

东海祥龙定增灵活配置混合型证券投资基金上市交易公告书

基金管理人：东海基金管理有限责任公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

注册登记机构：中国证券登记结算有限责任公司

上市地点：深圳证券交易所

上市时间：2017年2月27日

公告日期：2017年2月22日

目录

一、重要声明与提示.....	1
二、基金概览.....	1
三、基金的募集与上市交易.....	2
四、持有人数量、持有人结构及前十名持有人情况.....	4
五、基金主要当事人简介.....	5
六、基金合同摘要.....	7
七、基金财务状况.....	7
八、基金投资组合.....	8
九、重大事件揭示.....	11
十、基金管理人承诺.....	11
十一、基金托管人承诺.....	

11

十二、基金上市推荐人意见.....

11

十三、备查文件目录.....

12

附件：东海祥龙定增灵活配置混合型证券投资基金基金合同内容摘要.....

13

1

一、重要声明与提示

《东海祥龙定增灵活配置混合型证券投资基金上市交易公告书》（以下简称“本
公告

书”）依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、
《证券投资

基金信息披露内容与格式准则第 1 号<上市交易公告书的内容与格式>和《深
圳证券交易

所证券投资基金上市规则》的规定编制，东海祥龙定增灵活配置混合型证券投资
基金（以下

简称“本基金”）管理人保证本公告书所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或
者重大遗漏，

并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本基金托管人保证本公告书中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整
性，承

诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和深圳证券交易所（以下
简称“深

交所”）对本基金上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。

本公告书第七节“基金财务状况”未经审计。

凡本公告书未涉及的有关内容，请投资者详细查阅《东海祥龙定增灵活配置混合
型证券

投资基金招募说明书》（以下简称“招募说明书”）。

二、基金概览

- 1、基金名称：东海祥龙定增灵活配置混合型证券投资基金
- 2、基金简称：东海祥龙定增混合
- 3、基金场内简称：东海祥龙
- 4、交易代码：168301
- 5、截至 2017 年 2 月 20 日基金份额总额：863,058,457.47 份。
- 6、截至 2017 年 2 月 20 日基金份额净值：1.0009 元。
- 7、本次上市交易份额：306,637,170.00 份。（截止 2017 年 2 月 20 日）
- 8、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所。
- 9、上市交易日期：2017 年 2 月 27 日
- 10、基金管理人：东海基金管理有限责任公司
- 11、基金托管人：中国工商银行股份有限公司
- 12、本次上市交易的基金份额注册登记机构：中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司
- 13、上市推荐人：无

2

三、基金的募集与上市交易

（一）本次基金上市前的募集

- 1、基金募集申请的核准机构和核准文号：中国证券监督管理委员会证监许可[2016]2305号。
- 2、基金运作方式：契约型，本基金在封闭期内不办理申购与赎回业务，但投资人可在本基金上市交易后通过深圳证券交易所转让基金份额；封闭期届满后，本基金转换为上市开放式基金，并更名为东海祥龙灵活配置混合型证券投资基金（LOF），投资人可在基金开放日办理申购和赎回业务。
本基金的封闭期是指自《基金合同》生效之日起（包括《基金合同》生效之日）至第 18 个月后对应日（含该日）的期间，如遇非工作日或无该对应日的，则顺延至下一个工作

