

中海策略精选灵活配置混合型  
证券投资基金更新招募说明书  
(2018 年第 2 号)

基金管理人：中海基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

## 重要提示

中海策略精选灵活配置混合型证券投资基金由中海安鑫保本混合型证券投资基金转型而来。中海安鑫保本混合型证券投资基金的募集申请已于2013年4月19日获中国证监会证监许可【2013】369号文核准，其转型后的中海策略精选灵活配置混合型证券投资基金已经中国证监会备案。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会备案，但中国证监会对中海安鑫保本混合型证券投资基金募集的核准以及其转型为本基金的备案，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

投资有风险，投资者申购本基金时应认真阅读本招募说明书，全面认识本基金产品的风险收益特征，充分考虑投资者自身的风险承受能力，并对于申购基金的意愿、时机、数量等投资行为做出独立决策。基金管理人提醒投资者基金投资要承担相应风险，包括市场风险、管理风险、流动性风险、本基金的特定风险等。

本基金是一只混合型基金，其预期收益和风险水平高于货币市场基金、债券型基金，而低于股票型基金，在证券投资基金中属于中等风险收益品种。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。

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，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。

本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过50%的除外。

本招募说明书（更新）所载内容截止日为2018年9月16日，有关财务数据和净值表现截止日为2018年6月30日（财务数据未经审计）。

## 目 录

一、绪 言 .....	3
二、释 义 .....	4
三、基金管理人 .....	9
四、基金托管人 .....	21
五、相关服务机构 .....	28
六、基金的历史沿革 .....	64
七、基金的存续 .....	65
八、基金份额的申购和赎回 .....	66
九、基金的投资 .....	78
十、基金的业绩 .....	91
十一、基金的财产 .....	92
十二、基金资产的估值 .....	93
十三、基金的收益与分配 .....	98
十四、基金的费用与税收 .....	100
十五、基金的会计与审计 .....	102
十六、基金的信息披露 .....	103
十七、风险揭示 .....	109
十八、基金合同的变更、终止与基金财产的清算 .....	114
十九、基金合同的内容摘要 .....	116
二十、基金托管协议的内容摘要 .....	132
二十一、对基金份额持有人的服务 .....	156
二十二、其他应披露的事项 .....	159
二十三、招募说明书存放及查阅方式 .....	162
二十四、备查文件 .....	163

## 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》”)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性管理规定》”)等相关法律法规和《中海策略精选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。

本招募说明书阐述了中海策略精选灵活配置混合型证券投资基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资者投资决策有关的全部必要事项,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

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

本招募说明书根据本基金的基金合同编写,并经中国证监会备案。基金合同是约定基金合同当事人之间权利、义务的法律文件。本基金投资者自依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,其持有本基金份额的行为本身即表明其对本基金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。基金投资者欲了解本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

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

1、基金或本基金：指中海策略精选灵活配置混合型证券投资基金，由中海安鑫保本混合型证券投资基金转型而来

2、基金管理人：指中海基金管理有限公司

3、基金托管人：指上海浦东发展银行股份有限公司

4、基金合同、《基金合同》：指《中海策略精选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《中海策略精选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《中海策略精选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 日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自 2013 年 6 月 1 日起实施，并经 2015 年 4 月 24 日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修改的《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、《流动性风险管理规定》：指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时作出的修订

13、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

14、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

15、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

16、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

17、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

18、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

19、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人的合称

20、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

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

22、销售机构：指中海基金管理有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金

销售服务代理协议，代为办理基金销售业务的机构

23、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

24、登记机构：指办理登记业务的机构。基金的登记机构为中海基金管  
理有限公司或接受中海基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构

25、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

26、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  
售机构买卖基金的基金份额变动及结余情况的账户

