 6 个月持有期混合（FOF）C

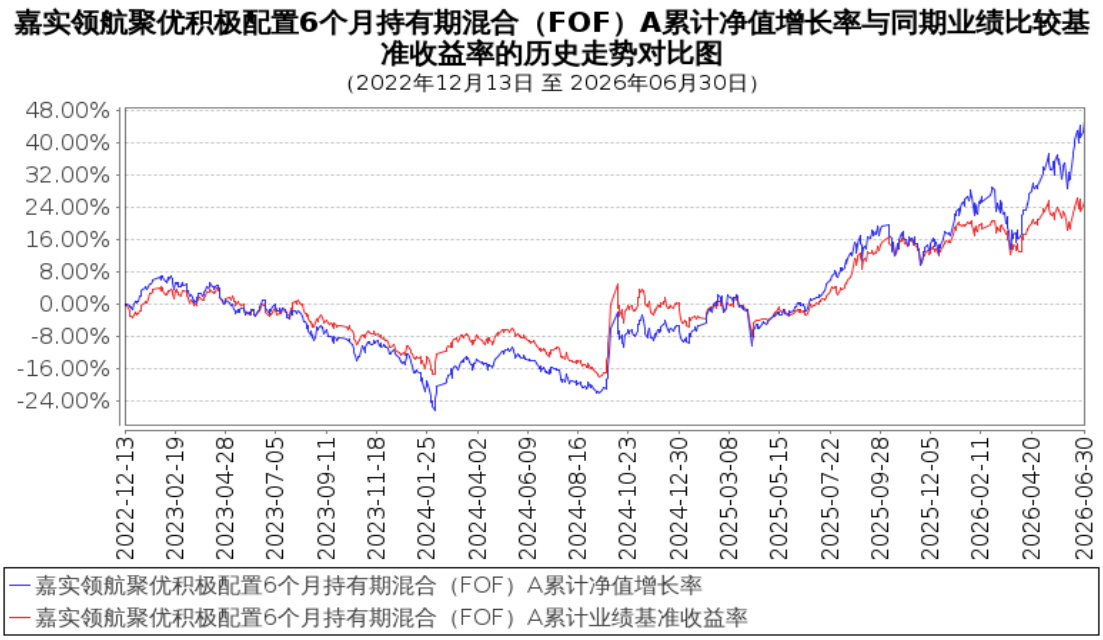
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2022 年 12 月 13 日（基金合同生效日）至 2022 年 12	0.77%	0.40%	-2.20%	0.55%	2.97%	-0.15%

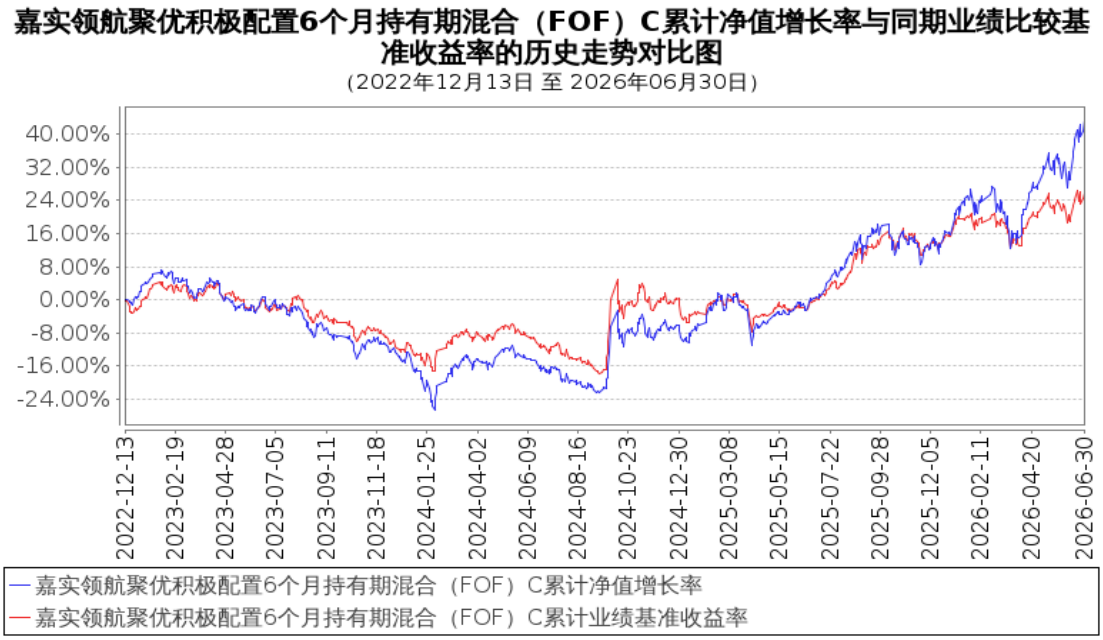
月 31 日						
2023 年	-13.40%	0.74%	-8.20%	0.65%	-5.20%	0.09%
2024 年	6.27%	1.23%	10.15%	1.14%	-3.88%	0.09%
2025 年	24.81%	1.08%	16.71%	0.82%	8.10%	0.26%
2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	23.70%	1.49%	8.99%	0.99%	14.71%	0.50%

该时间区间历任基金经理

姜玉雯女士，管理时间为 2022 年 12 月 13 日至 2024 年 3 月 29 日；唐棠先生，管理时间为 2024 年 1 月 25 日至 2026 年 4 月 9 日。

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





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

十一、基金的财产

（一）基金资产总值

基金资产总值是指基金持有的各类基金、证券及票据价值、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和。

（二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

（三）基金财产的账户

基金托管人根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立资金账户、证券账户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服务机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

（四）基金财产的保管和处分

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

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

十二、基金资产的估值

（一）估值日

本基金的估值日是指基金份额净值和基金份额累计净值的归属日，T+1 日内完成 T 日估值，T+2 日内披露。

（二）估值对象

基金所拥有的其他基金份额、股票、债券、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。

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

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

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

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

（四）估值方法

1、基金估值方法

（1）非上市基金估值

本基金投资于非上市基金的估值：

①本基金投资的境内非货币市场基金，按所投资基金估值日的基金份额净值估值。

②本基金投资的境内货币市场基金，如所投资基金披露份额净值，则按所投资基金估值日的份额净值估值；如所投资基金披露万份收益，按所投资基金前一估值日后至估值日期间（含节假日）的万份收益计提估值日基金收益。

（2）上市基金估值

本基金投资于交易所上市基金的估值：

①本基金投资的 ETF 基金、境内上市定期开放式基金、封闭式基金，按照所投资基金估值日的收盘价估值。

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

③本基金投资的境内上市交易型货币市场基金，如所投资基金披露份额净值，则按所投资基金估值日的份额净值估值；如所投资基金披露万份（百份）收益，则按所投资基金前一估值日后至估值日期间（含节假日）的万份（百份）收益计提估值日基金收益。

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

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

②以所投资基金的收盘价估值的，若估值日无交易，且最近交易日后市场环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后市场环境发生了重大变化的，可使用最新的基金份额净值为基础或参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素调整最近交易市价，确定公允价值。

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

2、证券交易所上市的有价证券（不包含交易所上市基金）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按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

（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。

3、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

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

（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。

4、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。对于含投资人回售权的固定收益品种，回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。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。

5、同一证券同时在两个或两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。

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

7、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。

8、本基金投资存托凭证的估值核算，依照国内依法发行上市的股票执行。

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

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

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

（五）估值程序

1、各类基金份额净值是按照每个估值日，该类基金资产净值除以该估值日该类基金份额的余额数量计算，精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的收益或损失归入基金财产。基金管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的，从其规定。

2、基金管理人应每个估值日后 1 个工作日内对该估值日的基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人对基金资产估值后，将各类基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人按照规定对外公布。