日。

3、基金合同期限：不定期

4、发售日期：2016 年 11 月 16 日起至 2016 年 12 月 13 日

5、发售价格：1.00 元人民币

6、发售方式：本基金通过场内、场外两种方式公开发售。

7、发售机构：

（1）场外销售机构：

1) 直销机构：东海基金管理有限责任公司直销中心

2) 其他销售机构：东海证券股份有限公司、中国工商银行股份有限公司、江南农村商

业银行股份有限公司、东海期货有限责任公司、华鑫证券有限责任公司、兴业证
券股份有限

公司、海通证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、德邦证券股份有限
公司、国泰

君安证券股份有限公司、恒泰证券股份有限公司、金元证券股份有限公司、上海
好买基金销

售有限公司、上海天天基金销售有限公司、诺亚正行（上海）基金销售投资顾问
有限公司、

泰诚财富基金销售（大连）有限公司、嘉实财富管理有限公司、浙江同花顺基金
销售有限公

司、北京钱景财富投资管理有限公司、上海联泰资产管理有限公司、上海陆金所
资产管理有

限公司、北京展恒基金销售有限公司、蚂蚁（杭州）基金销售有限公司。

（2）场内销售机构：

场内销售机构为具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员单位，具体名单可
在深交

所网站查询。

8、验资机构名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

9、募集资金总额及入账情况：

本次募集的净认购金额为 862,817,779.65 元人民币，认购款项在本基金验资确
认日之

前产生的银行利息共计 240,677.82 元人民币。本次募集所有资金已于 2016 年
12 月 21 日全 3

额划入本基金托管专户。

本基金通过场外、场内两种方式公开发售，本次募集有效认购总户数为 5,961 户，按照

每份基金份额面值 1.00 元人民币计算，募集期募集资金及利息结转的基金份额共计

863,058,457.47 份，其中场外认购的基金份额为 556,421,287.47 份；场内认购的基金份额

为 306,637,170 份。

10、本基金募集备案情况：根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投

资基金运作管理办法》等相关法律、法规的规定以及《东海祥龙定增灵活配置混合型证券投

资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）的有关约定，本基金募集结果符合备案条件，

东海基金管理有限责任公司（以下简称“本基金管理人”）已向中国证监会办理完毕基金备

案手续，并于 2016 年 12 月 21 日获中国证监会书面确认，本基金合同自该日起正式生效。

基金合同生效之日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

11、基金合同生效日：2016 年 12 月 21 日

12、基金合同生效日的基金份额总额：863,058,457.47 份。

（二）基金上市交易的主要内容

1、本基金上市交易的核准机构和核准文号：深圳证券交易所深证上[2017]127 号

2、上市交易日期：2017 年 2 月 27 日

3、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所。投资者在深圳证券交易所各会员单位证

券营业部均可参与基金交易。

4、基金简称：东海祥龙定增混合

5、基金场内简称：东海祥龙

6、交易代码：168301

7、本次交易份额：306,637,170 份（截止 2017 年 2 月 20 日）

8、基金资产净值的披露：基金管理人每个交易日对基金资产估值。用于基金信

息披露

的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算,基金托管人复核。基金管理人于每个交易日交易结束后将经过基金托管人复核的基金净值传给深交所,深交所于下一个交易日进行揭示。

9、未上市交易份额的流通规定:

登记在中国证券登记结算有限责任公司注册登记系统中的场外基金份额,通过办理跨系

统转托管业务将基金份额转至场内证券登记结算系统后,方可上市交易。

10、本基金开通跨系统转托管业务日期:2017年2月27日,具体业务按照中国证券登

记结算有限责任公司的相关规定办理。

4

四、持有人数量、持有人结构及前十名持有人情况

(一)基金份额持有情况

截至2017年2月20日的东海祥龙持有情况:

本基金募集总份额为863,058,457.47份,本基金持有人数量为5,956人,其中机构投

资者14人,共计持有本基金份额89,400,969.94份,占基金发行比例

10.36%;个人投资者

5,942人,共计持有本基金份额773,657,487.53份,占基金发行比例

89.64%。

本基金场内募集份额为306,637,170.00份,场内基金份额持有人数量为2,158人。场

内机构投资者持有本基金份额4,220,336.00份,占本基金总份额的0.49%;场内个人投资

者持有本基金份额302,416,834.00份,占本基金总份额的35.04%。

本基金场外募集份额为556,421,287.47份,场外基金份额持有人数量为3,798人。场

外机构投资者持有本基金份额85,180,633.94份,占本基金总份额的9.87%;

场外个人投资

者持有本基金份额471,240,653.53份,占本基金总份额的54.6%。

(二) 截止 2017 年 2 月 20 日, 本基金场内前十名持有人情况:

序号 持有人名称(全称) 持有基金份额(份) 占场内总份额比(%)

- 1 鲁涛 24,000,933.00 7.83%
- 2 郭新民 10,002,333.00 3.26%
- 3 张孔沛 7,921,307.00 2.58%
- 4 祁培丽 5,999,933.00 1.96%
- 5 陈洪发 5,000,097.00 1.63%
- 6 惠晓荣 4,250,413.00 1.39%
- 7 陈宗林 3,000,174.00 0.98%
- 8 庄瑞绵 3,000,058.00 0.98%
- 9 林坤 2,839,110.00 0.93%
- 10 陈桂华 2,700,226.00 0.88%

(三) 截止到 2017 年 2 月 20 日, 基金管理人的从业人员持有本基金份额的情况

本基金管理人的基金从业人员持有本基金份额总量为 836,874.63 份, 占该基金总份额

的比例为 0.09697%。其中, 本基金管理人高级管理人员、基金投资和部门负责人持有

该只基金份额总量为 0 份, 该只基金的基金经理未持有该只基金。 5

五、基金主要当事人简介

(一) 基金管理人

1、名称: 东海基金管理有限责任公司

2、法定代表人: 葛伟忠

3、总经理: 刘建锋

4、注册资本: 1.5 亿元人民币

5、注册地址: 上海市虹口区丰镇路 806 号 3 幢 360 室

6、设立批准文号: 中国证监会《关于核准设立东海基金管理有限责任公司的批复》(证

监许可[2013]179 号)

7、工商登记注册的法人营业执照文号: 91310000062562113E

8、经营范围: 基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可

的其他业务。

9、股权结构：目前公司股东为东海证券股份有限公司，持有股份 45%；深圳鹏博实业集团有限公司，持有股份 30%；苏州市相城区江南化纤集团有限公司，持有股份 25%。