27、基金合同生效日：原中海安鑫保本混合型证券投资基金因未能符合  
保本基金存续条件，按照《中海安鑫保本混合型证券投资基金基金合同》的  
规定，经基金管理人和基金托管人同意，并报中国证监会备案，基金管理  
人对《中海安鑫保本混合型证券投资基金基金合同》进行了变更，形成了《中  
海策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。基金合同生效日指《中  
海策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的生效日期，《中海安  
鑫保本混合型证券投资基金基金合同》自同一起失效

28、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

29、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

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《中海基金管理有限公司开放式基金业务规则》，

是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金登记方面的业务规则，由基金管理人和投资人共同遵守

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、**流动性受限资产**：指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因



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

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

50、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介

51、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：中海基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层

办公地址：上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层

邮政编码：200120

成立日期：2004 年 3 月 18 日

法定代表人：杨皓鹏

总经理：杨皓鹏

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、中国证监会许可的其他业务。

**【依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动】**

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：证监基金字[2004]24 号

组织形式：有限责任公司（中外合资）

注册资本：壹亿肆仟陆佰陆拾陆万陆仟柒佰元人民币

存续期间：持续经营

联系人：葛玮赓

联系电话：021-38429808

股东名称及其出资比例：

中海信托股份有限公司	41.591%
------------	---------

国联证券股份有限公司	33.409%
------------	---------

法国爱德蒙得洛希尔银行股份有限公司	25.000%
-------------------	---------

#### （二）主要人员情况

##### 1、董事会成员

黄晓峰先生，董事长。中国人民大学硕士，高级经济师。现任中海信托

股份有限公司总裁、党委书记。历任湖北省计划管理干部学院助教，国家海洋局管理司主任科员，中国海洋石油总公司计划项目处、经济评价处干部、保险处保险主管，中海石油有限公司税收保险岗、代理融资岗位经理、资金部副总监、代理总监、总监，中海石油财务有限责任公司总经理。

庞建先生，董事。中国人民大学本科毕业，高级会计师。现任中海石油财务有限公司总经理。历任渤海石油公司对外合作部计划财务部外事会计，渤海13/03合作区联管会财务专业代表，10/15、11/19、06/17合作区联管会财务专业代表，中国海洋石油总公司审计部干部，中海会计审计公司第三业务处干部、审计业务三部经理（副处级），中国海洋石油总公司（有限公司）审计部审计三处处长、项目审计经理、审计监察部投资项目审计调查经理、内审岗经理，中国海洋石油有限公司审计监察部总经理，中国海洋石油总公司（有限公司）审计监察部副总经理兼审计中心主任，中国海洋石油国际有限公司副总经理，中国海洋石油总公司资金部总经理。

杨皓鹏先生，董事。复旦大学硕士。现任中海基金管理有限公司总经理兼中海恒信资产管理（上海）有限公司董事长。历任中海信托股份有限公司综合管理部总裁秘书、托管部项目经理、自有资金及信息管理部综合业务经理、办公室主任、党委书记、人力资源部经理、资产经营部经理，中海基金管理有限公司总经理助理、代理督察长。

彭焰宝先生，董事。清华大学学士。现任国联证券股份有限公司总裁、董事，兼华英证券有限责任公司董事。历任无锡市证券公司（国联证券前身）交易员，国联证券有限责任公司投资经理，无锡市国联投资管理咨询有限公司投资经理，锡洲国际有限公司投资部经理，中海基金管理有限公司投资管理部总经理兼投资总监（期间曾兼任中海优质成长证券投资基金基金经理）、风险管理部总经理兼风控总监，国联证券股份有限公司证券投资部总经理、副总裁。

江志强先生，董事。东南大学硕士。现任国联证券股份有限公司监事会主席。历任国联证券股份有限公司证券投资部经理、证券营业部总经理、财富管理中心总经理、总裁助理、资产管理部总经理、副总裁。

MOLING CHEN（陈末翎）女士，董事。澳大利亚国籍。澳洲莫纳什大学工商管理硕士。现任爱德蒙罗斯柴尔德中国私募股权基金I期和II期主管合伙人。历任澳大利亚墨尔本药物技术研究所化学分析师，澳大利亚墨尔本凯龙生物区域经理，百奥维达中国基金高级投资总监。