（六）估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当任一类别的基金份额净值小数点后 4 位以内(含第 4 位)发生估值错误时，视为该类基金份额净值错误。

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、或投资人自身的原因造成估值错误，导致其他当事人遭受损失的，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，则有协助义务的当事人应当承担相应赔偿责任。估值错误责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保估值错误已得到更正。

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

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

（4）估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

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

4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

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

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

（3）如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

5、特殊情况的处理

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

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

人和基金托管人免除赔偿责任，但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

（七）暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

3、占本基金资产净值相当比例的被投资基金暂停估值时，本基金可以暂停估值；

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

5、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，由基金管理人按照《信息披露办法》的规定进行披露。

（九）实施侧袋机制期间的基金资产估值

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

十三、基金的收益与分配

（一）基金利润的构成

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

（二）基金可供分配利润

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

（三）基金收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下，由基金管理人根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；

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

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

4、由于基金费用的不同，不同类别的基金份额在收益分配数额方面可能有所不同，基金管理人可对各类别基金份额分别制定收益分配方案。同一类别的每一份基金份额享有同等分配权；

5、红利再投资获得的基金份额跟随原份额计算锁定持有期；

6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则和支付方式进行调整，不需召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前按照《信息披露办法》的要求在规定媒介公告。

（四）收益分配方案

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

（五）收益分配方案的确定、公告与实施

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

（六）基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份

额持有人的现金红利自动转为相应类别的基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。

（七）实施侧袋机制期间的收益分配

本基金实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配，详见招募说明书“侧袋机制”部分的规定。

十四、基金的费用与税收

（一）基金费用的种类

1、基金管理人的管理费；

2、基金托管人的托管费；

3、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、律师费和诉讼费或仲裁费；

6、基金份额持有人大会费用；

7、基金的证券交易费用；

8、基金的银行汇划费用；

9、基金的开户费用、账户维护费用；

10、被投资基金的申购、赎回费用等销售费用，但法律法规禁止从基金财产中列支的除外；

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。

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

（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

本基金基金财产中投资于本基金管理人管理的其他基金份额的部分不收取管理费。在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值扣除基金资产中本基金管理人管理的其他基金份额所对应资产净值后剩余部分（若为负数，则取 0）的 0.80%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×0.80%÷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扣除基金财产中本基金基金管理人管理的其他基金份额所对应资产净值的剩余部分；若为负数，则 E 取 0。

基金管理费每日计算，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力等，支付日期顺延至最近可支付日支付。

2、基金托管人的托管费

本基金基金财产中投资于本基金托管人托管的其他基金份额的部分不收取托管费。在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值扣除基金资产中本基金托管人托管的其他基金份额所对应资产净值后剩余部分（若为负数，则取 0）的 0.15%年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.15%÷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扣除基金财产中本基金基金托管人托管的其他基金份额所对应资产净值的剩余部分；若为负数，则 E 取 0。

基金托管费每日计算，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日或不可抗力等，支付日期顺延至最近可支付日支付。

3、基金的销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%，按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.40%年费率计提。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 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计算，按月支付，经基金管理人和基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性划出，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、休息日或不可抗力等，支付日期顺延至最近可支付日支付。

上述“（一）基金费用的种类”中第 4－11 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

（三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

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

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、基金合同生效前的相关费用；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

（四）实施侧袋机制期间的基金费用

本基金实施侧袋机制的，与侧袋账户有关的费用可以从侧袋账户中列支，但应待侧袋账户资产变现后方可列支，有关费用可酌情收取或减免，但不得收取管理费，详见招募说明书“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，本基金运作过程中应缴纳的增值税、附加税费等税费由基金财产承担，按照税务机关的要求以基金管理人名义缴纳。

十五、基金的会计与审计

（一）基金会计政策

1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；

2、基金的会计年度为公历年度的 1 月 1 日至 12 月 31 日；

3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；

4、会计制度执行国家有关会计制度；

5、本基金独立建账、独立核算；

6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；

7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

（二）基金的年度审计

1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的符合《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依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

十六、基金的信息披露

（一）本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《流动性风险管理规定》、基金合同及其他有关规定。相关法律法规或监管机关就基金的信息披露做出新的规定或予以调整的，本基金按照其最新规定执行，无需基金份额持有人大会审议批准。

（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”）及符合《信息披露办法》规定的互联网网站（以下简称“规定网站”）等媒介披露，并保证基金投资者能够按照基金合同约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

（三）本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；

2、对证券投资业绩进行预测；

3、违规承诺收益或者承担损失；

4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构；

5、登载任何自然人、法人和非法人组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；

6、中国证监会禁止的其他行为。

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

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

（五）公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

1、基金招募说明书、基金合同、基金托管协议、基金产品资料概要

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

（2）基金招募说明书应当按照法律法规和监管要求披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及

基金份额持有人服务等内容。基金合同生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在规定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。

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

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

基金募集申请经中国证监会注册后，基金管理人应当按照《信息披露办法》的规定，将基金份额发售公告、基金招募说明书提示性公告和基金合同提示性公告登载在规定报刊上，将基金份额发售公告、基金招募说明书、基金产品资料概要、基金合同和基金托管协议登载在规定网站上，并将基金产品资料概要登载在基金销售机构网站或营业网点；基金托管人应当同时将基金合同、基金托管协议登载在规定网站上。

2、基金份额发售公告

基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日按照《信息披露办法》的规定登载于规定媒介上。

3、基金合同生效公告

基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日按照《信息披露办法》的规定在规定媒介上登载基金合同生效公告。

4、基金净值信息

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

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在不晚于每个开放日后的 2 个工作日内，通过规定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日后的 2 个工作日内，在规定网站披露半年度和年度最后一日的各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值。

5、基金份额申购、赎回价格

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

6、基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告

基金管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载在规定网站上，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符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计。

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

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

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

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

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

7、临时报告

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当依照《信息披露办法》的有关规定编制临时报告书，并登载在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）本基金转换基金运作方式、与其他基金合并；

（4）本基金更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，本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、变更基金管理人的实际控制人；

（8）本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，中国证监会另有规定的情形除外；

（14）本基金收益分配事项；

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

（16）某类基金份额净值计价错误达该类基金份额净值百分之零点五；

（17）本基金开始办理申购、赎回；

（18）本基金发生巨额赎回并延期办理；

（19）本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；

（20）本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；

（21）发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；

（22）调整本基金基金份额类别设置；

（23）基金管理人采用摆动定价机制进行估值；

（24）本基金连续 30 个工作日、40 个工作日、45 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形时，对基金合同可能面临终止的不确定性风险进行提示；

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

8、澄清公告

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

9、基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决议，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

10、清算报告

发生基金合同终止事由的，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制作清算报告。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。

11、投资基金份额的信息披露

在定期报告和招募说明书等文件中应设立专门章节披露投资于其他基金的相关情况并揭示相关风险：（1）投资策略、持仓情况、损益情况、净值披露时间等；（2）交易及持有基金产生的费用，包括申购费、赎回费、销售服务费、管理费、托管费等；（3）本基金持有的基金发生的重大影响事件，如转换运作方式、与其他基金合并、终止基金合同以及召开基金份额持有人大会等；（4）本基金投资于基金管理人以及管理人关联方管理基金的情况。

12、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。

13、中国证监会规定应予公开披露的其他信息

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。

（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净值信息、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的信息。基金管理人、基金托管人应当向中国证监会基金电子披露网站报送拟披露的基金信息，并保证相关报送信息的真实、准确、完整、及时。