10、内部控制体系

董事会负责控制公司整体运营风险。董事会通过控制公司治理结构风险、制定基本管理

制度、完善有关议事规则及充分发挥独立董事的作用达到对风险的最终控制。

公司管理层在总经理领导下，认真执行董事会确定的内部控制战略，为有效贯彻公司董

事会制定的经营方针及发展战略，设立了投资决策委员会和风险控制委员会，就基金投资和

风险控制等发表专业意见及建议。

公司设立督察长，负责对公司和基金的内部控制和管理情况进行全面监督，对公司保持

各项管理制度的合法性、合理性、有效性和完备程度进行检查并督促改进，发现重大问题及

时向公司董事会、中国证监会及相关派出机构报告。

监察稽核部是公司对各项经营管理活动进行合规管理和风险控制的职能部门。监察稽核

部对公司各职能部门在业务运作中的遵纪守法情况进行监督和检查，保证公司为控制风险所

制定的各项管理制度切实得到贯彻和执行。

公司各职能部门是公司内部控制措施的具体执行单位，在法律、法规和公司各项基本管

理制度的基础上，依据具体情况制定部门的管理办法、操作流程及风险控制方法，并督导部

门员工严格执行。基金投资管理、基金运作、市场等业务部门有明确的授权分工，各部门的

操作相互独立，并且有独立的报告系统。各业务部门内部工作岗位分工合理、职责明确，形

成相互监督、相互制约的关系，以减少舞弊或差错发生的风险。 6

11、人员情况：

截止到 2016 年 12 月 31 日，公司总人数为 77 人，其中研究员和基金经理超过 94.12%

拥有硕士及以上学位。

12、信息披露负责人：王恒

电话：021-60586966

13、本基金基金经理

胡德军先生，博士。历任齐鲁证券有限公司研究所医药研究员，东海基金管理有限责任公司

公司研究开发部研究员、专户理财部投资经理等职。自 2015 年 10 月 27 日起任东海美丽中

国灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2016 年 12 月 21 日起任东海祥龙定增灵活配

置混合型证券投资基金基金经理。

（二）基金托管人

1、基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号（100032）

设立日期：1984 年 1 月 1 日

批准设立机关和批准设立文号：国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决

定》（国发[1983]146 号）

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币 35,640,625.71 万元

法定代表人：易会满

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】3 号

联系人：洪渊

联系电话：010-66105798

2、主要人员情况

截至 2016 年 9 月末，中国工商银行资产托管部共有员工 210 人，平均年龄 30 岁，95%

以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

3、基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自 1998 年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、企业年金基金、QFII 资产、QDII 资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII 专户资产、ESCROW 等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至 2016 年 9 月，中国工商银行共托管证券投资基金 624 只。自 2003 年以来，本行连续十一年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的 51 项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

（三）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）

住所：北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城安永大楼 16 层

办公地址：北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城安永大楼 16 层

执行事务合伙人：毛鞍宁

联系电话：（010）58153000

传真：（010）85188298

联系人：印艳萍

经办注册会计师：汤骏、印艳萍

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件。

七、基金财务状况

深圳证券交易所在本基金募集期间未收取任何费用。

本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

东海祥龙定增灵活配置混合型证券投资基金截至 2017 年 2 月 20 日资产负债表如下：

资 产 期末余额 负债和所有者权益 期末余额

资 产： 负债：

银行存款 222,034,036.45 短期借款 -

结算备付金 13,611,111.11 交易性金融负债 -

存出保证金 - 衍生金融负债 -

交易性金融资产 68,400,101.45

卖出回购金融资产

款

-

其中：股票投资 68,400,101.45 应付证券清算款

债券投资 应付赎回款 -

应付管理人报酬 709,811.27

应付托管费 118,301.87 8

衍生金融资产 - 应付销售服务费 -

买入返售金融资产 504,300,000.00 应付交易费用 -

应收证券清算款 55,899,690.08 应付税费 -

应收利息 477,679.03 应付利息 -

应收股利 - 应付利润 -

应收申购款 - 其他负债 43,053.41

其他资产 - 负债合计 871,166.55

所有者权益：

实收基金 863,058,457.47

未分配利润 792,994.10

所有者权益合计 863,851,451.57

资产合计：864,722,618.12

负债与持有人权益

总计：

864,722,618.12

注：报告截止日 2017 年 2 月 20 日，本基金的基金份额净值 1.0009 元，基金总份额 863,058,457.47 份，其中场内基金份额 306,637,170.00 份，场外基金份额 556,421,287.47 份。