陈道富先生，独立董事。中国人民银行金融研究所博士。现任国务院发展研究中心金融研究所综合研究室副所长。曾任中关村证券公司总裁助理、国务院发展研究中心金融研究所综合研究室主任。

WANG WEIDONG（王卫东）先生，独立董事。美国国籍。芝加哥大学博士。北京市中伦律师事务所合伙人，历任Sidley Austin(盛德律师事务所)芝加哥总部律师，北京大学国家发展研究院国际MBA项目访问教授，北京德恒律师事务所合伙人，美国德杰律师事务所合伙人。

张军先生，独立董事。复旦大学博士。现任复旦大学经济学院院长、中国经济研究中心主任、复旦大学“当代中国经济”长江学者特聘教授、复旦发展研究院副院长、博士生导师、教育部重点研究基地中国社会主义市场经济研究中心主任。历任复旦大学经济学院助教、讲师，复旦大学经济学院副教授。

## 2、监事会成员

张悦女士，监事长。硕士，高级会计师。现任中海信托股份有限公司总稽核、党办主任、信托事务管理总部总经理。历任北京石油交易所交易部副经理，中国海洋石油东海公司计财部会计、企管部企业管理岗，中海石油总公司平湖生产项目计财部经理，中海石油有限公司上海分公司计财部岗位经理，中海信托股份有限公司计划财务部会计、计划财务部经理、稽核审计部经理、纪委副书记、合规总监。

Pascal CHARLOT（夏乐博）先生，监事。法国国籍。法国埃夫里大学金融系硕士、法国国立电信管理学院金融系硕士。现任爱德蒙得洛希尔资产管理(香港)有限公司董事会成员、执行总监、营运总监、第1类和第9类受规管活动的负责人员，爱德蒙得洛希尔集团亚太区财务长以及爱德蒙得洛希尔（瑞士）商务拓展部高级副总裁。历任法国巴黎银行全球IT部门客户经理、

法国巴黎银行新加坡分行项目经理、爱德蒙得洛希尔资产管理香港有限公司财务总监、爱德蒙得洛希尔资产管理香港有限公司营运总监、第1类和第9类受规管活动的负责人员。

康铁祥先生，职工监事。博士。现任中海基金管理有限公司风险管理部总经理。历任山东省招远市绣品厂财务科科员，上海浦发银行外汇业务部科员，中海基金管理有限公司风险管理部助理风控经理、风控经理、风险管理部总经理助理、风险管理部总经理兼风控总监、风控稽核部总经理。

张奇先生，职工监事。学士。现任中海基金管理有限公司信息技术部总经理。历任沈阳联正科技有限公司技术部经理，北京致达赛都科技有限公司网络部经理，上海致达信息产业股份有限公司技术支持部经理，中海基金管理有限公司信息技术部工程师、信息技术部总经理助理、信息技术部副总经理。

### 3、高级管理人员

杨皓鹏先生，总经理。复旦大学世界经济专业硕士。历任中海信托股份有限公司综合管理部总裁秘书、托管部项目经理、自有资金及信息管理部综合业务经理、办公室主任、党委秘书、人力资源部经理、资产经营部经理。2017年7月进入本公司工作，曾任总经理助理，2017年8月至今任本公司总经理（期间2017年11月至2018年3月兼任本公司代理督察长），2017年9月至今任本公司董事，2017年11月至今任中海恒信资产管理（上海）有限公司董事长。

宋宇先生，常务副总经理。复旦大学数理统计专业学士，经济师。历任无锡市统计局秘书，国联证券股份有限公司营业部副经理、发行调研部副经理、办公室主任、研究发展部总经理。2004年3月进入本公司工作，历任本公司督察长、副总经理（期间2011年1月至2011年10月兼任本公司代理总经理，2014年5月至2014年10月兼任本公司代理督察长），2015年4月至今任本公司常务副总经理。黄乐军先生，督察长。厦门大学法律硕士。历任北京近铁运通运输有限公司厦门分公司职员、上海市公安局副主任科员、上海证监局主任科员、海富通基金管理有限公司监察稽核总监。2018年2月进入本公

