上海国泰海通证券资产管理有限公司

国泰海通君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)
招募说明书（更新）
（2026 年第 2 号）

基金管理人：上海国泰海通证券资产管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

重要提示

国泰海通君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)（以下简称“本基金”或“基金”）由国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)变更而来。国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)由国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)集合资产管理计划变更而来。国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)集合资产管理计划由国泰君安君得益二号优选基金集合资产管理计划变更而来。本基金为契约型开放式。

国泰君安君得益二号优选基金集合资产管理计划为非限定性集合资产管理计划，于 2011 年 3 月 30 日经中国证监会证监许可〔2011〕466 号文核准设立，自 2011 年 4 月 25 日起开始募集并于 2011 年 5 月 31 日结束募集，于 2011 年 6 月 7 日成立。

根据《基金法》、《运作办法》、《证券公司大集合资产管理业务适用<关于规范金融机构资产管理业务的指导意见>操作指引》等法律法规的规定，国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)集合资产管理计划变更为国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)，并相应修改《国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)集合资产管理计划资产管理合同》等法律文件。2021 年 11 月 5 日，国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)经中国证监会《关于准予国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)集合资产管理计划变更注册的批复》（证监许可[2021]3519 号文）注册。

2025 年 7 月 25 日，上海国泰君安证券资产管理有限公司变更名称为上海国泰海通证券资产管理有限公司。2025 年 9 月 29 日，国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)变更为国泰海通君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)，《国泰海通君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)基金合同》自基金管理人公告的生效之日起生效，原《国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)基金合同》同日起失效。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。中国证监会对国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF) 的注册，并不表明其对本基金的投资价值和市场前景做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风

险。

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本基金资产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。

投资有风险，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、基金产品资料概要等信息披露文件，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，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。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资人连续大量赎回基金份额产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特定风险等。本基金为混合型基金中基金，其预期收益和预期风险水平高于货币市场基金、货币型基金中基金、债券型基金和债券型基金中基金，低于股票型基金和股票型基金中基金。

本基金可投资于资产支持证券，资产支持证券具有一定的价格波动风险、流动性风险、信用风险等风险。价格波动风险指的是市场利率波动会导致资产支持证券的收益率和价格波动。流动性风险指的是受资产支持证券市场规模及交易活跃程度的影响，资产支持证券可能无法在同一价格水平上进行较大数量的买入或卖出，存在一定的流动性风险。信用风险指的基金所投资的资产支持证券之债务人出现违约，或在交易过程中发生交收违约，或由于资产支持证券信用质量降低导致证券价格下降，造成基金财产损失。

本基金可投资公募 REITs，将面临投资公募 REITs 的特有风险。

本基金的特定风险详见招募说明书“风险揭示”章节。

本基金的过往业绩并不预示其未来表现，基金管理人管理的其他产品的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资者投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

本基金本次更新招募说明书主要对基金经理变更及基金管理人的基本信息

相关内容进行更新，更新截止日为 2026 年 10 月 28 日，除非另有说明，本招募说明书其他所载内容截止日为 2026 年 2 月 27 日，有关财务和业绩表现数据截止日为 2025 年 12 月 31 日，财务和业绩表现数据未经审计。

目　　录

第一部分　绪言.....4
第二部分　释义.....5
第三部分　基金管理人.....11
第四部分　基金托管人.....22
第五部分　相关服务机构.....26
第六部分　基金的历史沿革.....28
第七部分　基金的存续.....29
第八部分　基金份额的申购与赎回.....30
第九部分　基金的投资.....41
第十部分 基金的业绩.....51
第十一部分　基金的财产.....54
第十二部分　基金资产估值.....55
第十三部分　基金的收益与分配.....62
第十四部分　基金费用与税收.....64
第十五部分　基金的会计与审计.....67
第十六部分　基金的信息披露.....68
第十七部分　侧袋机制.....75
第十八部分 风险揭示.....78
第十九部分　基金合同的变更、终止与基金财产的清算.....88
第二十部分　基金合同的内容摘要.....90
第二十一部分　基金托管协议的内容摘要.....107
第二十二部分　对基金份额持有人的服务.....126
第二十三部分 其他应披露事项.....128
第二十四部分　招募说明书的存放及查阅方式.....132
第二十五部分　备查文件.....133

第一部分　绪言

《国泰海通君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)招募说明书》（以下简称“招募说明书”或“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》、《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》”）及其他有关规定以及《国泰海通君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)基金合同》（以下简称“基金合同”或“《基金合同》”）编写。

本招募说明书阐述了国泰海通君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)的投资目标、策略、风险、费率等与投资人投资决策有关的全部必要事项，投资者在做出投资决策前应仔细阅读招募说明书。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，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销售的。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。

本招募说明书依据基金合同编写，并经中国证监会批准。基金合同是约定基金合同当事人之间权利义务的法律文件。投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、基金合同及其它有关规定享有权利，承担义务。

投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

第二部分　释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

1、基金或本基金：指国泰海通君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)

2、基金管理人：指上海国泰海通证券资产管理有限公司

3、基金托管人：指交通银行股份有限公司

4、基金合同、《基金合同》：指《国泰海通君得益三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《国泰海通君得益三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《国泰海通君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)招募说明书》及其更新

7、基金产品资料概要：指《国泰海通君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)基金产品资料概要》及其更新

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

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

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

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

出的修订

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

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

14、《基金中基金指引》：指中国证监会 2016 年 9 月 11 日颁布并实施的《公开募集证券投资基金运作指引第 2 号——基金中基金指引》及颁布机关对其不时做出的修订

15、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

16、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行保险监督管理委员会

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

18、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

19、机构投资者：指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织

20、合格境外机构投资者：指符合相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者

21、人民币合格境外机构投资者：指按照《合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者境内证券期货投资管理办法》及相关法律法规规定，运用来自境外的人民币资金进行境内证券投资的境外法人

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

23、基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人

24、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，办理基金份额

的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务

25、销售机构：指上海国泰海通证券资产管理有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务协议，办理基金销售业务的机构

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

27、登记机构：指办理登记业务的机构。本基金的登记机构为中国证券登记结算有限责任公司

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申购、赎回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《国泰海通君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)基金合同》的生效日，原《国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)基金合同》同日起失效

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、存续期：指《国泰君安君得益二号优选基金集合资产管理计划管理合同》生效至基金合同终止之间的不定期期限

33、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

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

35、T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日（不包含 T 日）

36、开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

37、开放时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

38、《业务规则》：指中国证券登记结算有限责任公司相关业务规则及其不时做出的修订，是规范基金管理人所管理的并由中国证券登记结算有限责任公司办理登记业务的登记方面的业务规则

39、最短持有期：指本基金对每份份额设置 3 个月的最短持有期。在最短持有期到期日之前（不含当日），投资者不能提出赎回申请；最短持有期期满后（含最短持有期到期日当日）投资者可以申请赎回

40、最短持有期起始日：指每份份额的参与确认日（对于持有国泰君安君得益二号优选基金份额至《国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)集合资产管理计划资产管理合同》生效日的份额而言）或每份基金份额的申购确认日（对申购份额而言，亦对于自原《国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)集合资产管理计划资产管理合同》生效后申购的基金份额）

41、最短持有期到期日：指最短持有期起始日起 3 个月后的对应日，如无对应日或该对应日为非工作日，则顺延至下一工作日

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

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

44、基金转换：指基金份额持有人按照基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有基金管理人管理的、某一的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金份额的行为

45、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

46、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

47、巨额赎回：指本基金单个开放日，基金净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一开放日基金总份额的 10%

48、元：指人民币元

49、基金收益：指基金投资所得证券投资基金分红收入、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

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

51、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

52、基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

53、基金资产估值：指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程

54、基金份额类别：指本基金根据申购费、销售服务费收取方式等不同，将基金份额分为不同的类别

55、A 类份额：指在投资者申购时收取申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的份额类别

56、C 类份额：指在投资者申购时不收取申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的份额类别

57、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

58、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

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

60、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

61、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

62、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

第三部分　基金管理人

一、基金管理人概况

公司名称：上海国泰海通证券资产管理有限公司（简称：本公司或公司）

注册地址：上海市黄浦区中山南路 888 号 8 层

办公地址：上海市黄浦区中山南路 888 号 B 栋 2-6 层及 8 层

设立日期：2010 年 8 月 27 日

法定代表人：陶耿

联系电话：021-38676999

联系人：李燕

注册资本：20 亿元人民币

批准设立机关及文号：中国证券监督管理委员会；证监许可【2010】631 号

存续期限：持续经营

股权结构：国泰海通证券股份有限公司，持有股份 100%。

二、主要人员情况

1、董事会成员

陶耿，男，博士，高级经济师，中共党员。历任中国银行、中国人民银行科员，中国证监会上海监管局机构处主任科员、机构监管二处副处长、基金监管处处长、办公室主任，光大保德信基金管理有限公司总经理，本公司董事长、总裁兼财务负责人。现任本公司董事长。

黄韦，男，硕士。历任君安证券有限公司信息技术中心主任助理，国泰君安证券股份有限公司信息技术部总经理。现任国泰海通证券股份有限公司技术研发部总经理，国泰君安证裕投资有限公司董事，国泰君安创新投资有限公司董事，本公司董事。

邹华，男，硕士研究生。历任上海梅林正广和（集团）有限公司及其附属公司财务部职员、财务科科长、财务部副经理；上海证监局副主任科员、主任科员、副处长、处长；上海国际集团有限公司投资管理一部副总经理；国泰君安投资管理股份有限公司总裁助理；原国泰君安证券投行事业部党委委员、纪委书记，执

行委员会委员兼综合执行组行政负责人、合规管理组行政负责人；原国泰君安证券法律合规部总经理。现任国泰海通证券股份有限公司法律合规部总经理，国泰君安证裕投资有限公司董事，国泰君安创新投资有限公司董事，本公司董事。

叶明，男，大学本科，中共党员。1995 年 7 月入职原国泰证券，1999 年 7 月加入国泰君安证券，先后担任计划财务部副经理、资金清算总部总经理助理、营运中心副总经理；2010 年 8 月起加入本公司，历任营运总监兼任营运部总经理；自 2013 年 7 月起担任本公司副总裁，先后兼任首席风险官、董事会秘书、代履职合规总监职责、合规总监、财务负责人、首席营运官、首席信息官（代为履职），并自 2025 年 4 月兼任上海海通证券资产管理有限公司副总经理（主持工作）。现任本公司总裁、财务负责人、首席市场官，本公司董事。

敖奇顺，男，硕士。历任普华永道会计师事务所审计部职员，平安资产管理有限公司职员，国泰君安证券股份有限公司计划财务部信息披露及投资者关系管理主管，国泰君安金融控股有限公司财务负责人，国泰君安国际控股有限公司财务总监，国泰君安咨询服务（深圳）有限公司执行董事、总经理，国泰君安证券股份有限公司资产负债部副总经理。现任国泰海通证券股份有限公司计划财务部副总经理（主持工作），海通恒信国际融资租赁股份有限公司董事，国泰海通开元投资有限公司董事，本公司董事。

陈稹，男，博士。历任中国人民大学劳动人事学院教师、副院长兼副书记，中国证监会人事教育部干部、处长，中国证监会山西监管局党委委员、副局长，中国证监会北京监管局党委委员、副局长，中国证监会中证金融研究院党委书记、常务副院长。现任中国人民大学国家发展与战略研究院高级研究员，国新证券股份有限公司独立董事，本公司独立董事。

Connie Lili Gu Howe（顾黎莉），女，学士，特许会计研究生。历任上海万国证券公司总裁办公室助理，普华永道会计师事务所上海、纽约、墨尔本审计金融服务部审计师、经理、高级经理，美国友邦保险公司上海分公司财务负责人，澳大利亚养老金投资者委员会财务总监、首席营运官及董事会秘书。现任峰石国际董事会咨询公司专家顾问，本公司独立董事。

钱军，男，博士。历任美国波士顿学院卡罗尔管理学院金融系终身教授，美国麻省理工学院斯隆管理学院金融学访问副教授，清华大学经济管理学院金融系

特聘教授，上海交通大学上海高级金融学院金融学特聘教授、教授、博士生导师、EMBA 项目联席主任、EMBA/DBA/EE 项目联席主任，上海交通大学中国金融研究院副院长，国际学术杂志 Review of Finance 副主编，中信银行股份有限公司独立非执行董事。现任复旦大学国际金融学院金融学教授、执行院长，中国资本市场学会首届学术委员会副主任委员，《国际经济研究》杂志编委，清华大学全球证券市场研究院学术委员会委员，上海证券交易所资本市场研究院学术委员会委员，《欧洲金融学杂志》顾问委员会委员，重庆蚂蚁消费金融有限公司独立董事，本公司独立董事。

孙佳宁，男，硕士，中共党员。历任国泰君安证券股份有限公司证券及衍生品投资总部投资经理（策略投资）、证券及衍生品投资总部交易经理、证券衍生品投资部高级交易经理，上海国泰君安证券资产管理有限公司量化投资部副总经理（主持工作）、总经理，权益与衍生品部总监、总经理，量化投资部总经理、权益研究部总经理。现任本公司总裁助理、首席研究官，本公司职工董事。

2、高级管理人员

陶耿，男，博士，高级经济师，中共党员。历任中国银行、中国人民银行科员，中国证监会上海监管局机构处主任科员、机构监管二处副处长、基金监管处处长、办公室主任，光大保德信基金管理有限公司总经理，本公司董事长、总裁兼财务负责人。现任本公司董事长。

叶明，男，1976 年 8 月出生，大学本科，中共党员。1995 年 7 月入职原国泰证券，1999 年 7 月加入国泰君安证券，先后担任计划财务部副经理、资金清算总部总经理助理、营运中心副总经理；2010 年 8 月起加入本公司，历任营运总监兼任营运部总经理；自 2013 年 7 月起担任本公司副总裁，先后兼任首席风险官、董事会秘书、代履职合规总监职责、合规总监、财务负责人、首席营运官（COO）、首席信息官（代为履职），并自 2025 年 4 月兼任上海海通证券资产管理有限公司副总经理（主持工作）。现任本公司总裁、财务负责人、首席市场官。