八、基金投资组合

截至公告前两个工作日即 2017 年 2 月 20 日，东海祥龙定增灵活配置混合型证券投资

基金的投资组合如下：

（一）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 68,400,101.45 7.91

其中：股票 68,400,101.45 7.91

2 固定收益投资

其中：债券

资产支持证券 --

3 金融衍生品投资 --

4 买入返售金融资产 504,300,000.00 58.32

其中：买断式回购的买入返售金融

资产

--

5 银行存款和结算备付金合计 235,645,147.56 27.25

6 其他各项资产 56,377,369.11 6.52

7 合计 864,722,618.12 100.00

(二) 按行业分类的股票投资组合

行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

农、林、牧、渔业 --

采矿业 --

制造业 9

电力、热力、燃气及水生产

和供应业

68,400,101.45 7.92

建筑业

批发和零售业 --

交通运输、仓储和邮政业 --

住宿和餐饮业 --

信息传输、软件和信息技术

服务业

--

金融业 --

房地产业 --

租赁和商务服务业

科学研究和技术服务业 --

水利、环境和公共设施管理

业

--

居民服务、修理和其他服务

业

--

教育 --

卫生和社会工作 --

文化、体育和娱乐业 --

综合 --

合计 68,400,101.45 7.92

(三) 按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

代码 名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例

(%)

000862 银星能源 68,400,101.45 7.92

(四) 按券种分类的债券投资组合

序号 债券品种 公允价值(元) 占基金资产净值比例

(%)

1 国家债券 --

2 央行票据 --

3 金融债券 --

其中：政策性金融债 --

4 企业债券 --

5 企业短期融资券 --

6 中期票据 --

7 可转债(可交换债) --

8 同业存单 --

9 其他 -- 10

10 合计 --

(五) 按公允价值占净值比例大小排序的前五名债券明细

注：截至 2017 年 2 月 20 日，本基金未持有债券。

(六) 按公允价值占净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：截至 2017 年 2 月 20 日，本基金未持有资产支持证券。

(七) 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

注：截至 2017 年 2 月 20 日，本基金未持有贵金属。

(八) 按公允价值占净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：截至 2017 年 2 月 20 日，本基金未持有权证。

(九) 本基金投资的股指期货交易情况说明

注：截至 2017 年 2 月 20 日，本基金未持有股指期货。

(十) 本基金投资的国债期货交易情况说明

注：截至 2017 年 2 月 20 日，本基金未持有国债期货。

(十一) 投资组合报告附注

1、截至 2017 年 2 月 20 日，本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案

调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

2、基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

3、其他各项资产构成

序号 名称 金额（元）

1 存出保证金

-

2 应收证券清算款 55,899,690.08

3 应收股利 -

4 应收利息 477,679.03

5 应收申购款 -

6 其他应收款 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 56,377,369.11

4、截至 2017 年 2 月 20 日，本基金投资持有的处于转股期的可转换债券的说明。

注：截至 2017 年 2 月 20 日，本基金未持有处于转股期的可转换债券

5、截至 2017 年 2 月 20 日，本基金投资前十名股票中存在流通受限情况的说明。

序号 股票代码 股票名称

流通受限部分的

公允价值(元)

占基金资产净

值的比例(%)

流通受限情况说

明 11

1 000862 银星能源 68,400,101.45 7.92 非公开发行认购

6、投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

九、重大事件揭示

截至 2017 年 2 月 20 日，本基金暂无其他对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

十、基金管理人承诺

本基金管理人就本基金上市交易之后履行管理人职责做出如下承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规、基金合同的规定，以诚实信用、勤勉尽责