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

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，相关档案的保存期限不低于法律法规规定的最低年限。

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

（七）信息披露文件的存放与查阅

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

（八）暂停或延迟信息披露的情形

当出现下述情况时，基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金信息：

1、基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

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

3、法律法规规定、中国证监会或基金合同认定的其他情形。

十七、基金持有其他基金的信息披露

（一）本基金所持其他基金的基本情况

本基金在投资其他基金后，应在定期报告和更新的招募说明书中披露该基金的基本情况，包括但不限于该基金的投资政策、损益情况、净值披露情况以及本基金的持仓情况。

（二）本基金交易及持有其他基金产生的费用

1、所持其他基金产生的费用种类

（1）本基金申购其他基金的申购费；

（2）本基金赎回其他基金的赎回费；

（3）本基金持有其他基金每日产生的销售服务费；

（4）本基金持有其他基金每日产生的该基金的管理费；

（5）本基金持有其他基金每日产生的该基金的托管费；

（6）本基金通过场内交易其他基金产生的交易费用；

（7）按照法律法规或监管部门的有关规定和所持基金的《基金合同》约定，在所持基金的基金财产中列支的其他费用。

本基金交易及持有其他基金的具体费用种类、费率标准、计算规则及保留位数等事项，以所交易及持有的其他基金的相关基金合同、招募说明书、相关公告等文件为准。

2、相关费用的计算方法和举例说明

（1）申购基金份额产生的申购费

1）本基金申购非本基金管理人管理的基金时：

A.前端收费模式

本基金所需支付的申购费的计算方法：

净申购金额=申购金额/（1+申购费率），或净申购金额=申购金额－固定申购费金额

申购费=申购金额－净申购金额，或申购费=固定申购费金额

例：假设 A 基金收取前端申购费，其费率结构如下：

申购金额（M）	前端申购费率
M＜1000 万元	1.5%
M≥1000 万元	每笔 1000 元

①本基金拟投资 1,015,000 元申购 A 基金的基金份额，且该申购申请被全额确认，A 基

金收取的是前端申购费，对应的申购费率为 1.5%，则产生的申购费用为 15,000 元：

申购金额=1,015,000 元

净申购金额＝1,015,000/(1+1.5%)＝1,000,000.00 元

申购费用＝1,015,000－1,000,000.00＝15,000.00 元

②本基金拟投资 10,000,000 元申购 A 基金的基金份额，且该申购申请被全额确认，A 基金收取前端申购费，对应的申购费为每笔 1000 元，则产生的申购费用为 1,000 元：

申购费用＝1,000 元

B. 后端收费模式

本基金所需支付的申购费的计算方法：

申购费用＝赎回份额×申购日基金份额净值×对应的后端申购费率

例：假设 B 基金收取后端申购费，其费率结构如下：

持有期限（T）	后端申购费率
T＜1 年	1.5%
T≥1 年	0

注：1 年指 365 日

本基金拟投资 1,000,000 元申购 B 基金，B 基金收取后端申购费，申请日当日 B 基金的基金份额净值为 1.0150 元，且该申购申请被全额确认。本基金持有 B 基金的持有期限不满 1 年即全部赎回，对应后端申购费率 1.5%，则产生的申购费用为 15,000 元：

申购份额=1,000,000/1.0150=985,221.67 份

赎回份额=申购份额=985,221.67 份

申购费用＝985,221.67×1.0150×1.5%=15,000.00 元

2）本基金申购本基金管理人管理的其他基金时，需通过直销渠道申购，且不收取申购费。

（2）赎回基金份额产生的赎回费

1）本基金赎回非本基金管理人管理的基金时：

本基金所需支付的赎回费的计算方法：

赎回总额=赎回份额×T 日基金份额净值

赎回费用=赎回总额×赎回费率

净赎回金额=赎回总额－赎回费用

例：假设 A 基金的赎回费率结构如下：

持有期限（Y）	赎回费率
Y＜7 日	1.5%
7 日≤Y＜30 日	0.5%
30 日≤Y	0

本基金赎回 10,000 份 A 基金的基金份额，持有时间 20 日，对应的赎回费率为 0.5%，假设赎回当日的基金份额净值是 1.0680 元，则产生的赎回费用为 53.40 元，可得到的净赎回金额为 10,626.60 元：

赎回总额=10,000×1.0680=10,680.00 元

赎回费用=10,680.00×0.5%=53.40 元

净赎回金额=10,680.00-53.40=10,626.60 元

2）本基金赎回本基金管理人管理的其他基金时，不收取赎回费，但按照相关法规、所投资基金的招募说明书约定应当收取赎回费，并计入基金财产的赎回费部分除外。

本基金所需支付的赎回费的计算方法：

赎回总额=赎回份额×T 日基金份额净值

赎回费用=赎回总额×赎回费率

实际支付的赎回费用=赎回费用×计入基金财产的比例

净赎回金额=赎回总额-实际支付的赎回费用

例：假设本基金管理人管理的 B 基金的赎回费率结构及计入基金财产的赎回费比例如下：

持有期限（Y）	赎回费率	计入基金财产的比例
Y＜30 日	1.5%	100%
30 日≤Y＜180 日	0.5%	50%
180 日≤Y	0	0

本基金赎回 10,000 份 B 基金的基金份额，持有时间 60 日，对应的赎回费率为 0.5%，假设赎回当日基金份额净值是 1.0680 元，则实际产生的赎回费用为 26.70 元，可得到的净赎回金额为 10,653.30 元：

赎回总额=10,000×1.0680=10,680.00 元

赎回费用=10,680.00×0.5%=53.40 元

实际支付的赎回费用=53.40×50%=26.70 元

净赎回金额=10,680.00-26.70=10,653.30 元

（3）所持其他基金每日产生的销售服务费；

1）本基金持有非本基金管理人管理的其他基金时：

本基金所需支付的销售服务费的计算方法：

所持该基金当日产生的销售服务费=所持该基金的基金份额总数×前一日的该基金份额净值×销售服务费率÷当年天数

例：假设 A 基金的销售服务费率为 0.20%，本基金持有 A 基金的基金份额 100,000 份，前一日的该基金份额净值为 1.0050 元，当年天数为 365 天，则 T 日产生的销售服务费为 0.55 元：

所持该基金当日产生的销售服务费=100,000×1.0050×0.20%÷365=0.55 元

2）本基金持有本基金管理人管理的其他基金时，所持有的该基金份额不得收取该基金的销售服务费，即其每日产生的销售服务费为 0。

（4）所持其他基金每日产生的管理费

1）本基金持有其他基金（包括非本基金管理人管理的基金和本基金管理人管理的其他基金）时，本基金所需支付的其他基金的管理费的计算方法：

所持该基金当日产生的管理费=所持该基金的基金份额总数×前一日的该基金份额净值×管理费率÷当年天数

例：假设 A 基金的管理费率为 1.00%，本基金持有 A 基金的基金份额 100,000 份，前一日的基金份额净值为 1.0050 元，当年天数为 365 天，则当日产生的其他基金管理费为 2.75 元：

所持该基金当日产生的管理费=100,000×1.0050×1.00%÷365=2.75 元

2）本基金持有本基金管理人管理的其他基金时，所持有的该基金份额对应的基金资产部分不收取本基金的管理费，本基金每日应计提的本基金管理费的计算方法：

本基金每日应计提的基金管理费=E×管理费率÷当年天数

（E 为前一日的基金资产净值扣除前一日所持有本基金管理人管理的基金份额部分基金资产后的余额（若为负数，则 E 取 0））

例：假设本基金前一日基金资产净值为 10 亿元，其中所持有的本基金管理人管理的其他基金所对应的基金资产净值为 4 亿元，若本基金管理费率为 0.8%，当年天数为 365 天，

则本基金当日应计提的管理费为：

当日应计提的管理费=（1,000,000,000.00-400,000,000.00）×0.8%÷365=13,150.68 元

（5）所持其他基金每日产生的托管费

1）本基金持有其他基金（包括非本基金托管人托管的基金和本基金托管人托管的其他基金）时，本基金所需支付的其他基金的托管费的计算方法：

所持该基金当日产生的托管费=所持该基金的基金份额总数×前一日的该基金份额净值×托管费率÷当年天数

例：A 基金的托管费率为 0.20%，本基金持有 A 基金的基金份额 100,000 份，前一日的基金份额净值为 1.0050 元，当年天数为 365 天，则今日产生的基金托管费为 0.55 元：

