

# 国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金 更新招募说明书 (2017年第二号)

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

截止日：二零一七年七月十六日

## 目 录

一、绪言.....	3
二、释义.....	3
三、基金管理人.....	7
四、基金托管人.....	20
五、相关服务机构.....	23
六、基金的历史沿革.....	42
七、基金的存续.....	43
八、基金份额的申购与赎回.....	44
九、基金的投资.....	51
十、基金的业绩.....	60
十一、基金的财产.....	60
十二、基金资产的估值.....	61
十三、基金的收益与分配.....	65
十四、基金的费用与税收.....	66
十五、基金的会计和审计.....	67
十六、基金的信息披露.....	68
十七、风险揭示.....	72
十八、基金合同的变更、终止与基金财产的清算.....	75
十九、基金合同的内容摘要.....	76
二十、托管协议的内容摘要.....	89
二十一、对基金份额持有人的服务.....	99
二十二、其他应披露事项.....	100
二十三、招募说明书存放及其查阅方式.....	101
二十四、备查文件.....	102

## 重要提示

国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）由国泰目标收益保本混合型证券投资基金变更而来。

国泰目标收益保本混合型证券投资基金经中国证监会《关于核准国泰目标收益保本混合型证券投资基金募集的批复》（证监许可【2013】364号文）核准募集，于2013年7月12日至2013年8月8日公开募集，募集结束后本基金管理人向中国证监会办理备案手续。经中国证监会书面确认，《国泰目标收益保本混合型证券投资基金基金合同》于2013年8月12日生效。

国泰目标收益保本混合型证券投资基金的保本期最长为每3年一个周期，在每一个保本期内均设置该保本期的目标收益率，在运作期间，如基金份额累计净值收益率连续15个工作日达到或超过预设目标收益率，则国泰目标收益保本混合型证券投资基金当期保本期提前到期。国泰目标收益保本混合型证券投资基金第一个保本期的目标收益率为15%。自2014年11月24日起至2014年12月12日止国泰目标收益保本混合型证券投资基金的基金份额累计净值收益率连续15个工作日超过15%，即国泰目标收益保本混合型证券投资基金已于2014年12月12日触发第一个保本期提前到期的条件。依据国泰目标收益保本混合型证券投资基金基金合同的约定，国泰目标收益保本混合型证券投资基金的第一个保本期提前到期并进入过渡期。过渡期结束后的下一日起，由于不再符合保本基金存续条件，国泰目标收益保本混合型证券投资基金变更为“国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金”。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书报中国证监会备案，但并不表明中国证监会对本基金的投资价值、收益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。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资人在投资本基金前，需全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对投资本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资人根据所持有份额享受基金的收益，但同时也需承担相应的投资风险。基金投资中的风险包括：因整体政治、经济、社会等环境因素变化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，由于基金份额持有人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特定风险等。本基金是一只灵活配置的混合型基金，属于基金中的中高风险品种，本基金的风险与预期收益介于股票型基金和债券型基金之间。

投资有风险，投资人申购本基金时应认真阅读本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行承担。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证投资本基金一定盈利，也不保证基金份额持有人的最低收益。

投资人应当认真阅读基金合同、基金招募说明书等信息披露文件，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。

本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为 2017 年 7 月 16 日，投资组合报告为 2017 年 2 季度报告，有关财务数据和净值表现截止日为 2017 年 6 月 30 日。

## 一、绪言

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运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）和其他相关法律法规的规定以及《国泰策略收益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”）编写。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本基金由国泰目标收益保本混合型证券投资基金变更而来。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书作任何解释或者说明。

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

## 二、释义

在招募说明书中，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：指国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金；本基金由“国泰目标收

益保本混合型证券投资基金”变更而来

2、基金管理人：指国泰基金管理有限公司

3、基金托管人：指中国建设银行股份有限公司

4、基金合同：指《国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充

5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充

6、招募说明书或本招募说明书：指《国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》及其定期的更新

7、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

8、《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，2012 年 12 月 28 日经第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议通过，并自 2013 年 6 月 1 日起实施的《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

9、《销售办法》：指中国证监会 2013 年 3 月 15 日颁布、同年 6 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

10、《信息披露办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 8 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《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

11、《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

12、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

13、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会

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

15、个人投资者：指符合法律法规规定的条件可以投资证券投资基金的自然人

16、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

17、合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理办法》及相

关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者

18、投资人：指个人投资者、机构投资者和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者的合称

19、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

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

21、销售机构：指国泰基金公司以及符合《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

22、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

23、登记机构：指办理登记业务的机构。基金的登记机构为国泰基金管理有限公司或接受国泰基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构

24、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

25、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、转换、转托管及定期定额投资等业务的基金份额变动及结余情况的账户

26、基金合同生效日：指《国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效日，原《国泰目标收益保本混合型证券投资基金基金合同》自同一日终止

27、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

28、存续期：指《国泰目标收益保本混合型证券投资基金基金合同》生效之日起至《国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》终止日之间的不定期期限

29、基金变更：指包括国泰目标收益保本混合型证券投资基金的基金类别变更为非保本的混合型基金，基金名称更名为“国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金”，投资目标、投资范围、投资限制、基金费用等适用原《国泰目标收益保本混合型证券投资基金基金合同》关于变更后国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金的相关约定，基金合同进行修订等一系列事项的统称

30、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

31、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

32、T+n日：指自T日起第n个工作日（不包含T日）

33、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

34、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

35、《业务规则》：指《国泰基金管理有限公司证券投资基金注册登记业务规则》，是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金登记结算方面的业务规则，由基金管理人和投资人共同遵守

36、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

37、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

38、基金转换：指基金份额持有人按照基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金基金份额的行为

39、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

40、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

41、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%

42、元：指人民币元

43、基金收益：指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约

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

45、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

46、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

47、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

48、指定媒介：指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站及其他媒体

49、不可抗力：指基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

### 三、基金管理人

#### （一）基金管理人概况

名称：国泰基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道100号上海环球金融中心39楼

办公地址：上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层-19层

成立时间：1998年3月5日

法定代表人：陈勇胜

注册资本：壹亿壹千万元人民币

联系人：辛怡

联系电话：（021）31089000，4008888688

股本结构：

股东名称	股权比例
中国建银投资有限责任公司	60%
意大利忠利集团	30%
中国电力财务有限公司	10%

#### （二）基金管理人管理基金的基本情况

截至2017年7月16日，本基金管理人共管理95只开放式证券投资基金：国泰金鹰增长灵活配置混合型证券投资基金、国泰金龙系列证券投资基金（包括2只子基金，分别为国泰金龙行业精选证券投资基金、国泰金龙债券证券投资基金）、国泰金马稳健回报证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、国泰金鹿保本增值混合证券投资基金、国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金、国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金（由金鼎证券投资基金转型而来）、

国泰金牛创新成长混合型证券投资基金、国泰沪深 300 指数证券投资基金（由国泰金象保本增值混合证券投资基金转型而来）、国泰双利债券证券投资基金、国泰区位优势混合型证券投资基金、国泰中小盘成长混合型证券投资基金（LOF）（由金盛证券投资基金转型而来）、国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金、国泰价值经典灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金、国泰上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国泰事件驱动策略混合型证券投资基金、国泰信用互利分级债券型证券投资基金、国泰成长优选混合型证券投资基金、国泰大宗商品配置证券投资基金（LOF）、国泰信用债券型证券投资基金、国泰现金管理货币市场基金、国泰金泰平衡混合型证券投资基金（由金泰证券投资基金转型而来）、国泰民安增利债券型发起式证券投资基金、国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金、国泰估值优势混合型证券投资基金（LOF）（由国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金封闭期届满转换而来）、上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金、国泰上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金联接基金、纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金、国泰中国企业境外高收益债券型证券投资基金、国泰黄金交易型开放式证券投资基金、国泰美国房地产开发股票型证券投资基金、国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金、国泰淘金互联网债券型证券投资基金、国泰聚信价值优势灵活配置混合型证券投资基金、国泰民益灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、国泰国策驱动灵活配置混合型证券投资基金、国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金、国泰安康养老定期支付混合型证券投资基金、国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金、国泰金鑫股票型证券投资基金（由金鑫证券投资基金转型而来）、国泰新经济灵活配置混合型证券投资基金、国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金、国泰创利债券型证券投资基金（由国泰 6 个月短期理财债券型证券投资基金转型而来）、国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金（由国泰目标收益保本混合型证券投资基金转型而来）、国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金、国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金、国泰睿吉灵活配置混合型证券投资基金、国泰兴益灵活配置混合型证券投资基金、国泰生益灵活配置混合型证券投资基金、国泰互联网+股票型证券投资基金、国泰央企改革股票型证券投资基金、国泰新目标收益保本混合型证券投资基金、国泰全球绝对收益型基金优选证券投资基金、国泰鑫保本混合型证券投资基金、国泰大健康股票型证券投资基金、国泰民福保本混合型证券投资基金、国泰黄金交易型开放式证券投资基金联接基金、国泰融丰定增灵活配置混合型证券投资基金、国泰国证新能源汽车指数证券投资基

金（LOF）（由国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金转型而来，国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金由中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金转型而来）、国泰民利保本混合型证券投资基金、国泰中证军工交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、国泰添益灵活配置混合型证券投资基金、国泰福益灵活配置混合型证券投资基金、国泰创业板指数证券投资基金（LOF）、国泰鸿益灵活配置混合型证券投资基金、国泰景益灵活配置混合型证券投资基金、国泰泽益灵活配置混合型证券投资基金、国泰丰益灵活配置混合型证券投资基金、国泰鑫益灵活配置混合型证券投资基金、国泰信益灵活配置混合型证券投资基金、国泰利是宝货币市场基金、国泰安益灵活配置混合型证券投资基金、国泰普益灵活配置混合型证券投资基金、国泰民惠收益定期开放债券型证券投资基金、国泰润利纯债债券型证券投资基金、国泰嘉益灵活配置混合型证券投资基金、国泰众益灵活配置混合型证券投资基金、国泰润泰纯债债券型证券投资基金、国泰融信定增灵活配置混合型证券投资基金、国泰现金宝货币市场基金、国泰景气行业灵活配置混合型证券投资基金、国泰国证航天军工指数证券投资基金（LOF）、国泰中证国有企业改革指数证券投资基金（LOF）、国泰民丰回报定期开放灵活配置混合型证券投资基金、国泰中证申万证券行业指数证券投资基金（LOF）、国泰策略价值灵活配置混合型证券投资基金（由国泰保本混合型证券投资基金变更而来）、国泰量化收益灵活配置混合型证券投资基金、国泰睿信平衡混合型证券投资基金、国泰大农业股票型证券投资基金、国泰智能装备股票型证券投资基金、国泰融安多策略灵活配置混合型证券投资基金、国泰润鑫纯债债券型证券投资基金。另外，本基金管理人于 2004 年获得全国社会保障基金理事会社保基金资产管理人资格，目前受托管理全国社保基金多个投资组合。2007 年 11 月 19 日，本基金管理人获得企业年金投资管理人资格。2008 年 2 月 14 日，本基金管理人成为首批获准开展特定客户资产管理业务（专户理财）的基金公司之一，并于 3 月 24 日经中国证监会批准获得合格境内机构投资者（QDII）资格，囊括了公募基金、社保、年金、专户理财和 QDII 等管理业务资格。

### （三）主要人员情况

#### 1、董事会成员

陈勇胜，董事长，硕士研究生，高级经济师。1982 年 2 月至 1992 年 10 月在中国建设银行总行工作，历任综合计划处、资金处副处长、国际结算部副总经理（主持工作）。1992 年 11 月至 1998 年 1 月任国泰证券有限公司国际业务部总经理，公司总经理助理兼北京分公司总经

理。1998年2月至2015年10月在国泰基金管理有限公司工作，其中1998年2月至1999年10月任总经理，1999年10月至2015年8月任董事长。2015年10月至2016年8月，在中建投信托有限责任公司任监事长。2016年8月至11月，在建投投资有限责任公司、建投传媒华文公司任监事长、纪委书记。2016年11月起任公司党委书记，2017年3月起任公司董事长、法定代表人。

张瑞兵，董事，博士研究生。2006年7月起在中国建银投资有限责任公司工作，先后任股权管理部业务副经理、业务经理，资本市场部业务经理，策略投资部助理投资经理，公开市场投资部助理投资经理，战略发展部业务经理、组负责人，现任战略发展部处长。2014年5月起任公司董事。

傅敏，董事，大学本科，会计师。1979年12月至1988年3月，任冶金工业部西南地勘局财会处干部。1988年3月至2005年7月，在中国建设银行工作，历任财会部干部、人力资源部干部、副处长、处长、总经理助理。2005年7月至2011年3月在中国建银投资有限责任公司工作，历任人力资源部副总经理、业务总监。2011年6月至2016年11月，在中投发展有限责任公司工作，历任人力资源部总经理、总裁助理、工会主席、党委委员、副总裁、董事。现任中国建银投资有限责任公司战略发展部专职董事。2017年3月起任公司董事。

Santo Borsellino，董事，硕士研究生。1994-1995年在BANK OF ITALY负责经济研究；1995年在UNIVERSITY OF BOLOGNA任金融部助理，1995-1997年在ROLOFINANCE UNICREDITO ITALIANO GROUP – SOFIPA SpA任金融分析师；1999-2004年在LEHMAN BROTHERS INTERNATIONAL任股票保险研究员；2004-2005年任URWICK CAPITAL LLP合伙人；2005-2006年在CREDIT SUISSE任副总裁；2006-2008年在EURIZONCAPITAL SGR SpA历任研究员/基金经理。2009-2013年任GENERALI INVESTMENTS EUROPE权益部总监。2013年6月起任GENERALI INVESTMENTS EUROPE总经理。2013年11月起任公司董事。

游一冰，董事，大学本科，英国特许保险学会高级会员(FCII)及英国特许保险师(Chartered Insurer)。1989年起任中国人民保险公司总公司营业部助理经理；1994年起任中国保险(欧洲)控股有限公司总裁助理；1996年起任忠利保险有限公司英国分公司再保险承保人；1998年起任忠利亚洲中国地区总经理。2002年起任中意人寿保险有限公司董事。2007年起任中意财产保险有限公司董事、总经理。2010年6月起任公司董事。