的原则管理和运用基金资产。

（二）真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件，披露所有对基金

份额持有人有重大影响的信息，并接受中国证监会、证券交易所的监督管理。

（三）在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出

现的或者在市场上流传的消息后，将及时予以公开澄清。

十一、基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，设立专门的基金托

管部，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员负责基金财产托管事宜。

（二）根据《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，对基金的投资范围、基

金资产的投资组合比例、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

报酬的计提和支付等行为进行监督和核查。

（三）基金托管人发现基金管理人的行为违反《基金法》及其他证券法律法规、基金合

同的规定，将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，督促基金管理人改正。

（四）基金托管人发现基金管理人重大违规行为，将立即报告中国证监会，同时通知

基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

十二、基金上市推荐人意见

本基金无上市推荐人。

12

十三、备查文件目录

下列文件存放在本基金管理人和托管人的办公场所，投资者可在办公时间免费查阅；也

可按工本费购买本基金合同复制件或复印件，但应以基金合同正本为准。

（一）中国证监会核准东海祥龙定增灵活配置混合型证券投资基金募集的文件；

（二）《东海祥龙定增灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；

（三）《东海祥龙定增灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；

（四）《东海祥龙定增灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；

（五）法律意见书；

（六）基金管理人业务资格批件、营业执照；

（七）基金托管人业务资格批件、营业执照；

（八）中国证监会要求的其他文件。

东海基金管理有限责任公司

2017年2月22日 13

附件：东海祥龙定增灵活配置混合型证券投资基金基金合同内容摘要

一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

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

金投资者的利益；

(7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

(8) 选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；

(9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基

金合同》规定的费用；

(10) 依据《基金合同》及有关法律法规规定决定基金收益的分配方案；

(11) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；

(12) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基

金财产投资于证券所产生的权利；

(13) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；

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

律行为；

(15) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券、期货经纪商或其他为基金提供服

务的外部机构； 14

(16) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、

转换

等业务规则；

(17) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

(1) 依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的

发售、申购、赎回和登记事宜；

(2) 办理基金备案手续；

(3) 自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；

(4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式

管理和运作基金财产；

(5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理

的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别

记账，进行

证券投资；

(6) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产

为自己及

任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

(7) 依法接受基金托管人的监督；

(8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法

符合《基

金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值，确定基金份

额申购、赎

回的价格；

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(10) 编制季度、半年度和年度基金报告；

(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 15 年以上；

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

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

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

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

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

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

为承担责任；

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

(24) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金

管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后

30 日内退还基金认购人；

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(26) 建立并保存基金份额持有人名册；

(27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(二) 基金托管人的权利与义务

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

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

产；

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

用；

(3) 监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人违反《基金合

同》及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应呈

报中国证监

会，并采取必要措施保护基金投资者的利益； 16

(4) 根据相关市场规则，为基金开设资金账户、证券账户、期货账户等投资所

需账户，

为基金办理证券、期货交易资金清算；

(5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

(6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

- (1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；
- (2) 设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；
- (3) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；
- (4) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；
- (5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
- (6) 按规定开设基金财产的资金账户、证券账户、期货账户等投资所需账户，按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
- (7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；
- (8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、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、半年度和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行；如果基金管理人未执行《基金合同》规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；
- (11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；
- (12) 建立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。

(三) 基金份额持有人的权利和义务

基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受，基

金投资

者自依据《基金合同》取得基金份额，即成为本基金份额持有人和《基金合同》

的当事人，

直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为《基金合同》当事人并不以在《基

金合同》上书面签章或签字为必要条件。

每份基金份额具有同等的合法权益。

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包

括但不限

于：

(1) 分享基金财产收益；

(2) 参与分配清算后的剩余基金财产；

(3) 依法申请赎回或转让其持有的基金份额；

- (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。 18

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

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) 缴纳基金认购、申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；
- (5) 在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；
- (6) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；
- (7) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- (8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

二、基金份额持有人大会

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表

基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

本基金份额持有人大会不设日常机构。

(一) 召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会，但法律

法规、

中国证监会另有规定或基金合同另有约定的除外：

- (1) 终止《基金合同》；
- (2) 更换基金管理人；
- (3) 更换基金托管人；
- (4) 转换基金运作方式；
- (5) 调整基金管理人、基金托管人的报酬标准；
- (6) 变更基金类别；
- (7) 本基金与其他基金的合并；
- (8) 变更基金投资目标、范围或策略；
- (9) 变更基金份额持有人大会程序；
- (10) 终止基金份额上市，但因本基金不再具备上市条件而被深圳证券交易所终

止上市

的除外； 19

- (11) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；

(12) 单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以

基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人

大会；

- (13) 对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

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

的事项。

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

- (1) 法律法规要求增加的基金费用的收取；

(2) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内且对现有基金份额持有人利益无实质性

不利影响的前提下调整本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式；

(3) 因相应的法律法规、深圳证券交易所或登记机构的相关业务规则发生变动而应当

对《基金合同》进行修改；

(4) 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金

金合同》当事人权利义务关系发生重大变化；

(5) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内且对现有基金份额持有人利益无实质性

不利影响的前提下调整本基金份额类别的设置；

(6) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内且对现有基金份额持有人利益无实质性

不利影响的前提下推出新业务或服务；

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

(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；

集；

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集；

3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提

议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。

基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，

基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集，并自出具书面决定之日起 60

日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合；

4、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额 20

额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10

日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。

基金管理人

决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份

额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提

议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基

金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60

日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合；

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

有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表基金份额 10%以上（含

10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。基金份额持有

人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干

扰；

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

（三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 30 日，在指定媒介公告。

基金份

额持有人大会通知应至少载明以下内容：

（1）会议召开的时间、地点和会议形式；

（2）会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；

（3）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；

（4）授权委托证明的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限

等）、送达时间和地点；

（5）会务常设联系人姓名及联系电话；

（6）出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；

（7）召集人需要通知的其他事项。

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知中说明本次

基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、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 21

到指定地点对表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对表决意见的

计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。

（四）基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式或法律法规、监管机构允许的

其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托证明委派代表出席，

现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人

或基金托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行

基金份额持有人大会议程：

（1）亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份

额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，

并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；

（2）经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金

份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）；若到会者在权益登

记日代表的有效的基金份额少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一，召

集人可以在

原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内，就原定审议事项重新召集

基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效的基

金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之一（含三分之一）。

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以会议通知载明的

形式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

示性公告；

（2）召集人按基金合同约定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管

理人）到指定地点对表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人（如果基金托管人

为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持

有人的表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取表决意见的，不影响表决效力；

（3）本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的，基金份额持有人所持有

的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）；若本人直接出具表

决意见或授权他人代表出具表决意见基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日22

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（含三分之一）以上基金份额的持有人直接出具表决意见或授权他人