左秀海，男，1982 年 2 月出生，硕士研究生，中共党员。2008 年 5 月入职华宝证券有限责任公司担任 CRM 分析员；2010 年 6 月入职海通证券股份有限公司，先后担任销售交易总部交易管理部经理，零售与网络金融部交易管理部经理，财富管理中心交易管理部经理、财富管理中心总经理助理、副总经理；2021 年 5

月入职上海海通证券资产管理有限公司，历任投资总监兼组合投资部总监、公司副总经理；2025 年 12 月加入本公司，现任本公司副总裁。

丁杰能，男，1981 年 3 月出生，硕士研究生，中共党员。2006 年 4 月入职国泰君安证券，历任固定收益证券总部投资经理助理(自营)、固定收益证券总部董事(自营)、固定收益证券部执行董事(自营)、固定收益证券部利率投资经理、固定收益证券部自营投资业务主管 MD、固定收益证券部 FI 自营主管、投资业务部总经理；2021 年 3 月起加入本公司，历任固定收益投资部总经理、固定收益研究部总经理及 AI 投资部总经理，现任本公司副总裁、首席投资官（CIO）。

李艳，女，1974 年 2 月出生，硕士研究生，FRM，中共党员。2001 年 3 月入职上海证券有限责任公司，历任证券投资总部高级经理、创新产品总部高级经理、研究所金融工程部负责人、基金评价研究中心副总经理、创新发展总部总经理兼基金评价研究中心总经理，2015 年 9 月起加入本公司担任战略发展部（原综合管理部）总经理，现任本公司董事会秘书。

陈颖，女，1974 年 11 月出生，大学本科，民主党派。历任华安基金管理有限公司信息技术部总助、海通证券股份有限公司客户资产管理部高级经理；2012 年 6 月入职上海海通证券资产管理有限公司，先后任职运营保障部副总监、产品运营部总监、公司首席信息官、首席风险官等职务；2026 年 3 月加入本公司，现任本公司首席信息官。

吕巍，男，1976 年 9 月出生，硕士研究生。2002 年 7 月入职中国银行深圳分行法律合规部担任法律顾问；2005 年 8 月入职中国证监会深圳证监局担任主任科员；2012 年 1 月入职中信证券股份有限公司担任合规部主管；2016 年 8 月起加入本公司担任法务监察部总经理；现任本公司合规总监、督察长、首席风险官。

孙佳宁，男，1981 年 8 月出生，硕士研究生，中共党员。2006 年 7 月入职国泰君安证券，历任证券及衍生品投资总部投资经理(策略投资)、证券及衍生品投资总部交易经理、证券衍生品投资部高级交易经理；2014 年 7 月起加入本公司，历任量化投资部副总经理（主持工作）、总经理，权益与衍生品部总监、总经理，量化投资部总经理、权益研究部总经理，现任本公司总裁助理、首席研究官（CRO）。

徐刚，男，1985 年 8 月出生，博士研究生，中共党员。2011 年 7 月入职中海信托股份有限公司风险管理总部；2013 年 2 月起加入本公司，历任金融市场部投资经理，结构融资部高级投资经理，资产证券化部总经理助理（主持工作）、总经理，结构金融部总经理、不动产投资部总经理，现任本公司总裁助理、首席投资官（CIO）。

3、本基金的基金经理

（1）现任基金经理

高琛，华东理工大学工商管理硕士。曾任上海证券基金评价分析师、金融实验室负责人，国泰君安资产管理业务委员会执行办董事。2019 年 4 月加入上海国泰君安证券资产管理有限公司，现担任基金投资部（公募）基金经理。自 2020 年 11 月 16 日起至 2022 年 3 月 20 日止，担任“国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)集合资产管理计划”投资经理，自 2021 年 12 月 28 日起担任“国泰海通善融稳健一年持有期混合型基金中基金(FOF)”基金经理，自 2022 年 3 月 21 日起担任“国泰海通君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)”基金经理，自 2023 年 12 月 8 日起担任“国泰海通善怡稳健六个月持有期债券型发起式基金中基金(FOF)”基金经理。

郭圳滨，中山大学概率论与数理统计专业，硕士研究生，历任广发证券股份有限公司发展研究中心金融工程分析师，申万宏源证券有限公司财富管理部资产配置经理。2022 年 11 月加入本公司，历任基金投资部研究员，现任基金投资部（公募）基金经理。自 2025 年 6 月 17 日起担任“国泰海通善融稳健一年持有期混合型基金中基金(FOF)”基金经理，自 2025 年 6 月 17 日起担任“国泰海通君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)”基金经理，自 2025 年 6 月 17 日起担任“国泰海通善怡稳健六个月持有期债券型发起式基金中基金(FOF)”基金经理，自 2026 年 3 月 17 日起担任“国泰海通善选稳健配置三个月持有期混合型基金中基金(FOF)”基金经理，自 2026 年 5 月 28 日起担任“国泰海通善享多元配置三个月持有期混合型基金中基金(ETF-FOF)”基金经理，自 2026 年 9 月 1 日起担任“国泰海通善诚多元配置三个月持有期混合型基金中基金(ETF-FOF)”基金经理。

张金洪，上海财经大学数量经济学专业硕士研究生。历任华宝证券有限责任

公司宏观分析师；上海汇利资产管理有限公司策略分析师；平安资产管理有限责任公司市场策略研究经理；中国平安财产保险股份有限公司资产管理部研究主管、首席策略师；光大兴陇信托有限责任公司上海区域总部证券业务部 FOF 投资负责人、投资经理；上海海通证券资产管理有限公司组合投资部投资经理；2025 年 11 月加入上海国泰海通证券资产管理有限公司，历任基金投资部投资经理。自 2026 年 10 月 28 日起担任“国泰海通君得益三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

基金经理姓名	管理时间
李少君	2020 年 12 月 7 日-2022 年 10 月 17 日
丁一戈	2022 年 12 月 21 日-2024 年 8 月 1 日

4、投资决策委员会成员

陶耿，投资决策委员会主任委员，现任本公司董事长。

左秀海，投资决策委员会副主任委员，现任本公司副总裁。

丁杰能，投资决策委员会副主任委员，现任本公司副总裁、首席投资官（CIO）。

孙佳宁，投资决策委员会副主任委员，现任本公司总裁助理、首席研究官（CRO）。

吕莉萍，投资决策委员会委员，现任本公司固定收益投资部（北京）总经理。

丁颖，投资决策委员会委员，现任本公司综合策略投资部总经理。

苏旺兴，投资决策委员会委员，现任本公司权益研究部总经理。

杨先锋，投资决策委员会委员，现任本公司风险管理部副总经理。

胡崇海，投资决策委员会委员，现任本公司量化投资部总经理。

薛磊荣，投资决策委员会委员，现任本公司多资产策略投资部总经理。

杨钤雯，投资决策委员会委员，现任本公司基金投资部总经理。

5、上述人员之间不存在近亲属关系。

三、基金管理人的职责

1、依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的申购、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申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回的价格；

9、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

10、编制季度报告、中期报告和年度报告；

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

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

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

14、按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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

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

17、确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保

证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件；

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

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

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

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

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

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

24、执行生效的基金份额持有人大会的决议；

25、建立并保存基金份额持有人名册；

26、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

四、基金管理人承诺

1、基金管理人将根据基金合同的规定，按照招募说明书列明的投资目标、理念、策略及限制等全权处理本基金的投资。

2、基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《基金法》、《信息披露办法》、《运作办法》、《销售办法》及有关法律法规，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止以下行为发生：

（1）将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；

（2）不公平地对待基金管理人管理的不同证券投资基金财产；

（3）利用基金财产或者职务之便为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；

（4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；

（5）侵占、挪用基金财产；

（6）泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

（7）玩忽职守，不按照规定履行职责；

（8）法律法规或中国证监会禁止的其他行为。

3、基金经理承诺

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

（2）不能利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者谋取利益；

（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，不泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息，或利用该信息从事或明示、暗示他人从事相关的交易活动；

（4）不协助、接受委托或以其它任何形式为其它组织或个人进行证券交易；

（5）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

为保障公司及其所开展的资产管理业务规范运作，有效防范、规避和化解各类风险，最大限度地保护利益相关者及公司的合法权益，基金管理人建立了科学合理、控制严密、运行高效的内部控制制度。

内部控制制度是对公司章程规定的内控原则的细化和展开，是公司各项基本管理制度的纲要和总揽，贯穿公司运营的所有环节，其内容包括公司内控目标、内控原则、控制环境、内控措施等。

2、内部控制目标

（1）确保公司经营运作严格遵守国家有关法律、法规和行业监管规则，自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念。

（2）防范和化解经营风险，提高经营管理效益，实现公司资产管理业务的持续、稳定、健康发展。

（3）建立行之有效的风险控制系统，保障公司资产及客户资产的安全完整，维护公司股东的合法权益，并最大限度地保护投资人的合法权益。

（4）确保公司业务记录、财务信息和其它信息真实、准确、完整、及时。

（5）保证公司内部规章制度的贯彻执行，提高公司经营效益。

3、内部控制原则

（1）健全性原则。内部控制机制应当做到事前、事中、事后控制相统一；覆盖公司各个部门和各级岗位，渗透到决策、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，建立合理的内部控制程序，维护内控制度的有效执行。

（3）独立性原则。公司各部门和岗位职责应当保持相对独立，公司对受托资产、自有资产、其他资产的管理运作必须分离；公司设立法律合规部及风险管理部，承担内部控制监督检查职能，对各部门、岗位进行流程监控和风险管理。

（4）相互制约原则。内部部门和岗位的设置必须权责分明、相互制衡；前台业务运作与后台管理支持适当分离。

（5）成本效益原则。公司内部控制与公司业务范围、经营规模、风险状况相适应，运用科学化的经营管理方法，以合理的成本实现内部控制目标。

4、控制环境

内部控制环境主要包括公司经营理念与风险意识、治理结构、组织架构与决策程序、内部控制体系、员工的诚信和道德价值观、人力资源政策等。

5、内控措施

公司建立科学严密的风险控制评估体系，通过定期与不定期风险评估，对公司内外部风险进行识别、评估和分析，发现风险来源和类型，针对不同的风险由相关部门提出相应的风险控制方案，及时防范和化解风险。

控制活动主要包括：授权控制、内幕交易控制、关联交易控制和法律风险控制等。内部控制的主要内容包括：市场开发业务控制、投资管理业务控制、信息披露控制、信息技术系统控制、会计系统控制和人力资源控制等。

6、基金管理人关于内部控制的声明

（1）基金管理人确知建立、实施和维持内部控制制度是基金管理人的责任；

（2）上述关于内部控制的披露真实、准确；

（3）基金管理人承诺将根据市场环境的变化及基金管理人业务的发展不断完善内部控制制度。

第四部分　基金托管人

一、基金托管人基本情况

（一）基金托管人概况

公司法定中文名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）

公司法定英文名称：Bank of Communications Co., Ltd.

法定代表人：任德奇

住　　所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号

办公地址：上海市长宁区仙霞路 18 号

邮政编码：200336

注册时间：1987 年 3 月 30 日

注册资本：742.63 亿元

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]25 号

联系人：方圆

电　话：95559

交通银行始建于 1908 年，是中国历史最悠久的银行之一，也是近代中国的发钞行之一。1987 年重新组建后的交通银行正式对外营业，成为中国第一家全国性的国有股份制商业银行，总部设在上海。2005 年 6 月交通银行在香港联合交易所挂牌上市，2007 年 5 月在上海证券交易所挂牌上市。交通银行连续 17 年跻身《财富》(FORTUNE)世界 500 强，营业收入排名第 168 位；列《银行家》(The Banker)杂志全球千家大银行一级资本排名第 9 位。

截至 2025 年 9 月 30 日，交通银行资产总额为人民币 15.50 万亿元。2025 年前三季度，交通银行实现净利润（归属于母公司股东）人民币 699.94 亿元。

交通银行总行设资产托管部/资产托管业务发展中心（下文简称“托管部/托管发展中心”）。现有员工具有多年基金、证券和银行的从业经验，具备基金从业资格，以及经济师、会计师、工程师和律师等中高级专业技术职称，员工的学历层次较高，专业分布合理，职业技能优良，职业道德素质过硬，是一支诚实勤勉、积极进取、开拓创新、奋发向上的资产托管从业人员队伍。

（二）主要人员情况

任德奇先生，董事长、执行董事，高级经济师。

任先生 2020 年 1 月起任交通银行股份有限公司董事长，2018 年 8 月起任交通银行股份有限公司执行董事。曾任交通银行股份有限公司副董事长、执行董事、行长。曾任中国银行执行董事、副行长，期间曾兼任中银香港（控股）有限公司非执行董事，中国银行上海人民币交易业务总部总裁。曾任中国建设银行信贷审批部副总经理、风险监控部总经理、授信管理部总经理、湖北省分行行长、风险管理部总经理。任先生 1988 年于清华大学获工学硕士学位。

张宝江先生，副董事长、执行董事、行长，高级经济师。

张先生 2024 年 8 月起任交通银行股份有限公司副董事长、执行董事，2024 年 6 月起任交通银行股份有限公司行长；曾任中国农业发展银行副行长，安徽省分行行长，总行办公室主任，陕西省分行副行长，总行政策研究室副主任（主持工作）、办公室副主任、研究室副主任等职务。张先生 1998 年于中央党校研究生院获经济学硕士学位，2004 年于中央党校研究生院获经济学博士学位。

孟羽先生，资产托管部/资产托管业务发展中心总经理。

孟先生 2025 年 9 月起任交通银行股份有限公司资产托管部/资产托管业务发展中心总经理。曾任交通银行股份有限公司香港分行行政总裁，交通银行（香港）有限公司副董事长、执行董事、行政总裁，交银国际控股有限公司执行董事、首席执行官，广东省分行副行长，营业部副总经理，深圳分行国际业务部高级经理。曾在中国工商银行十堰分行工作。孟先生 1999 年于复旦大学获工商管理硕士学位。