董树梓，董事，大学本科，高级会计师。1983年7月至2002年3月，在山东临沂电业局工作，历任会计、科长、副总会计师。2002年3月至2003年2月，在山西鲁晋王曲发电公司工作，任党组成员、总会计师。2003年2月至2008年3月，任鲁能集团经营考核与审计部总

经理。2008年3月至2011年2月，任英大泰和人寿股份有限公司山东分公司总经理。2011年2月至今，在中国电力财务有限公司工作。历任审计部主任，公司党组成员、总会计师。2017年3月起任公司董事。

周向勇，董事，硕士研究生，21年金融从业经历。1996年7月至2004年12月在中国建设银行总行工作，先后任办公室科员、个人银行业务部主任科员。2004年12月至2011年1月在中国建银投资公司工作，任办公室高级业务经理、业务运营组负责人。2011年1月加入国泰基金管理有限公司，任总经理助理，2012年11月至2016年7月7日任公司副总经理，2016年7月8日起任公司总经理及公司董事。

王军，独立董事，博士研究生，教授。1986年起在对外经济贸易大学法律系、法学院执教，任助教、讲师、副教授、教授、博士生导师、法学院副院长、院长，兼任全国法律专业学位研究生教育指导委员会委员、国际贸易和金融法律研究所所长、中国法学会国际经济法学研究会副会长、中国法学会民法学研究会常务理事、中国法学教育研究会第一届理事会常务理事、中国国际经济贸易仲裁委员会仲裁员、新加坡国际仲裁中心仲裁员、北京仲裁委员会仲裁员、大连仲裁委员会仲裁员等职。2013年起兼任金诚信矿业管理股份有限公司（目前已上市）独立董事，2015年5月起兼任北京采安律师事务所兼职律师。2010年6月起任公司独立董事。

常瑞明，独立董事，大学学历，高级经济师。1980年起在工商银行河北省工作，历任河北沧州市支行主任、副行长；河北省分行办公室副主任、信息处处长、副处长；河北保定市分行行长、党组副书记、书记；河北省分行副行长、行长、党委书记；2004年起任工商银行山西省分行行长、党委书记；2007年起任工商银行工会工作委员会常务副主任；2010年至2014年任北京银泉大厦董事长。2014年10月起任公司独立董事。

杨小舟，独立董事，博士研究生，研究员。1981年7月至1985年7月，任南京林业大学（原南京林产工业学院）财务处会计员。1988年9月至1998年3月，在中国财政科学研究院（原财政部财政科学研究所）工作，历任实习研究员、助理研究员、副研究员、研究室主任。1998年3月至2000年3月，任长天国际科技有限公司财务总监。2000年3月至2002年4月，任福建实达集团股份有限公司财务总监。2002年6月至2005年5月，任同方股份有限公司副总裁。2005年12月起在中国财政科学研究院工作，任研究员，研究生部博士生导师。2017年3月起任公司独立董事。

黄晓衡，独立董事，硕士研究生，高级经济师。1975年7月至1991年6月，在中国建设银行江苏省分行工作，先后任职于计划处、信贷处、国际业务部，历任副处长、处长。1991

年6月至1993年9月，任中国建设银行伦敦代表处首席代表。1993年9月至1994年7月，任中国建设银行纽约代表处首席代表。1994年7月至1999年3月，在中国建设银行总行工作，历任国际部副总经理、资金计划部总经理、会计部总经理。1999年3月至2010年1月，在中国国际金融有限公司工作，历任财务总监、公司管委会成员、顾问。2010年4月至2012年3月，任汉石投资管理有限公司（香港）董事总经理。2013年8月至2016年1月，任中金基金管理有限公司独立董事。2017年3月起任公司独立董事。

## 2、监事会成员

梁凤玉，监事会主席，硕士研究生，高级会计师。1994年8月至2006年6月，先后于建设银行辽宁分行国际业务部、人力资源部、葫芦岛市分行城内支行、葫芦岛市分行计财部、葫芦岛市分行国际业务部、建设银行辽宁分行计划财务部工作，任业务经理、副行长、副总经理等职。2006年7月至2007年3月在中国建银投资有限责任公司财务会计部工作。2007年4月至2008年2月在中国投资咨询公司任财务总监。2008年3月至2012年8月在中国建银投资有限责任公司财务会计部任高级经理。2012年9月至2014年8月在建投投资有限责任公司任副总经理。2014年12月起任公司监事会主席。

Yezdi Phiroze Chinoy，监事，大学本科。1995年12月至2000年5月在Jardine Fleming India任公司秘书及法务。2000年9月至2003年2月，在Dresdner Kleinwort Benson任合规部主管、公司秘书兼法务。2003年3月至2008年1月任JP Morgan Chase India合规部副总经理。2008年2月至2008年8月任Prudential Property Investment Management Singapore法律及合规部主管。2008年8月至2014年3月任Allianz Global Investors Singapore Limited东南亚及南亚合规部主管。2014年3月17日起任Generali Investments Asia Limited首席执行官。2016年12月1日起任Generali Investments Asia Limited执行董事。2014年12月起任公司监事。

刘锡忠，监事，研究生。1989年2月至1995年5月，中国人民银行总行稽核监察局主任科员。1995年6月至2005年6月，在华北电力集团财务有限公司工作，历任部门经理、副总经理。2005年7月起在中国电力财务有限公司工作，历任华北分公司副总经理、纪检监察室主持工作、风险管理部主任、资金管理部主任、河北业务部主任，现任风险管理部主任。2017年3月起任公司监事。

邓时锋，监事，硕士研究生。曾任职于天同证券。2001年9月加盟国泰基金管理有限公司，历任行业研究员、社保111组合基金经理助理、国泰金鼎价值混合和国泰金泰封闭的基金经理助理，2008年4月起任国泰金鼎价值精选证券投资基金的基金经理，2009年5月起兼任国泰区位优势混合型证券投资基金（原国泰区位优势股票型证券投资基金）的基金经理，2013

年9月至2015年3月兼任国泰估值优势股票型证券投资基金（LOF）的基金经理，2015年9月起兼任国泰央企改革股票型证券投资基金的基金经理。2017年7月起任权益投资总监。2015年8月起任公司职工监事。

倪莹，监事，硕士研究生。1998年7月至2001年3月，任新晨信息技术有限责任公司项目经理。2001年3月加入国泰基金管理有限公司，现任信息技术部总监、运营管理部总监。2017年2月起任公司职工监事。

宋凯，监事，大学本科。2008年9月至2012年10月，任毕马威华振会计师事务所上海分所助理经理。2012年12月加入国泰基金管理有限公司，现任纪检监察室副主任、审计部总监助理。2017年3月起任公司职工监事。

### 3、高级管理人员

陈勇胜，董事长，简历情况见董事会成员介绍。

周向勇，总经理，简历情况见董事会成员介绍。

陈星德，博士，15年证券基金从业经历。曾就职于江苏省人大常委会、中国证券监督管理委员会、瑞士银行环球资产管理香港公司和国投瑞银基金管理有限公司。2009年1月至2015年11月就职于上投摩根基金管理有限公司，历任督察长、副总经理。2015年12月加入国泰基金管理有限公司，担任公司副总经理。

李辉，大学本科，17年金融从业经历。1997年7月至2000年4月任职于上海远洋运输公司，2000年4月至2002年12月任职于中宏人寿保险有限公司，2003年1月至2005年7月任职于海康人寿保险有限公司，2005年7月至2007年7月任职于AIG集团，2007年7月至2010年3月任职于星展银行。2010年4月加入国泰基金管理有限公司，先后担任财富大学负责人、总经理办公室负责人、人力资源部（财富大学）及行政管理部负责人，2015年8月至2017年2月任公司总经理助理，2017年2月起担任公司副总经理。

李永梅，博士研究生学历，硕士学位，18年证券从业经历。1999年7月至2014年2月就职于中国证监会陕西监管局，历任稽查处副主任科员、主任科员、行政办公室副主任、稽查二处副处长等；2014年2月至2014年12月就职于中国证监会上海专员办，任副处长；2015年1月至2015年2月就职于上海申乐实业控股集团有限公司，任副总经理；2015年2月至2016年3月就职于嘉合基金管理有限公司，2015年7月起任公司督察长；2016年3月加入国泰基金管理有限公司，2016年3月25日起任公司督察长。

### 4、本基金的基金经理

（1）现任基金经理

艾小军，硕士研究生，16年证券基金从业经历。2001年5月至2006年9月在华安基金管理有限公司任量化分析师；2006年9月至2007年8月在汇丰晋信基金管理有限公司任应用分析师；2007年9月至2007年10月在平安资产管理有限公司任量化分析师；2007年10月加入国泰基金管理有限公司，历任金融工程分析师、高级产品经理和基金经理助理。2014年1月起任国泰黄金交易型开放式证券投资基金、上证180金融交易型开放式指数证券投资基金、国泰上证180金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理，2015年3月起兼任国泰深证TMT50指数分级证券投资基金的基金经理，2015年4月起兼任国泰沪深300指数证券投资基金的基金经理，2016年4月起兼任国泰黄金交易型开放式证券投资基金联接基金的基金经理，2016年7月起兼任国泰中证军工交易型开放式指数证券投资基金和国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2017年3月至2017年5月任国泰保本混合型证券投资基金的基金经理，2017年3月起兼任国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金和国泰国证航天军工指数证券投资基金（LOF）的基金经理，2017年4月起兼任国泰中证申万证券行业指数证券投资基金（LOF）的基金经理，2017年5月起兼任国泰策略价值灵活配置混合型证券投资基金（由国泰保本混合型证券投资基金变更而来）、国泰量化收益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年7月起任投资总监（量化）、金融工程总监。

（2）历任基金经理

本基金自转型之日（2015年1月16日）起至2015年7月16日由邱晓华、姜南林共同担任基金经理；自2015年7月17日至2017年3月5日由邱晓华担任本基金的基金经理；自2017年3月6日起至2017年8月10日由邱晓华、艾小军共同担任本基金的基金经理；自2017年8月11日起由艾小军担任本基金的基金经理。

5、本基金投资决策委员会成员

本基金管理人设有公司投资决策委员会，其成员在公司高级管理人员、投研部门负责人及业务骨干等相关人员中产生。公司总经理可以推荐上述人员以外的投资管理相关人员担任成员，督察长和运营体系负责人列席公司投资决策委员会会议。公司投资决策委员会主要职责是根据有关法规和基金合同，审议并决策公司投资研究部门提出的公司整体投资策略、基金大类资产配置原则，以及研究相关投资部门提出的重大投资建议等。

投资决策委员会成员组成如下：

主任委员：

周向勇：总经理

委员：

周向勇：总经理

陈星德：副总经理

吴晨：绝对收益投资（事业）部副总监（主持工作）

邓时锋：权益投资（事业）部小组负责人

吴向军：国际业务部副总监（主持工作）

6、上述成员之间均不存在近亲属或家属关系。

#### （四）基金管理人职责

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

2、办理基金备案手续；

3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；

4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

6、编制季度、半年度和年度基金报告；

7、计算并公告基金资产净值与基金份额净值，确定基金份额申购、赎回价格；

8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；

9、按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

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

12、有关法律、法规和中国证监会规定的其它职责。

#### 五、基金管理人承诺

1、基金管理人承诺不从事违反《中华人民共和国证券法》的行为，并承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反《中华人民共和国证券法》行为的发生。

2、基金管理人承诺不从事违反《基金法》的行为，并承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止下列行为发生：

（1）将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；

- (2) 不公平地对待其管理的不同基金财产；
- (3) 利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人谋取利益；
- (4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- (5) 法律法规或中国证监会禁止的其他行为。

3、基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下活动：

- (1) 越权或违规经营；
- (2) 违反基金合同或托管协议；
- (3) 故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益；
- (4) 在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；
- (5) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
- (6) 玩忽职守、滥用职权，不按照规定履行职责；

(7) 违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

- (8) 违反证券交易场所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；
- (9) 贬损同行，以抬高自己；
- (10) 以不正当手段谋求业务发展；
- (11) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；
- (12) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
- (13) 其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

4、基金管理人承诺严格遵守基金合同的规定，并承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反基金合同行为的发生。

5、基金管理人承诺不从事其他法规规定禁止从事的行为。

#### 六、基金经理承诺

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

2、不利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者谋取利益；

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

4、不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

## 七、基金管理人内部控制制度

### 1、内部控制制度概述

基金管理人为防范和化解经营运作中面临的风险，保证经营活动的合法合规和有效开展，制定了一系列组织机制、管理方法、操作程序与控制措施，形成了公司完整的内部控制体系。该内部控制体系涵盖了内部会计控制、风险管理控制和监察稽核制度等公司运营的各个方面，并通过相应的具体业务控制流程来严格实施。

#### （1）内部风险控制遵循的原则

1）全面性原则：内部风险控制必须覆盖公司所有部门和岗位，渗透各项业务过程和业务环节；

2）独立性原则：公司设立独立的稽核监察部，稽核监察部保持高度的独立性和权威性，负责对公司各部门内部风险控制工作进行稽核和检查；

3）相互制约原则：公司及各部门在内部组织结构的设计上形成一种相互制约的机制，建立不同岗位之间的制衡体系；

4）保持与业务发展的同等地位原则：公司的发展必须建立在风险控制制度完善和稳固的基础上，内部风险控制应与公司业务发展放在同等地位上；

5）定性和定量相结合原则：建立完备风险控制指标体系，使风险控制更具客观性和操作性。

#### （2）内部会计控制制度

公司根据国家有关法律法规和财务会计准则的要求，建立了完善的内部会计控制制度，实现了职责分离和岗位相互制约，确保会计核算的真实、准确、完整，并保证各基金会计核算和公司财务管理的相互独立，保护基金资产的独立、安全。

#### （3）风险管理控制制度

公司为有效控制管理运营中的风险，建立了一整套完整的风险管理控制制度，其内容由一系列的具体制度构成，主要包括：岗位分离和空间分离制度、投资管理控制制度、信息技术控制、营销业务控制、信息披露制度、资料保全制度和独立的稽核制度、人力资源管理以及相应的业务控制流程等。通过这些控制制度和流程，对公司面临的投资风险和管理风险进