代表出具表决意见；

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

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

4、在会议召开方式上，本基金亦可采用其他非现场方式或者以现场方式与非现场相结合的方式召开基金份额持有人大会，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。

(五) 议事内容与程序

1、议事内容及提案权

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

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

2、议事程序

(1) 现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人，

然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人

授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权

其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，

则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）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。 23

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

称）、身份证明文件号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）和

联系方式等事项。

（2）通讯开会

在通讯开会的情况下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后 2

个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

（六）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1、一般决议，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分

之一以上（含二分之一）通过方为有效；除下列第 2 项所规定的须以特别决议通过事项以外

的其他事项均以一般决议的方式通过。

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三

分之二以上（含三分之二）通过方可做出。除基金合同另有约定外，转换基金运

作方式、更

换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》、本基金与其他基金合并以特别决议通过

方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通

知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的表

决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具表决

意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

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

决。

（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 24

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异议，

可以在

宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点以

一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

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

影响计票的效力。

2、通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权

代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关

对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对表决意见的计票进行监督的，

不影响计票和表决结果。

（八）生效与公告

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

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 个工作日内在指定媒介上公告。如果采用通讯

方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员

姓名等一同公告。

基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决议。

生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束

力。

（九）本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规

定，凡是直接引用法律法规的部分，如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的，基

金管理人与基金托管人协商一致并提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需

召开基金份额持有人大会审议。

三、基金的投资

（一）投资目标

本基金将在严格控制风险的前提下，充分挖掘和利用市场中潜在的投资机会，力争实现

基金资产的长期稳定增值。 25

（二）投资范围

本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（含主板、中小板、创业板及其他经中

国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期

票据、短期融资券、中小企业私募债、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、次级债）、

资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、权证、股指期货、国债期货以及法律

法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）

。

如果法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金管理人在履行适当程序后，

可以将其纳入本基金的投资范围。

基金的投资组合比例为：封闭期内，股票资产占基金资产的比例范围为 0%-100%，非公

开发行股票资产占非现金基金资产的比例不低于 80%；每个交易日日终在扣除国债期货和股

指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；转换为上市开

放式基金（LOF）后，股票资产占基金资产的比例范围为 0%-95%，每个交易日日终在扣除国

债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券投资比

例合计不低于基金资产净值的 5%。

（三）投资策略

1. 本基金在基金合同生效后的 18 个月内（含第 18 个月），通过对宏观经济，行业轮动效

应与定向增发项目优势的深入研究，充分挖掘和利用市场中的潜在机会，，优选能够改善、

提升企业基本面与经营状况的定向增发股票进行投资，形成以定向增发为核心的投资策略。

（1）类别资产配置策略

本基金根据各类资产的市场趋势和预期收益风险的比较判别，对股票、债券及货币市场

工具等类别资产的配置比例进行动态调整，以期在投资中达到风险和收益的优化平衡。

本基金采用多因素分析框架，将综合考量宏观经济变量（包括 GDP 增长率、CPI 走势、M2

的绝对水平和增长率、利率水平与走势等）以及国家财政、税收、货币、汇率各项政策，来

动态调整大类资产的配置比例。

（2）定向增发股票投资策略

在本基金的封闭期，基金管理人将主要采取一级市场参与定向增发策略，以价值投资理

念和方法分析拟参与定增项目的内在价值。首先本基金对潜在投资目标公司所处行业的周期

性、景气度、成长性、发展现状及未来趋势、进入壁垒、产业政策等应进行审慎研究，回避

行业投资风险。精选投资期内上行的行业，并进而精选上行行业中具有核心竞争能力、具有

持续成长能力的上市公司；其次本基金在价值精选的基础上，严格执行成本控制和 26 安全边际

法则。通过内在价值比较和市场相对价值比较确定安全边际。对于内在价值相较于市场相对

价值具有一定的差距时，相应地，本基金在参与此定增项目时将要求较高的折价比例；再次

本基金管理人将密切跟踪投资项目的 基本面情况，动态评估企业投资价值，及时

调整未来售

出时的目标价。最后对于解除锁定的增发股份，基金管理人将基于市场环境、公司估值水平、

同类行业估值水平、公司近期的经营管理状况等作出是否售出的判断。

基于以上定向增发策略，结合当前政策的变化，基金管理人采取相对灵活的参与方法获

取超额收益。

（3）股指期货投资策略

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原

则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。

（4）国债期货投资策略

为更好地实现投资目标，本基金在注重风险管理的前提下，以套期保值为目的，适度运

用国债期货。本基金利用国债期货流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点，通过国债期货

提高投资组合的运作效率。

（5）债券投资策略

根据流动性管理、资产配置等需要，本基金将进行国债、金融债、企业债等固定收益类

证券的投资。债券投资策略包括利率策略、信用策略、久期策略等，由相关领域的专业研究

人员提出独立的投资策略建议，经固定收益投资团队讨论，并经投资决策委员会批准后形成

固定收益证券指导性投资策略。

（6）权证投资策略

权证为本基金辅助性投资工具，投资原则为有利于基金资产增值、控制下跌风险、实现

保值和锁定收益。本基金将主要投资满足成长和价值优选条件的高科技公司发行的权证。

（7）资产支持证券投资策略

本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线变动分析、收益率利

差分析

和公司基本面分析、把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后的收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