所持该基金当日产生的托管费=100,000×1.0050×0.20%÷365=0.55 元

2）本基金持有本基金托管人托管的其他基金时，所持有的该基金份额对应的基金资产部分不收取本基金的托管费，本基金每日应计提的基金托管费的计算方法：

本基金每日应计提的基金托管费=E×托管费率÷当年天数

（E 为前一日的基金资产净值扣除前一日所持有本基金托管人托管的基金份额部分基金资产后的余额（若为负数，则 E 取 0））

例：假设本基金前一日基金资产净值为 10 亿元，其中所持有的本基金托管人托管的其他基金所对应的基金资产净值为 1 亿元，本基金托管费率为 0.2%，当年天数为 365 天，则本基金当日应计提的托管费为：

当日应计提的托管费=（1,000,000,000.00-100,000,000.00）×0.2%÷365=4,931.51 元

（6）通过场内交易其他基金产生的交易费用

本基金通过场内进行交易其他基金时，所产生的相关交易费用按相关交易所和证券经纪公司的规则和费率标准处理，从本基金财产中列支。

（7）按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在所持基金的基金财产中列支的其他费用

按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在所持基金的基金财产中列支的其他费用，按费用实际支出金额列入或摊入当期费用，由该基金的基金份额持有人共同承担。

3、所持基金产生的费用的调整

如果本基金所持的其他基金收取的相关基金费用发生变更的，或法律法规或监管部门对基金中基金支付所持基金相关基金费用的规则发生变更的，即以变更后的规定为准，无需召

开基金份额持有人大会。

（三）本基金持有的其他基金的重大事件

本基金应在定期报告和更新的招募说明书中披露所持其他基金发生的重大事件，包括但不限于发生转换运作方式、与其他基金合并、终止基金合同或召开基金份额持有人大会等情况。

（四）关联基金的投资情况

本基金投资本基金管理人及其关联方所管理的基金的，应在定期报告和更新的招募说明书中披露相关基金的投资情况。

十八、侧袋机制

（一）侧袋机制的实施条件

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

基金管理人应当在启用侧袋机制后及时发布临时公告，并在五个工作日内聘请符合《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，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。

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。

3、除基金管理人应按照主袋账户的份额净值办理主袋账户份额的申购和赎回外，本招募说明书“基金份额的申购与赎回”部分的申购、赎回规定适用于主袋账户份额。巨额赎回按照单个开放日内主袋账户份额净赎回申请超过前一工作日主袋账户总份额的 10%认定。

（三）实施侧袋机制期间的基金投资

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

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

基金管理人不得在侧袋账户中进行除特定资产处置变现以外的其他投资操作。

（四）实施侧袋机制期间的基金估值

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

（五）实施侧袋账户期间的基金费用

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。

（六）侧袋账户中特定资产的处置变现和支付

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

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

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

（七）侧袋机制的信息披露

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，并在基金定期报告中披露特定资产的运作情况。

（八）本部分关于侧袋机制的相关规定，凡是直接引用法律法规或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，或将来法律法规或监管规则针对侧袋机制的内容有进一步规定的，基金管理人经与基金托管人协商一致并履行适当程序后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

十九、风险揭示

（一）市场风险

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

1、政策风险

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

2、经济周期风险

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

3、利率风险

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

4、购买力风险

本基金投资的目的是使基金资产保值增值，如果发生通货膨胀，基金投资于证券所获得的收益可能会被通货膨胀抵消，从而影响基金资产的保值增值。

5、上市公司经营风险

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

6、再投资风险

再投资风险反映了利率下降对固定收益证券利息收入再投资收益的影响，这与利率上升所带来的价格风险（即利率风险）互为消长。

（二）信用风险

信用风险主要指债券、资产支持证券等信用证券发行主体信用状况恶化，导致信用评级下降甚至到期不能履行合约进行兑付的风险，另外，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。

（三）流动性风险

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

1、本基金的申购、赎回安排

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

基金合同生效后，若证券交易所交易时间变更或有其他特殊情况，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。

基金合同生效后，本基金对每一份认购/申购的基金份额分别计算 6 个月的“锁定持有期”，投资者持有的基金份额自锁定到期日的下一工作日起，方可申请赎回。

本基金每一份基金份额的“锁定持有期”视投资者认购/申购的时间不同而分别计算，具体规则如下：

有效认购的基金份额的锁定持有期指基金合同生效日（锁定起始日）起至基金合同生效日后第 6 个月度对日的前一日（锁定到期日）之间的区间；有效申购的基金份额的锁定持有期指申购确认日（锁定起始日）起至申购确认日后第 6 个月度对日的前一日（锁定到期日）之间的区间。认购/申购的基金份额自锁定到期日的下一工作日起方可申请赎回。

2、拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

（1）投资市场的流动性风险

本基金投资于公募基金、股票、债券、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、现金等。上述资产运作时间长，市场透明度较高，运作方式规范，历史流动性状况良好，正常情况下能够及时满足基金变现需求，保证基金按时应对赎回要求。极端市场情况下，上述资产可能出现流动性不足，导致基金资产无法变现，从而影响投资者按时收到赎回款项。根据过往经验统计，绝大部分时间本基金可投资资产流动性充裕，流动性风险可控，当遇到极端市场情况时，基金管理人会按照基金合同及相关法律法规要求，及时启动流动性风险应对措施，保护基金投资者的合法权益。

（2）投资行业的流动性风险

从所投资行业方面，实际投资运作中，本基金主要投资的基金类型为开放式的债券型基金、货币市场基金、混合型基金与股票型基金，上述各类基金为我国证券投资基金市场上的主要品种，运作时间长、运作方式规范、历史流动性状况好。

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

（3）投资资产的流动性风险

本基金绝大部分基金资产投资于 7 个工作日可变现资产，包括开放式基金、可在交易所、银行间市场正常交易的股票、债券、非金融企业债务融资工具及同业存单，7 个工作

日内到期或可支取的逆回购、银行存款，7 个工作日内能够确认收到的各类应收款项等，上述资产流动性情况良好。

按照基金合同中投资限制部分约定，本基金管理人管理的全部基金（ETF 联接基金除外）持有单只基金不得超过被投资基金净资产的 20%，且本基金投资于其他基金，被投资基金的运作期限应当不少于 1 年、最近定期报告披露的基金净资产应当不低于 1 亿元，表明本基金占任一被投资基金的比例较低，且被投资基金具备一定的规模，整体流动性状况良好。

在本基金运作过程中，基金管理人会合理控制对所投资基金的赎回份额，尽可能避免出现被所投资基金认定为单个基金及份额持有人超过基金总份额一定比例以上赎回申请的情形，减少被实施延期办理赎回申请的情况。

3、巨额赎回措施

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过上一工作日基金总份额的 10%，即认为是发生了巨额赎回。

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

（1）部分延期赎回，并有权对当日申请赎回的份额超过上一工作日基金总份额 20%的单个赎回申请人实施部分延期办理；

（2）暂停接受赎回申请；

（3）采用摆动定价机制；

（4）中国证监会认定的其他措施。

4、实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响：

（1）占前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金申购赎回申请的措施。基金份额持有人存在不能及时赎回基金份额的风险。

（2）若本基金发生了巨额赎回，基金管理人有可能采取部分延期赎回或暂停赎回的措施以应对巨额赎回，具体措施请见基金合同及招募说明书中“基金份额的申购与赎回”部分“巨额赎回的处理方式”。因此在巨额赎回情形发生时，基金份额持有人存在不能及时赎回基金份额的风险。