司工作，2018年3月至今任本公司督察长。

#### 4、基金经理

刘俊先生，复旦大学金融学专业博士。历任上海申银万国证券研究所有限公司策略研究部策略分析师、海通证券股份有限公司战略合作与并购部高级项目经理。2007年3月进入本公司工作，曾任产品开发总监。2010年3月至2015年8月任中海稳健收益债券型证券投资基金基金经理，2015年4月至2017年6月任中海安鑫宝1号保本混合型证券投资基金基金经理，2012年6月至今任中海优势精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2013年7月至今任中海策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2014年5月至今任中海积极收益灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015年12月至今任中海顺鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017年4月至今任中海添顺定期开放混合型证券投资基金基金经理，2018年1月至今任中海添瑞定期开放混合型证券投资基金基金经理，2018年6月至今任中海环保新能源主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

#### 5、历任基金经理

本基金系由中海安鑫保本混合型证券投资基金转型而来，中海安鑫保本混合型证券投资基金基金合同于2013年7月31日生效，历任基金经理如下表：

基金经理姓名	管理基金时间
刘俊	2013年7月31日-至今

#### 6、投资决策委员会成员

杨皓鹏先生，主任委员。现任中海基金管理有限公司董事、总经理。

许定晴女士，委员。现任中海基金管理有限公司代理投资总监、投资副总监、基金经理。

夏春晖先生，委员。现任中海基金管理有限公司投资副总监、首席策略分析师、基金经理。

江小震先生，委员。现任中海基金管理有限公司投资副总监、基金经理。

7、上述人员之间不存在近亲属关系。

### （三）基金管理人的职责

- 1、依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的申购、赎回和登记事宜。
- 2、办理基金备案手续。
- 3、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，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、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、法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他职责。

#### （四）基金管理人的承诺

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

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

- （1）将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资。
- （2）不公平地对待其管理的不同基金财产。
- （3）利用基金财产或者职务之便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) 侵占、挪用基金财产。

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

(7) 法律、行政法规和中国证监会禁止的其他行为。

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

(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利益；

(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；

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

(8) 违反证券交易所业务规则，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。

(五) 基金管理人关于禁止性行为的承诺



为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

- 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、向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- 6、买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、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。

若法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，本基金投资可不受上述规定限制。

#### （六）基金经理的承诺

- 1、依照有关法律法规和基金合同的规定，本着谨慎勤勉的原则为基金份额持有人谋取最大利益。
- 2、不利用职务之便为自己及其代理人、受雇人或任何第三人谋取利益。
- 3、不违反现行有效的有关法律法规、基金合同和中国证监会的有关规定，泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息，或利用该信息明示、暗示他人从事相关的交易活动。
- 4、不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

#### （七）基金管理人的风险管理和内部控制制度

- 1、内部控制体系概述

内部控制是指基金管理人为防范和化解风险,保证经营运作符合基金管理人发展规划,在充分考虑内外部环境的基础上,通过建立组织机制、运用管理方法、实施控制程序与控制措施而形成的系统。

基金管理人结合自身具体情况,建立了科学合理、控制严密、运行高效的内部控制体系,并制定了科学完善的内部控制制度。

## 2、风险管理的理念和文化

- (1) 以最大程度保护基金份额持有人利益为己任。
- (2) 风险管理是业务发展的保障。
- (3) 最高管理层承担最终责任。
- (4) 分工明确、相互制约的组织结构是前提。
- (5) 制度建设是基础。
- (6) 制度执行监督是保障。