（8）中小企业私募债券投资策略

中小企业私募债票面利率较高、信用风险较大、二级市场流动性较差。本基金将运用基本面研究，结合公司财务分析方法对债券发行人信用风险进行分析和度量，综合考虑中小企业私募债券的安全性、收益性和流动性等特征，选择风险与收益相匹配的品种进行投资。 27

2. 本基金转为上市开放式基金（LOF）后，投资策略相应调整。

（1）类别资产配置策略

本基金根据各类资产的市场趋势和预期收益风险的比较判别，对股票、债券及货币市场工具等类别资产的配置比例进行动态调整，以期在投资中达到风险和收益的优化平衡。本基金采用多因素分析框架，将综合考量宏观经济变量（包括 GDP 增长率、CPI 走势、M2 的绝对水平 and 增长率、利率水平与走势等）以及国家财政、税收、货币、汇率各项政策，来动态调整大类资产的配置比例。

（2）股票投资策略

深入挖掘并充分理解国内经济增长和结构转型所带来的投资机会，积极把握宏观经济和 market 发展趋势，精选具有估值优势的公司股票进行投资。基金管理人通过“自上而下”和“自下而上”相结合的投资思路和定性分析与定量分析相结合的分析方法，严选其中安全边际较高的个股构建投资组合：自上而下地分析行业的 growth 前景、行业结构、商业模式、竞争要素等分析把握其投资机会；自下而上地评判企业的产

品、核心竞争力、管理层、治理结构等；并结合企业基本面和估值水平进行综合的研判，严

选安全边际较高的个股。

本基金在进行个股筛选时，将主要从定性和定量两个角度对上市公司的投资价值进行

综合评价，精选具有较高投资价值的上市公司：1) 定性分析：通过分析上市公司所处行业、

主营业务、同行业竞争水平、公司内部管理水平、盈利能力、资本负债结构、商誉等，评估

上市公司的“内在价值”。2) 定量分析：主要考察上市公司的成长性、盈利能力及其估值指

标，选取具备成长性好，估值合理的股票，主要采用的指标包括但不限于：

公司收入、

未来公司利润增长率等；ROE、ROIC、毛利率、净利率等；PE、PEG、PB、PS等。

(3) 股指期货投资策略

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原

则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。

(4) 国债期货投资策略

为更好地实现投资目标，本基金在注重风险管理的前提下，以套期保值为目的，适度运

用国债期货。本基金利用国债期货流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点，通过国债期货

提高投资组合的运作效率。

(5) 债券投资策略

根据流动性管理、资产配置等需要，本基金将进行国债、金融债、企业债等固定收益类 28

证券的投资。债券投资策略包括利率策略、信用策略、久期策略等，由相关领域的专业研究

人员提出独立的投资策略建议，经固定收益投资团队讨论，并经投资决策委员会批准后形成

固定收益证券指导性投资策略。

（6）权证投资策略

权证为本基金辅助性投资工具，投资原则为有利于基金资产增值、控制下跌风险、实现

保值和锁定收益。本基金将主要投资满足成长和价值优选条件的高科技公司发行的权证。

（7）资产支持证券投资策略

本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线变动分析、收益率利差分析

和公司基本面分析、把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，通过信用研

究和流动性管理，选择风险调整后的收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

（8）中小企业私募债券投资策略

中小企业私募债票面利率较高、信用风险较大、二级市场流动性较差。本基金将运用基

本面研究，结合公司财务分析方法对债券发行人信用风险进行分析和度量，综合考虑中小企

业私募债券的安全性、收益性和流动性等特征，选择风险与收益相匹配的品种进行投资。

（四）投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）在封闭期，本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 0%-100%，非公开发

行股票资产占非现金基金资产的比例不低于 80%；转换为上市开放式基金（LOF）后，本基金投资

组合中股票投资比例为基金资产的 0%-95%；

（2）在封闭期内，每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证

金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；转换为上市开放式基金（LOF）后，每个交

易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日

在一年以内

的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%；

(3) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；

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

(5) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

(6) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

(7) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；

(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%；本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

(15) 封闭期内，本基金资产总值不得超过基金资产净值的 200%；转换为上市开

放式基

金（LOF）后，本基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

（16）本基金在投资股指期货、国债期货时，遵循以下投资比例限制：

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

的 10%；本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净

值的 15%；

2) 转换为上市开放式基金（LOF）后，任何交易日日终，持有的买入国债期货和股指期

货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；在封闭期内，任何交易日

日终，持有的买入国债期货和股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净

值的 100%；其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资

产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

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

总市值的 20%；本基金在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有

的债券总市值的 30%；

4) 本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上

一交易日基金资产净值的 20%；本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债期货合约 30

的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 30%；

5) 基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符

合基金合同关于股票投资比例的有关约定；基金所持有的债券（不含到期日在一年以内的政

府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于债

券投资比例的有关约定；

(17) 本基金投资于中小企业私募债券，其单只市值不得超过基金资产净值的 10%；
封

闭期内，本基金投资中小企业私募债券的到期日不得超过封闭期结束之日；

(18) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使

基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中

国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

本基金持有证券期间，如发生证券处于流通受限状态等非基金管理人原因导致基金投资

比例不符合前述规定的，基金管理人应在上述情形消除后的 10 个交易日内调整完毕。法律法

规另有规定的，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本基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程