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

（4）暂停基金估值

投资人具体请参见基金合同“第十四部分 基金资产估值”中的“七、暂停估值的情形”，详细了解本基金暂停估值的情形及程序。

在此情形下，投资人没有可供参考的基金份额净值，同时赎回申请可能被延期办理或被暂停接受，或被延缓支付赎回款项。

（5）实施侧袋机制

投资人具体请参见招募说明书“十七、侧袋机制”，详细了解本基金侧袋机制的情形及程序。

5、实施侧袋机制对投资者的影响

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

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

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

启用侧袋机制后，基金管理人计算各项投资运作指标和基金业绩指标时仅需考虑主袋账户资产，并根据相关规定对分割侧袋账户资产导致的基金净资产减少进行按投资损失处理，因此本基金披露的业绩指标不能反映特定资产的真实价值及变化情况。

（四）管理风险

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

（五）操作或技术风险

指相关当事人在业务各环节操作过程中，因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险，例如，越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误、IT 系统故障等风险。

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

（六）合规性风险

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

（七）本基金特有的风险

1、基金中基金风险

本基金是基金中基金，基金资产主要投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集基金，因此所投资基金净值变化将影响到基金业绩表现。本基金的资产配置策略将通过战略资产配置与权益类资产投资策略确定各个大类资产的具体配置比例，尽可能降低单一资产价格波动对组合的冲击，但并不能完全抵御市场整体下跌带来的被投资基金基金净值下跌风险，本基金净值表现因此可能受到影响。本基金管理人将发挥专业研究优势，加强对市场环境及各类型公募基金的深入研究，持续优化组合配置，以控制特定风险。

本基金投资经中国证监会依法核准或注册的公开募集基金，可能面临以下风险：

（1）集中度风险

同一基金公司管理被投资的基金组合在投资风格、重仓证券、市场判断等方面可能具有相对较高的相似性，因而当本基金持有同一基金公司发行的基金比例较高时，本基金在市场风险、信用风险、流动性风险等方面可能面临较高的集中度，不利于风险分散。

（2）被投资基金收益不达预期的风险

本基金投资目标的实现建立在被投资基金投资目标实现的基础上。如果由于被投资基金管理人未能实现投资目标，则本基金存在达不成投资目标的风险。

（3）被投资基金风格偏离风险

本基金基金筛选策略依靠对被投资基金风格的研判，通过选择和不同市场环境风格相匹配的基金，获取收益。因此当被投资基金投资风格出现偏离，会使得本基金存在收益不达预期的风险。

（4）被投资基金引起的流动性风险

由于本基金投资的其他基金份额往往都有通过“巨额赎回条款”限制持有人赎回变现的权利，因此本基金可能存在不能以下达赎回指令时的被投资基金价格变现全部资产的风险。

2、锁定期持有期风险

基金合同生效后，本基金对每一份认购/申购的基金份额分别计算 6 个月的“锁定持有期”，投资者持有的基金份额自锁定到期日的下一工作日起，方可申请赎回。红利再投资

获得的基金份额跟随原份额锁定持有期。在锁定持有期届满前，基金份额持有人不能申请赎回，因此面临流动性风险。

3、资产支持证券风险

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

4、公募 REITs 风险

公募 REITs 采用“公募基金+基础设施资产支持证券”的产品结构，主要特点如下：一是公募 REITs 与投资股票或债券的公募基金具有不同的风险收益特征，80%以上基金资产投资于基础设施资产支持证券，并持有其全部份额，基金通过基础设施资产支持证券持有基础设施项目公司全部股权，穿透取得基础设施项目完全所有权或经营权利；二是公募 REITs 以获取基础设施项目租金、收费等稳定现金流为主要目的，收益分配比例不低于合并后基金年度可供分配金额的 90%；三是公募 REITs 采取封闭式运作，不开放申购与赎回，在证券交易所上市，存在流动性不足的风险。

投资公募 REITs 可能面临以下风险，包括但不限于：

（1）基金价格波动风险

公募 REITs 大部分资产投资于基础设施项目，具有权益属性，受经济环境、运营管理等因素影响，基础设施项目市场价值及现金流情况可能发生变化，可能引起公募 REITs 价格波动，甚至存在基础设施项目遭遇极端事件（如地震、台风等）发生较大损失而影响基金价格的风险。

（2）基础设施项目运营风险

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

（3）流动性风险

公募 REITs 采取封闭式运作，不开通申购赎回，只能在二级市场交易，存在流动性不足的风险。

（4）终止上市风险

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

（5）税收等政策调整风险

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

（6）公募 REITs 相关法律法规和交易所业务规则，可能根据市场情况进行修改，或者制定新的法律法规和业务规则，可能面临相关法律法规和业务规则变更风险。

5、存托凭证投资风险

本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于境内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。

6、境外投资风险

本基金可以通过投资港股通基金等子基金间接投资于境外市场，可能面临以下风险：

（1）境外市场风险

相关地区处于不同产业景气循环周期位置，将对子基金的投资绩效产生影响，进而可能影响本基金。境外证券市场可能对于特定事件、特有的政治因素、法律法规、市场状况、经济发展趋势的反应较境内证券市场有诸多不同，并且拟投资市场如香港的证券交易市场对每日证券交易价格并无涨跌幅上下限的规定，这些地区证券的每日涨跌幅空间可能相对较大。以上所述因素可能带来市场的急剧波动，从而带来投资风险的增加。

（2）政策风险

子基金所投资的地区因政治局势变化(如罢工、暴动、战争等)或法令、政策等的变动，可能导致市场的较大波动，从而给本基金的投资收益造成直接或间接的影响。此外，子基金所投资的地区可能会不时采取某些管制措施，如资本或外汇管制、对公司或行业的国有化以及征收高额税收等，从而对本基金收益以及基金资产带来不利影响。

（3）汇率与外汇管制风险

子基金以人民币募集和计价，经过换汇后投资于以外币计价的金融工具。 外币相对于人民币的汇率变化将会影响本基金以人民币计价的基金资产价值，从而导致本基金基金资产面临潜在风险。

（4）税收风险

子基金因地区税务法律法规的不同，可能会就股息、利息、资本利得等收益向地区税务机构缴纳税金，包括预扣税，该行为可能会使得资产回报受到一定影响。此外，由于地区的税收规定可能发生变化，或者实施具有追溯力的修订，从而导致子基金向该地区缴纳在基金销售、估值或者出售投资当日并未预计的额外税项，进而可能影响本基金。

7、商品基金风险

本基金可投资于商品基金，因此将间接承担商品基金可能面临的商品价格波动风险、投资商品期货合约的风险、盯市风险等商品投资风险。

8、赎回资金到账时间、估值、净值披露时间较晚的风险

本基金的赎回资金到账时间在一定程度上取决于卖出或赎回持有基金所得款项的到账时间，受此影响本基金的赎回资金到账时间可能会较晚。本基金持有其他公募基金，其估值须待持有的公募基金的基金净值披露后方可进行，因此本基金的估值和净值披露时间较一般证券投资基金为晚。

9、基金合同提前终止的风险

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 万元情形的，基金合同终止，无需召开基金份额持有人大会进行表决。因此，投资者将面临基金合同提前终止的不确定性风险。

（八）其他风险

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

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

二十、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或变更注册。

2、关于基金合同变更的基金份额持有人大会决议自通过之日起生效。信息披露义务人应在决议生效后依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

（二）《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，基金合同应当终止：

1、基金份额持有人大会决定终止的；

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

3、基金合同约定的其他情形；

4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

（三）基金财产的清算

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

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

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

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

5、基金财产清算程序：

（1）基金财产清算小组成立后，由基金财产清算小组统一接管基金；

（2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；

（3）对基金财产进行估值和变现；

（4）制作清算报告；

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

（6）将清算报告报中国证监会备案并公告；

（7）对基金剩余财产进行分配。

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

（四）清算费用

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

（五）基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按各类基金份额资产净值的比例确定剩余财产在各类基金份额中的分配比例，并在各类基金份额可分配的剩余财产范围内按各类别基金份额持有人持有的该类基金份额比例进行分配。同一类别的基金份额持有人持有的每一份基金份额对基金财产清算后本类别基金份额的剩余资产具有同等的分配权。