行有效的控制。

#### （4）监察稽核制度

公司实行独立的监察稽核制度，通过对稽核监察部充分授权，对公司执行国家有关法律法规情况、以及公司内部控制制度的遵循情况和有效性进行全面的独立监察稽核，确保公司经营合法合规性和内部控制的有效性。

### 2、基金管理人内部控制制度要素

#### （1）控制环境

公司经过多年的管理实践，建立了良好的控制环境，以保证内部会计控制和管理控制的有效实施，主要包括科学的公司治理结构、合理的组织结构和分级授权、注重诚信并关注风险的道德观和经营理念、独立的监察稽核职能等方面。

1) 公司建立并完善了科学的治理结构，目前有独立董事 4 名。董事会下设提名及资格审查委员会、薪酬委员会、考核委员会等专业委员会，对公司重大经营决策和发展规划进行决策及监督；

2) 在组织结构方面，公司设立的执行委员会、投资决策委员会、风险管理委员会等机构分别负责公司经营、基金投资和风险控制等方面的决策和监督控制。同时公司各部门之间有明确的授权分工和风险控制责任，既相互独立，又相互合作和制约，形成了合理的组织结构、决策授权和风险控制体系；

3) 公司一贯坚持诚信为投资人服务的道德观和稳健经营的管理理念。在员工中加强职业道德教育和风险观念，形成了诚信为本和稳健经营的企业文化；

4) 公司稽核监察部拥有对公司任何经营活动进行独立监察稽核的权限，并对公司内部控制措施的实施情况和有效性进行评价和提出改进建议。

#### （2）控制的性质和范围

##### 1) 内部会计控制

公司建立了完善的内部会计控制，保证基金核算和公司财务核算的独立性、全面性、真实性和及时性。

首先，公司根据国家有关法律法规、有关会计制度和准则，制定了完善的公司财务制度、基金会计制度以及会计业务控制流程，做好基金业务和公司经营的核算工作，真实、完整、准确地记录和反映基金运作情况和公司财务状况。

其次，公司将基金会计和公司财务核算从人员上、空间上和业务活动上严格分开，保证两者相互独立，各基金之间做到独立建账、独立核算，保证基金资产和公司资产之间、以及

各基金资产之间的相互独立性。

公司建立了严格的岗位职责分离控制、凭证与记录控制、资产接触控制、独立稽核等制度，确保在基金核算和公司财务管理中做到对资源的有效控制、有关功能的相互分离和各岗位的相互监督等。

另外公司还建立了严格的财务管理制度，执行严格的预算管理和财务费用审批制度，加强成本控制和监督。

## 2) 风险管理控制

公司在经营管理中建立了有效的风险管理控制体系，主要包括：

**岗位分离和空间隔离制度：**为保证各部门的相对独立性，公司建立了明确的岗位分离制度；同时实行空间隔离制度，建立防火墙，充分保证信息的隔离和保密；

**投资管理业务控制：**通过建立完整的研究业务控制、投资决策控制、交易业务控制，完善投资决策委员会的投资决策职能和风险管理委员会的风险控制职能，实行投资总监和基金经理分级授权制度和股票池制度，进行集中交易，以及风险管理部对投资交易实时监控等，加强投资管理控制，做到研究、投资、交易、风险控制相互独立、相互制约和相互配合，有效控制操作风险；建立了科学先进的投资风险量化评估和管理体系，控制投资业务中面临的市场风险、集中风险、流动性风险等；建立了科学合理的投资业绩绩效评估体系，对投资管理的风险和业绩进行及时评估和反馈；

**信息技术控制：**为保证信息技术系统的安全稳定，公司在硬件设备运行维护、软件采购维护、网络安全、数据库管理、危机处理机制等方面均制定实施了完善的制度和控制流程；

**营销业务控制：**公司制定了完善的市场营销、客户开发和客户服务制度，以保证在营销业务中对有关法律法规的遵守，以及对经营风险的有效控制；

**信息披露控制和资料保全制度：**公司制定了规范的信息披露管理办法，保证信息披露的及时、准确和完整；在资料保全方面，建立了完善的信息资料保全备份系统，以及完整的会计、统计和各种业务资料档案；

**独立的监察稽核制度：**稽核监察部有权对公司各业务部门工作进行稽核检查，并保证稽核的独立性和客观性。

## 3) 内部控制制度的实施

公司风险管理委员会首先从总体上制定了公司风险控制制度，对公司面临的主要风险进行辨识和评估，制定了风险控制原则。在风险管理委员会总体方针指导下，各部门根据各自业务特点，对业务活动中存在的风险点进行了揭示和梳理，有针对性地建立了详细的风险控

制流程，并在实际业务中加以控制。

### （3）内部控制制度实施情况检查

公司稽核监察部在进行风险评估的基础上，对公司各业务活动中内部控制措施的实施情况进行定期和不定期的监察稽核，重点是业务活动中风险暴露程度较高的环节，以确保公司经营合法合规、以及内部控制制度的有效遵循。

在确保现有内部控制制度实施情况的基础上，公司会根据新业务开展和市场变化情况，对内部控制制度进行及时的更新和调整，以适应公司经营活动的变化。公司稽核监察部在对内部控制制度的执行情况进行监察稽核的基础上，也会重点对内部控制制度的有效性进行评估，并提出相应改进建议。

### （4）内部控制制度实施情况的报告

公司建立了有效的内部控制制度实施报告流程，各部门对于内部控制制度实施过程中出现的失效情况须及时向公司高级管理层和稽核监察部报告，使公司高级管理层和稽核监察部及时了解内部控制出现的问题并作出妥善处理。

稽核监察部在对内部控制实施情况的监察中，对发现的问题均立即向公司高级管理层报告，并提出相应的建议，对于重大问题，则通过督察长及时向公司董事长和中国证监会报告。同时稽核监察部定期出具独立的监察稽核报告，直接报公司董事长和中国证监会。

## 3、基金管理人内部控制制度声明书

基金管理人保证以上关于内部控制制度的披露真实、准确，并承诺基金管理人将根据市场变化和业务发展不断完善内部控制制度，切实维护基金份额持有人的合法权益。

## 四、基金托管人

### 一、基金托管人情况

#### （一）基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司（简称：中国建设银行）

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：王洪章

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12号

联系人：田青

联系电话：(010)6759 5096

中国建设银行成立于1954年10月，是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行，总部设在北京。本行于2005年10月在香港联合交易所挂牌上市（股票代码939），于2007年9月在上海证券交易所挂牌上市（股票代码601939）。

资产负债稳步增长。2016年末，本集团资产总额20.96万亿元，较上年增加2.61万亿元，增幅14.25%，其中客户贷款总额11.76万亿元，较上年增加1.27万亿元，增幅12.13%。负债总额19.37万亿元，较上年增加2.47万亿元，增幅14.61%，其中客户存款总额15.40万亿元，较上年增加1.73万亿元，增幅12.69%。

核心财务指标表现良好。积极消化五次降息、利率市场化等因素影响，本集团实现净利润2,323.89亿元，较上年增长1.53%。手续费及佣金净收入1,185.09亿元，在营业收入中的占比较上年提升0.83个百分点。平均资产回报率1.18%，加权平均净资产收益率15.44%，净利息收益率2.20%，成本收入比为27.49%，资本充足率14.94%，均居同业领先水平。

2016年，本集团先后获得国内外知名机构授予的100余项重要奖项。荣获《欧洲货币》“2016中国最佳银行”，《环球金融》“2016中国最佳消费者银行”、“2016亚太区最佳流动性管理银行”，《机构投资者》“人民币国际化服务钻石奖”，《亚洲银行家》“中国最佳大型零售银行奖”及中国银行业协会“年度最具社会责任金融机构奖”。本集团在英国《银行家》2016年“世界银行1000强排名”中，以一级资本总额继续位列全球第2；在美国《财富》2016年世界500强排名第22位。

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII托管处、养老金托管处、清算处、核算处、跨境托管运营处、监督稽核处等10个职能处室，在上海设有投资托管服务上海备份中心，共有员工220余人。自2007年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

## （二）主要人员情况

赵观甫，资产托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行郑州市分行、总行信贷部、总行信贷二部、行长办公室工作，并在中国建设银行河北省分行营业部、总行个人银行业务部、

总行审计部担任领导职务，长期从事信贷业务、个人银行业务和内部审计等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

龚毅，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行北京市分行国际部、营业部并担任副行长，长期从事信贷业务和集团客户业务等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

原玎，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行国际业务部，长期从事海外机构及海外业务管理、境内外汇业务管理、国外金融机构客户营销拓展等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

### （三）基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、(R)QFII、(R)QDII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2017年一季度末，中国建设银行已托管719只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行连续11年获得《全球托管人》、《财资》、《环球金融》“中国最佳托管银行”、“中国最佳次托管银行”、“最佳托管专家——QFII”等奖项，并在2016年被《环球金融》评为中国市场唯一一家“最佳托管银行”。

## 二、基金托管人的内部控制制度

### （一）内部控制目标

作为基金托管人，中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和本行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

### （二）内部控制组织结构

中国建设银行设有风险与内控管理委员会，负责全行风险管理与内部控制工作，对托管业务风险控制工作进行检查指导。资产托管业务部配备了专职内控合规人员负责托管业务的

内控合规工作，具有独立行使内控合规工作职权和能力。

### （三）内部控制制度及措施

资产托管业务部具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理严格实行复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

## 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

### （一）监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的“新一代托管应用监督子系统”，严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

### （二）监督流程

1. 每工作日按时通过新一代托管应用监督子系统，对各基金投资运作比例控制等情况进行监控，如发现投资异常情况，向基金管理人进行风险提示，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，如有重大异常事项及时报告中国证监会。

2. 收到基金管理人的划款指令后，对指令要素等内容进行核查。

3. 根据基金投资运作监督情况，定期编写基金投资运作监督报告，对各基金投资运作的合法合规性和投资独立性等方面进行评价，报送中国证监会。

4. 通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求基金管理人进行解释或举证，并及时报告中国证监会。

## 五、相关服务机构

### （一）基金份额销售机构

#### 1、直销机构

序号	机构名称	机构信息
----	------	------

1	国泰基金管理有限公司上海直销柜台	地址：上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层-19层	
		客户服务专线：400-888-8688，021-31089000	
		传真：021-31081861	网址：www.gtfund.com
2	国泰基金电子交易平台	电子交易网站：www.gtfund.com 登录网上交易页面 智能手机APP平台：iphone交易客户端、Android交易客户端 “国泰基金”微信交易平台	
		电话：021-31081738	联系人：李静姝

## 2、其它销售机构

### (1) 销售银行及券商

序号	机构名称	机构信息	
1	中国农业银行股份有限公司	注册地址：北京市东城区建国门内大街69号	
		办公地址：北京市东城区建国门内大街69号	
		法定代表人：周慕冰	客户服务电话：95599
		联系人：客户服务中心	传真：010-85109219
		网址：www.95599.cn	
2	中国银行股份有限公司	注册地址：北京市西城区复兴门内大街1号	
		法定代表人：田国立	联系人：客户服务中心
		客服电话：95566	网址：www.boc.cn
3	中国建设银行股份有限公司	注册地址：北京市西城区金融大街25号	
		办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼	
		法定代表人：王洪章	客服电话：95533
		网址：www.ccb.com	
4	招商银行股份有限公司	注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦	
		法定代表人：傅育宁	联系人：邓炯鹏
		电话：0755-83198888	传真：0755-83195109
		客户服务热线：95555	网址：www.cmbchina.com
5	上海浦东发展银行股份有限公司	注册地址：上海市中山东一路12号	
		办公地址：上海市中山东一路12号	
		法定代表人：吉晓辉	电话：021-61618888
		联系人：高天、虞谷云	客户服务热线：95528

6	上海农村商业银行股份有限公司	注册地址：上海市浦东新区浦东大道 981 号	
		法定代表人：胡平西	联系人：吴海平
		电话：021-38576977	传真：021-50105124
		客服电话：021-962999	网址：www.srcb.com
7	杭州银行股份有限公司	注册地址：杭州市庆春路 46 号杭州银行大厦	
		法定代表人：吴太普	联系人：严峻
		电话：0571-85163127	传真：0571-85179591
		客服电话：400-888-8508	网址：www.hzbank.com.cn
8	渤海银行股份有限公司	注册地址：天津市河东区海河东路 218 号	
		法定代表人：李伏安	联系人：陈玮
		客服电话：95541	传真：022-58316259
		网址：www.cbhb.com.cn	
9	大连银行股份有限公司	注册地址：大连市中山区中山路 88 号天安国际大厦 49 楼	
		法定代表人：陈占维	联系人：李鹏
		电话：0411-82308602	传真：0411-82311420
		客服电话：400-664-0099	网址：www.bankofd1.com
10	哈尔滨银行股份有限公司	注册地址：哈尔滨市道里区尚志大街 160 号	
		法定代表人：郭志文	联系人：吴昊、冯小航
		电话：0451-86779608	传真：0451-86779218
		客服电话：95537	
		网址：www.hrbb.com.cn	
11	广州农村商业银行股份有限公司	注册地址：广州市天河区珠江新城华夏路 1 号	
		法定代表：王继康	联系人：卢媛薇、陈捷
		客服电话：95313	电话：020-28852729
		网址：www.grcbank.com	
12	东莞农村商业银行股份有限公司	注册地址：广东省东莞市东城区鸿福东路 2 号	
		法定代表：何沛良	联系人：林培珊、杨亢
		客服电话：0769-961122	电话：0769-22866254
		网址：www.drcbank.com	
13	国泰君安证券股	注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号	