（三）基金托管业务经营情况

截至 2025 年 9 月 30 日，交通银行共托管证券投资基金 892 只。此外，交通银行还托管了基金公司特定客户资产管理计划、证券公司客户资产管理计划、理财产品、信托计划、私募投资基金、保险资金、全国社保基金、基本养老保险基金、划转国有资本充实社保基金、养老保障管理产品、企业年金基金、职业年金基金、企业年金养老金产品、商业养老金产品、期货公司资产管理计划、QFI 证券投资资产、QDII 证券投资资产、RQDII 证券投资资产、QDIE、QDLP 和 QFLP、债券“南向通”等产品。

二、基金托管人的内部控制制度

（一）内部控制目标

交通银行严格遵守国家法律法规、行业规章及行内相关管理规定，加强内部管理，托管部/托管发展中心业务制度健全并确保贯彻执行各项规章，通过对各种风险的识别、评估、控制及缓释，有效地实现对各项业务的风险管控，确保业务稳健运行，保护基金持有人的合法权益。

（二）内部控制原则

1、合法性原则：托管部/托管发展中心制定的各项制度符合国家法律法规及监管机构的监管要求，并贯穿于托管业务经营管理活动始终。

2、全面性原则：托管部/托管发展中心建立各二级部自我监控和风险合规部风险管控的内部控制机制，覆盖各项业务、各个部门和各级人员，并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个经营环节，建立全面的风险管理监督机制。

3、独立性原则：托管部/托管发展中心独立负责受托基金资产的保管，保证基金资产与交通银行的自有资产相互独立，对不同的受托基金资产分别设置账户，独立核算，分账管理。

4、制衡性原则：托管部/托管发展中心贯彻适当授权、相互制约的原则，从组织架构的设置上确保各二级部和各岗位权责分明、相互制约，并通过有效的相互制衡措施消除内部控制中的盲点。

5、有效性原则：托管部/托管发展中心在岗位、业务二级部和风险合规部三级内控管理模式的基础上，形成科学合理的内部控制决策机制、执行机制和监督机制，通过行之有效的控制流程、控制措施，建立合理的内控程序，保障各项内控管理目标被有效执行。

6、效益性原则：托管部/托管发展中心内部控制与基金托管规模、业务范围和业务运作环节的风险控制要求相适应，尽量降低经营运作成本，以合理的控制成本实现最佳的内部控制目标。

（三）内部控制制度及措施

根据《证券投资基金法》、《中华人民共和国商业银行法》、《商业银行资产托管业务指引》等法律法规，托管部/托管发展中心制定了一整套严密、完整的证券投资基金托管管理规章制度，确保基金托管业务运行的规范、安全、高效，

包括《交通银行资产托管业务管理办法》、《交通银行资产托管业务风险管理办法》、《交通银行资产托管业务商业秘密管理规定》、《交通银行资产托管业务从业人员行为规范》、《交通银行资产托管业务运营档案管理办法》等，并根据市场变化和基金业务的发展不断加以完善。做到业务分工科学合理，技术系统管理规范，业务管理制度健全，核心作业区实行封闭管理，落实各项安全隔离措施，相关信息披露由专人负责。

托管部/托管发展中心通过对基金托管业务各环节的事前揭示、事中控制和事后检查措施实现全流程、全链条的风险管理，聘请会计师事务所对基金托管业务运行进行国际标准的内部控制评审。

三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

交通银行作为基金托管人，根据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和有关证券法规的规定，对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金的申购资金的到账与赎回资金的划付、基金收益分配等行为的合规性进行监督和核查。

交通银行作为基金托管人，发现基金管理人有违反《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关证券法规和《基金合同》的行为，及时通知基金管理人予以纠正，基金管理人收到通知后及时确认并进行调整。交通银行有权对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对交通银行通知的违规事项未能及时纠正的，交通银行按规定报告中国证监会。

交通银行作为基金托管人，发现基金管理人有重大违规行为，按规定报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

四、其他事项

最近一年内交通银行及其负责资产托管业务的高级管理人员无重大违法违规行为，未受到中国人民银行、中国证监会、中国银保监会及其他有关机关的处罚。负责基金托管业务的高级管理人员在基金管理公司无兼职的情况。

第五部分　相关服务机构

一、基金销售机构

1、直销机构

（1）上海国泰海通证券资产管理有限公司直销中心

注册地址：上海市黄浦区中山南路 888 号 8 层

办公地址：上海市黄浦区中山南路 888 号 B 栋 2-6 层及 8 层

法定代表人：陶耿

电话：021-38676999

联系人：甘珉

网址：www.gthtzg.com

（2）上海国泰海通证券资产管理有限公司网上直销系统

2、非直销销售机构：

本基金非直销销售机构信息请详见基金管理人官网公示的销售机构信息表。基金管理人可根据有关法律法规规定调整销售机构，并在基金管理人网站公示。

二、基金登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街17号

办公地址：北京市西城区锦什坊街26号

法定代表人：于文强

电话：4008058058

联系人：赵亦清

三、出具法律意见的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：韩炯

电话：021-31358666

传真：021-31358600

经办律师：黎明、陆奇

联系人：陆奇

四、审计基金财产的会计师事务所

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室

办公地址：上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心50楼

执行事务合伙人：毛鞍宁

电话：021-22283479

传真：021-22280000

经办注册会计师：蒋燕华，魏文博

联系人：魏文博

第六部分　基金的历史沿革

国泰海通君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)由国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)变更而来。国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)由国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)集合资产管理计划变更而来。国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)集合资产管理计划由国泰君安君得益二号优选基金集合资产管理计划变更而来。

国泰君安君得益二号优选基金集合资产管理计划为非限定性集合资产管理计划，于 2011 年 3 月 30 日经中国证监会证监许可〔2011〕466 号文核准设立，自 2011 年 4 月 25 日起开始募集并于 2011 年 5 月 31 日结束募集，于 2011 年 6 月 7 日成立。

根据《基金法》、《运作办法》、《证券公司大集合资产管理业务适用<关于规范金融机构资产管理业务的指导意见>操作指引》等法律法规的规定，国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)集合资产管理计划变更为国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)，并相应修改《国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)集合资产管理计划资产管理合同》等法律文件。2021 年 11 月 5 日，国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)经中国证监会《关于准予国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)集合资产管理计划变更注册的批复》（证监许可[2021]3519 号文）注册。

2025 年 7 月 25 日，上海国泰君安证券资产管理有限公司变更名称为上海国泰海通证券资产管理有限公司。经基金管理人履行适当程序，国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)变更为国泰海通君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)，《国泰海通君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)基金合同》自基金管理人公告的生效之日起生效，原《国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)基金合同》同日起失效。

第七部分　基金的存续

基金合同生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当 10 个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并在 6 个月内召集基金份额持有人大会进行表决。

法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。

第八部分　基金份额的申购与赎回

一、申购和赎回场所

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

二、申购和赎回的开放日及时间

1、开放日及开放时间

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

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

2、申购、赎回开始日及业务办理时间

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

基金管理人自基金合同生效之日起不超过 3 个月起开始办理赎回，具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。在最短持有期到期日后（含当日），基金份额持有人可就该份额提出赎回申请。如果投资人多次申购本基金，则其持有的每一份计划份额的最短持有期到期日可能不同。

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

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的，该申购、赎回价格为下一开放日该类基金份额申购、赎回的价格。

三、申购与赎回的原则

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

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；

4、赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人持有基金份额登记日期的先后次序进行顺序赎回。基金份额持有人持有原国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)的基金份额期限连续计算；

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

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

四、申购与赎回的程序

1、申购和赎回的申请方式

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

2、申购和赎回的款项支付

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

基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；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＋10 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或其他非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程时，赎回款项顺延至上述情形消除后的下一个工作日划出。在发生巨额赎回或基金合同载明的延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。

3、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日（T 日），在正常情况下，登记机构在 T+3 日内对该交易的有效性进行确认。T 日提交的有效申请，投资人应在 T+4 日后（包括该日）及时到销售

网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功，则申购款项退还给投资人。

基金销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。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，投资人应及时查询并妥善行使合法权利。

五、申购和赎回的数量限制

1、投资人单笔申购的最低金额为 1 元，具体规定请参见更新的招募说明书或相关公告。

2、投资者可将其账户中持有的全部或部分份额赎回，持有人在销售机构赎回时，每次赎回申请不得低于 1 份。持有人赎回时或赎回后在销售机构（网点）保留的份额余额不足 1 份的，在赎回时需一次全部赎回。

3、基金管理人可以规定单个投资人累计持有的基金份额上限，具体请参见相关公告。

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

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

六、申购和赎回的价格、费用及其用途

1、申购费

（1）投资人申购 A 类基金份额时，需交纳申购费用，A 类份额申购费率按照申购金额递减，即申购金额越大，所适用的申购费率越低。C 类份额不收取申购费。

投资者可以多次申购本基金，申购费率按单笔分别计算。具体申购费率如下表所示：

单笔申购金额（含申购费，M）	A 类份额的申购费率

M＜100 万元	1.20%
100 万元≤M＜200 万元	1.00%
200 万元≤M＜500 万元	0.30%
M≥500 万	每笔 1000 元

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

2、赎回费

本基金的赎回费在基金份额持有人赎回基金份额时收取。基金份额的赎回费率按照持有时间递减，即基金份额持有时间越长，所适用的赎回费率越低。具体赎回费率如下表所示：

持有期限（N）	A 类份额的赎回费率	C 类份额的赎回费率
N＜7 日	1.50%	1.50%
7 日≤N＜365 日	0.50%	0.50%
365 日≤N＜730 日	0.25%	0.25%
N≥730 日	0	0

本基金对持续持有期少于 30 日的投资人收取的赎回费，将全额计入基金财产；对持续持有期大于等于 30 日少于 90 日的投资人，将赎回费总额的 75%计入基金财产；对持续持有期大于等于 90 日但少于 180 日的投资人，将赎回费总额的 50%计入基金财产。对持续持有期大于等于 180 日的投资人，将赎回费总额的 25%计入基金财产。未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。

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

4、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。5、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定且对存量基金份额持有人利益无实质性不利影响的情形下根据市场情况制定基金促销计划，定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，

按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金销售费用。

七、申购份额、赎回金额的计算方式

1、申购份额的计算

当投资者选择申购本基金份额时，申购份额的计算方法如下：

（1）申购费用适用比例费率时：

净申购金额＝申购金额/（1＋申购费率）

申购费用＝申购金额－净申购金额

申购份额＝净申购金额/申购当日 A 类基金份额净值

（2）申购费用为固定金额时：

申购费用＝固定金额

净申购金额=申购金额－申购费用

申购份额＝净申购金额/申购当日 A 类基金份额净值

申购的有效份额为净申购金额除以当日的 A 类基金份额净值，有效份额单位为份，上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

例：某投资者投资 5 万元申购本基金，则对应的申购费率为 1.20%，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，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 份的 A 类基金份额。

例：某投资者投资 550 万元申购本基金，则其对应的申购费用为 1,000 元，假设申购当日 A 类基金份额净值为 1.0500 元，则其可得到的基金份额的份数计算如下:

申购费用＝1,000.00 元

净申购金额＝5,500,000-1,000＝5,499,000.00 元

申购份额＝5,499,000/1.0500＝5,237,142.86 份

即：投资人投资 550 万元申购本基金，假设申购当日 A 类基金份额净值为

1.0500 元，则其可得到 5,237,142.86 份 A 类基金份额。

2、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 日的该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。

当投资者赎回基金份额时，赎回金额的计算方法如下：

赎回总额＝赎回份额×赎回当日该类基金份额净值

赎回费用＝赎回总额×赎回费率

赎回金额=赎回总额－赎回费用

赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日该类基金份额净值并扣除其他相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

例：某持有人赎回 5 万份本基金 C 类份额，持有期为 731 日，则对应的赎回费率为 0，假设赎回当日 C 类基金份额净值为 1.0500 元，则可得到的赎回金额为：

赎回总金额=50,000×1.0500=52,500.00 元

赎回费用＝52,500.00×0=0 元

净赎回金额=52,500.00－0＝52,500.00 元

即：持有人赎回 5 万份本基金份额，持有期为 731 日，假设赎回当日 C 类基金份额净值为 1.0500 元，则其可得到 52,500.00 元。

3、基金份额净值计算

T 日某类基金份额净值=T 日该类基金资产净值/T 日发行在外的集该类合计划份额总数。

本基金份额净值的计算，保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T 日的各类基金份额净值在 T+3 日内公告。遇特殊情况，经履行适当程序，可以适当延迟计算或公告。

八、拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

1、因不可抗力导致基金无法正常运作。

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受

投资人的申购申请。

3、证券交易所交易时间非正常停市或休市，或本基金所持有的占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。

4、接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。

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

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

7、基金管理人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。

8、占相当比例的被投资基金拒绝或暂停申购、暂停上市或二级市场交易停牌。

9、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第 1、2、3、5、6、8、9 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在规定媒介上刊登暂停申购公告。发生上述第 7 项情形时，基金管理人可以采取比例确认等方式对该投资人的申购申请进行限制，基金管理人有权拒绝该等全部或者部分申购申请。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝，被拒绝部分的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

九、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。

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

3、证券交易所交易时间非正常停市或休市，或本基金所持有的基金暂停估值，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

5、发生继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时，基金管理人可暂停接受基金份额持有人的赎回申请。

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

7、占相当比例的被投资基金暂停赎回、暂停上市或二级市场交易停牌。

8、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。若出现上述第 4 项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

十、巨额赎回的情形及处理方式

1、巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过前一开放日的基金总份额的 10%，即认为是发生了巨额赎回。

2、巨额赎回的处理方式

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

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

（2）部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的 10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部

分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的该类基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