## 3、内部控制遵循的原则

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

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

(3) 独立性原则。公司各机构、部门和岗位职责保持相对独立,基金财产、公司自有资产、其他资产的运作分离。

(4) 相互制约原则。公司内部部门和岗位的设置权责分明、相互制衡。

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

## 4、风险管理和内部控制的组织体系

公司的风险控制组织体系至少应包括以下几个层面:一、董事会负责控制公司整体运营风险;二、公司高级管理层负责公司内部风险控制的领导及政策决定;三、风险管理部负责对业务风险进行日常管理;四、各职能部门负责对各自业务活动中潜在的风险通过执行制度进行控制。

- (1) 董事会应充分重视风险控制。通过批准公司的风险控制战略、制

度和工作计划，确保公司已具有了管理其面临的所有风险所需的必要系统、运作制度和控制环境，并通过审计与合规委员会和督察长对公司经营管理层的风险控制工作发挥更权威的监督作用。董事会通过控制公司治理结构风险、制定内部管理制度、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。

(2) 风险控制委员会为公司非常设议事机构，负责对公司业务风险控制进行决策和协调，是公司日常风险控制工作的最高决策机构。其具体职责主要有：审议基金财产风险状况评价分析报告，审定公司的业务授权方案的合法性、合规性，负责协调处理突发性重大事件并界定相关人员的责任，审议公司其他各项资产管理业务的风险状况评价分析报告。

(3) 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审计与合规委员会、董事长和中国证监会报告。

(4) 监察稽核部是公司管理层对各项经营管理活动（包括风险管理活动）进行合规控制的职能部门。其职责主要是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，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。

(5) 公司各职能部门是公司内部风险控制措施的具体执行单位，应在公司各项基本管理制度的基础上，根据具体情况制订本部门的业务管理规定、操作流程及风险控制规定，并督导部门员工严格执行。

#### 5、监督机构的合规检查作用

公司日常管理中的监督机构由董事会审计与合规委员会、公司督察长和监察稽核部组成，其主要作用是对公司各项经营管理活动进行合规控制。其中，审计与合规委员会通过定期审阅公司督察长工作报告和监察稽核报告，检查公司合规运作情况和督察长、监察稽核部对公司合规运作的监督工作，从而加强董事会对公司运作情况的监督；

督察长是董事会常设的执行监督职能的岗位，负责对公司的内部控制

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审计与合规委员会、董事长和中国证监会报告；

监察稽核部是公司管理层对各项经营管理活动（包括风险管理活动）进行合规性检查的职能部门。其职责主要是对公司各职能部门在业务运作中的遵规守法情况进行监督，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。

## 6、内部控制的基本要素

内部控制的基本要素包括控制环境、风险评估、控制活动、信息沟通和内部监控。

（1）控制环境构成公司内部控制的基础，控制环境包括经营理念和内控文化、公司治理结构、组织结构、员工道德素质等内容。

（2）公司管理层牢固树立内控优先和风险管理理念，培养全体员工的风险防范意识，营造一个浓厚的内控文化氛围，保证全体员工及时了解国家法律法规和公司规章制度，使风险意识贯穿到公司各个部门、各个岗位和各个环节。