	份有限公司	法定代表人：杨德红	联系人：芮敏祺
		电话：021-38676161	传真：021-38670161
		客服电话：95521	网址：www.gtja.com
14	中信建投证券股份 有限公司	注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼	
		法定代表人：王常青	联系人：许梦园
		电话：010-85156398	传真：010-65182261
		客服电话：95587 4008-888-108	网址：www.csc108.com
15	国信证券股份有 限公司	注册地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16-26楼	
		法定代表人：何如	联系人：周杨
		电话：0755-82130833	传真：0755-82133952
		客服电话：95536	网址：www.guosen.com.cn
16	招商证券股份有 限公司	注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层	
		法定代表人：宫少林	联系人：黄婵君
		电话：0755-82960167	传真：0755-83734343
		网址：www.newone.com.cn	
		客服电话：400-888-8111/95565	
17	中国银河证券股 份有限公司	注册地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座	
		法定代表人：陈有安	联系人：邓颜
		电话：010-66568292	传真：010-66568990
		客服电话：400-8888-888	
		网址：www.chinastock.com.cn	
18	海通证券股份有 限公司	注册地址：上海市广东路689号	
		法定代表人：王开国	联系人：李笑鸣
		电话：021-23219000	传真：021-63602722
		客服电话：95553	
		网址：www.htsec.com	
19	申万宏源证券有 限公司	注册地址：上海市徐汇区长乐路989号45层	
		法定代表人：李梅	联系人：黄莹
		电话：021-33388211	客服电话：95523 4008895523

		网址：www.swhysc.com	
20	万联证券有限责任公司	注册地址：广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 F 栋 18、19 层	
		法定代表人：张建军	联系人：甘蕾
		电话：020-38286026	传真：020-38286588
		客服电话：400-888-8133	网址：www.wlzq.com.cn
21	东吴证券股份有限公司	注册地址：苏州工业园区星阳街 5 号	
		法定代表人：范力	联系人：陆晓
		电话：0512-62938521	传真：0512-65588021
		全国客服电话：95330	网址：www.dwzq.com.cn
22	上海证券有限责任公司	注册地址：上海市西藏中路 336 号	
		法定代表人：郁忠民	联系人：张瑾
		电话：021-53519888	传真：021-53519888
		客服电话：021-962518	网址：www.962518.com
23	国盛证券有限责任公司	注册地址：江西省南昌市永叔路 15 号	
		办公地址：江西省南昌市北京西路 88 号江信国际金融大厦 4 楼	
		法定代表人：曾小普	联系人：徐美云
		电话：0791-6285337	传真：0791-6288690
		网址：www.gsstock.com	
24	光大证券股份有限公司	注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号	
		法定代表人：薛峰	联系人：刘晨、李芳芳
		电话：021-22169999	传真：021-22169134
		客服电话：95525、10108998、400-888-8788	
		网址：www.ebscn.com	
25	广发证券股份有限公司	注册地址：广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街 2 号 618 室	
		办公地址：广东省广州天河北路大都会广场 5、18、19、36、38、39、41、42、43、44 楼	
		法定代表人：孙树明	联系人：黄岚
		电话：020-87555888	传真：020-87555305
		客服电话：95575	网址：www.gf.com.cn

26	中信证券股份有 限公司	注册地址：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座	
		法定代表人：张佑君	联系人：侯艳红
		电话：010-60838888	传真：010-60836029
		网址：www.cs.ecitic.com	
27	渤海证券股份有 限公司	注册地址：天津市经济技术开发区第二大街42号写字楼101室	
		办公地址：天津市河西区宾水道8号	
		法定代表人：杜庆平	联系人：王兆权
		电话：022-28451861	传真：022-28451892
		客服电话：400-651-5988	网址：www.bhzb.com
28	中信证券（山东） 有限责任公司	注册地址：青岛市崂山区苗岭路29号澳柯玛大厦15层1507-1510室	
		办公地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼第20层（266061）	
		法定代表人：杨宝林	联系人：赵艳青
		电话：0532-85023924	传真：0532-85022605
		客服电话：95548	网址：www.citicssd.com
29	长江证券股份有 限公司	注册地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦	
		法定代表人：崔少华	联系人：奚博宇
		电话：027-65799999	传真：027-85481900
		客服电话：95579	网址：www.95579.com
30	国海证券股份有 限公司	注册地址：广西桂林市辅星路13号	
		法定代表人：张雅锋	联系人：牛孟宇
		电话：0755-83709350	传真：0755-83704850
		客服电话：95563	网址：www.ghzq.com.cn
31	中泰证券股份有 限公司	注册地址：山东省济南市市中区经七路86号	
		办公地址：山东省济南市市中区经七路86号	
		法定代表人：李玮	联系人：吴阳
		电话：0531-68889155	传真：0531-68889185
		客服电话：95538	网址：www.zts.com.cn
32	安信证券股份有 限公司	注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元	

		法定代表人：王连志	联系人：陈剑虹
		联系电话：0755-82825551	传真：0755-82558355
		客服电话：400-800-1001	
		网址：www.essence.com.cn	
33	东莞证券有 限公司	注册地址：东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼	
		法定代表人：游锦辉	联系人：梁健伟
		电话：0769-22119341	传真：0769-22116999
		客服电话：0769-961130	网址：www.dgzq.com.cn
34	中国中投证券有 限责任公司	注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中 心A栋第18层-21层及第04层01.02.03.05.11.12.13. 15.16.18.19.20.21.22.23单元	
		法定代表人：高涛	联系人：张鹏
		电话：0755-82023442	传真：0755-82026539
		网址：www.china-invs.cn	
		客服电话：400-600-8008、95532	
35	长城国瑞证券有 限公司	注册地址：厦门市莲前西路二号莲富大厦十七楼	
		法定代表人：王勇	联系人：赵钦
		电话：0592-5161642	传真：0592-5161140
		客服电话：0592-5163588	网址：www.xmzq.cn
36	华宝证券有限责 任公司	注册地址：上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心57 层	
		法定代表人：陈林	联系人：刘闻川
		电话：021-68778081	传真021-68778117
		客服电话：400-820-9898	网址：www.cnhbstock.com
37	中国国际金融股 份有限公司	注册地址：北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及 28层	
		法定代表人：李剑阁	联系人：罗文雯
		电话：010-65051166	传真：010-65051156
		网址：www.cicc.com.cn	
38	天相投资顾问有 限公司	注册地址：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701	
		法定代表人：林义相	联系人：林爽
		电话：010-66045608	传真：010-66045527

		客服电话：010-66045678	网址：www.txsec.com
39	信达证券股份有 限公司	注册地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼	
		法定代表人：高冠江	联系人：唐静
		电话：010-88656100	传真：010-88656290
		客服电话：400-800-8899	网址：www.cindasc.com
40	华龙证券有限责 任公司	注册地址：甘肃省兰州市静宁路308号	
		法定代表人：李晓安	联系人：李昕田
		电话：0931-8888088	传真：0931-4890515
		客服电话：0931-4890100、4890619、4890618	
		网址：www.hlzqgs.com	
41	国元证券股份有 限公司	注册地址：安徽省合肥市寿春路179号	
		法定代表人：凤良志	联系人：祝丽萍
		电话：0551-2257012	传真：0551-2272100
		客服电话：95578	网址：www.gyzq.com.cn
42	西部证券股份有 限公司	注册地址：陕西省西安市东大街232号信托大厦16-17楼	
		法定代表人：刘建武	联系人：冯萍
		电话：029-87406488	传真：029-87406387
		客服电话：95582	网址：www.westsecu.com
43	平安证券股份有 限公司	注册地址：深圳市福田区中心区金田路4036号荣超大厦16-20层	
		法定代表人：谢永林	联系人：周一涵
		电话：021-38637436	传真：021-33830395
		客服电话：95511-8	网址：stock.pingan.com
44	东海证券股份有 限公司	注册地址：江苏省常州市延陵西路23号投资广场18层	
		法定代表人：刘化军	联系人：李涛
		电话：0519-88157761	传真：0519-88157761
		客服电话：400-888-8588	网址：www.longone.com.cn
45	山西证券股份有 限公司	注册地址：太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼	
		法定代表人：侯巍	联系人：郭熠
		电话：0351-8686659	传真：0351-8686619
		客服电话：400-666-1618、95573	

		网址：www.i618.com.cn	
46	华融证券股份有 限公司	注册地址：北京市西城区金融大街8号	
		法定代表人：宋德清	联系人：黄恒
		电话：010-58568235	传真：010-58568062
		客服电话：010-58568118	网址：www.hrsec.com.cn
47	江海证券有限公 司	注册地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号	
		法定代表人：孙名扬	联系人：张宇宏
		电话：0451-82336863	传真：0451-82287211
		客服电话：400-666-2288	网址：www.jhzq.com.cn
48	广州证券有限责 任公司	注册地址：广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19楼、20楼	
		法定代表人：刘东	联系人：林洁茹
		电话：020-88836655	传真：020-88836654
		客服电话：020-961303	网址：www.gzs.com.cn
49	西南证券股份有 限公司	注册地址：重庆市江北区桥北苑8号	
		法定代表人：余维佳	联系人：张煜
		电话：023-63786141	传真：023-63786212
		网址：www.swsc.com.cn	
50	国都证券股份有 限公司	注册地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层	
		法定代表人：常喆	联系人：黄静
		电话：010-84183333	传真：010-84183311-3389
		客服电话：4008188118	网址：www.guodu.com
51	华安证券股份有 限公司	注册地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号财智中心B1座	
		法定代表人：李工	联系人：汪燕
		电话：0551-65161675	传真：0551-65161600
		客服电话：4008096518	网址：www.huaan.com
52	华鑫证券有限责 任公司	注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01(b)单元	
		法定代表人：俞洋	联系人：王道
		电话：021-64339000	

		客服电话：021-32109999；029-68918888；4001099918	
		网址：www.cfsc.com.cn	
53	国金证券股份有限公司	注册地址：四川省成都市东城根上街95号	
		办公地址：四川省成都市东城根上街95号	
		法定代表人：冉云	联系人：贾鹏
		电话：028-86690058	传真：028-86690126
		客户服务电话：4006600109	网址：www.gjq.com.cn
54	中信期货股份有限公司	注册地址：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层	
		办公地址：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层	
		法定代表人：张皓	联系人：洪诚
		电话：0755-23953913	传真：0755-83217421
		网址：www.citicsf.com	
55	申万宏源西部证券有限公司	注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室	
		法定代表人：李季	联系人：王怀春
		电话：0991-2307105	传真：0991-2301927
		客服电话：4008000562	网址：www.hysec.com
56	华西证券股份有限公司	注册地址：四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦	
		办公地址：四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦	
		法定代表人：杨炯洋	联系人：谢国梅
		联系电话：010-52723273	传真：028-86150040
		客户服务电话：95584	网址：www.hx168.com.cn
57	杭州联合农村商业银行股份有限公司	注册地址：杭州市建国中路99号	
		法定代表：张晨	联系人：仇侃宁
		电话：0571-87923225	传真：0571-87923214
		客服电话：96592	网址：www.urcb.com
58	山东寿光农村商业银行股份有限公司	注册地址：山东寿光市银海路19号	
		法定代表：颜廷军	联系人：周淑贞
		电话：0536-5293756	传真：0536-5293756

		客服电话：0536—96633	
59	晋商银行股份有 限公司	注册地址：山西省太原市万柏林区长风西街一号丽华大厦 A 座	
		法定代表：阎俊生	
		客服电话：95105588	网址： www. jshbank. com
60	浙商银行股份有 限公司	注册地址：浙江省杭州市庆春路 288 号	
		法定代表人：张达洋	
		客服电话：95527	
		网址： www. czbank. com	
61	张家港农村商业 银行股份有限公司	注册地址：张家港市人民中路 66 号	
		法定代表：王自忠	联系人：朱芳
		电话：0512-96065	客服电话：0512-96065
		传真：051256968259	
		网址： www. zrcbank. com	
62	广发银行股份有 限公司	注册地址：广东省越秀区东风东路 713 号	
		法定代表人：杨明生	
		电话：020-38322888	传真：020-87310955
		客服电话：400-830-8003	
		网址： www. cgbchina. com. cn	
63	苏州银行股份有 限公司	注册地址：江苏省苏州工业园区钟园路 728 号	
		法定代表人：王兰凤	
		电话：0512-69868365	传真：0512-69868370
		客服电话：0512-96067	
		网址： <a href="http://www.suzhoubank.com">www. suzhoubank. com</a>	
64	江苏江南农村商业 银行股份有限公司	注册地址：常州市和平中路 413 号	
		法定代表：陆向阳	联系人：包静
		电话：0519-89995170	传真：0519-89995170
		客服电话：(0519)96005	
		网址： www. jnbank. com. cn.	