（3）在出现巨额赎回时，对于单个基金份额持有人当日超过上一开放日基金总份额 20%以上的赎回申请，基金管理人可以对超过的部分全部进行延期办理，具体措施如下：延期的赎回申请将自动与下一个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。如该单个基金份额持有人在提交赎回申请时未作明确选择，未能赎回部分作自动延期赎回处理。对于此类持有人未超过上述比例的部分，基金管理人有权根据前述“（1）全额赎回”或“（2）部分延期赎回”的方式与其他持有人的赎回申请一并办理。但是，如此类持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。

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

3、巨额赎回的公告

当发生上述巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，并于两日内在规定媒介上刊登公告。

十一、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

1、发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人应在规定期限内在规定媒介上刊登暂停公告。

2、如发生暂停的时间为 1 日，基金管理人应于重新开放日，在规定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近 1 个开放日的各类基金份额净值。

3、若暂停时间超过 1 日，则基金管理人可以根据《信息披露办法》的有关

规定，最迟于重新开放申购或赎回日，在规定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近 1 个开放日的各类基金份额净值；也可以根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间，届时不再另行发布重新开放的公告。

十二、基金转换

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

十三、基金的非交易过户

基金的非交易过户是指登记机构受理继承、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份额的投资人。

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

十四、基金的转托管

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

十五、定期定额投资计划

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

十六、基金份额的冻结和解冻

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。

十七、基金份额的转让

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

十八、实施侧袋机制期间本基金的申购与赎回

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

十九、如相关法律法规允许基金管理人办理其他基金业务，基金管理人将制定和实施相应的业务规则。

第九部分　基金的投资

一、投资目标

在控制风险的前提下，通过优选基金积极把握基金市场的投资机会，力求基金资产的长期稳健增值。

二、投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金（包括 QDII 基金、香港互认基金和公开募集基础设施证券投资基金（以下简称“公募 REITs”））、国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板以及其他依法发行上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、证券公司短期公司债券、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具以及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相关规定。

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

基金的投资组合比例为：投资于中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金的资产比例不低于基金资产的 80%，其中，股票、股票型基金、混合型基金（混合型基金仅包含以下两类：基金合同约定股票资产投资比例不低于基金资产 60%的混合型基金；根据基金披露的定期报告，最近四个季度股票资产占基金资产比例均不低于 60%的混合型基金）合计占基金资产的比例为 60%-95%，投资于货币市场基金的资产占基金资产的比例不高于 15%；本基金应当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。

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

三、投资策略

1、资产配置策略

本基金采取积极的资产配置策略，通过宏观策略研究，对相关资产类别的预期收益进行动态跟踪，精选基金品种，构建有超额收益能力的基金组合。同时通过有效地风险管理，降低业绩的波动性，获得稳定而持续的投资收益。

2、基金投资策略

（1）开放式基金投资策略

本基金以权益类基金为重点投资方向，在开放式基金的投资选择上，更倾向于挑选中长期主动管理能力得到验证的优质基金产品进行配置。在具体选择维度上分为基金公司、基金经理、基金产品三个方向，进行定量和定性的合理分析，筛选出超额收益稳定的基金产品进入组合配置。

1）在基金公司维度，主要考虑的因素有：基金公司的股东背景、公司治理、核心管理团队的综合素质和稳定性、基金经理与投研团队的综合素质和稳定性、公司管理的资产规模和盈利能力、管理层的管理风格、投资决策程序的科学性和执行度、公司风险控制制度健全性和执行力度、公司基金的类型和收益情况、公司基金交叉持股情况、基金公司产品创新能力及客户服务水平等。评价方式主要来自于实地调研、公司刊物和公开信息。

2）基金经理维度，对基金经理的从业经验、业绩表现、风险控制、业绩归因、风格特征等多个层面全方位地进行分析，定量和定性相结合，并通过持续跟踪保持更新。该体系从多种维度对基金经理的风格特征加以剖析，包括但不限于：组合构建思路、选股偏好、擅长投资领域、投资集中度、换手率情况等。

3）基金产品维度，重点考量首先根据基金的历史业绩情况，挑选出业绩持续优秀的基金，根据基金的风险收益特征，构建合适的基金投资组合。通过风险收益综合评价方法挖掘持续稳定的基金品种，主要包括选股能力、择时能力、风险控制能力等指标。

（2）场内 ETF 等基金投资策略

场内 ETF 等基金评价中更多考虑业绩持续性和市场因素的影响。通过对基金规模、流动性、跟踪误差、交易成本，以及 ETF 所跟踪指数的综合评价挑选适合的 ETF 投资标的，再根据市场波动因素的变化在适当时机完成基金的买入或卖出操作。

3、股票的投资策略

通过分析宏观经济、产业政策和行业景气程度，以证监会行业分类标准为基础，挑选出增长前景持续向好的行业或周期景气复苏或上升的行业。通过定性和定量分析精选个股。定量分析使用的指标包括成长指标、价值指标和盈利指标，针对不同行业采取相应的估值方法；定性分析对精选公司进行“波特五力模型”分析，结合行业估值模型进行数量化的辅助投资决策。

4、债券的投资策略

本基金将采取久期偏离、收益率曲线配置和类属配置、无风险套利、杠杆策略和个券选择策略等投资策略，发现、确认并利用市场失衡实现组合增值。在综合考虑流动性、市场分割、息票率、税赋特点、提前偿还和赎回等因素的基础上，评估债券投资价值，选择定价合理或者价值被低估的债券构建投资组合，并根据市场变化情况对组合进行优化。

5、资产支持证券等品种投资策略

资产支持证券包括资产抵押贷款支持证券（ABS）、住房抵押贷款支持证券（MBS）等，其定价受多种因素影响，包括市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率等。本基金将深入分析上述基本面因素，并辅助数量化定价模型，评估其内在价值。

6、公募 REITs 投资策略

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。

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）本基金投资于中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金的资产比例不低于基金资产的 80%，其中，股票、股票型基金、混合型基金（混合型基金仅包含以下两类：基金合同约定股票资产投资比例不低于基金资产 60%

的混合型基金；根据基金披露的定期报告，最近四个季度股票资产占基金资产比例均不低于 60%的混合型基金）合计占基金资产的比例为 60%-95%，投资于货币市场基金的资产占基金资产的比例不高于 15%；

（2）本基金持有单只基金，其市值不高于本基金资产净值的 20%，且不持有其他基金中基金；

（3）本基金应当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）本基金基金管理人管理的全部基金中基金持有单只证券投资基金的比例不超过该被投资证券投资基金净资产的 20%，被投资证券投资基金净资产规模以最近定期报告披露的规模为准；

（5）本基金不得持有具有复杂、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；

（6）本基金持有一家公司发行的证券（不含证券投资基金），其市值不超过基金资产净值的 10%；

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

（8）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%；

（9）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%；

（10）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%；

（11）本基金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%；

（12）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；

（13）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；

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

（15）本基金投资的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；

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

（17）本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

（18）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条规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

（19）本基金基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金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%；

（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）法律法规及中国证监会规定的其他投资限制。

因证券市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合上述第（2）、（4）项的，基金管理人应当在 20 个交易日内进行调整；对于除第（2）、（3）、（4）、（12）、（18）、（20）项外的其他比例限制，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 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，从其规定。

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

法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

2、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。

3、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

（1）承销证券；

（2）违反规定向他人贷款或者提供担保；

（3）从事承担无限责任的投资；

（4）向其基金管理人、基金托管人出资；

（5）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

（6）持有具有复杂、衍生品性质的基金份额，包括分级基金和中国证监会认定的其他基金份额，但中国证监会认可或批准的特殊基金中基金除外；

（7）投资其他基金中基金；

（8）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

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

法律、行政法规或监管部门取消上述禁止行为规定或从事关联交易的条件和要求，本基金可不受相关限制。法律法规或监管部门对上述禁止行为规定或从事关联交易的条件和要求进行变更的，本基金可以变更后的规定为准。经与基金托管人协商一致，基金管理人可在履行适当程序后，依据法律法规或监管部门规定对基金合同进行变更。

五、业绩比较基准

本基金采用业绩比较基准：沪深 300 指数收益率*75%+中债综合(全价)指数

收益率*25%。

本基金不低于 80%的基金资产投资于公开募集证券投资基金，沪深 300 指数由专业指数提供商中证指数有限公司编制和发布，由沪深 A 股中规模大、流动性好的最具代表性的 300 只股票组成，以综合反映沪深 A 股市场整体表现，具有良好的市场代表性和市场影响力。

中债综合（全价）指数由中央国债登记结算有限公司编制，旨在综合反映债券全市场整体价格和投资回报情况，是具有代表性的债券市场指数。

选用以上业绩比较基准可以有效评估本基金投资组合业绩，反映本基金的风格特点。

如果指数编制单位停止计算编制该指数或更改指数名称，或今后法律法规发生变化，或有更适当的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，本基金管理人可依据维护基金份额持有人合法权益的原则，经履行适当程序，调整业绩比较基准并及时公告。

六、风险收益特征

本基金为混合型基金中基金，其预期收益和预期风险水平高于货币市场基金、货币型基金中基金、债券型基金和债券型基金中基金，低于股票型基金和股票型基金中基金。

七、基金管理人代表基金行使股东或债权人权利的处理原则及方法

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

2、不谋求对上市公司的控股；

3、有利于基金财产的安全与增值；

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

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

国泰海通君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)管理人－上海国泰海通证券资产管理有限公司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。

本投资组合报告所载数据截至 2025 年 12 月 31 日，来源于《国泰海通君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)2025 年第四季度报告》。

9.1 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	996,473,012.06	90.25
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	69,731,268.39	6.32
8	其他资产	37,939,678.39	3.44
9	合计	1,104,143,958.84	100.00

9.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

9.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

9.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

9.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

9.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

9.5 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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

9.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

9.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

9.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

9.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

9.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

9.10.1 本期国债期货投资政策

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

9.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

9.11 投资组合报告附注

9.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到监管部门立案调查或报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形说明

本基金持有的前十名证券发行主体南方基金管理股份有限公司，2025 年 3 月因未依法履行职责被证监会分局警示，2025 年 11 月因违规被国家外汇管理局地方分局警告、罚款。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

9.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

9.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	194,270.82
2	应收证券清算款	37,672,016.88
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,331.96
6	其他应收款	70,058.73
7	其他	-
8	合计	37,939,678.39

9.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

9.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

第十部分 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、基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

国泰海通君得益三个月持有混合(FOF)A：

阶段	基金份额净值增长率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
2020.11.16-2020.12.31	5.87%	0.64%	7.19%	0.78%	-1.32%	-0.14%
2021.01.01-2021.12.31	8.27%	0.98%	3.98%	1.01%	4.29%	-0.03%
2022.01.01-2022.12.31	-21.61%	1.14%	-18.60%	0.98%	-3.01%	0.16%
2023.01.01-2023.12.31	-11.34%	0.71%	-8.04%	0.63%	-3.30%	0.08%
2024.01.01-2024.12.31	3.21%	1.15%	12.65%	1.00%	-9.44%	0.15%
2025.01.01-2025.12.31	22.85%	1.05%	12.78%	0.71%	10.07%	0.34%
自基金成立起至 2025.12.31	1.01%	1.01%	5.99%	0.88%	-4.98%	0.13%

国泰海通君得益三个月持有混合(FOF)C：

阶段	基金份额净值增长率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
2021.01.12-2021.12.31	4.17%	0.98%	0.68%	1.00%	3.49%	-0.02%
2022.01.01-2022.12.31	-21.93%	1.14%	-18.60%	0.98%	-3.33%	0.16%
2023.01.01-2023.12.31	-11.70%	0.70%	-8.04%	0.63%	-3.66%	0.07%
2024.01.01-2024.12.31	2.80%	1.15%	12.65%	1.00%	-9.85%	0.15%
2025.01.01-2025.12.31	22.36%	1.05%	12.78%	0.71%	9.58%	0.34%
自基金成立起至 2025.12.31	-9.67%	1.02%	-4.25%	0.88%	-5.42%	0.14%

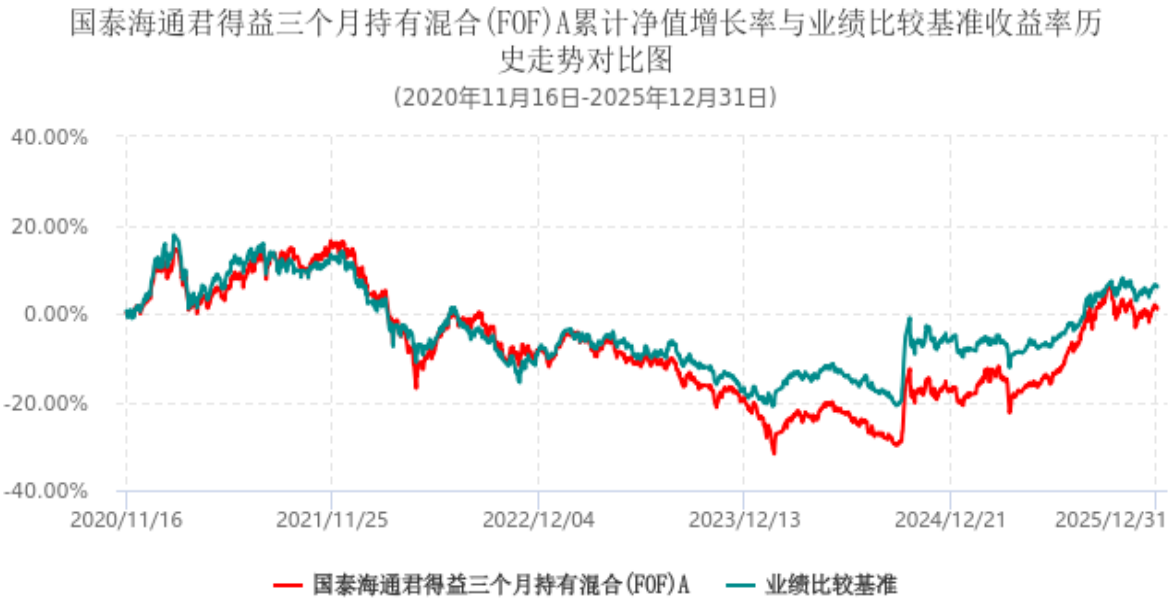
注：1、国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)集合资产管理计划合同生效日为 2020 年 11 月 16 日，“国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)集合资产管理计划”于 2022 年 3 月 21 日变更注册为“国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)”。“国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)”于 2025 年 9 月 29 日起变更为“国泰海通君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)”。