（六）基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项应及时公告；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。基金财产清算报告报中国证监会备案后按照《信息披露办法》的规定由基金财产清算小组进行公告。

（七）基金财产清算账册及文件的保存

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

二十一、基金合同的内容摘要

（一）基金管理人、基金托管人和基金份额持有人的权利、义务

A、基金管理人的权利与义务

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

（1）依法募集资金；

（2）自基金合同生效之日起，根据法律法规和基金合同独立运用并管理基金财产；

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

（4）销售基金份额；

（5）按照规定召集基金份额持有人大会；

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

（7）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

（8）依据基金合同及有关法律规定决定基金收益的分配方案；

（9）在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购、赎回及转换申请；

（10）依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使证券持有人权利，为基金的利益行使因基金财产投资所产生的其他权利，代表基金份额持有人的利益行使因基金财产投资于证券投资基金所产生的权利，包括但不限于参加本基金持有基金的基金份额持有人大会并行使相关投票权利，代表本基金的基金份额持有人提议召开或召集本基金所持基金的基金份额持有人大会，无需召开本基金的基金份额持有人大会；

（11）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；

（12）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；

（13）选择、更换为本基金提供销售、支付结算、基金份额注册登记、估值、投资顾问、法律、会计等服务的机构并确定相关费率，对该等服务机构的相关行为进行监督和处理；

（14）在不违反法律法规的前提下，制订和调整有关基金开户、认购、申购、赎回、转换和非交易过户及其他相关业务的业务规则；

（15）法律法规或中国证监会或基金合同规定的其他权利。

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）按照法律规定要求编制季度报告、中期报告和年度报告；

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

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

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

（14）按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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

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

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

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

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

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

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

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

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

（24）基金管理人在募集期满未能达到基金的备案条件，基金合同不能生效，基金管理人应当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）法律法规或中国证监会或基金合同规定的其他义务。

B、基金托管人的权利与义务

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

（1）自基金合同生效之日起，依法律法规和基金合同的规定安全保管基金财产；

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

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

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

（5）提议召开或召集基金份额持有人大会；

（6）在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

（7）法律法规或中国证监会或基金合同约定的其他权利。

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

（1）以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

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

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

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

（5）保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

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

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

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

（9）办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

（10）对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人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，保存期限不低于法律法规规定的最低年限；

（12）从基金管理人或其委托的登记机构处接收并保存基金份额持有人名册；

（13）按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

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

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

（16）按照法律法规和基金合同的规定监督基金管理人的投资运作；

（17）参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

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

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

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

（21）执行生效的基金份额持有人大会的决议；

（22）法律法规或中国证监会或基金合同规定的其他义务。

C、基金份额持有人的权利与义务

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

同一类别的每份基金份额具有同等的合法权益。

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

（1）分享基金财产收益；

（2）参与分配清算后的剩余基金财产；

（3）依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；

（4）按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会；

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

（6）查阅或者复制公开披露的基金信息资料；

（7）监督基金管理人的投资运作；

（8）对基金管理人、基金托管人损害其合法权益的行为依法提起仲裁；

（9）法律法规或中国证监会或基金合同规定的其他权利。

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

（1）认真阅读并遵守基金合同、招募说明书、基金产品资料概要、业务规则以及基金管理人按照规定就本基金发布的相关公告；

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

（3）关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；

（4）交纳基金认购、申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用；

（5）在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；

（6）不从事任何有损基金及其他基金合同当事人合法权益的活动；

（7）执行生效的基金份额持有人大会的决议；

（8）返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；

（9）如实提供基金管理人或其销售机构依法要求提供的信息，并不时予以更新和补充；

（10）法律法规或中国证监会或基金合同规定的其他义务。

（二）基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。就本部分所述基金份额持有人大会事宜，基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的权利。

A、召开事由

1、除法律法规或中国证监会或基金合同另有规定外，当需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

（1）终止基金合同；

（2）更换基金管理人；

（3）更换基金托管人；

（4）转换基金运作方式；

（5）调整基金管理人、基金托管人的报酬标准或提高销售服务费率；

（6）变更基金类别；

（7）本基金与其他基金的合并；

（8）变更基金投资目标、范围或策略；

（9）变更基金份额持有人大会程序；

（10）对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

（11)法律法规或中国证监会或基金合同规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

2、以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

（1）法律法规要求增加的基金费用的收取；

（2）在基金合同规定的范围内，且对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，调整本基金的申购费率、调低赎回费率、调低销售服务费率或变更收费方式、调整本基金的基金份额类别的设置；

（3）因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改；

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

（5）基金管理人、登记机构、销售机构在法律法规和中国证监会规定范围内调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管、收益分配等业务的规则；

（6）对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金推出新业务或服务；

（7）按照法律法规和基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

B、会议召集人及召集方式

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

2、基金管理人未按规定召集或不能召开时，由基金托管人召集。

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

4、代表基金份额 10%以上（含 10%，以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同)的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决

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

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

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

C、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前至少 30 日，按照《信息披露办法》的规定在规定媒介公告会议通知。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

（1）会议召开的时间、地点和会议形式；

（2）会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；

（3）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；

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

（5）会务常设联系人姓名及联系电话；

（6）出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；

（7）召集人需要通知的其他事项。

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

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

D、基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式或法律法规、监管机构、基金合同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审议事项的表决意见以书面形式或基金合同约定的其他方式在收取表决意见截止时间以前送达召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式或基金合同约定的其他方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

（2）召集人按基金合同约定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式统计基金份额持有人的书面表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参与书面表决意见统计的，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应符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与基金登记机构记录相符。

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

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

E、议事内容与程序

1、议事内容及提案权

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

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

2、议事程序

（1）现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第 G 条规定程序确定和公布计票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的 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，首先由召集人在收取会议审议事项书面表决意见截止时间前至少提前 30 日公布提案，在所通知的收取表决意见截止日期后 2 个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

F、表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

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

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

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

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

G、计票

1、现场开会

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

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

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

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

2、通讯开会

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

H、生效与公告

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

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

基金份额持有人大会决议生效后应按照《信息披露办法》的规定在规定媒介上公告。

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

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

J、实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定

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

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

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

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

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

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

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

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

同一主侧袋账户内的每份基金份额具有平等的表决权。

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

（三）基金合同的变更、终止与基金财产的清算

A、基金合同的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本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或变更注册。

2、关于基金合同变更的基金份额持有人大会决议自通过之日起生效。信息披露义务人应在决议生效后依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

B、基金合同的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，基金合同应当终止：

1、基金份额持有人大会决定终止的；

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

3、基金合同约定的其他情形；

4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

C、基金财产的清算

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

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

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

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

5、基金财产清算程序：

（1）基金财产清算小组成立后，由基金财产清算小组统一接管基金；

（2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；

（3）对基金财产进行估值和变现；

（4）制作清算报告；

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

（6）将清算报告报中国证监会备案并公告；

（7）对基金剩余财产进行分配。

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

D、清算费用

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

E、基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按各类基金份额资产净值的比例确定剩余财产在各类基金份额中的分配比例，并在各类基金份额可分配的剩余财产范围内按各类别基金份额持有人持有的该类基金份额比例进行分配。同一类别的基金份额持有人持有的每一份基金份额对基金财产清算后本类别基金份额的剩余资产具有同等的分配权。

F、基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项应及时公告；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。基金财产清算报告报中国证监会备案后按照《信息披露办法》的规定由基金财产清算小组进行公告。

G、基金财产清算账册及文件的保存

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

（四）争议的处理和适用的法律

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

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

基金合同受中国法律（为本基金合同之目的，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区法律）管辖，并从其解释。