(2) 第三方销售机构

序号	机构名称	机构信息	
1	诺亚正行（上海） 基金销售投资顾问 有限公司	注册地址：上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室	
		办公地址：上海市杨浦区秦皇岛路32号c栋	
		法定代表人：汪静波	联系人：李娟
		电话：021-38602377	传真：021-38509777
		客服电话：400-821-5399	网址：www.noah-fund.com
2	上海好买基金销售 有限公司	注册地址：上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号	
		办公地址：上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903~906室	
		法定代表人：杨文斌	联系人：薛年
		电话：021-20613999	传真：021-68596916
		客服电话：400-700-9665	网址：www.ehowbuy.com
3	蚂蚁（杭州）基金 销售有限公司	注册地址：杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1栋202室	
		办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路18号黄龙时代广场B座6F	
		法定代表人：陈柏青	联系人：韩爱彬
		电话：0571-28829790	传真：0571-26698533
		客服电话：4000-766-123	网址：www.fund123.cn
4	深圳众禄金融控股 股份有限公司	注册地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼801	
		办公地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼801	
		法定代表人：薛峰	联系人：童彩平
		电话：0755-33227950	传真：0755-82080798
		客服电话：4006-788-887	
		网址：www.zlfund.cn 及 www.jjmmw.com	
5	上海长量基金销售 投资顾问有限公司	注册地址：上海市浦东新区高翔路526号2幢220室	
		办公地址：上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层	
		法定代表人：张跃伟	联系人：何昶
		电话：021-58788678-8201	传真：021-58787698
		客服电话：400-820-2899	网址：www.erichfund.com

6	北京展恒基金销售有限公司	注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街6号	
		法定代表人：闫振杰	联系人：焦琳
		电话：010-62020088-8288	传真：010-62020088-8802
		客服电话：4008886661	
		网址：www.myfund.com	
7	浙江同花顺基金销售有限公司	注册地址：杭州市文二西路1号903室	
		办公地址：杭州市余杭区五常街道同顺街18号同花顺大楼	
		法定代表人：凌顺平	联系人：杨翼
		电话：0571-88911818-8653	传真：0571-86800423
		客服电话：4008-773-772 0571-88920897	网址：www.5ifund.com
8	江苏金百临投资咨询有限公司	注册地址：无锡市滨湖区锦溪路99号	
		法定代表：费晓燕	联系人：袁丽萍
		电话：0510-82758877	传真：0510-88555858
		客服电话：0510-9688988	网址：www.jsjbl.com
9	上海天天基金销售有限公司	注册地址：上海市徐汇区龙田路190号2号楼二层	
		办公地址：上海市徐汇区宛平南路88号金座	
		法定代表：其实	联系人：朱钰
		电话：021-54509977	传真：021-64383798
		客服电话：4001818188	网址：www.1234567.com.cn
10	众升财富（北京）基金销售有限公司	注册地址：北京市朝阳区望京东园四区13号楼A座9层908室	
		办公地址：北京市朝阳区望京浦项中心A座9层04-08	
		法定代表：李招弟	联系人：李艳
		电话：010-59497361	传真：010-64788016
		客服电话：400-876-9988	网址：www.zscffund.com
11	上海利得基金销售有限公司	注册地址：上海市宝山区蕴川路5475号1033室	
		法定代表：李兴春	联系人：叶志杰
		电话：021-50583533	传真：021-50583633
		客服电话：400-921-7755	

		网址：www.leadfund.com.cn	
12	鼎信汇金（北京）投资管理有限公司	注册地址：北京市海淀区中关村东路1号院8号楼C座1701室	
		办公地址：北京市海淀区中关村东路1号院8号楼C座1701室	
		法定代表人：齐凌峰	联系人：阮志凌
		电话：010-82151989	传真：010-82158830
		客服电话：400-158-5050	网址：www.9ifund.com
13	浙江金观诚财富管理有限公司	注册地址：杭州市拱墅区登云路45号（锦昌大厦）1幢10楼1001室	
		办公地址：杭州市拱墅区登云路45号锦昌大厦一楼金观诚财富	
		法定代表人：徐黎云	联系人：孙成岩
		电话：0571-88337888	传真：0571-56899710
		客服电话：400-068-0058	
		网址：www.jincheng-fund.com	
14	嘉实财富管理有限公司	注册地址：上海市浦东新区世纪大道8号B座46楼06-10单元	
		法定代表人：赵学军	联系人：张倩
		电话：021-20289890	客服电话：400-021-8850
		传真：021-20280110、010-85097308	
		网址：www.harvestwm.cn	
15	宜信普泽投资顾问（北京）有限公司	注册地址：北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809	
		法定代表人：沈伟桦	联系人：王巨明
		电话：010-52858244	传真：010-85894285
		客服电话：400-6099-200	网址：www.yixinfund.com
16	一路财富（北京）信息科技有限公司	办公地址：北京西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座22层2208	
		办公地址：北京西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座2208	
		法定代表人：吴雪秀	联系人：徐越
		客服电话：400-001-1566	联系电话：010-88312877
		网址：www.yilucaifu.com	

17	上海联泰资产管理 有限公司	注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室	
		办公地址：上海市长宁区福泉北路 518 号 8 座 3 层	
		法定代表人：燕斌	联系人：兰敏
		电话：021-52822063	传真：021-52975270
		客服电话：400-166-6788	网址：www.66zichan.com
18	上海汇付金融服务 有限公司	注册地址：上海市黄浦区中山南路100号19层	
		办公地址：上海市徐汇区虹梅路1801号凯科国际大厦7楼	
		法定代表人：金佶	联系人：陈云卉
		客服电话：400-821-3999	
		手机客户端：天天盈基金	
19	上海陆金所资产管 理有限公司	注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元	
		办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号15楼	
		法定代表人：鲍东华	
		客户服务电话：400-821-9031	
		网站：www.lufunds.com	
20	泰诚财富基金销售 （大连）有限公司	注册地址：辽宁省大连市沙河口区星海公园3号	
		法定代表人：林卓	
		电话：0411-88891212	传真：0411-84396536
		客服电话：4006411999	
		网址：www.taichengcaifu.com	
21	北京钱景基金销售 有限公司	注册地址：北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012	
		法定代表人：赵荣春	
		电话：010-57418829	传真：010-57569671
		客服电话：400-893-6885	
		网址：www.qianjing.com	
22	北京虹点基金销售 有限公司	注册地址：北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙楼2层222单元	

		办公地址：北京市朝阳区工人体育馆北路甲 2 号盈科中心 B 座裙楼二层	
		法定代表人：胡伟	
		客户服务电话：400-618-0707	
		网址：www.hongdianfund.com	
23	北京微动利投资管理有限公司	注册地址：北京市石景山区古城西路 113 号景山财富中心金融商业楼 341 室	
		法定代表人：梁洪军	
		客户服务电话：400-819-6665	
		网址：www.buyforyou.com.cn	
24	深圳市新兰德证券投资咨询有限公司	注册地址：深圳市新兰德证券投资咨询有限公司	
		公司地址：北京市西城区宣武门外大街 28 号富卓大厦 A 座 7 层	
		客户服务电话：400-166-1188	
		法定代表人：张彦	联系人：文雯
		电话：010-83363101	
		网址：8.jrj.com.cn	
25	上海凯石财富基金销售有限公司	注册地址：上海市黄浦区西藏南路 765 号 602-115 室	
		法定代表：陈继武	联系人：李晓明
		电话：021-63333319	传真：021-63333390
		客服电话：4006-433-389	
		网址：www.lingxianfund.com	
26	深圳富济财富管理有限公司	注册地址：深圳市南山区粤海街道科苑南路高新南七道惠恒集团二期 418 室	
		办公地址：深圳市南山区粤海街道科苑南路高新南七道惠恒集团二期 418 室	
		法定代表：刘鹏宇	联系人：杨涛
		电话：0755-83999907-815	传真：0755-83999926
		客服电话：0755-83999907	
		网址：www.jinqianwo.cn	
27	珠海盈米财富管理	注册地址：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491	

	有限公司	办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼 1201-1203 单元	
		法定代表人：肖雯	联系人：李孟军
		电话：18500050725	传真：021-63333390
		客服电话：020-89629099	
		网址：www.yingmi.cn	
28	北京新浪仓石基金销售有限公司	注册地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期（西扩）N-1、N-2 地块新浪总部科研楼 5 层 518 室	
		办公地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期（西扩）N-1、N-2 地块新浪总部科研楼 5 层 518 室	
		法定代表人：李昭琛	联系人：付文红
		电话：010-62676405	传真：010-82607151
		客服电话：010-62675369	
		网址：www.xincai.com	
29	上海万得基金销售有限公司	注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座	
		法定代表人：王廷富	联系人：姜吉灵
		电话：021-51327185	传真：021-50710161
		客服电话：400-821-0203	
30	南京苏宁基金销售有限公司	注册地址：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号	
		办公地址：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号（苏宁总部）	
		法定代表人：钱燕飞	联系人：喻明明
		电话：025-66996699-884131	传真：025-66008800-884131
		客服电话：95177	
		网址：www.snjijin.com	
31	北京汇成基金销售有限公司	注册地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108	
		法定代表人：王伟刚	联系人：丁向坤
		电话：010-56282140	传真：010-62680827
		客服电话：400-619-9059	
		网址：www.hcjijin.com	
32	北京创金启富投资管理有限公司	注册地址：北京市西城区民丰胡同 31 号 5 号楼 215A	
		法定代表人：梁蓉	联系人：李婷婷

		电话：010-66154828	传真：010-63583991
		客服电话：400-6262-818	
		网址：www.5irich.com	
33	北京格上富信投资顾问有限公司	注册地址：北京市朝阳区东三环北路19号楼701内09室	
		办公地址：北京市朝阳区东三环北路19号楼701内09室	
		法定代表人：李悦章	联系人：曹庆展
		电话：010-68983311	传真：010-65983333
		客服电话：400-066-8586	
		网址：www.igesafe.com	
34	北京肯特瑞财富投资管理有限公司	注册地址：北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-06	
		办公地址：北京市亦庄经济开发区科创十一街18号院	
		法定代表人：江卉	联系人：赵德赛
		电话：010-89188343	客服电话：95118
		网址：fund.jd.com	
35	北京蛋卷基金销售有限公司	注册地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507	
		办公地址：北京市朝阳区望京SOHO T2 B座2507	
		法定代表人：钟斐斐	联系人：戚晓强
		电话：010-61840688	传真：010-61840699
		客服电话：4000618518	
		APP下载网址：danjuanapp.com	
36	北京恒天明泽基金销售有限公司	注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路10号五层5122室	
		办公地址：北京市朝阳区东三环北路甲19号SOHO嘉盛中心30层3001室	
		法定代表人：周斌	联系人：张鼎
		电话：010-59313555	传真：010-59313586
		客服电话：4008980618	
		网址：www.chtfund.com	
37	上海华夏财富投资管理有限公司	注册地址：上海市虹口区东大名路687号1幢2楼268室	
		办公地址：北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座16层	

		法定代表人：李一梅	联系人：仲秋玥
		电话：010-88066632	传真：010-88066552
		客服电话：400-817-5666	
		网址：www.amcfortune.com	
38	通华财富（上海） 基金销售有限公司	注册地址：上海市虹口区同丰路 667 弄 107 号 201 室	
		办公地址：上海市浦东新区杨高南路 799 号陆家嘴世纪金融广场 3 号楼 9 楼	
		法定代表人：兰奇	联系人：庄洁茹
		电话：021-60818110	客服电话：95156 转 5
		网址：www.tonghuafund.com	

（二）登记机构

名称：国泰基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道100号上海环球金融中心39楼

办公地址：上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层-19层

法定代表人：陈勇胜

联系人：辛怡

传真：021-31081800

客户服务专线：400-888-8688，021-31089000

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：俞卫锋

联系电话：021-31358666

传真：021-31358600

经办律师：黎明、丁媛

联系人：丁媛

（五）审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 507 单元

办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

执行事务合伙人：李丹

联系电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

联系人：李一

经办注册会计师：许康玮、李一

## 六、基金的历史沿革

国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金由国泰目标收益保本混合型证券投资基金变更而来。

国泰目标收益保本混合型证券投资基金经中国证监会《关于核准国泰目标收益保本混合型证券投资基金募集的批复》（证监许可【2013】364号文）核准募集。基金管理人为国泰基金管理有限公司、基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

国泰目标收益保本混合型证券投资基金于2013年7月12日至2013年8月8日公开募集，募集结束后基金管理人向中国证监会办理备案手续。经中国证监会书面确认，《国泰目标收益保本混合型证券投资基金基金合同》于2013年8月12日生效。

国泰目标收益保本混合型证券投资基金的保本期最长为每 3 年一个周期，在每一个保本期内均设置该保本期的目标收益率，在运作期间，如基金份额累计净值收益率连续 15 个工作日达到或超过预设目标收益率，则国泰目标收益保本混合型证券投资基金当期保本期提前到期。国泰目标收益保本混合型证券投资基金第一个保本期的目标收益率为 15%。自 2014 年 11 月 24 日起至 2014 年 12 月 12 日止国泰目标收益保本混合型证券投资基金的基金份额累计净值收益率连续 15 个工作日超过 15%，即国泰目标收益保本混合型证券投资基金已于 2014 年 12 月 12 日触发第一个保本期提前到期的条件。依据国泰目标收益保本混合型证券投资基金基金合同的约定，国泰目标收益保本混合型证券投资基金的第一个保本期提前到期并进入过渡期。过渡期结束后的下一日起，由于不再符合保本基金存续条件，国泰目标收益保本混合型证券投资基金变更为“国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金”。

根据《国泰目标收益保本混合型证券投资基金基金合同》的约定，变更后基金合同、托管协议和招募说明书分别修改为《国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金托管协议》和《国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》，调整的内容包括但不限于保留并适用《国泰目标收益保本混合型证券

投资基金基金合同》关于变更后的国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金的基金名称、投资目标、投资范围、投资限制以及基金费率等条款的约定，并根据现行有效的法律法规规定，在对持有人无实质性不利影响的前提下对基金合同的其他条款进行了修订。自过渡期结束后的下一日起，《国泰目标收益保本混合型证券投资基金基金合同》失效，《国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效，国泰目标收益保本混合型证券投资基金变更为国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金。前述修改变更事项已报中国证监会备案。

根据本基金管理人于2014年12月25日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和本基金管理人网站上刊登的《关于国泰目标收益保本混合型证券投资基金保本期提前到期处理规则及变更为国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金的公告》的相关规定，2015年1月16日是国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金合同生效日，同时也是基金份额折算基准日。在该日日终，基金管理人将对当日登记在册的基金份额实施折算。折算后，基金份额净值调整为1.000元，基金份额持有人持有的基金份额数按照折算比例相应调整。

经本基金管理人计算，并经本基金托管人中国建设银行股份有限公司复核，2015年1月16日本基金折算前的基金份额净值为1.183元，依据上述折算规则确定的折算比例为1.183489886。折算后本基金的总份额由64,095,910.03份调整为75,856,861.24份，基金份额净值调整为1.000元。基金份额持有人在其持有的基金份额所代表的资产净值总额保持不变的前提下，基金份额数按折算比例相应调整并进行变更登记，并以调整后的基金份额计为本基金的基金份额数。折算后的基金份额数以截位法保留到小数点后2位，并采用循环进位的方法分配因小数点运算所引起的剩余份额，最终结果以本基金登记机构确认的数据为准。

## 七、基金的存续

### （一）基金份额的变更登记

《基金合同》生效后，本基金登记机构将进行本基金份额的更名以及必要信息的变更。

### （二）基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

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

法律法规另有规定时，从其规定。

## 八、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。具体的销售网点将由基金管理人在相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减代销机构，并予以公告。若基金管理人或其指定的代销机构开通电话、传真或网上等交易方式，投资人可以通过上述方式进行申购与赎回，具体参见各销售机构的相关公告。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。