2、本基金合同生效日为 2025 年 9 月 29 日。

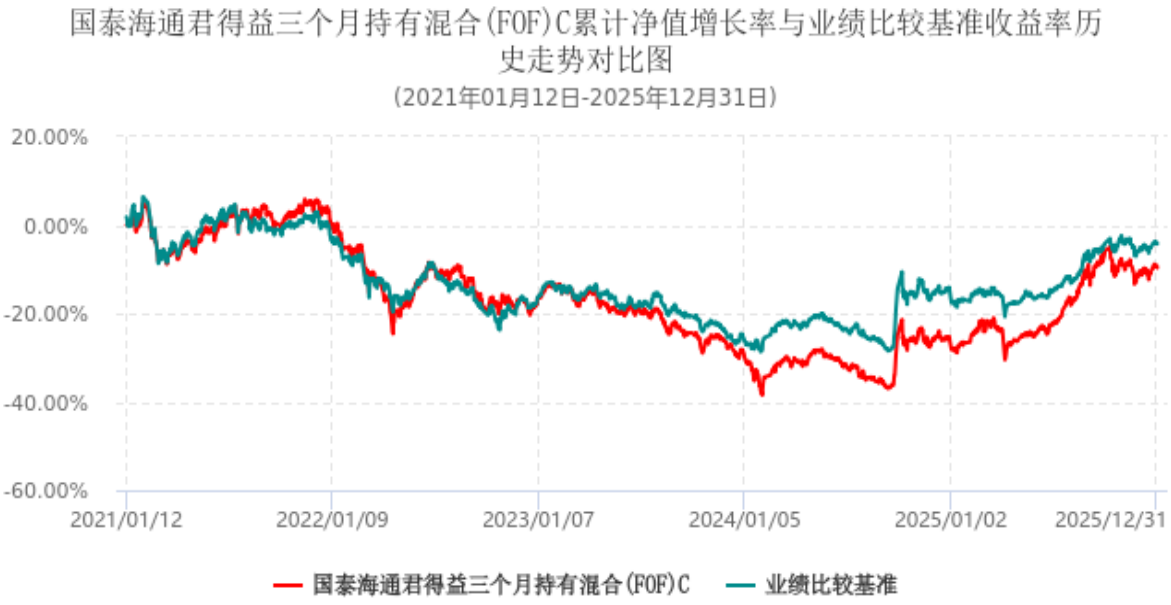
3、国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)C 类份额于 2021 年 1 月 12 日首次申购确认。

二、基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

国泰海通君得益三个月持有混合(FOF)A：



国泰海通君得益三个月持有混合(FOF)C：



注：1、国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)集合资产管理计划合同生效日为 2020 年 11 月 16 日，“国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)集合资产管理计划”于 2022 年 3 月 21 日变更注册为“国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)”。“国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)”于 2025 年 9 月 29 日起变更为“国泰海通君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)”。

2、本基金合同生效日为 2025 年 9 月 29 日。

3、国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)C 类份额于 2021 年 1 月 12 日首次申购确认。

第十一部分　基金的财产

一、基金资产总值

基金资产总值是指购买的各类证券、证券投资基金及票据价值、银行存款本息和基金应收的申购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、基金销售机构和登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

四、基金财产的保管和处分

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

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

第十二部分　基金资产估值

一、估值日

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

二、估值对象

基金所拥有的证券投资基金份额、股票、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

三、估值原则

基金管理人在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，应符合《企业会计准则》、监管部门有关规定。

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

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

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

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

四、估值方法

1、对于未在交易所上市的证券投资基金的估值

（1）本基金投资的境内非货币市场基金，按所投资基金估值日的份额净值估值。

（2）本基金投资的境内货币市场基金，按所投资基金前一估值日后至估值日期间（含节假日）的万份收益计提估值日基金收益；如所投资基金披露份额净值，则按所投资基金的基金管理人披露的估值日份额净值进行估值。

2、对于在交易所上市的证券投资基金的估值

（1）本基金投资的交易型开放式指数基金（ETF），按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份额净值估值。

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

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

3、对于证券投资基金特殊情况的估值处理

如遇所投资的证券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）若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，基金管理人将根据份额净值或收盘价、单位基金份额分红金额、折算拆分比例、

持仓份额等因素合理确定公允价值。

4、证券交易所上市的有价证券（不含证券投资基金）的估值

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

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

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

（4）交易所上市交易的可转换债券以每日收盘价作为估值全价；

（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。

5、处于未上市期间的有价证券（不含证券投资基金）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。

6、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。

7、同一债券或股票同时在两个或两个以上市场交易的，按债券或股票所处的市场分别估值。

8、同业存单按估值日第三方估值机构提供的估值净价估值；选定的第三方估值机构未提供估值价格的，按成本估值。

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

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

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

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

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对基金净值的计算结果对外予以公布。由此给基金份额持有人和基金造成损失以及因该交易日基金资产净值计算顺延错误而引起损失的，基金托管人不承担赔偿责任。

五、估值程序

1、各类基金份额净值是按照每个估值日闭市后，该类基金资产净值除以当

日该类基金份额的余额数量计算，精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人每个估值日计算基金资产净值及各类基金份额净值，并按法律法规规定和基金合同约定进行公告。

2、基金管理人应每个估值日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个估值日对基金资产估值后，将基金资产净值和各类基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人按法律法规规定和基金合同约定对外公布。

六、估值错误的处理

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

基金合同的当事人应按照以下约定处理：

1、估值错误类型

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

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

2、估值错误处理原则

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

（2）估值错误的责任方对有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，

并且仅对估值错误的有关直接当事人负责，不对第三方负责。

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

（4）估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

（4）根据估值错误处理的方法，需要修改登记机构交易数据的，由登记机构进行更正，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）错误偏差达到或超过基金份额净值的 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；错误偏差达到或超过基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告，并报中国证监会备案。

（3）前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

七、暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

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

4、占相当比例的被投资基金暂停估值时；

5、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

八、基金净值的确认

基金资产净值和各类基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个估值日计算基金资产净值和各类基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人按法律法规规定及基金合同约定对基金净值予以公布。

九、实施侧袋机制期间的基金资产估值

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

十、特殊情况的处理

1、基金管理人或基金托管人按基金合同约定的估值方法第 9 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理；

2、由于不可抗力，或由于证券交易所、登记结算公司等机构发送的数据错误等原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、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。

第十三部分　基金的收益与分配

一、基金利润的构成

基金利润指基金所投资证券投资基金的分红收入、股息、利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额，基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

二、基金可供分配利润

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

三、基金收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金可以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；通过红利再投资所得基金份额的最短持有期起始日与该份额最短持有期起始日相同；

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

4、同一类别每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

四、收益分配方案

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、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，在 2 日内在规定媒介公告。

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

七、实施侧袋机制期间的收益分配

本基金实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配。

第十四部分　基金费用与税收

一、基金费用的种类

1、基金管理人的管理费；

2、基金托管人的托管费；

3、C 类份额的销售服务费；

4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；

5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费等；

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、基金投资证券投资基金份额产生的费用（包括但不限于申购费、赎回费等），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。

二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.80%年费率计提，但本基金投资于基金管理人所管理的其他基金的部分不收取管理费。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中扣除本基金持有的基金管理人自身管理的其他基金部分（若为负数，则取 0）

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 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、公休假等，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20%的年费率计提，但本基金投资于基金托管人所托管的其他公开募集证券投资基金的部分不收取托管费。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.20%÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值中扣除本基金持有的基金托管人自身托管的其他公开募集证券投资基金部分（若为负数，则取 0）

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

3、C 类份额的销售服务费

本基金 A 类份额不收取销售服务费，C 类份额的销售服务费年费率为 0.40%，销售服务费按前一日 C 类份额的基金资产净值的 0.40%年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.40%÷当年天数

H 为 C 类份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类份额前一日的基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性划出，经基金管理人分别支付给各个销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

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

三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

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

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、《基金合同》生效前的相关费用；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

基金管理人运用基金财产申购自身管理的其他的（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、招募说明书约定应当收取并计入基金财产的赎回费用除外）、销售服务费等销售费用。

四、实施侧袋机制期间的基金费用

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

五、基金税收

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

第十五部分　基金的会计与审计

一、基金会计政策

1、基金管理人为本基金的会计责任方；

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在 2 日内在规定媒介公告。

第十六部分　基金的信息披露

一、本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《流动性风险管理规定》、《基金合同》及其他有关规定。

二、信息披露义务人

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

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

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

三、本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；

2、对证券投资业绩进行预测；

3、违规承诺收益或者承担损失；

4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构；

5、登载任何自然人、法人和非法人组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；

6、中国证监会禁止的其他行为。

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

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

五、公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

（一）招募说明书、《基金合同》、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、招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金申购和赎回安排、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招募说明书。

3、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。

基金管理人应将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，将招募说明书、基金产品资料概要、《基金合同》和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》、托管协议登载在规定网站上。

（二）《基金合同》生效公告

基金管理人应当在规定媒介上登载《基金合同》生效公告。

（三）基金净值信息

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

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在不晚于每个开放日后的第 3 个工作日，通过规定网站、基金份额销售机构网站或者营业网点披露开

放日的各类基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日后的第 3 个工作日，在规定网站披露半年度和年度最后一日的各类基金份额净值和基金份额累计净值。

（四）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销售机构网站或营业网点查阅或者复制前述信息资料。

（五）定期报告，包括年度报告、中期报告和季度报告

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。年度报告中的财务会计报告应当经过符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计。

基金管理人应当在上半年结束之日起两个月内，编制完成中期报告，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。

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。

（六）临时报告

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

前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件：

1、基金份额持有人大会的召开及决定的事项；

2、《基金合同》终止、基金清算；

3、转换基金运作方式、基金合并；

4、更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；

5、基金管理人委托服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；

6、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；

7、基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人的实际控制人变更；

8、基金管理人的分管资产管理业务的高级管理人员、基金经理和基金托管人专门托管部门负责人发生变动；

9、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；

10、涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼或仲裁；

11、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托管部门负责人因托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；

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

13、基金收益分配事项；

14、管理费、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；

15、基金份额净值估值错误达基金份额净值百分之零点五；

16、本基金开始办理申购、赎回；

17、本基金发生巨额赎回并延期办理；

18、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；

19、本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；

20、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；

21、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；

22、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和基金合同约定的其他事项。

（七）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的，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。

（八）基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

（九）清算报告

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

（十）投资证券投资基金的信息披露

基金管理人应在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露所持有基金以下相关情况：

1、投资政策、持仓情况、损益情况、净值披露时间等；

2、交易及持有基金产生的费用，包括申购费、赎回费、销售服务费、管理费、托管费等；

3、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、基金投资于基金管理人以及基金管理人关联方所管理基金或的情况；

基金管理人应在定期报告中披露本基金参与基金的基金份额持有人大会的表决意见。

（十一）投资资产支持证券信息披露

基金管理人应在年度报告及中期报告中披露基金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。

基金管理人应在季度报告中披露基金持有的资产支持证券总额、资产支持证

券市值占基金净资产的比例和报告期末按市值占基金净资产比例大小排序的前 10 名资产支持证券明细。

（十二）实施侧袋机制期间的信息披露

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

（十三）中国证监会规定的其他信息。

六、信息披露事务管理

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

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

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、各类基金份额净值、基金份额申购赎回价格、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媒介中选择一家披露本基金信息。基金管理人、基金托管人应当向中国证监会基金电子披露网站报送拟披露的基金信息，并保证相关报送信息的真实、准确、完整、及时。

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

为基金信息披露义务人公开披露的基金信息出具审计报告、法律意见书的专业机构，应当制作工作底稿，并将相关档案至少保存到《基金合同》终止后 10 年。

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各自住所，供社会公众查阅、复制。

第十七部分　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，并及时聘请符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所进行审计并披露专项审计意见。

二、实施侧袋机制期间基金份额的申购与赎回

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

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

3、除基金管理人应按照主袋账户的份额净值办理主袋账户份额的申购和赎回外，本招募说明书“基金份额的申购与赎回”部分的申购、赎回规定适用于主袋账户份额。巨额赎回按照单个开放日内主袋账户份额净赎回申请超过前一开放日主袋账户总份额的 10%认定。

三、实施侧袋机制期间的基金投资

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

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

四、实施侧袋机制期间的基金估值

本基金实施侧袋机制的，基金管理人和基金托管人应对主袋账户资产进行估值并披露主袋账户的基金净值信息，暂停披露侧袋账户份额净值。侧袋账户的会

计核算应符合《企业会计准则》的相关要求。

五、实施侧袋账户期间的基金费用

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

2、与侧袋账户有关的费用可从侧袋账户中列支，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清算

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。

处置特定资产的临时公告内容应当包括特定资产处置价格和时间、向侧袋账户份额持有人支付的款项、相关费用发生情况等重要信息。

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

1、临时公告

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

2、基金净值信息

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

3、定期报告

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

八、本部分关于侧袋机制的相规定，凡是直接引用法律法规的部分，如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人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修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

第十八部分 风险揭示

一、投资本基金的风险

1、市场风险

本基金主要投资于证券市场，而证券市场价格因受到经济因素、政治因素、投资者心理和交易制度等各种因素的影响而产生波动，从而导致基金收益水平发生变化，产生风险。主要的风险因素包括：

（1）政策风险。因财政政策、货币政策、产业政策、地区发展政策等国家宏观政策发生变化，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，随着经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化，基金投资的收益水平也会随之变化，从而产生风险。