序后，则本基金投资不再受相关限制，或以变更后的规定为准。

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- (6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

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

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的原则，防范利

益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事

先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会

审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事

项进行审查。

法律、行政法规或监管部门取消或变更上述禁止性规定，如适用于本基金，基金管理人

在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准。

四、基金收益分配原则

1、在封闭期内，本基金不进行收益分配。

2、转换为上市开放式基金（LOF）后，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年

收益分配次数最多为12次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的25%；

3、本基金场外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；选择采取红利再投资形式的，红利再投资的份额免收申购费；本基金场内收

益分配方式为现金分红；

4、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净

值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

5、每一基金份额享有同等分配权；

6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

五、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，基金托管人按照与基金管理人

协商一致的方式于次月前 2 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。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不

符，及时联系基金托管人协商解决。

2、基金托管人的托管费 32

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，基金托管人按照与基金管理人

协商一致的方式于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

若遇法定节

假日、公休日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不

符，及时联系基金托管人协商解决。

六、基金资产的净值及估值方式

（一）估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券交易场所的交易日以及国家法律法规规定需要对

外披露基金净值的非交易日。

（二）估值对象

基金所拥有的股票、股指期货合约、国债期货合约、权证、债券和银行存款本息、

应收

款项、其它投资等资产及负债。

（三）估值方法

1、证券交易所上市的非固定收益品种的估值

交易所上市的非固定收益品种（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的

市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发

行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交

易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类

似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

2、交易所市场交易的固定收益品种的估值

（1）对在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（另有规定的除外），选取第

三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；

（2）对在交易所市场上市交易的可转换债券，按估值日收盘价减去可转换债券收盘价

中所含债券应收利息后得到的净价进行估值；

（3）对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募债券，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、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，选取第三

方估值 33

机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值。

4、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

5、本基金投资股指期货、国债期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日

无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

6、中小企业私募债券，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。

7、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可

根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

8、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，按照基金管理人对于基金资产净值的计算

结果对外予以公布。

（四）估值程序

1、基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数

量计算，精确到0.0001元，小数点后第5位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人于每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或本基金合

同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将基金份额净值结果

发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人按约定对外公布。

（五）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。

本基金合同的当事人应按照以下约定处理：

1、估值错误类型 34

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

责任；若估值错误责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而

未更正，则其应当承担相应赔偿责任。估值错误责任方应对更正的情况向有关当事人进行确

认，确保估值错误已得到更正。

（2）估值错误的责任方对有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对

估值错误的有关直接当事人负责，不对第三方负责。

（3）因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但估值错误

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

（4）估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

估值错误的责任方；

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

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

损失；

（4）根据估值错误处理的方法，需要修改基金登记机构交易数据的，由基金登记机构 35

进行更正，并就估值错误的更正向有关当事人进行确认。

4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

（1）基金份额净值计算出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，

并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

（2）错误偏差达到基金份额净值的 0.25%时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国

证监会备案；错误偏差达到基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告并报中国

证监会备案。

(3) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

(六) 暂停估值的情形

- 1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；
- 3、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

(七) 基金净值的确认

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

(八) 特殊情况的处理

- 1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 8 项进行估值时，所造成的误差不得作为基金资产估值错误处理。
- 2、由于不可抗力原因，或由于证券、期货交易所或登记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，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

七、基金合同变更、终止与基金财产的清算

(一) 《基金合同》的变更

- 1、变更基金合同涉及法律法规规定或本基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于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完成备案手续生效后方可执行，36

并自决议生效后两个工作日内在指定媒介公告。

（二）《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在6个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- 3、《基金合同》约定的其他情形；
- 4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

（三）基金财产的清算

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

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、

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

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

4、基金财产清算程序：

- （1）《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；
- （2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- （3）对基金财产进行估值和变现；
- （4）制作清算报告；
- （5）聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- （6）将清算报告报中国证监会备案并公告；

(7) 对基金剩余财产进行分配。

5、基金财产清算的期限为 6 个月。

(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 37

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。

(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 15 年以上。

(八) 基金合并

本基金与其他基金的合并应当按照法律法规规定的程序进行。

八、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，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，根据该会当

时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京市，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有

约束力，仲裁费由败诉方承担。

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》受中国法律管辖。

九、基金合同存放地和投资人取得基金合同的方式

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

东海基金管理有限责任公司

2017 年 2 月 22 日