（五）基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

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

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

二十二、基金托管协议的内容摘要

（一）托管协议当事人

A、基金管理人（或简称“管理人”）

名称：嘉实基金管理有限公司

住所： 中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 1806A 单元

办公地址：北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层

法定代表人：经雷

成立时间：1999 年 3 月 25 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监基金字【1999】5 号

组织形式：有限责任公司（外商投资、非独资）

注册资本：1.5 亿元人民币

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务

存续期间：持续经营

B、基金托管人（或简称“托管人”）

名称：中国银行股份有限公司

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：葛海蛟

成立时间：1983 年 10 月 31 日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整

经营范围：吸收人民币存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；从事同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱服务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代客外汇买卖；外汇信用卡的发行和代理国外信用卡的发行及付款；资信调查、咨询、见证业务；组织或参加银团贷款；国际贵金属买卖；海外分支机构经营与当地法律许可的一切银行业务；在港澳地区的分行依据当地法令可发行或参与代理发行当地货币；经中国人民银行批准的其他业务。

存续期间：持续经营

（二）基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

A、基金托管人根据有关法律法规的规定，对基金管理人的下列投资运作进行监督：

1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。

本基金的投资范围包括经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金（以下简称“公募基金”，含公开募集基础设施证券投资基金，不含 QDII 基金、香港互认基金）、国内依法发行上市的股票（包括创业板、存托凭证以及其他依法发行上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换公司债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、现金等资产，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金不投资于分级基金、股指期货、国债期货和股票期权。

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：本基金投资于公募基金的比例不少于基金资产的 80%。基金保留的现金或者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。本基金投资于权益类资产占基金资产的比例为 60%-95%。其中，权益类资产包括股票、股票型基金和满足下述条件之一的混合型基金：

①基金合同约定股票资产投资比例应不低于基金资产的 60%；

②最近四个季度定期报告披露的股票资产投资比例均不低于基金资产的 60%。

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

2、对基金投融资比例进行监督。

（1）本基金投资于公募基金的比例不得低于基金资产的 80%；

（2）本基金投资于权益类资产占基金资产的比例为 60%-95%。其中，权益类资产包括股票、股票型基金和满足下述条件之一的混合型基金：

①基金合同约定股票资产投资比例应不低于基金资产的 60%；

②最近四个季度定期报告披露的股票资产投资比例均不低于基金资产的 60%；

（3）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；

（4）本基金持有单只基金市值不得高于基金资产净值的 20%；本基金管理人管理的且在本托管人处托管的全部基金（ETF 联接基金除外）持有单只基金不得超过被投资基金净资产的 20%，被投资基金净资产规模以最近定期报告披露的规模为准；

（5）本基金投资于其他基金，被投资基金的运作期限应当不少于 1 年、最近定期报告披露的基金净资产应当不低于 1 亿元；

（6）本基金投资于封闭运作基金、定期开放式基金等流通受限基金的比例不超过基金资产净值的 10%；

（7）本基金投资于货币市场基金的比例不超过基金资产的 15%；

（8）本基金持有一家公司发行的证券（不含本基金所投资的基金份额），其市值不超过基金资产净值的 10%；

（9）本基金管理人管理的且在本托管人处托管的全部基金持有一家公司发行的证券（不含本基金所投资的基金份额），不超过该证券的 10%；

（10）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%；

（11）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%；

（12）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%；

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

（14）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；

（15）本基金基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

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

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

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

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

（20）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；

（21）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，与国内依法发行上市的股票合并计算；

（22）法律法规或中国证监会规定的其他投资比例限制。

除上述第（3）、（4）、（14）、（19）、（20）项规定外，因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在所涉证券可交易之日起 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。法律法规另有规定的，从其规定。因证券市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述第（4）项时，基金管理人应当在 20 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

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

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

本基金投资基金管理人或基金管理人关联方管理基金的情况，不属于前述重大关联交易，但是应当按照法律法规或监管规定的要求履行信息披露义务。

4、法律法规或监管部门对基金合同所述投资比例、投资限制、组合限制、禁止行为等作出强制性调整的，本基金应当按照法律法规或监管部门的规定执行；如法律法规或监管部门修改或调整涉及本基金的投资比例、投资限制、组合限制、禁止行为等，且该等调整或修改属于非强制性的，则基金管理人与基金托管人协商一致后，可按照法律法规或监管部门调整或修改后的规定执行。

B、基金托管人应根据有关法律法规的规定、《基金合同》和本协议的约定，对基金资产净值计算、各类基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露材料中登载基金业绩表现数据等进行复核。

C、基金托管人在上述第 A、B 款的监督和核查中发现基金管理人违反法律法规的规定及本协议的约定，应及时提示基金管理人，基金管理人收到提示后应及时核对确认并改正。在限期内，基金托管人有权随时对提示事项进行复查。基金管理人对基金托管人提示的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应及时向中国证监会报告。

D、基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律法规及本协议的规定，应当拒绝执行，及时提示基金管理人，并依照法律法规的规定及时向中国证监会报告。基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律法规和其他有关规定，或者违反本协议约定的，应当及时提示基金管理人，并依照法律法规的规定及时向中国证监会报告。

E、基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查，包括但不限于：在规定时间内答复基金托管人并改正，就基金托管人的疑义进行解释或举证，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。

F、如启用侧袋机制，在侧袋机制实施期间，本部分约定的投资组合比例、组合限制等约定仅适用于主袋账户。

（三）基金管理人对基金托管人的业务核查

A、在本协议的有效期内，在不违反公平、合理原则以及不妨碍基金托管人遵守相关法律法规及其行业监管要求的基础上，基金管理人有权对基金托管人履行本协议的情况进行必要的核查，核查事项包括但不限于基金托管人安全保管基金财产、开设或注销基金财产的资金账户和证券账户及投资所需其他账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和各类基金份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

B、基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、无正当理由未执行或延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反法律法规、《基金合同》及本协议有关规定时，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正，基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金管理人发出回函。在限期内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应依照法律法规的规定报告中国证监会。

C、基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复基金管理人并改正。对基金管理人按照法规要求需向中国证监会提交基金监督报告的，基金托管人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

（四）基金财产的保管

A、基金财产保管的原则

1、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。

2、基金托管人应安全保管基金财产，未经基金管理人的合法合规指令或法律法规、《基金合同》及本协议另有规定，不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。

3、基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户、证券账户及投资所需其他账户。

4、基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，独立核算，分账管理，确保基金财产的完整与独立。

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

B、《基金合同》生效前募集资金的验资和入账

基金募集期满或基金管理人宣布停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定的，由基金管理人在法定期限内聘请符合《证券法》规定的会计师事务所对基金进行验资，并出具验资报告。出具的验资报告应由参加验资的 2 名以上（含 2 名）中国注册会计师签字方为有效。

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

C、基金的银行账户的开设和管理

1、基金托管人应负责本基金的银行账户的开设和管理。

2、基金托管人以本基金的名义开设本基金的银行账户。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。本基金的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益、收取申购款，均需通过本基金的银行账户进行。

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

4、基金银行账户的管理应符合法律法规的有关规定。

D、基金进行定期存款投资的账户开设和管理

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

E、基金证券账户、结算备付金账户的开设和管理

1、基金托管人应当代表本基金，以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司开设证券账户。

2、本基金证券账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借或转让本基金的证券账户，亦不得使用本基金的证券账户进行本基金业务以外的活动。

3、基金托管人以自身法人名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户，用于办理基金托管人所托管的包括本基金在内的全部基金在证券交易所进行证券投资所涉及的资金结算业务。结算备付金的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