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

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

（5）公司依据自身经营特点设立顺序递进、权责统一、严密有效的内控防线：

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

b、建立重要业务处理凭据传递和信息沟通制度，相关部门和岗位之间

相互监督制衡；

c、公司督察长和内部监察稽核部门独立于其他部门，对内部控制制度的执行情况实行严格的检查和反馈；

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

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

(8) 授权控制贯穿于公司经营活动的始终，通过完善法人治理结构、明确各部门职能与授权范围来完成；

(9) 公司建立完善的资产分离制度，基金财产与公司资产、不同基金的财产和其他委托资产要实行独立运作，分别核算；

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

(11) 公司制订切实有效的应急应变措施，建立危机处理机制和程序；

(12) 公司维护信息沟通渠道的畅通，建立清晰的报告系统；

(13) 公司建立有效的内部监控制度，设置督察长和独立的监察稽核部门，对公司内部控制制度的执行情况进行持续的监督，保证内部控制制度落实。

## 7、基金管理人关于内部控制的声明

(1) 基金管理人承诺以上关于内部控制的披露真实、准确。

(2) 基金管理人承诺根据市场变化和公司发展不断完善内部控制制度。

## 四、基金托管人

### （一）基金托管人概况

本基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司，基本信息如下：

名称：上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“上海浦东发展银行”）

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：高国富

成立时间：1992 年 10 月 19 日

经营范围：经中国人民银行和中国银行业监督管理委员会批准，公司主营业务主要包括：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱业务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外币兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代客外汇买卖；资信调查、咨询、见证业务；离岸银行业务；证券投资基金托管业务；全国社会保障基金托管业务；经中国人民银行和中国银行业监督管理委员会批准经营的其他业务。

组织形式：股份有限公司

注册资本：293.52 亿元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基金字[2003]105 号

联系人：胡波

联系电话：(021) 61618888

上海浦东发展银行自 2003 年开展资产托管业务，是较早开展银行资产

托管服务的股份制商业银行之一。经过二十年来的稳健经营和业务开拓，各项业务发展一直保持较快增长，各项经营指标在股份制商业银行中处于较好水平。

上海浦东发展银行总行于 2003 年设立基金托管部，2005 年更名为资产托管部，2013 年更名为资产托管与养老金业务部，2016 年进行组织架构优化调整，并更名为资产托管部，目前下设证券托管处、客户资产托管处、内控管理处、业务保障处、总行资产托管运营中心（含合肥分中心）五个职能处室。

目前，上海浦东发展银行已拥有客户资金托管、资金信托保管、证券投资基金托管、全球资产托管、保险资金托管、基金专户理财托管、证券公司客户资产托管、期货公司客户资产托管、私募证券投资基金托管、私募股权托管、银行理财产品托管、企业年金托管等多项托管产品，形成完备的产品体系，可满足多领域客户、境内外市场的资产托管需求。

## （二）主要人员情况

高国富，男，1956 年出生，研究生学历，博士学位，高级经济师职称。曾任上海外高桥保税区开发（控股）公司总经理；上海外高桥保税区管委会副主任；上海万国证券公司代总裁；上海久事公司总经理；上海市城市建设投资开发总公司总经理；中国太平洋保险（集团）股份有限公司党委书记、董事长。现任上海浦东发展银行股份有限公司党委书记、董事长。第十二届全国政协委员。伦敦金融城中国事务顾问委员会委员，中欧国际工商学院理事会成员、国际顾问委员会委员，上海交通大学安泰经济管理学院顾问委员会委员。

刘信义，男，1965 年出生，硕士研究生，高级经济师。曾任上海浦东发展银行上海地区总部副总经理，上海市金融服务办挂职任机构处处长、市金融服务办主任助理，上海浦东发展银行党委委员、副行长、财务总监，上海国盛集团有限公司总裁。现任上海浦东发展银行党委副书记、副董事长、行长。

孔建，男，1968 年出生，博士研究生。历任工商银行山东省分行计划处科员、副主任科员，国际业务部、工商信贷处科长，资金营运处副处长，上海浦东发展银行济南分行信管处总经理，上海浦东发展银行济南分行行长助理、副行长、党委书记、行长。现任上海浦东发展银行总行资产托管部总经理。