开放日的具体业务办理时间以销售机构公布时间为准。

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》的有关规定在指定媒介上公告。

#### 2、申购、赎回开始日及业务办理时间

本基金由国泰目标收益保本混合型证券投资基金变更而来。基金管理人自本基金基金合同生效之日起开始办理申购，自本基金基金合同生效之日起不超过1个月开始办理赎回。具体开始日期见基金管理人届时发布的相关公告。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》的有关规定在指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、赎回或转换申请的，其基金份额申购、赎回价格为下一开放日基金份额申购、赎回的价格。

### （三）申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的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、基金份额持有人在赎回基金份额时，基金管理人赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人申购的先后次序进行顺序赎回；

4、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。

基金管理人可在法律法规允许的情况下，根据基金运作的实际情况依法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》的有关规定在指定媒介上公告。

#### （四）申购和赎回的金额

##### 1、申购金额的限制

投资人单笔申购的最低金额为 10.00 元（含申购费）。各销售机构对本基金最低申购金额及交易级差有其他规定的，以各销售机构的业务规定为准。

##### 2、赎回份额的限制

基金份额持有人可将其全部或部分基金份额赎回。单笔赎回申请最低份数为 100.00 份,若某基金份额持有人赎回时在销售机构持有的基金份额不足 100.00 份，则该次赎回时必须一起赎回。

3、本基金不对投资者每个交易账户的最低基金份额余额进行限制。

4、本基金不对单个投资者累计持有的基金份额上限进行限制。

5、基金管理人可以根据市场情况，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的数量限制。基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。

#### （五）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；基金份额登记机构确认赎回时，赎回生效。基金份额持有人赎回申请成功后，基金管理人将在 T+7 日（包括该日）内支付赎回款项。在发生巨额赎回时，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申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日（T日），在正常情况下，本基金登记机构在 T+1 日内对该交易的有效性进行确认。T 日提交的有效申请，投资人应在 T+2 日后（包括该日）到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式及时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。

（六）申购与赎回的费率

1、申购费用

（1）申购费用由投资人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用。

（2）申购费率

本基金的前端申购费率最高不得高于 1.20%，且随申购金额的增加而递减，如下表所示：

申购金额（M）	前端申购费率
M<100 万	1.20%
100 万≤M<300 万	0.80%
300 万≤M<500 万	0.50%
500 万≤M	按笔收取，1000 元/笔

2、赎回费用

（1）赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。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；对持续持有期长于 30 日但少于 90 日的投资人收取的赎回费，将不低于赎回费总额的 75% 计入基金财产；对持续持有期长于 90 日但少于 180 日的投资人收取的赎回费，将不低于赎回费总额的 50% 计入基金财产；对持续持有期长于 180 日的投资人，将不低于赎回费总额的 25% 归入基金财产。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。

（2）赎回费率

本基金的赎回费率随基金份额持有时间增加而递减，赎回费率如下：

申请份额持有时间（N）	赎回费率
N<7 日	1.50%
7 日≤N<30 日	0.75%
30 日≤N<180 日	0.50%
180 日≤N<365 日	0.10%

365 日 ≤ N < 730 日	0.05%
N ≥ 730 日	0.00%

（注：申请份额持有时间的计算，以该份额在登记机构的登记日开始计算。）

（3）基金份额持有人赎回或转换转出其持有的本基金基金份额时应按基金合同和本招募说明书规定的费率确定并支付赎回费，但对于由国泰目标收益保本混合型证券投资基金变更而来的基金份额，在赎回或转换转出时，无需支付赎回费用。

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》的有关规定在指定媒介上公告。

4、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对特定地域范围、特定行业、特定职业的投资人以及以特定交易方式（如网上交易、电话交易等）等进行基金交易的投资人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申购费率和基金赎回费率。

#### （七）申购和赎回的价格、费用及其用途

1、申购份额、余额的处理方式：申购的有效份额为净申购金额除以当日的基金份额净值，有效份额单位为份，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。

2、赎回金额的处理方式：赎回金额为按实际确认的有效赎回份额以当日基金份额净值为基准并扣除相应的费用，计算结果按四舍五入方法，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。

#### 3、申购份额的计算

（1）申购费用适用比例费率时，申购份数的计算方法如下：

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} / (1 + \text{申购费率})$$

$$\text{申购费用} = \text{申购金额} - \text{净申购金额}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / T \text{ 日基金份额净值}$$

（2）申购费用为固定金额时，申购份数的计算方法如下：

$$\text{申购费用} = \text{固定金额}$$

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} - \text{申购费用}$$

$$\text{申购份数} = \text{净申购金额} / T \text{ 日基金份额净值}$$

例：某投资人投资 5,000 元申购本基金，对应费率为 1.20%，假设申购当日基金份额净值

为 1.128 元，则其可得到的申购份额为：

$$\text{净申购金额} = 5,000 / (1 + 1.20\%) = 4,940.71 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 5,000 - 4,940.71 = 59.29 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 4,940.71 / 1.128 = 4,380.06 \text{ 份}$$

投资人投资 5,000 元申购本基金，假设申购当日基金份额净值为 1.128 元，则可得到 4,380.06 份基金份额。

#### 4、赎回金额的计算

赎回金额的计算方法如下：

$$\text{赎回金额} = \text{赎回份额} \times \text{T 日基金份额净值}$$

$$\text{赎回费用} = \text{赎回金额} \times \text{相应的赎回费率}$$

$$\text{净赎回金额} = \text{赎回金额} - \text{赎回费用}$$

例：某投资人赎回 10,000 份基金份额，假设该份额的持有时间为 1 年 5 个月，赎回当日基金份额净值为 1.250 元，则其获得的赎回金额计算如下：

$$\text{赎回金额} = 10,000 \times 1.250 = 12,500.00 \text{ 元}$$

$$\text{赎回费用} = 12,500 \times 0.05\% = 6.25 \text{ 元}$$

$$\text{净赎回金额} = 12,500 - 6.25 = 12,493.75 \text{ 元}$$

5、本基金份额净值的计算，保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

#### （八）拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

- 1、因不可抗力导致基金无法正常运作。
- 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。
- 3、证券/期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
- 4、基金管理人接受某笔或某些申购申请会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，或出现其他损害现有基金份额持有人利益的情形。
- 6、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 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受申购申请时，

基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

#### （九）暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受基金份额持有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基金份额持有人的赎回申请或延缓支付赎回款项。
- 3、证券/期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
- 4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。
- 5、发生继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时，基金管理人可暂停接受基金份额持有人的赎回申请。
- 6、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基金份额持有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，基金份额持有人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如基金份额持有人在提交赎回申请时未作明确选择，基金份额持有人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

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

### 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、传真或者基金管理人网站在 3 个工作日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在指定媒介上刊登公告。

#### （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，基金管理人当日应立即向中国证监会备案，并在规定时间内在指定媒介上刊登暂停公告。

2、如发生暂停的，基金管理人应于重新开放日，在指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 个工作日的基金份额净值。

#### （十二）基金转换

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

#### （十三）基金的非交易过户

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

继承是指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；捐赠指基金

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

#### （十四）基金的转托管

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

#### （十五）定期定额投资计划

基金管理人可以为投资人办理定期定额投资计划，具体规则由基金管理人在届时发布公告或更新的招募说明书中确定。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）基金的冻结和解冻

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

#### （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。

## 九、基金的投资

### （一）投资目标

本基金力图通过灵活的大类资产配置，积极把握个股的投资机会，在控制风险并保持基金资产良好的流动性的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。

### （二）投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内上市交易的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货及中国证监会允许投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将

其纳入投资范围。

其中，股票、股指期货、权证等资产占基金资产的 30%-80%，债券、货币市场工具、现金、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 20% 以上，其中，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。股指期货的投资比例及限制按照法律法规及中国证监会相关规定执行。

当法律法规的相关规定变更时，基金管理人在履行适当程序后可对上述资产配置比例进行适当调整。

### （三）投资策略

#### 1、资产配置策略

本基金管理人依据 Melva 资产评估体系，通过考量宏观经济、企业盈利、流动性、估值和行政干预等相关变量指标的变化，评估确定一定阶段股票、债券和现金资产的配置比例。

#### 2、股票投资策略

##### （1）盈利能力股票筛选

本基金的股票资产投资主要以具有投资价值的股票作为投资对象，采取自下而上精选个股策略，利用 ROIC、ROE、股息率等财务指标筛选出盈利能力强的上市公司，构成具有盈利能力的股票备选池。

##### （2）价值评估分析

本基金通过价值评估分析，选择价值被低估上市公司，形成优化的股票池。价值评估分析主要运用国际化视野，采用专业的估值模型，合理使用估值指标，选择其中价值被低估的公司。具体采用的方法包括市盈率法、市净率法、市销率、PEG、EV/EBITDA、股息贴现模型等，基金管理人根据不同行业特征和市场特征灵活进行运用，努力为从估值层面持有人发掘价值。

##### （3）实地调研

对于本基金计划重点投资的上市公司，公司投资研究团队将实地调研上市公司，深入了解其管理团队能力、企业经营状况、重大投资项目进展以及财务数据真实性等。为了保证实地调研的准确性，投资研究团队还将通过对上市公司的外部合作机构和相关行政管理部门进一步调研，对上述结论进行核实。

##### （4）投资组合建立和调整

本基金将在案头分析和实地调研的基础上，建立和调整投资组合。在投资组合管理过程

中，本基金还将注重投资品种的交易活跃程度，以保证整体组合具有良好的流动性。

### 3、债券投资策略

本基金的债券资产投资主要以长期利率趋势分析为基础，结合中短期的经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析，通过收益率曲线配置等方法，实施积极的债券投资管理。

### 4、权证投资策略

本基金将在严格控制风险的前提下,主动进行权证投资。基金权证投资将以价值分析为基础,在采用数量化模型分析其合理定价的基础上,把握市场的短期波动,进行积极操作,追求在风险可控的前提下稳健的超额收益。

### 5、资产支持证券投资策略

本基金将分析资产支持证券的资产特征，估计违约率和提前偿付比率，并利用收益率曲线和期权定价模型，对资产支持证券进行估值。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。

### 6、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，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场 and 期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露股指期货交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示股指期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标。

## （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）本基金的投资组合比例为：股票、股指期货、权证等资产占基金资产的 30%-80%；债券、货币市场工具、现金、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 20%以上；

（2）每个交易日日终在扣除股指期货合约所需缴纳的交易保证金以后，保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；

（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%；本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；
- (15) 本基金参与股指期货交易依据下列标准建构组合：
  - 1) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；
  - 2) 本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和不得超过基金资产净值的 95%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、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，持有的卖出期货合约价值不得超过本基金持有的股票总市值的 20%；
  - 4) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；
  - 5) 本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；

(16) 基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

(17) 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、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 3 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上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

(1) 承销证券；

(2) 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，但是国务院另有规定的除外；

(5) 向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；

(6) 买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他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；

(7) 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；

(8) 依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

## (五) 业绩比较基准

本基金的业绩比较基准： $60\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 40\% \times \text{中证全债指数收益率}$

采用沪深 300 指数作为股票投资部分的业绩比较基准主要基于以下原因：

1、沪深 300 指数是沪深证券交易所第一次联合发布的反映 A 股市场整体走势的指数，由中证指数公司编制和维护，是在上海和深圳证券市场中选取 300 只 A 股作为样本编制而成。

2、该指数样本覆盖了沪深市场六成左右的市值，具有良好的市场代表性，投资者可以方便地从报纸、互联网等财经媒体中获取。

3、沪深 300 指数引进国际指数编制和管理的经验，编制方法清晰透明，具有独立性和良

好的市场流动性；与市场整体表现具有较高的相关度，且指数历史表现强于市场平均收益水平。

因此，沪深 300 指数是衡量该混合型基金股票投资业绩的理想基准。同时，根据目标资产配置比例，业绩比较基准中加入了中证全债指数并按照该混合型基金的目标资产配置比例来安排。

如果今后证券市场中有其他代表性更强或者更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。调整业绩比较基准应经基金托管人同意，并报中国证监会备案。基金管理人应在调整前 2 个工作日在指定媒介上予以公告。

#### （六）风险收益特征

本基金是一只灵活配置的混合型基金，属于基金中的中高风险品种，本基金的风险与预期收益介于股票型基金和债券型基金之间。

#### （七）投资组合报告

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 7 月 14 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截止 2017 年 6 月 30 日，本报告所列财务数据未经审计。

#### 1. 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	36,441,426.09	67.30
	其中：股票	36,441,426.09	67.30
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-

	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	17,643,163.00	32.58
7	其他资产	64,653.37	0.12
8	合计	54,149,242.46	100.00

## 2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	95,026.77	0.18
B	采矿业	-	-
C	制造业	29,705,796.06	55.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	3,969,328.00	7.38
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	685,032.00	1.27
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,923,357.32	3.58
S	综合	62,885.94	0.12
	合计	36,441,426.09	67.76

## 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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净
----	------	------	-------	---------	--------

					值比例（%）
1	002310	东方园林	237,400	3,969,328.00	7.38
2	600487	亨通光电	140,000	3,927,000.00	7.30
3	300156	神雾环保	108,800	3,564,288.00	6.63
4	600146	商赢环球	70,000	2,265,200.00	4.21
5	000858	五粮液	40,200	2,237,532.00	4.16
6	300145	中金环境	126,000	2,131,920.00	3.96
7	002217	合力泰	200,000	1,976,000.00	3.67
8	300148	天舟文化	103,948	1,464,627.32	2.72
9	300203	聚光科技	46,600	1,310,392.00	2.44
10	600872	中炬高新	70,000	1,281,000.00	2.38

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。

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。

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。

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。

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. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

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。

9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。若本基金投资股指期货，本基金将根据风险管理的原

则，以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

#### 10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

#### 11. 投资组合报告附注

11.1 本报告期内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受到公开谴责、处罚的情况。

11.2 基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情况。

#### 11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	4,884.59
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,264.67
5	应收申购款	56,504.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	64,653.37