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

（4）再投资风险。债券、票据偿付本息后以及回购到期后可能由于市场利率的下降面临资金再投资的收益率低于原来利率，由此本基金面临再投资风险。

（5）信用风险。债券发行人不能按期还本付息或回购交易中交易对手在回购到期履行交割责任时，不能偿还全部或部分证券或价款，都可能使本基金面临信用风险。

（6）上市公司经营风险。上市公司的经营状况受多种因素的影响，如管理能力、行业竞争、市场前景、技术更新、新产品研究开发等都会导致公司盈利发生变化。如果基金所投资的上市公司经营不善，其债券价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，使基金投资收益下降。虽然基金可以通过投资多样化来分散这种非系统风险，但不能完全避免。

（7）购买力风险。基金份额持有人收益将主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀因素而使其购买力下降,从而使基金的实际收益下降。

（8）债券回购风险。债券回购为提升整体基金组合收益提供了可能，但也存在一定的风险。债券回购的主要风险包括信用风险、投资风险及波动性加大的

风险，其中，信用风险指回购交易中交易对手在回购到期时，不能偿还全部或部分证券或价款，造成基金净值损失的风险；投资风险是指在进行回购操作时，回购利率大于债券投资收益而导致的风险以及由于回购操作导致投资总量放大，致使整个组合风险放大的风险；而波动性加大的风险是指在进行回购操作时，在对基金组合收益进行放大的同时，也对基金组合的波动性（标准差）进行了放大，即基金组合的风险将会加大。回购比例越高，风险暴露程度也就越高，对基金净值造成损失的可能性也就越大。

2、管理风险

在基金管理运作过程中，基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的占有以及对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平。

基金管理人和基金托管人的管理手段和管理技术等因素的变化也会影响基金收益水平。

3、流动性风险

基金的流动性风险主要表现在两方面：一是基金管理人建仓时或为实现投资收益而进行组合调整时，可能会由于特定投资标流动性相对不足而无法按预期的价格将股票或债券买进或卖出；二是为应付投资者的赎回，当个券的流动性较差时，基金管理人被迫在不适当的价格大量抛售股票或债券。两者均可能使基金净值受到不利影响。

（1）基金申购、赎回安排

本基金对每份基金份额设置 3 个月的最短持有期。在最短持有期到期日（不含该日）前，基金份额持有人不能提出赎回申请。在最短持有期到期日（含该日）后，基金份额持有人可提出赎回申请。

为切实保护存量份额持有人的合法权益，遵循份额持有人利益优先的原则，基金管理人将合理控制基金份额持有人集中度，审慎确认申购、赎回业务申请，包括但不限于：

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

基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。

2）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。

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

本基金申购、赎回安排详见基金合同“第六部分 基金份额的申购与赎回”章节及本招募说明书“第八部分 基金份额的申购与赎回”章节。

（2）拟投资资产的流动性风险评估

本基金主要投资对象为具有良好流动性的金融工具，包括经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金（包括 QDII 基金、香港互认基金和公开募集基础设施证券投资基金（以下简称“公募 REITs”））、国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板以及其他依法发行上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、证券公司短期公司债券、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具以及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相关规定；同时，本基金基于分散投资的原则在行业和个券方面未有高集中度的特征，综合评估在正常市场环境下本基金的流动性风险适中。

（3）巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

根据《流动性风险规定》的相关要求，基金管理人对本基金实施流动性风险管理，并针对性制定流动性风险管理措施，尽量避免或减小因发生流动性风险而导致的投资者损失，最大程度的降低巨额赎回情形下的可能出现的流动性风险。

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

1）全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时，按

正常赎回程序执行。

2）部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的 10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的该类基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

3）在出现巨额赎回时，对于单个基金份额持有人当日超过上一开放日基金总份额 20%以上的赎回申请，基金管理人可以对超过的部分全部进行延期办理，具体措施如下：延期的赎回申请将自动与下一个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。如该单个基金份额持有人在提交赎回申请时未作明确选择，未能赎回部分作自动延期赎回处理。对于此类持有人未超过上述比例的部分，基金管理人有权根据前述“（1）全额赎回”或“（2）部分延期赎回”的方式与其他持有人的赎回申请一并办理。但是，如此类持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。

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

本基金巨额赎回安排详见基金合同“第六部分 基金份额的申购与赎回”章节及本招募说明书“第八部分 基金份额的申购与赎回”章节。

（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

在市场大幅波动、流动性枯竭等极端情况下发生无法应对投资者巨额赎回的情形时，基金管理人将以保障投资者合法权益为前提，严格按照法律法规及基金

合同的规定，谨慎选取暂停接受赎回申请、延缓支付赎回款项、延期办理巨额赎回申请、收取短期赎回费、暂停基金估值、摆动定价等流动性风险管理工具作为辅助措施。对于各类流动性风险管理工具的使用，基金管理人将依照严格审批、审慎决策的原则，及时有效地对风险进行监测和评估，使用前经过内部审批程序并与基金托管人协商一致。在实际运用各类流动性风险管理工具时，投资者的赎回申请、赎回款项支付等可能受到相应影响，基金管理人将密切关注市场资金动向，提前调整投资和头寸安排，尽可能的避免出现不得不实施上述流动性风险管理工具的流动性风险，将对投资者可能出现的潜在影响降至最低。

（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。

4、本基金特有风险

本基金为混合型基金中基金，其预期收益和预期风险水平高于货币市场基

金、货币型基金中基金、债券型基金、债券型，低于股票型基金、股票型。

（1）FOF 投资风险

本基金投资于中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金的资产比例不低于基金资产的 80%，其中，股票、股票型基金、混合型基金（混合型基金仅包含以下两类：基金合同约定股票资产投资比例不低于基金资产 60%的混合型基金；根据基金披露的定期报告，最近四个季度股票资产占基金资产比例均不低于 60%的混合型基金）合计占基金资产的比例为 60%-95%，投资于货币市场基金的资产占基金资产的比例不高于 15%；基金管理人将发挥专业研究优势，加强对市场、上市公司基本面和固定收益类产品的深入研究，持续优化组合配置，以控制特定风险。

本基金是主动管理型产品，在挑选基金等投资品种的过程中，基金管理人的专业技能、研究能力及投资管理水平直接影响到其对信息的占有、分析和对经济形势、证券价格走势的判断，进而影响基金的投资收益水平。

基金管理人在构建 FOF 投资组合的时候，对基金的选择在很大的程度上依靠了基金的历史业绩表现。但是基金的过往业绩往往不能代表基金未来的表现，所以可能引起一定的风险。

（2）最短持有期限内不能赎回基金份额的风险

本基金对每份基金份额设置 3 个月的最短持有期。在最短持有期到期日（不含该日）前，基金份额持有人不能提出赎回申请。在最短持有期到期日（含该日）后，基金份额持有人可提出赎回申请。投资者存在流动性风险。因此，基金份额持有人面临在最短持有期限届满前不能赎回的风险。

（3）本基金投资资产支持证券，资产支持证券具有一定的价格波动风险、流动性风险、信用风险等风险。价格波动风险指的是市场利率波动会导致资产支持证券的收益率和价格波动。流动性风险指的是受资产支持证券市场规模及交易活跃程度的影响，资产支持证券可能无法在同一价格水平上进行较大数量的买入或卖出，存在一定的流动性风险。信用风险指的基金所投资的资产支持证券之债务人出现违约，或在交易过程中发生交收违约，或由于资产支持证券信用质量降低导致证券价格下降，造成基金财产损失。

（4）流通受限证券的风险

本基金可投流通受限证券，因此本基金可能由于持有流通受限证券而面临流动性风险以及流通受限期间内证券价格大幅下跌的风险。

（5）本基金可投资公募 REITs，将面临投资公募 REITs 的特有风险，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）基金份额交易价格折溢价风险。公募 REITs 基金合同生效后，将根据相关法律法规申请在交易所上市，在每个交易日的交易时间将根据相关交易规则确定交易价格，该交易价格可能受诸多因素影响；此外，公募 REITs 还将按照相关业务规则、基金合同约定进行估值并披露基金份额净值等信息。由于基金份额交易价格与基金份额净值形成机制以及影响因素不同，存在基金份额交易价格相对于基金份额净值折溢价的风险。

4）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。此外，公募 REITs 持有基础设施资产支持证券全部份额，如发生特殊情况需要处置基础设施资产支持证券，可能会由于基础设施资产支持证券流动性较弱而带来损失（如证券不能卖出或贬值出售等）。基础设施资产支持证券通过项目公司持有的基础设施资产可能会存在无法处置及变现的风险。

5）政策调整风险。公募 REITs 存在因相关法律法规或监管机构政策修改等基金管理人无法控制的因素的变化，使基金或投资者利益受到影响的风险，例如：公募 REITs 运作过程中可能涉及基金持有人、公募基金、资产支持证券、项目公

司等多层面税负，如果国家税收等政策发生调整，可能影响投资运作与基金收益；监管机构基金估值政策的修改导致基金估值方法的调整而引起基金净值波动；相关法规的修改导致基金投资范围变化，基金管理人为调整投资组合而引起基金净值波动等。

6）利益冲突风险。公募 REITs 基金管理人可能同时管理多支同类型的公募 REITs；公募 REITs 基金管理人聘请的运营管理机构可能持有或为其他同类型的基础设施项目提供运营管理服务；公募 REITs 原始权益人也可能持有或管理其他同类型的基础设施项目等。由于上述情况，公募 REITs 的关联方可能与公募 REITs 存在一定的利益冲突。

7）估值风险。基础设施资产的评估以收益法为主，收益法进行估价时需要测算收益期、测算未来收益、确定报酬率或者资本化率，并将未来收益折现为现值。由于基础设施资产的评估值是基于相关假设条件测算得到的，估值技术和信息的局限性导致基础设施资产的评估值并不代表对基础设施资产真实的公允价值，也不构成未来可交易价格的保证。在基础设施项目出售的过程中，可能出现成交价格低于估值的情形，对基金财务状况造成不利影响。

8）市场风险。公募 REITs 投资于基础设施资产支持证券的比例不低于 80%，投资于利率债、AAA 级信用债、货币市场工具的比例不超过 20%，因此也面临证券市场价格波动风险，市场风险主要为债券投资风险，包括信用风险、利率风险、收益率曲线风险、利差风险、市场供需风险、购买力风险等。

9）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。

以上所述因素可能会给本基金投资带来特殊交易风险。

5、操作或技术风险

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基金份额持有人的利益受到影响。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/期货交易所、证券/

期货登记结算机构等等。

6、合规性风险

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

7、科创板投资的特别风险

（1）科创板企业所处行业和业务往往具有研发投入规模大、盈利周期长、技术迭代快、风险高以及严重依赖核心项目、核心技术人员、少数供应商等特点，企业上市后的持续创新能力、主营业务发展的可持续性、公司收入及盈利水平等仍具有较大不确定性，投资者应当关注科创板公司盈利能力巨变的风险。

（2）科创板企业可能存在首次公开发行前最近 3 个会计年度未能连续盈利、公开发行并上市时尚未盈利、有累计未弥补亏损等情形，可能存在上市后仍无法盈利、持续亏损、无法进行利润分配等情形。

（3）科创板退市制度较主板更为严格，退市时间更短，退市速度更快；退市情形更多，新增市值低于规定标准、上市公司信息披露或者规范运作存在重大缺陷导致退市的情形；执行标准更严，明显丧失持续经营能力，仅依赖与主业无关的贸易或者不具备商业实质的关联交易维持收入的上市公司可能会被退市。

（4）科创板股票竞价交易设置较宽的涨跌幅限制，首次公开发行上市的股票，上市后的前 5 个交易日不设涨跌幅限制，其后涨跌幅限制为 20%，应当关注可能产生的股价波动的风险。

（5）科创板股票的交易制度与主板存在明显差异。例如上市首日即可作为融资融券标的，与上交所主板市场存在差异，投资者应注意相关风险。科创板股票交易盘中临时停牌情形和严重异常波动股票核查制度与上交所主板市场规定不同，投资者应当关注与此相关的风险。

（6）科创板股票相关法律、行政法规、部门规章、规范性文件和交易所业务规则，可能根据市场情况进行修改，或者制定新的法律法规和业务规则，投资者应当关注规则变化的风险。

8、其他风险

（1）因技术因素而产生的风险，如电脑系统不可靠产生的风险；

（2）因基金业务快速发展而在制度建设、人员配备、内控制度建立等方面

不完善而产生的风险；

（3）因人为因素而产生的风险，如内幕交易、欺诈等行为产生的风险；

（4）对主要业务人员如基金经理的依赖而可能产生的风险；

（5）因战争、自然灾害等不可抗力导致的基金管理人、基金其他销售机构等机构无法正常工作，从而影响基金的申购、赎回按正常时限完成的风险。

二、声明

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

2、除基金管理人直接办理本基金的销售外，本基金还通过基金管理人委托的其他基金销售机构销售，但是，基金资产并不是销售机构的存款或负债，也没有经基金销售机构担保收益，销售机构并不能保证其收益或本金安全。

第十九部分　基金合同的变更、终止与基金财产的清算

一、《基金合同》的变更

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

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

二、《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：

1、基金份额持有人大会决定终止的；

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

3、《基金合同》约定的其他情形；

4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

三、基金财产的清算

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

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

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

4、基金财产清算程序：

（1）《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；

（2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；

（3）对基金财产进行估值和变现；

（4）制作清算报告；

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

（6）将清算报告报中国证监会备案并公告；

（7）对基金剩余财产进行分配。

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

四、清算费用

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

五、基金财产清算剩余资产的分配

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

六、基金财产清算的公告

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

七、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存不低于法律法规规定的最低期限。

第二十部分　基金合同的内容摘要

一、基金份额持有人、基金管理人及基金托管人的权利、义务

（一）基金份额持有人的权利、义务

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

（1）分享基金财产收益；

（2）参与分配清算后的剩余基金财产；

（3）依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；

（4）按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会；

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

（6）查阅或者复制公开披露的基金信息资料；

（7）监督基金管理人的投资运作；

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

（9）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

（1）认真阅读并遵守《基金合同》、招募说明书等信息披露文件；

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

（3）关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；

（4）交纳基金申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；

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

（6）不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；

（7）执行生效的基金份额持有人大会的决议；

（8）返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；

（9）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

（二） 基金管理人的权利与义务

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

（1）依法募集资金；

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

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

（4）销售基金份额；

（5）按照规定召集基金份额持有人大会；

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

（7）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

（8）选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；

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

（10）依据《基金合同》及有关法律规定决定基金收益的分配方案；

（11）在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；

（12）依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；代表本基金份额持有人的利益，参与所持有基金的份额持有人大会，并在遵循本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；