### （三）基金托管业务经营情况

截止 2018 年 6 月 30 日，上海浦东发展银行证券投资基金托管规模为 2762.81 亿元，比去年末减少 1.95%。托管证券投资基金共一百三十二只，分别为国泰金龙行业精选基金、国泰金龙债券基金、天治财富增长基金、广发小盘成长基金、汇添富货币基金、长信金利趋势基金、嘉实优质企业基金、国联安货币基金、长信利众债券基金(LOF)、华富保本混合型证券投资基金、中海策略精选灵活配置混合基金、博时安丰 18 个月基金 (LOF)、易方达裕丰回报基金、鹏华丰泰定期开放基金、汇添富双利增强债券基金、中信建投稳信债券基金、华富恒财分级债券基金、汇添富和聚宝货币基金、工银目标收益一年定开债券基金、北信瑞丰宜投宝货币基金、中海医药健康产业基金、国寿安保尊益信用纯债基金、华富国泰民安灵活配置混合基金、安信动态策略灵活配置基金、东方红稳健精选基金、国联安鑫享混合基金、长安鑫利优选混合基金、工银瑞信生态环境基金、天弘新价值混合基金、嘉实机构快线货币基金、鹏华 REITs 封闭式基金、华富健康文娱基金、国寿安保稳定回报基金、国寿安保稳健回报基金、国投瑞银新成长基金、金鹰改革红利基金、易方达裕祥回报债券基金、国联安鑫禧基金、中银瑞利灵活配置混合基金、华夏新活力混合基金、鑫元汇利债券型基金、南方转型驱动灵活配置基金、银华远景债券基金、华富诚鑫灵活配置基金、富安达长盈灵活配置混合型基金、中信建投睿溢混合型证券投资基金、工银瑞信恒享纯债基金、长信利发债券基金、博时景发纯债基金、国泰添益混合基金、鑫元得利债券型基金、中银尊享半年定开基金、鹏华兴盛灵活配置混合型证券投资基金、华富元鑫灵活配置基金、东方红战略沪港深混合基金、博时富发纯债基金、博时利发



纯债基金、银河君信混合基金、汇添富保鑫保本混合基金、景顺长城景颐盛利债券基金、兴业启元一年定开债券基金、工银瑞信瑞盈 18 个月定开债券基金、中信建投稳裕定开债券基金、招商招怡纯债债券基金、中加丰享纯债债券基金、长安泓泽纯债债券基金、银河君耀灵活配置混合基金、广发汇瑞 3 个月定期开放债券发起式证券投资基金、汇安嘉汇纯债债券基金、南方宣利定开债券基金、招商兴福灵活配置混合基金、博时鑫润灵活配置混合基金、兴业裕华债券基金、易方达瑞通灵活配置混合基金、招商招祥纯债债券基金、国泰景益灵活配置混合基金、易方达瑞程混合基金、华福长富一年定开债券基金、中欧骏泰货币基金、招商招华纯债债券基金、汇安丰融灵活配置混合基金、汇安嘉源纯债债券基金、国泰普益混合基金、汇添富鑫瑞债券基金、鑫元合丰纯债债券基金、博时鑫惠混合基金、工银瑞信瑞盈半年定开债券基金、国泰润利纯债基金、华富天益货币基金、汇安丰华混合基金、汇安沪深 300 指数增强型证券投资基金、汇安丰恒混合基金、交银施罗德启通灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城中证 500 指数基金、南方和利定开债券基金、鹏华丰康债券基金、兴业安润货币基金、兴业瑞丰 6 个月定开债券基金、兴业裕丰债券基金、易方达瑞弘混合基金、银河犇利灵活配置混合基金、长安鑫富领先混合基金、长盛盛泰灵活配置混合基金、万家现金增利货币基金、上银慧增利货币市场基金、易方达瑞富灵活配置证券投资基金、博时富腾纯债债券型证券投资基金、安信工业 4.0 主题沪港深精选混合基金、民生加银鑫顺债券型基金、万家天添宝货币基金、长安鑫珏主题轮动混合基金、中欧瑾泰灵活配置混合基金、中银证券安弘债券基金、鑫元鑫趋势灵活配置混合基金、泰康年年红纯债一年定期开放债券基金、广发高端制造股票型发起式基金、永赢永益债券基金、博时鑫禧灵活配置混合基金、南方安福混合基金、中银证券聚瑞混合基金、太平改革红利精选灵活配置混合基金、中金价值轮动灵活配置混合基金、富荣富乾债券型证券投资基金基金、国联安安稳灵活配置混合型证券投资基金、国泰恒益灵活配置混合型基金、前海开源景鑫灵活配置混合型证券投资基金、前海开源润鑫灵活配置混合型证券投资基金、中海沪港深多策略灵活配置混合型基金基金、中银证券祥瑞混合型证券投资