#### 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可转换债券。

11.5 报告期末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 值比例(%)	流通受限情 况说明
1	600146	商赢环球	2,265,200.00	4.21	重大事项
2	300145	中金环境	2,131,920.00	3.96	重大事项
3	300148	天舟文化	1,464,627.32	2.72	重大事项

## 十、基金的业绩

本基金业绩截止日为2017年6月30日，并经基金托管人复核。

本基金管理人依照恪守职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，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。

阶段	净值增 长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准收 益率标准差④	①-③	②-④
2015年1月16日至 2015年12月31日	49.90%	2.71%	7.23%	1.50%	42.67	1.21%
2016年度	-9.47%	1.70%	-5.64%	0.84%	-3.83%	0.86%
2017年上半年	6.48%	0.68%	6.30%	0.35%	0.18%	0.33%
2015年1月16日至 2017年6月30日	44.50%	2.04%	7.55%	1.10%	36.95%	0.94%

注：2015年1月16日为基金合同生效日

## 十一、基金的财产

### （一）基金资产总值

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

### （二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### （三）基金财产的账户

基金托管人根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立资金账户、证券账户以及投资

所需的其他专用账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

#### （四）基金财产的保管和处分

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

## 十二、基金资产的估值

### （一）估值日

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

### （二）估值对象

基金所拥有的股票、权证、债券和银行存款本息、应收款项、股指期货合约、其他投资等资产及负债。

### （三）估值方法

#### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

（1）交易所上市的有价证券（包括股票、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）交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

（3）交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

（4）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。交易所上市的资产支持证券，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。

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

（2）首次公开发行未上市的股票、债券和权证，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）首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

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，采用估值技术确定公允价值。

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、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。

6、股票指数期货合约估值方法：

（1）股票指数期货合约以结算价格进行估值。

（2）在任何情况下，基金管理人如采用本项第（1）小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第（1）小项规定的方法对基金资产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，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

（3）国家有最新规定的，按其规定进行估值。

7、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0.001元，小数点后第4位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人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3位以内（含第3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。

责任；若估值错误责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责任。估值错误责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保估值错误已得到更正。

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

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

（4）估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

### 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

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

### 4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

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

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

（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他情形。

#### （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，由基金管理人对基金净值予以公布。

#### （八）特殊情况的处理

1、基金管理人或基金托管人按上述“（三）估值方法”的第5项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

2、由于不可抗力原因，或由于证券、期货交易所及登记结算公司发送的数据错误等，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。

## 十三、基金的收益与分配

#### （一）基金利润的构成

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

#### （二）基金可供分配利润

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

#### （三）基金收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为4次，每次收益分配比例不得低于该次单位可供分配利润的10%，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基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的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、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

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

#### （五）收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，在 2 日内在指定媒介公告并报中国证监会备案。

基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过 15 个工作日。

#### （六）基金收益分配中发生的费用

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

## 十四、基金的费用与税收

### （一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券、期货交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

### （二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 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，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 3 个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，应及时联系基金托管人协商解决。

## 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 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，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 3 个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，应及时联系基金托管人协商解决。

上述“（一）基金费用的种类中第 3—8 项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

### （三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

### （四）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## 十五、基金的会计和审计

### （一）基金会计政策

- 1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；
- 2、基金的会计年度为公历年度的 1 月 1 日至 12 月 31 日；

- 3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
- 4、会计制度执行国家有关会计制度；
- 5、本基金独立建账、独立核算；
- 6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；
- 7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

#### （二）基金的年度审计

- 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的具有证券从业资格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日内在指定媒介公告并报中国证监会备案。

## 十六、基金的信息披露

（一）本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《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法规和中国证监会规定的自然人、法人和其他组织。

本基金信息披露义务人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、准确性和完整性。

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中国证监会的指定媒介披露，并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

（三）本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

- 1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；
- 2、对证券投资业绩进行预测；
- 3、违规承诺收益或者承担损失；
- 4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构；

5、登载任何自然人、法人或者其他组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；

6、中国证监会禁止的其他行为。

（四）本基金公开披露的信息应采用中文文本。如同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证两种文本的内容一致。两种文本发生歧义的，以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

（五）公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

1、基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议

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

（2）基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金申购和赎回安排、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，基金管理人在每6个月结束之日起45日内，更新招募说明书并登载在其网站上，将更新后的招募说明书摘要登载在指定媒介上；基金管理人在公告的15日前向主要办公场所所在地的中国证监会派出机构报送更新的招募说明书，并就有关更新内容提供书面说明。

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

基金管理人将基金招募说明书、《基金合同》摘要登载在指定媒介上；基金管理人、基金托管人应当将《基金合同》、基金托管协议登载在各自网站上。

2、基金资产净值、基金份额净值

《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公告一次基金资产净值和基金份额净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过其网站、基金份额销售机构以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定媒介上。

3、基金份额申购、赎回价格

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

#### 4、基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告

基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于其网站上，将年度报告摘要登载在指定媒介上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。

基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定媒介上。

基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定媒介上。

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

基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。

#### 5、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，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地的中国证监会派出机构备案。

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；
- （2）终止《基金合同》；
- （3）转换基金运作方式；
- （4）更换基金管理人、基金托管人；
- （5）基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- （6）基金管理人股东及其出资比例发生变更；
- （7）基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动；
- （8）基金管理人的董事在一年内变更超过百分之五十；

(9) 基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年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者仲裁；

(11) 基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查；

(12) 基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚，基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚；

(13) 重大关联交易事项；

(14) 基金收益分配事项；

(15) 管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；

(16) 基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；

(17) 基金改聘会计师事务所；

(18) 变更基金销售机构；

(19) 更换基金登记机构；

(20) 本基金开始办理申购、赎回；

(21) 本基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；

(22) 本基金发生巨额赎回并延期办理；

(23) 本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；

(24) 本基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；

(25) 中国证监会规定的其他事项。

## 6、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，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会。

## 7、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。

## 8、投资股指期货的相关公告

基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露股指期货交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示股指期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标等。

## 9、投资资产支持证券的相关公告

基金管理人应在基金年报及半年报中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细。

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

#### 10、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，指定专人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的规定。

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告和定期更新的招募说明书等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人出具书面文件或者盖章确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定媒介中选择披露信息的报刊。

基金管理人、基金托管人除依法在指定媒介上披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒体披露信息，但是其他公共媒介不得早于指定媒介披露信息，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。

##### （七）信息披露文件的存放与查阅

招募说明书公布后，应当分别置备于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的办公场所，供公众查阅、复制。

基金定期报告公布后，应当分别置备于基金管理人和基金托管人的办公场所，以供公众查阅、复制。

## 十七、风险揭示

### （一）市场风险

证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响，导致

基金收益水平变化，产生风险，主要包括：

- 1、政策风险。因国家宏观政策（如货币政策、财政政策、行业政策、地区发展政策等）发生变化，导致市场价格波动而产生风险。
- 2、经济周期风险。随经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化。基金投资于国债与上市公司的股票，收益水平也会随之变化，从而产生风险。
- 3、利率风险。金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着国债的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。基金投资于国债和股票，其收益水平会受到利率变化的影响。
- 4、上市公司经营风险。上市公司的经营好坏受多种因素影响，如管理能力、财务状况、市场前景、行业竞争、人员素质等，这些都会导致企业的盈利发生变化。如果基金所投资的上市公司经营不善，其股票价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，使基金投资收益下降。虽然基金可以通过投资多样化来分散这种非系统风险，但不能完全规避。
- 5、购买力风险。基金的利润将主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀的影响而导致购买力下降，从而使基金的实际收益下降。

#### （二）债券收益率曲线变动风险

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

#### （三）再投资风险

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

#### （四）管理风险

在基金管理运作过程中基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等会影响其对信息的占有和对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平。因此，本基金的收益水平与本基金管理人的管理水平、管理手段和管理技术等相关性较大。因此本基金可能因为基金管理人的因素而影响基金收益水平。

#### （五）操作或技术风险

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

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

#### （六）流动性风险

本基金属于开放式基金，在基金的所有开放日，基金管理人都有义务接受投资人的赎回。如果基金资产不能迅速转变成现金，或者变现为现金时使资金净值产生不利的影响，都会影响基金运作和收益水平。尤其是在发生巨额赎回时，如果基金资产变现能力差，可能会产生基金仓位调整的困难，导致流动性风险，可能影响基金份额净值。

#### （七）本基金的特定风险

本基金是混合型基金，股票、股指期货、权证等资产占基金资产的 30%-80%；本基金投资于国内上市交易的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货及中国证监会允许投资的其他金融工具。因此股市、债市的变化将影响到本基金的业绩表现。本基金管理人将发挥专业研究优势，加强对市场、上市公司基本面和固定收益类产品的深入研究，持续优化组合配置，以控制特定风险。

本基金可投资于股指期货，股指期货作为一种金融衍生品，具备一些特有的风险点。投资股指期货所面临的主要风险是市场风险、流动性风险、基差风险、保证金风险、信用风险、和操作风险。具体为：

1、市场风险是指由于股指期货价格变动而给投资者带来的风险。市场风险是股指期货投资中最主要的风险。

2、流动性风险是指由于股指期货合约无法及时变现所带来的风险。

3、基差风险是指股指期货合约价格和标的指数价格之间价格差的波动所造成的风险，以及不同股指期货合约价格之间价格差的波动所造成的期限价差风险。

4、保证金风险是指由于无法及时筹措资金满足建立或维持股指期货合约头寸所要求的保证金而带来的风险。

5、信用风险是指期货经纪公司违约而产生损失的风险。

6、操作风险是指由于内部流程的不完善，业务人员出现差错或者疏漏，或者系统出现故障等原因造成损失的风险。

#### （八）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、欺诈行为等产生的风险；
- 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、因业务竞争压力可能产生的风险；
- 6、战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金资产的损失，影响基金收益水平，从而带来风险；
- 7、其他意外导致的风险。

## 十八、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2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

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。

## 十九、基金合同的内容摘要

(一) 基金合同当事人的权利、义务

1、基金管理人

- (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) 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；
  - 2) 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；

- 3) 销售基金份额;
  - 4) 按照规定召集基金份额持有人大会;
  - 5) 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、法规规定, 应呈报中国证监会和其他监管部门, 并采取必要措施保护基金投资者的利益;
  - 6) 在基金托管人更换时, 提名新的基金托管人;
  - 7) 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;
  - 8) 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;
  - 9) 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;
  - 10) 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;
  - 11) 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;
  - 12) 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、融券;
  - 13) 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;
  - 14) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商、期货经纪机构或其他为基金提供服务的外部机构;
  - 15) 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、转换和非交易过户等业务规则;
  - 16) 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) 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内发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件；

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

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

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

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

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

- 23) 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；
- 24) 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。

## 2、基金托管人

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

- 1) 自《基金合同》生效之日起，依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产；
- 2) 依《基金合同》约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用；
- 3) 监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人违反《基金合同》及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

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

5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

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

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

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

5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

6) 按规定开设基金财产的资金账户、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；

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份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

16) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；

17) 参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

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

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

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

21) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

### 3、基金份额持有人

(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；

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) 缴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各种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立日常机构。

1、召开事由

(1) 当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

- 1) 终止《基金合同》；
- 2) 更换基金管理人；
- 3) 更换基金托管人；
- 4) 转换基金运作方式；
- 5) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；

- 6) 变更基金类别;
- 7) 本基金与其他基金的合并;
- 8) 变更基金投资目标、范围或策略;
- 9) 变更基金份额持有人大会程序;
- 10) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会;
- 11) 单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会;
- 12) 对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项;
- 13) 法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

(2) 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) 调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用;
- 2) 法律法规要求增加的基金费用的收取;
- 3) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内或在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;
- 4) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改;
- 5) 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生重大变化;
- 6) 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以外的其他情形。

## 2、会议召集人及召集方式

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

(2) 基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。

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

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

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

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

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

### 3、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

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

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

（3）如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人

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

#### 4、基金份额持有人出席会议的方式

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

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

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

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

（2）通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式在表决截至日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

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

3）本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）；若本人直接出具书面意见

或授权他人代表出具书面意见基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）基金份额的持有人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见；

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

#### 5、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。

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

##### 2) 通讯开会

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

## 6、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。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》、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。

## 7、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。

## 8、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。

9、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,基金管理人提前公告后,可直接对本部分内容进行修改和调整,无需召开基金份额持有人大会审议。

## (三) 基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### 1、《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生效后方可执行,并自决议生效后2个工作日内在指定媒介公告。

### 2、《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。

### 3、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。

### 4、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。

### 5、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。

### 6、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。

#### 7、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。

#### （四）争议的处理和适用的法律

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力，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》受中国法律管辖。

#### （五）基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

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

## 二十、托管协议的内容摘要

### （一）托管协议当事人

#### 1、基金管理人

名称：国泰基金管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道100号上海环球金融中心39楼

办公地址：上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层-19层

邮政编码：200082

法定代表人：陈勇胜

成立日期：1998年3月5日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字【1998】5号

组织形式：有限责任公司

注册资本：壹亿壹仟万元人民币

存续期间：持续经营

经营范围：基金募集；基金销售；资产管理以及中国证监会许可的其他业务。

## 2、基金托管人

名称：中国建设银行股份有限公司（简称：中国建设银行）

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

邮政编码：100033

法定代表人：王洪章

成立日期：2004 年 09 月 17 日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】12 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、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；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；经中国银行业监督管理机构等监管部门批准的其他业务。

### （二）基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

1、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种池，以便基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内上市交易的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货及中国证监会允许投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，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的约定，对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督：

（1）本基金的投资组合比例为：股票、权证等资产占基金资产的 30%-80%；债券、货币

市场工具、现金、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 20%以上；

（2）每个交易日日终在扣除股指期货合约所需缴纳的交易保证金以后，保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；

（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）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

（5）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%；

（6）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%；

（7）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%；

（8）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%；

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

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

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

（12）本基金参与股指期货交易依据下列标准建构组合：

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

2）本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和不得超过基金资产净值的 95%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、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，持有的卖出期货合约价值不得超过本基金持有的股票总市值的 20%；

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

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

(13) 本基金持有的所有流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的 20%；本基金持有的同一流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的 10%；

(14) 基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

(15) 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、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 3 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的约定，对本托管协议第十五条第九款基金投资禁止行为进行监督。