（13）在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；

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

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

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

（17）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

（1）依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的申购、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申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回的价格；

（9）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

（10）编制季度报告、中期报告和年度报告；

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

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

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

（14）按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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

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

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

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

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

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

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

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

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

（24）执行生效的基金份额持有人大会的决议；

（25）建立并保存基金份额持有人名册；

（26）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

（三） 基金托管人的权利与义务

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

（1）自《基金合同》生效之日起，依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产；

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

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

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

（5）提议召开或召集基金份额持有人大会；

（6）在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

（7）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

（1）以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

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

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

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

（5）保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

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

（7）保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露，但向审计、法律等外部专业顾问提供的情况除外；

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

（9）办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

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

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

（12）从基金管理人或其委托的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业监督管理机构，并通知基金管理人；

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

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

（21）执行生效的基金份额持有人大会的决议；

（22）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

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

额拥有平等的投票权。

本基金份额持有人大会不设日常机构。在本基金存续期内，根据本基金的运作需要，基金份额持有人大会可以设立日常机构，日常机构的设立与运作应当根据相关法律法规和中国证监会的规定进行。

（一）召开事由

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

（1）终止《基金合同》；

（2）更换基金管理人；

（3）更换基金托管人；

（4）转换基金运作方式；

（5）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；

（6）变更基金类别；

（7）本基金与其他基金的合并；

（8）变更基金投资目标、范围或策略；

（9）变更基金份额持有人大会程序；

（10）基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；

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

（12）对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

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

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

（1）法律法规要求增加或调整的基金费用的收取；

（2）调整本基金的申购费率、调低赎回费率、基金管理人/基金托管人的报酬标准或变更收费方式；

（3）因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；

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

（5）按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

（二）会议召集人及召集方式

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

2、基金管理人未按规定召集或不能召开时，由基金托管人召集。

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

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

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

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

（三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

（1）会议召开的时间、地点和会议形式；

（2）会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；

（3）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；

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

（5）会务常设联系人姓名及联系电话；

（6）出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；

（7）召集人需要通知的其他事项。

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

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

（四）基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式或法律法规、监管机构允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托证明委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或基金托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

（1）亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的基金份额持有人持有基金份额的凭证及基金份额持有人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；

（2）经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）。若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效的基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之一（含三分之一）。

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式或基金合同约定的其他方式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址或系统。通讯开会应以书面方式或基金合同约定的其他方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

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

（3）本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）；若本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）基金份额的基金份额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基金份额持有人持有基金份额的凭证及基金份额持有人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并与基金登记机构记录相符。

3、在不与法律法规冲突的前提下，基金份额持有人大会亦可采用网络、电话、短信等其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开，会议程序比照现场开会和通讯开会的程序进行。基金份额持有人可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式进行表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

4、在不与法律法规冲突的前提下，基金份额持有人可采用其他书面或非书面方式授权他人代为出席基金份额持有人大会并行使表决权，授权方式可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式，具体方式在会议通知中列明。

（五）议事内容与程序

1、议事内容及提案权

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

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

2、议事程序

（1）现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权

代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的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、基金份额持有人姓名（或单位名称）和联系方式等事项。

（2）通讯开会

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

（六）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

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

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

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

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

（七）计票

1、现场开会

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

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

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

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

2、通讯开会

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

（八）生效与公告

基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

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

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

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

本基金持有的基金召开基金份额持有人大会时，基金管理人应当代表其基金份额持有人的利益，参与所持有基金的基金份额持有人大会，并在遵循本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。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。

法律法规对于本基金参与本基金持有的基金召开基金份额持有人大会的程序或要求另有规定的，从其规定。

（十）实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定

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

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

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

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

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

5、现场开会由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的50%以上（含

50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人；

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

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

侧袋机制实施期间，基金份额持有人大会审议事项涉及主袋账户和侧袋账户的，应分别由主袋账户、侧袋账户的基金份额持有人进行表决，同一主侧袋账户内的每份基金份额具有平等的表决权。表决事项未涉及侧袋账户的，侧袋账户份额无表决权。

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

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

三、基金合同解除和终止的事由、程序

（一）《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。

（二）基金财产的清算

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

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托

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

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

4、基金财产清算程序：

（1）《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；

（2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；

（3）对基金财产进行估值和变现；

（4）制作清算报告；

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

（6）将清算报告报中国证监会备案并公告；

（7）对基金剩余财产进行分配。

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

（三）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。

（四）基金财产清算剩余资产的分配

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

（五）基金财产清算的公告

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

（六）基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存不低于法律法规规定的最低期限。

四、争议解决方式

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，任何一方可将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会上海分会并按其仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为上海市。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，基金合同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。

五、基金合同的存放地和投资者取得基金合同的方式

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

第二十一部分　基金托管协议的内容摘要

一、托管协议当事人

（一）基金管理人

名称：上海国泰海通证券资产管理有限公司

住所：上海市黄浦区中山南路 888 号 8 层

法定代表人：陶耿

成立时间：2010 年 8 月 27 日

批准设立机关：中国证监会

批准设立文号：证监许可【2010】631 号

注册资本：人民币 20 亿元

组织形式：有限责任公司

存续期间：永久存续

（二）基金托管人

名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）

住所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号（邮政编码：200120）

办公地址：上海市长宁区仙霞路 18 号（邮政编码：200336）

法定代表人：任德奇

成立时间：1987 年 3 月 30 日

批准设立机关及批准设立文号：国务院国发(1986)字第 81 号文和中国人民银行银发［1987］40 号文

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字［1998］25 号

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项业务；提供保管箱服务；经国务院银行业

监督管理机构批准的其他业务；经营结汇、售汇业务。

注册资本：742.63 亿元人民币

组织形式：股份有限公司

存续期间：持续经营

二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

（一）基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权

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

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金（包括 QDII 基金、香港互认基金和公开募集基础设施证券投资基金（以下简称“公募 REITs”））、国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板以及其他依法发行上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、证券公司短期公司债券、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具以及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相关规定。

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

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

根据《基金合同》的约定，本基金投资组合比例应符合以下规定：

（1）本基金投资于中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金的资产比例不低于基金资产的80%，其中，股票、股票型基金、混合型基金（混合型基金仅包含以下两类：基金合同约定股票资产投资比例不低于基金资产60%的混合型基金；根据基金披露的定期报告，最近四个季度股票资产占基金资产比例均不低于60%的混合型基金）合计占基金资产的比例为60%-95%，投资于货币市场

基金的资产占基金资产的比例不高于15%；

（2）本基金持有单只基金，其市值不高于本基金资产净值的20%，且不持有其他基金中基金；

（3）本基金应当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）本基金基金管理人管理的全部基金中基金持有单只证券投资基金的比例不超过该被投资证券投资基金净资产的20%，被投资证券投资基金净资产规模以最近定期报告披露的规模为准；

（5）本基金不得持有具有复杂、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；

（6）本基金持有一家公司发行的证券（不含证券投资基金），其市值不超过基金资产净值的10%；

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

（8）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%；

（9）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%；

（10）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%；

（11）本基金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%；

（12）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；

（13）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；

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

（15）本基金投资的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；

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

（17）本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的140%；

（18）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条规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

（19）本基金基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的15%；本基金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%；

（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）法律法规及中国证监会规定的其他投资限制。

因证券市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合上述第（2）、（4）项的，基金管理人应当在20个交易日内进行调整；对于除第（2）、（3）、（4）、（12）、（18）、（20）项外的其他比例限制，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，从其规定。

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

法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

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

（1）承销证券；

（2）违反规定向他人贷款或者提供担保；

（3）从事承担无限责任的投资；

（4）买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；

（5）向其基金管理人、基金托管人出资；

（6）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

（7）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，但中国证监会认可或批准的特殊基金中基金除外；

（8）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

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

在基金合同生效后2个工作日内，基金管理人和基金托管人应相互提供与本机构有控股关系的股东或者与本机构有其他重大利害关系的公司名单，以上名单发生变化的，应及时予以更新并通知对方。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

4.基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同和本协议的约定，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。

（1）基金托管人依据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定对于基金管理人参与银行间市场交易时面临的交易对手资信风险进行监督。

基金管理人向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的银行间市场交易对手的名单。基金托管人在收到名单后2个工作日内电话或回函确认收到该名单。

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

（2）基金管理人参与银行间市场交易时，有责任控制交易对手的资信风险，由于交易对手资信风险引起的损失,基金管理人应当负责向相关责任人追偿。

5.基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同和本协议的约定，对基金管理人银行存款业务进行监督。

本基金投资银行存款应符合如下规定：

（1）基金管理人、基金托管人应当与存款银行建立定期对账机制，确保基金银行存款业务账目及核算的真实、准确。

（2）基金管理人与基金托管人应根据相关规定，就本基金银行存款业务另行签订书面协议，明确双方在相关协议签署、账户开设与管理、投资指令传达与执行、资金划拨、账目核对、到期兑付、文件保管以及存款证实书的开立、传递、保管等流程中的权利、义务和职责，以确保基金财产的安全，保护基金份额持有人的合法权益。

（3）基金托管人应加强对基金银行存款业务的监督与核查，严格审查、复核相关协议、账户资料、投资指令、存款证实书等有关文件，切实履行托管职责。

（4）基金管理人与基金托管人在开展基金存款业务时，应严格遵守《基金法》、《运作办法》等有关法律法规，以及国家有关账户管理、利率管理、支付结算等的各项规定。

6.基金托管人对基金投资流通受限证券的监督

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

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

（3）基金管理人应在基金首次投资流通受限证券前,向基金托管人提供经基

金管理人董事会批准的有关基金投资流通受限证券的投资决策流程、风险控制制度。基金投资非公开发行股票,基金管理人还应提供基金管理人董事会批准的流动性风险处置预案。上述资料应包括但不限于基金投资流通受限证券的投资额度和投资比例控制情况。 基金管理人应至少于首次执行投资指令之前两个工作日将上述资料书面发至基金托管人,保证基金托管人有足够的时间进行审核。基金托管人应在收到上述资料后两个工作日内,以书面或其他双方认可的方式确认收到上述资料。

（4）基金投资流通受限证券前,基金管理人应向基金托管人提供符合法律法规要求的有关书面信息,包括但不限于拟发行证券主体的中国证监会批准文件、发行证券数量、发行价格、锁定期，基金拟认购的数量、价格、总成本、总成本占基金资产净值的比例、已持有流通受限证券市值占资产净值的比例、资金划付时间等。基金管理人应保证上述信息的真实、完整,并应至少于拟执行投资指令前两个工作日将上述信息书面发至基金托管人,保证基金托管人有足够的时间进行审核。

（5）基金托管人应对基金管理人提供的有关书面信息进行审核，基金托管人认为上述资料可能导致基金投资出现风险的,有权要求基金管理人在投资流通受限证券前就该风险的消除或防范措施进行补充书面说明,并保留查看基金管理人风险管理部门就基金投资流通受限证券出具的风险评估报告等备查资料的权利。否则,基金托管人有权拒绝执行有关指令。因拒绝执行该指令造成基金财产损失的,基金托管人不承担任何责任,并有权报告中国证监会。

如基金管理人和基金托管人无法达成一致,应及时上报中国证监会请求解决。如果基金托管人切实履行监督职责,则不承担任何责任。

7.基金托管人根据法律法规的规定及《基金合同》和本协议的约定，对基金投资其他方面进行监督。

（二）基金托管人应根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金资产净值计算、各类基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确认、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查。如果基金管理人未经基金托管人的审核擅自将不实的业绩表现数据印制在宣传推介材料上，则基金托管人对此不承担任何责任，并有权在发现后

报告中国证监会。

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

基金托管人发现基金管理人的投资指令或实际投资运作违反《基金法》及其他有关法规、《基金合同》和本协议规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对，并以电话或书面形式向基金托管人反馈，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人有权报告中国证监会。

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

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

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

三、基金管理人对基金托管人的业务核查

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

基金管理人定期和不定期地对基金托管人保管的基金资产进行核查。基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金

管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复并改正。

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

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

四、基金财产的保管

（一）基金财产保管的原则

1.基金托管人应安全保管基金财产，未经基金管理人的指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何资产。

2.基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。

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

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

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

（二）基金的银行存款账户的开立和管理

1.基金托管人应负责本基金银行存款账户的开立和管理。

2.基金托管人以本基金的名义在其营业机构开立基金的银行存款账户，并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托管

人保管和使用。

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

4.基金托管人可以通过申请开通本基金银行账户的企业网上银行业务进行资金支付，并使用交通银行企业网上银行（简称“交通银行网银”）办理托管资产的资金结算汇划业务。

5.基金银行存款账户的管理应符合银行业监督管理机构的有关规定。

（三）基金证券交收账户、资金交收账户的开立和管理

基金托管人以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司开立证券账户。

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

基金管理人不得对基金证券交收账户、资金交收账户进行证券的超卖或超买。

证券账户资产的管理和运用由基金管理人负责。

基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户即资金交收账户，用于证券交易资金的结算。基金托管人以本基金的名义在基金托管人处开立基金的证券交易资金结算的二级结算备付金账户。

（四）债券托管账户的开立和管理

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

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

（五）基金账户的开立和管理

基金管理人在销售机构以本基金名义开立基金账户，基金管理人在基金销售机构预留的基金赎回款项和现金分红款项的指定收款账户应是本基金的银行存款账户。基金托管人提供必要的协助。