4、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。

F、其他账户的开设和管理

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

G、债券托管专户的开设和管理

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

H、基金财产投资的有关有价凭证的保管

基金财产投资的实物证券、银行定期存款存单等有价凭证由基金托管人负责妥善保管。基金托管人对其以外机构实际有效控制的有价凭证不承担责任。

I、与基金财产有关的重大合同及有关凭证的保管

基金托管人按照法律法规保管由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同及有关凭证。基金管理人代表基金签署有关重大合同后应在收到合同正本后 30 日内将一份正本的原件提交给基金托管人。除本协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时应保证基金一方持有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。重大合同由基金管理人与基金托管人按规定各自保管，期限不少于法律法规规定的最低年限。

对于无法取得两份以上的正本的，基金管理人应向基金托管人提供加盖公章的合同复印件，未经双方协商或未在合同约定范围内，合同原件不得转移。

（五）基金资产净值计算和会计核算

A、基金资产净值的计算和复核

1、基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。某一类别基金份额净值是指估值日该类别基金资产净值除以估值日该类别基金份额总数后的价值，精确到 0.0001 元，小数点后第五位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

2、基金管理人应每个估值日的后 1 个工作日对基金财产估值。但基金管理人根据法律法规或基金合同的规定暂停估值时除外。估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算业务指引》及其他法律法规的规定。用于基金信息披露的基金资产净值和各类基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个估值日后 1 个工作日结束后计算得出当日的各类基金份额净值，并在盖章后以双方约定的方式发送给基金托管人。基金托管人应对净值计算结果进行复核，并以双方约定的方式将复核结果传送给基金管理人，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

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

4、基金管理人、基金托管人发现基金估值违反《基金合同》订明的估值方法、程序以及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，双方应及时进行协商和纠正。

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

6、除基金合同和本协议另有约定外，由于基金管理人对外公布的任何基金净值数据错误，导致该基金财产或基金份额持有人的直接损失，相关责任方应依据基金合同及本协议的约定承担责任。若基金托管人计算的净值数据正确，则基金托管人对该损失不承担责任；若基金管理人对外公布的基金净值信息经基金托管人复核同意的，则基金托管人也应承担部分未正确履行复核义务的责任，基金托管人不承担基金管理人未接受基金托管人的复核意见进行信息披露产生的责任。如果上述错误造成了基金财产或基金份额持有人的不当得利，且基金管理人及基金托管人已各自承担了赔偿责任，则基金管理人应负责向不当得利之主体主张返还不当得利，基金托管人应提供必要的协助。如果返还金额不足以弥补基金管理人和基金托管人已承担的赔偿金额，则双方按照各自赔偿金额的比例对返还金额进行分配。

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

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

B、基金会计核算

1、基金账册的建立

基金管理人和基金托管人在《基金合同》生效后，应按照双方约定的同一记账方法和会计处理原则，分别独立地设置、登记和保管基金的全套账册，对双方各自的账册定期进行核对，互相监督，以保证基金财产的安全。若双方对会计处理方法存在分歧，应以基金管理人的处理方法为准。

2、会计数据和财务指标的核对

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

3、基金财务报表和定期报告的编制和复核

基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。月度报表的编制，应于每月终了后 5 个工作日内完成；在《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。

基金管理人应当在季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，将季度报告登载在规定网站上，并将季度报告提示性公告登载在规定报刊上；基金管理人应当在上半年结束之日起两个月内，编制完成基金中期报告，将中期报告登载在规定网站上，并将中期报告提示性公告登载在规定报刊上；基金管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载在规定网站上，并将年度报告提示性公告登载在规定报刊上。《基金合同》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。

基金管理人应及时完成报表编制，将有关报表提供给基金托管人复核，基金托管人在收到后应及时进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人；基金管理人应留足充分的时间，便于基金托管人复核相关报表及报告。

基金托管人在复核过程中，发现双方的报表存在不符时，基金管理人和基金托管人应共同查明原因，进行调整，调整以双方认可的账务处理方式为准；若双方无法达成一致以基金管理人的账务处理为准。核对无误后，基金托管人在基金管理人提供的报告上加盖托管业务部门公章或者出具加盖托管业务部门公章的复核意见书，双方各自留存一份。如果基金管理人与基金托管人不能于应当发布公告之日之前就相关报表达成一致，基金管理人有权按照其编制的报表对外发布公告，基金托管人有权就相关情况报证监会备案。

（六）基金份额持有人名册的保管

基金份额持有人名册至少应包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。基金份额持有人名册由基金登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，基金管理人和基金托管人应分别保管基金份额持有人名册，基金登记机构保存期限不少于法定最低期限。如不能妥善保管，则按相关法律法规承担责任。

在基金托管人要求或编制中期报告和年度报告前，基金管理人应将有关资料送交基金托管人，不得无故拒绝或延误提供，并保证其的真实性、准确性和完整性。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。

（七）适用法律与争议解决方式

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

B、基金管理人与基金托管人之间因本协议产生的或与本协议有关的争议可通过友好协商、调解解决。但若争议未能以协商、调解方式解决的，任何一方有权将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会，并按届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。仲裁费用由败诉方承担，除非仲裁裁决另有决定。

C、除争议所涉的内容之外，本协议的当事人仍应履行本协议的其他规定。

（八）托管协议的变更、终止与基金财产的清算

A、托管协议的变更

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

B、托管协议的终止

发生以下情况，经履行适当程序后，本托管协议应当终止：

1、《基金合同》终止；

2、本基金更换基金托管人；

3、本基金更换基金管理人；

4、发生《基金法》、《运作办法》或其他法律法规规定、中国证监会规定或《基金合同》约定的终止事项。

C、基金财产的清算

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

二十三、对基金份额持有人的服务

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

（一）资料寄送/发送

1、开户确认书和交易对账单

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

2、基金份额持有人对账单

每月向定制电子对帐单服务的份额持有人发送电子对帐单。

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

（二）定期定额投资计划

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

（三）在线服务

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

1、查询服务

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

2、信息资讯服务

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

3、网上交易

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

（四）咨询服务

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

2、网站和电子信箱

公司网址：http://www.jsfund.cn

电子信箱：service@jsfund.cn

二十四、其他应披露事项

以下信息披露事项已通过规定媒介（含基金管理人网站）公开披露。

序号	临时报告名称	披露时间
1	关于嘉实领航聚优积极配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金资产净值连续低于 5000 万元的提示性公告	2025 年 11 月 26 日
2	关于嘉实领航聚优积极配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金资产净值连续低于 5000 万元的提示性公告	2025 年 12 月 10 日
3	关于嘉实领航聚优积极配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金资产净值连续低于 5000 万元的提示性公告	2025 年 12 月 17 日
4	关于新增嘉实领航聚优积极配置 6 个月持有期混合（FOF）基金经理的公告	2026 年 3 月 12 日
5	关于嘉实领航聚优积极配置 6 个月持有期混合（FOF）基金经理变更的公告	2026 年 4 月 9 日
6	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	2026 年 6 月 26 日
7	嘉实基金管理有限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	2026 年 6 月 26 日
8	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	2026 年 7 月 9 日
9	关于嘉实领航聚优积极配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金资产净值连续低于 5000 万元的提示性公告	2026 年 7 月 11 日
10	关于嘉实领航聚优积极配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金资产净值连续低于 5000 万元的提示性公告	2026 年 7 月 24 日
11	关于嘉实领航聚优积极配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金资产净值连续低于 5000 万元的提示性公告	2026 年 7 月 31 日

二十五、招募说明书存放及查阅方式

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

二十六、备查文件

（一）备查文件目录

1、中国证监会准予嘉实领航聚优积极配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）注册的批复文件。

2、《嘉实领航聚优积极配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》。

3、《嘉实领航聚优积极配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）托管协议》。

4、法律意见书。

5、基金管理人业务资格批件、营业执照。

6、基金托管人业务资格批件、营业执照。

（二）存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人处。

（三）查阅方式

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

嘉实基金管理有限公司

2026 年 10 月 12 日