基金托管人通过事后监督方式对基金管理人基金投资禁止行为和关联交易进行监督。根据法律法规有关基金禁止从事关联交易的规定，基金管理人和基金托管人应事先相互提供与本机构有控股关系的股东、与本机构有其他重大利害关系的公司名单及有关关联方发行的证券名单。基金管理人和基金托管人有责任确保关联交易名单的真实性、准确性、完整性，并负责及时将更新后的名单发送给对方。

若基金托管人发现基金管理人与关联交易名单中列示的关联方进行法律法规禁止基金从事的关联交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人采取必要措施阻止该关联交易的发生，如基金托管人采取必要措施后仍无法阻止关联交易发生时，基金托管人有权向中国证监会报告。对于基金管理人已成交的关联交易，基金托管人事前无法阻止该关联交易的发生，只能进行事后结算，基金托管人不承担由此造成的损失，并向中国证监会报告。

4、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的、经慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手名单，并约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金管理人应严格按照交易对手名单的范围在银行间债券市场选择交

易对手。基金托管人监督基金管理人是否按事前提提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易。基金管理人可以每半年对银行间债券市场交易对手名单及结算方式进行更新，新名单确定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。如基金管理人根据市场情况需要临时调整银行间债券市场交易对手名单及结算方式的，应向基金托管人说明理由，并在与交易对手发生交易前3个工作日内与基金托管人协商解决。

基金管理人负责对交易对手的资信控制，按银行间债券市场的交易规则进行交易，并负责解决因交易对手不履行合同而造成的纠纷及损失，基金托管人不承担由此造成的任何法律责任及损失。若未履约的交易对手在基金托管人与基金管理人确定的时间前仍未承担违约责任及其他相关法律责任的，基金管理人可以对相应损失先行予以承担，然后再向相关交易对手追偿。基金托管人则根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督。如基金托管人事后发现基金管理人没有按照事先约定的交易对手或交易方式进行交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人，基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任。

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

基金管理人投资流通受限证券，应事先根据中国证监会相关规定，明确基金投资流通受限证券的比例，制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险。基金托管人对基金管理人是否遵守相关制度、流动性风险处置预案以及相关投资额度和比例等的情况进行监督。

（1）本基金投资的流通受限证券须为经中国证监会批准的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。本基金不投资有锁定期但锁定期不明确的证券。

本基金投资的流通受限证券限于可由中国证券登记结算有限责任公司或中央国债登记结算有限责任公司负责登记和存管，并可在证券交易所或全国银行间债券市场交易的证券。

本基金投资的流通受限证券应保证登记存管在本基金名下，基金管理人负责相关工作的落实和协调，并确保基金托管人能够正常查询。因基金管理人原因产生的流通受限证券登记存管问题，造成基金托管人无法安全保管本基金资产的责任与损失，及因受限证券存管直接影响本基金安全的责任及损失，由基金管理人承担。

本基金投资流通受限证券，不得预付任何形式的保证金。

（2）基金管理人投资非公开发行股票，应制订流动性风险处置预案并经其董事会批准。

风险处置预案应包括但不限于因投资流通受限证券需要解决的基金投资比例限制失调、基金流动性困难以及相关损失的应对解决措施，以及有关异常情况的处置。基金管理人应在首次投资流通受限证券前向基金托管人提供基金投资非公开发行股票相关流动性风险处置预案。

基金管理人对本基金投资流通受限证券的流动性风险负责，确保对相关风险采取积极有效的措施，在合理的时间内有效解决基金运作的流动性问题。如因基金巨额赎回或市场发生剧烈变动等原因而导致基金现金周转困难时，基金管理人应保证提供足额现金确保基金的支付结算，并承担所有损失。对本基金因投资流通受限证券导致的流动性风险，基金托管人不承担任何责任。如因基金管理人原因导致本基金出现损失致使基金托管人承担连带赔偿责任的，基金管理人应赔偿基金托管人由此遭受的损失。

（3）本基金投资非公开发行股票，基金管理人应至少于投资前三个工作日向基金托管人提交有关书面资料，并保证向基金托管人提供的有关资料真实、准确、完整。有关资料如有调整，基金管理人应及时提供调整后的资料。上述书面资料包括但不限于：

1) 中国证监会批准发行非公开发行股票的批准文件。

2) 非公开发行股票有关发行数量、发行价格、锁定期等发行资料。

3) 非公开发行股票发行人与中国证券登记结算有限责任公司或中央国债登记结算有限责任公司签订的证券登记及服务协议。

4) 基金拟认购的数量、价格、总成本、账面价值。

（4）基金管理人应在本基金投资非公开发行股票后两个交易日内，在中国证监会指定媒介披露所投资非公开发行股票的名称、数量、总成本、账面价值，以及总成本和账面价值占基金资产净值的比例、锁定期等信息。

本基金有关投资流通受限证券比例如违反有关限制规定，在合理期限内未能进行及时调整，基金管理人应在两个工作日内编制临时报告书，予以公告。

（5）基金托管人根据有关规定有权对基金管理人进行以下事项监督：

1) 本基金投资流通受限证券时的法律法规遵守情况。

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

3) 有关比例限制的执行情况。

4) 信息披露情况。

（6）相关法律法规对基金投资流通受限证券有新规定的，从其规定。

6、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金资产净值计算、基金

份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、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。

7、基金托管人发现基金管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作违反法律法规、基金合同和本托管协议的规定，应及时以电话提醒或书面提示等方式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到书面通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函，就基金托管人的疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

8、基金管理人义务配合和协助基金托管人依照法律法规、基金合同和本托管协议对基金业务执行核查。对基金托管人发出的书面提示，基金管理人应在规定时间内答复并改正，或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律法规、基金合同和本托管协议的要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

9、若基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当立即通知基金管理人，由此造成的损失由基金管理人承担。

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

### （三）基金管理人对于基金托管人的业务核查

1、基金管理人对于基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户、证券账户等投资所需账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

2、基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、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时，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正。基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式给基金管理人发出回函，说明违规原因及纠正期限，并保证在

规定期限内及时改正。在上述规定期限内，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。基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复基金管理人并改正。

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

#### （四）基金财产的保管

##### 1、基金财产保管的原则

（1）基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。

（2）基金托管人应安全保管基金财产。

（3）基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户、证券账户等投资所需账户。

（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与独立。

（5）基金托管人按照基金合同和本协议的约定保管基金财产，如有特殊情况双方可另行协商解决。基金托管人未经基金管理人的指令，不得自行运用、处分、分配本基金的任何资产（不包含基金托管人依据中国结算公司结算数据完成场内交易交收、托管资产开户银行扣收结算费和账户维护费等费用）。

（6）对于因为基金投资产生的应收资产，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，到账日基金财产没有到达基金账户的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金财产造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金财产的损失，基金托管人对此不承担任何责任。

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

##### 2、基金银行账户的开立和管理

（1）基金托管人可以基金的名义在其营业机构开立基金的银行账户，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。

（2）基金银行账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立任何其他银行账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

（3）基金银行账户的开立和管理应符合银行业监督管理机构的有关规定。

（4）在符合法律法规规定的条件下，基金托管人可以通过基金托管人专用账户办理基金

资产的支付。

### 3、基金证券账户和结算备付金账户的开立和管理

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

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

（3）基金证券账户的开立和证券账户卡的保管由基金托管人负责，账户资产的管理和运用由基金管理人负责。

（4）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，并代表所托管的基金完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级法人清算工作，基金管理人应予以积极协助。结算备付金、结算互保基金、交收价差资金等的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

（5）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，若无相关规定，则基金托管人比照上述关于账户开立、使用的规定执行。

### 4、债券托管专户的开设和管理

基金合同生效后，基金管理人负责以基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表基金进行交易；基金托管人根据中国人民银行、银行间市场登记结算机构的有关规定，在银行间市场登记结算机构开立债券托管账户，持有人账户和资金结算账户，并代表基金进行银行间市场债券的结算。基金管理人和基金托管人共同代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议。

### 5、其他账户的开立和管理

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

（2）法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

### 6、基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的有关实物证券、银行存款开户证实书等有价凭证由基金托管人存放于基

金托管人的保管库，也可存入中央国债登记结算有限责任公司、中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司或票据营业中心的代保管库，保管凭证由基金托管人持有。有价凭证的购买和转让，由基金管理人和基金托管人共同办理。基金托管人对由基金托管人以外机构实际有效控制的资产不承担保管责任。

#### 7、与基金财产有关的重大合同的保管

与基金财产有关的重大合同的签署，由基金管理人负责。由基金管理人代表基金签署的、与基金财产有关的重大合同的原件分别由基金管理人、基金托管人保管。除本协议另有规定外，基金管理人代表基金签署的与基金财产有关的重大合同包括但不限于基金年度审计合同、基金信息披露协议及基金投资业务中产生的重大合同，基金管理人应保证基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人应在重大合同签署后及时以加密方式将重大合同传真给基金托管人，并在三十个工作日内将正本送达基金托管人处。重大合同的保管期限为基金合同终止后 15 年。

### （五）基金资产净值计算和会计核算

#### 1、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的金额。

基金份额净值是指按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额总数，基金份额净值的计算，精确到 0.001 元，小数点后第四位四舍五入，国家另有规定的，从其规定。

基金管理人每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，经基金托管人复核，按规定公告。

#### 2、复核程序

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基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每工作日对基金资产进行估值后，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，由基金管理人对外公布。

3、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，仍无法达成一致意见的，按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。

### （六）基金份额持有人名册的登记与保管

基金份额持有人名册至少应包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。基金份额持有人名册由基金登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，基金管理人和基金托管人应分

别保管基金份额持有人名册，保存期不少于15年。如不能妥善保管，则按相关法规承担责任。

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

#### （七）争议解决方式

因本协议产生或与之相关的争议，双方当事人应通过协商、调解解决，协商、调解不能解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，仲裁地点为北京市，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，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，双方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责，各自继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和本托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本协议受中国法律管辖。

#### （八）托管协议的变更与终止

##### 1、托管协议的变更程序

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。基金托管协议的变更报中国证监会备案。

##### 2、基金托管协议终止出现的情形

- （1）基金合同终止；
- （2）基金托管人解散、依法被撤销、破产或由其他基金托管人接管基金资产；
- （3）基金管理人解散、依法被撤销、破产或由其他基金管理人接管基金管理权；
- （4）发生法律法规或基金合同规定的终止事项。

## 二十一、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、修改这些服务项目。

#### （一）客户服务专线

##### 1、理财咨询

人工理财咨询、账户查询、投资人个人资料完善等。

2、全天候的7×24小时电话自助查询（基金净值、账户信息、公司介绍、产品介绍、交易费率等）。

3、7×24小时留言信箱。若不在人工服务时间或座席繁忙，可留言，基金管理人会尽快在2个工作日内回电。

（二）客户投诉及建议受理服务

投资人可以通过信函、电邮、传真等方式提出咨询、建议、投诉等需求，基金管理人将尽快给予回复，并在处理进程中随时给予跟踪反馈。

（三）短信提示发送服务

投资人可以通过拨打基金管理人客户服务电话、网站申请订制（退订）免费的手机短信资讯。基金管理人定期或不定期向投资人发送短信资讯。

（四）电子邮件电子刊物发送服务

投资人可以通过拨打基金管理人客户服务电话、网站申请订制（退订）免费的电子邮件资讯。基金管理人定期或不定期向投资人发送电子资讯。

（五）联系基金管理人

1、网址：[www.gtfund.com](http://www.gtfund.com)

2、电子邮箱：[service@gtfund.com](mailto:service@gtfund.com)

3、客户服务热线：400-888-8688（全国免长途话费），021-31089000

4、客户服务传真：021-31081700

5、基金管理人办公地址：上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层-19层 邮编：200082

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

## 二十二、其他应披露事项

公告名称	报社	日期
国泰基金管理有限公司调整长期停牌股票估值方法的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017/1/17
国泰基金管理有限公司调整长期停牌股票估值方法的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017/1/18
国泰基金管理有限公司副总经理任职公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017/2/9

国泰基金管理有限公司关于新增交通银行股份有限公司直销账户的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017/3/3
国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017/3/7
国泰基金管理有限公司关于新增北京肯特瑞财富投资管理有限公司销售旗下部分基金、开通定期定额投资计划、转换业务并开展费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017/3/14
国泰基金管理有限公司关于旗下部分基金参加宜信普泽投资顾问（北京）有限公司申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017/3/17
国泰基金管理有限公司关于北京分公司迁址的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017/3/25
国泰基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017/3/25
国泰基金管理有限公司关于旗下部分基金参加张家港农村商业银行股份有限公司申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017/3/31
国泰基金管理有限公司关于新增北京蛋卷基金销售有限公司销售旗下部分基金、开通定期定额投资计划、转换业务并开展费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017/3/31
国泰基金管理有限公司关于旗下部分基金参加广发证券股份有限公司申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017/4/7
国泰基金管理有限公司关于新增北京恒天明泽基金销售有限公司销售旗下部分基金并开通定期定额投资计划、转换业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017/4/7
国泰基金管理有限公司调整长期停牌股票估值方法的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017/4/22
国泰基金管理有限公司关于新增上海华夏财富投资管理有限公司销售旗下部分基金的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017/5/10
国泰基金管理有限公司关于新增上海通华财富资产管理有限公司销售旗下部分基金并开通定期定额投资计划、转换业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017/5/12
国泰基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中泰证券股份有限公司申购（含定投）费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2017/7/12

### 二十三、招募说明书存放及其查阅方式

本招募说明书存放在本基金管理人、基金托管人、基金销售机构和登记机构的办公场所，投资人可在办公时间免费查阅；也可按工本费购买本招募说明书复制件或复印件，但应以招

募说明书正本为准。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

## 二十四、备查文件

以下备查文件存放在本基金管理人、基金托管人的办公场所。投资人可在办公时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

- （一）《国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- （二）《国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- （三）法律意见书
- （四）基金管理人业务资格批件、营业执照
- （五）基金托管人业务资格批件、营业执照
- （六）中国证监会规定的其他文件

国泰基金管理有限公司

二〇一七年八月二十九日