基金管理人应在基金账户开立完成后以书面形式向基金托管人提供基金账户信息，并定期提供对账单等书面资料。基金管理人应向基金托管人提供所持仓基金的公司网站的登录用户和密码，用于下载基金交易确认数据和查询基金持仓数据。

（六）基金投资银行存款账户的开立和管理

存款账户必须以基金名义开立，账户名称为基金名称，存款账户开户文件上加盖预留印鉴（须包括基金托管人印章）及基金管理人公章。

本基金投资银行存款时，基金管理人应当与存款银行签订具体存款协议/存款确认单据，明确存款的类型、期限、利率、金额、账号、对账方式、支取方式、存款到期指定收款账户等细则。

为防范特殊情况下的流动性风险，存款协议中应当约定提前支取条款。

（七）其他账户的开立和管理

若中国证监会或其他监管机构在本托管协议订立日之后允许基金从事其他投资品种的投资业务，涉及相关账户的开立、使用的，由基金管理人协助基金托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定，开立有关账户。该账户按有关规则使用并管理。

（八）基金财产投资的有关实物证券、银行存款定期存单等有价凭证的保管

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

银行存款定期存单等有价凭证由基金托管人负责保管。

基金托管人负责对存款证实书进行保管，不负责对存款证实书真伪的辨别，不承担存款证实书对应存款的本金及收益的安全保管责任。

（九）与基金财产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同的原件分别由基金托管人、基金管理人保管，相关业务程序另有限制除外。除本协议另有规定外，基

金管理人在代基金签署与基金有关的重大合同时应尽可能保证持有二份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件，基金管理人应及时将正本送达基金托管人处。合同的保管期限按照国家有关规定执行。对于无法取得二份以上的正本的，基金管理人应向基金托管人提供加盖授权业务章的合同传真件，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、基金资产净值计算与复核

（一）基金资产净值及基金份额净值的计算与复核

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

基金管理人应每个估值日对基金资产估值。估值原则应符合《基金合同》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》及其他法律、法规的规定。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交易结束后计算当日的基金资产净值和各类基金份额净值，以约定方式发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核后，将复核结果反馈给基金管理人，由基金管理人对基金净值予以公布。

本基金按以下方法估值：

1、对于未在交易所上市的证券投资基金的估值

（1）本基金投资的境内非货币市场基金，按所投资基金估值日的份额净值估值。

（2）本基金投资的境内货币市场基金，按所投资基金前一估值日后至估值日期间（含节假日）的万份收益计提估值日基金收益；如所投资基金披露份额净值，则按所投资基金的基金管理人披露的估值日份额净值进行估值。

2、对于在交易所上市的证券投资基金的估值

（1）本基金投资的交易型开放式指数基金（ETF），按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份额净值估值。

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

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

3、对于证券投资基金特殊情况的估值处理

如遇所投资的证券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）若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，基金管理人将根据份额净值或收盘价、单位基金份额分红金额、折算拆分比例、持仓份额等因素合理确定公允价值。

4、证券交易所上市的有价证券（不含证券投资基金）的估值

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

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

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

（4）交易所上市交易的可转换债券以每日收盘价作为估值全价；

（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。

5、处于未上市期间的有价证券（不含证券投资基金）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。

6、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。

7、同一债券或股票同时在两个或两个以上市场交易的，按债券或股票所处的市场分别估值。

8、同业存单按估值日第三方估值机构提供的估值净价估值；选定的第三方估值机构未提供估值价格的，按成本估值。

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

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

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

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

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对基金净值的计算结果对外予以公布。由此给基金份额持有人和基金造成损失以及因该交易日基金资产净值计算顺延错误而引起损失的，基金托管人不承担赔偿责任。

（二）净值差错处理

当发生净值计算错误时，由基金管理人负责处理，由此给基金份额持有人和基金造成损失的，由基金管理人对基金份额持有人或者基金先行支付赔偿金。基金管理人和基金托管人应根据实际情况界定双方承担的责任，经确认后按以下条款进行赔偿。

1.如采用本协议第八章“基金资产净值及基金份额净值的计算与复核”中估值方法的第1－8、10、11进行处理时，若基金管理人净值计算出错，基金托管人在复核过程中没有发现，且造成基金份额持有人损失的，应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金，就实际向投资者或基金支付的赔偿金额，由基金管理人与基金托管人按照管理费率和托管费率的比例各自承担相应的责任；

2.如基金管理人和基金托管人对基金份额净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对，尚不能达成一致时，为避免不能按时公布基金份额净值的情形，以基金管理人的计算结果对外公布，由此给基金份额持有人和基金造成的损失以及因该交易日基金资产净值计算顺延错误而引起的损失，由基金管理人负责赔付，基金托管人不负赔偿责任；

3.基金管理人、基金托管人按基金合同约定的估值方法第9项进行估值时，

所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

针对净值差错处理，如果法律法规或证监会有新的规定，则按新的规定执行；如果行业有通行做法，在不违背法律法规且不损害投资者利益的前提下，双方应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则重新协商确定处理原则。

（三）基金会计制度

按国家有关部门制定的会计制度执行。

（四）基金账册的建立

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

（五）会计数据和财务指标的核对

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

（六）基金定期报告的编制和复核

基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。月度报表的编制，应于每月终了后5个工作日内完成。定期报告文件应按中国证监会的要求公告。季度报表的编制，应于每季度终了后15个工作日内完成。中期报告在会计年度前6个月结束后的两个月内公告；年度报告在会计年度结束后三个月内公告。

基金管理人在月初3个工作日内完成上月度报表的编制，经盖章后，以约定方式将有关报表提供基金托管人；基金托管人收到后在2个工作日内进行复核，并将复核结果及时书面或双方约定的其他方式通知基金管理人。对于季度报告、中期报告、年度报告等定期报告，基金管理人和基金托管人应在上述监管部门规定的时间内完成编制、复核及公告。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。如果基金管理人与基金托管人不能于应当发布公告之日前就相关报表达成一致，基金管理人有权按照其编制的报表对外发布公告，基

金托管人有权就相关情况报证监会备案。

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

六、基金份额持有人名册的保管

基金管理人可委托登记机构登记和保管基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容包括但不限于基金份额持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册，包括权益登记日的基金份额持有人名册、基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册、每年最后一个交易日的基金份额持有人名册，由登记机构负责编制和保管，并对基金份额持有人名册的真实性、完整性和准确性负责。

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

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

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

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

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

基金托管人以电子版形式妥善保管基金份额持有人名册，并定期刻成光盘备份，保存期限为不低于法律法规规定的最低期限。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。若基金管理人或基金托管人由于自身原因无法妥善保管基金份额持有人名册，应按有关法规规定各自承担相应的责任。

七、争议解决方式

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，任何一方可将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会上海分会并按其仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为上海市。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，本托管协议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。

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

八、托管协议的修改与终止

（一）托管协议的变更

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

（二）托管协议的终止

1.《基金合同》终止；

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

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

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

（三）基金财产的清算

1.基金财产清算小组：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。

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

（2）基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清

理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

2.基金财产清算程序：

（1）《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；

（2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；

（3）对基金财产进行估值和变现；

（4）制作清算报告；

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

（6）将清算报告报中国证监会备案并公告；

（7）对基金剩余财产进行分配。

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

3.清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金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。

4.基金财产清算剩余资产的分配

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

5.基金财产清算的公告

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

6.基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存不低于法律法规规定的最低期限。

第二十二部分　对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务。以下是主要的服务内容，基金管理人根据基金份额持有人的需要和市场的变化，有权增加、修改服务项目：

一、基金份额持有人交易记录查询服务

本基金份额持有人可通过基金管理人的官方网站（www.gthtzg.com）和网上直销系统（国泰海通资管APP）查询历史交易记录。

二、基金份额持有人的对账单服务

基金管理人至少每年度以电子邮件、短信或其他电子形式向通过基金管理人直销机构持有基金管理人基金份额的持有人提供基金保有情况信息，基金份额持有人也可通过网上直销系统（国泰海通资管APP）查询对账单。

由于持有人提供的邮寄地址、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前述服务无法按时或准确送达。因上述原因无法正常获得前述服务的持有人，敬请及时通过基金管理人官方网站或网上直销系统（国泰海通资管APP），或拨打基金管理人客服热线查询、核对、变更您的预留联系方式。

三、资讯服务

1、客户服务电话

投资者如果想了解基金产品、服务等信息，或反馈投资过程中需要投诉与建议的情况，可拨打如下电话：95521。

2、基金管理人官方网站

www.gthtzg.com

3、基金管理人网上直销系统

投资者可以在应用市场搜索“国泰海通资管”，或者扫描下方二维码，下载国泰海通资管APP，了解基金产品、服务等信息。

国泰海通资管APP下载二维码

如本招募说明书存在任何您/贵机构无法理解的内容，请通过上述客户服务电话或其他方式联系基金管理人。请确保投资前，您/贵机构已经全面理解了本招募说明书。

第二十三部分 其他应披露事项

本基金的其他应披露事项将严格按照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》等相关法律法规规定的内容与格式进行披露，并在指定媒介上公告。

以下为基金管理人在招募说明书更新期间刊登的与本基金相关的公告。

序号	公告事项	披露方式	披露日期
1	国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)（A 类份额）基金产品资料概要更新	证监会指定网站、公司官网	2025-03-20
2	国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)（C 类份额）基金产品资料概要更新	证监会指定网站、公司官网	2025-03-20
3	国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)招募说明书（更新）（2025 年第 1 号）	证监会指定网站、公司官网	2025-03-20
4	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）	证监会指定网站、公司官网	2025-03-29
5	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金 2024 年年度报告提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2025-03-31
6	国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)2024 年年度报告	证监会指定网站、公司官网	2025-03-31
7	国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)2025 年第 1 季度报告	证监会指定网站、公司官网	2025-04-22
8	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金 2025 年 1 季度报告提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2025-04-22
9	上海国泰君安证券资产管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、证监会指定网站、公司官网、上交所	2025-04-26
10	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于办公地址变更的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、证监会指定网站、公司官网、上交所	2025-04-30

11	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于旗下基金持有停牌股票估值调整的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、证监会指定网站、公司官网	2025-06-11
12	国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)基金经理变更公告	上海证券报、证监会指定网站、公司官网	2025-06-17
13	国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)（A 类份额）基金产品资料概要更新	证监会指定网站、公司官网	2025-06-17
14	国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)（C 类份额）基金产品资料概要更新	证监会指定网站、公司官网	2025-06-17
15	国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)招募说明书（更新）（2025 年第 2 号）	证监会指定网站、公司官网	2025-06-17
16	国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)2025 年第 2 季度报告	证监会指定网站、公司官网	2025-07-21
17	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金 2025 年 2 季度报告提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2025-07-21
18	上海国泰海通证券资产管理有限公司关于基金管理人法定名称、住所变更的公告	证监会指定网站、公司官网、上交所	2025-07-25
19	上海国泰海通证券资产管理有限公司关于基金管理人法定名称、住所变更的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2025-07-26
20	国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)（A 类份额）基金产品资料概要更新	证监会指定网站、公司官网	2025-08-02
21	国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)（C 类份额）基金产品资料概要更新	证监会指定网站、公司官网	2025-08-02
22	国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)招募说明书（更新）（2025 年第 3 号）	证监会指定网站、公司官网	2025-08-02
23	关于上海国泰海通证券资产管理有限公司管理人官网地址变更的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、证监会指定网站、公司官网、上交所	2025-08-09
24	上海国泰海通证券资产管理有限	上海证券报、中国	2025-08-27

	公司关于吸收合并事项通知债权人的公告	证券报、证券时报、证券日报、证监会指定网站、公司官网、上交所	
25	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金 2025 年中期报告提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2025-08-29
26	国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)2025 年中期报告	证监会指定网站、公司官网	2025-08-29
27	上海国泰海通证券资产管理有限公司关于旗下基金持有停牌股票估值调整的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、证监会指定网站、公司官网	2025-09-05
28	上海国泰海通证券资产管理有限公司关于旗下基金更名事宜的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、证监会指定网站、公司官网、上交所	2025-09-26
29	国泰海通君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)（A 类份额）基金产品资料概要更新	证监会指定网站、公司官网	2025-09-29
30	国泰海通君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)（C 类份额）基金产品资料概要更新	证监会指定网站、公司官网	2025-09-29
31	国泰海通君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)招募说明书（更新）（2025 年第 4 号）	证监会指定网站、公司官网	2025-09-29
32	国泰海通君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)基金合同	证监会指定网站、公司官网	2025-09-29
33	国泰海通君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)托管协议	证监会指定网站、公司官网	2025-09-29
34	关于上海国泰海通证券资产管理有限公司监事变更的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、证监会指定网站、公司官网、上交所	2025-10-14
35	国泰海通君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)2025 年第 3 季度报告	证监会指定网站、公司官网	2025-10-28
36	上海国泰海通证券资产管理有限公司旗下基金 2025 年 3 季度报告提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2025-10-28

37	上海国泰海通证券资产管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、证监会指定网站、公司官网、上交所	2025-12-25
38	国泰海通君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)2025 年第 4 季度报告	证监会指定网站、公司官网	2026-01-22
39	上海国泰海通证券资产管理有限公司旗下基金 2025 年 4 季度报告提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2026-01-22
40	在本报告期内刊登的其他公告		

第二十四部分　招募说明书的存放及查阅方式

本招募说明书存放在基金管理人和销售机构的办公场所和营业场所，投资者可免费查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

第二十五部分　备查文件

（一）中国证监会准予国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)集合资产管理计划变更为国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)的文件

（二）国泰海通君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)基金合同

（三）国泰海通君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)托管协议

（四）法律意见书

（五）基金管理人业务资格批件、营业执照

（六）基金托管人业务资格批件、营业执照

（七）中国证监会要求的其他文件

上述备查文件存放在基金管理人和其他销售机构的办公场所和营业场所，投资者可免费查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

基金管理人：上海国泰海通证券资产管理有限公司