基金、前海开源盛鑫灵活配置混合型证券投资基金、鑫元行业轮动灵活配置混合型证券投资基金、华富恒悦定期开放债券型证券投资基金、兴业3个月定期开放债券型发起式证券投资基金等。

#### （四）基金托管人的内部控制制度

1、本行内部控制目标为：确保经营活动中严格遵守国家有关法律法规、监管部门监管规则和本行规章制度，形成守法经营、规范运作的经营思想。确保经营业务的稳健运行，保证基金资产的安全和完整，确保业务活动信息的真实、准确、完整，保护基金份额持有人的合法权益。

2、本行内部控制组织架构为：总行法律合规部是全行内部控制的牵头管理部门，指导业务部门建立并维护资产托管业务的内部控制体系。总行风险监控部是全行操作风险的牵头管理部门。指导业务部门开展资产托管业务的操作风险管控工作。总行资产托管部下设内控管理处。内控管理处是全行托管业务条线的内部控制具体管理实施机构，并配备专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，独立行使监督稽核职责。

3、内部控制制度及措施：本行已建立完善的内部控制制度。内控制度贯穿资产托管业务的决策、执行、监督全过程，渗透到各业务流程和各操作环节，覆盖到从事资产托管各级组织结构、岗位及人员。内部控制以防范风险、合规经营为出发点，各项业务流程体现“内控优先”要求。

具体内控措施包括：培育员工树立内控优先、制度先行、全员化风险控制的风险管理理念，营造浓厚的内控文化氛围，使风险意识贯穿到组织架构、业务岗位、人员的各个环节。制定权责清晰的业务授权管理制度、明确岗位职责和各项操作规程、员工职业道德规范、业务数据备份和保密等在内的各项业务管理制度；建立严格完善的资产隔离和资产保管制度，托管资产与托管人资产及不同托管资产之间实行独立运作、分别核算；对各类突发事件或故障，建立完备有效的应急方案，定期组织灾备演练，建立重大事项报告制度；在基金运作办公区域建立健全安全监控系统，利用录音、录像等技术手段实现风险控制；定期对业务情况进行自查、内部稽核等措施进行监控，通

过专项/全面审计等措施实施业务监控，排查风险隐患。

### （五）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

#### 1、监督依据

托管人严格按照有关政策法规、以及基金合同、托管协议等进行监督。

监督依据具体包括：

- （1）《中华人民共和国证券法》；
- （2）《中华人民共和国证券投资基金法》；
- （3）《公开募集证券投资基金运作管理办法》；；
- （4）《证券投资基金销售管理办法》
- （5）《基金合同》、《基金托管协议》；
- （6）法律、法规、政策的其他规定。

#### 2、监督内容

我行根据基金合同及托管协议约定，对基金合同生效之后所托管基金的投资范围、投资比例、投资限制等进行严格监督，及时提示基金管理人违规风险。

#### 3、监督方法

（1）资产托管部设置核算监督岗位，配备相应的业务人员，在授权范围内独立行使对基金管理人投资交易行为的监督职责，规范基金运作，维护基金投资人的合法权益，不受任何外界力量的干预；

（2）在日常运作中，凡可量化的监督指标，由核算监督岗通过托管业务的自动处理程序进行监督，实现系统的自动跟踪和预警；

（3）对非量化指标、投资指令、管理人提供的各种报表和报告等，采取人工监督的方法。

#### 4、监督结果的处理方式

（1）基金托管人对基金管理人的投资运作监督结果，采取定期和不定期报告形式向基金管理人和中国证监会报告。定期报告包括基金监控周报等。

不定期报告包括提示函、临时日报、其他临时报告等；

(2) 若基金托管人发现基金管理人违规违法操作，以电话、邮件、书面提示函的方式通知基金管理人，指明违规事项，明确纠正期限。在规定期限内基金托管人再对基金管理人违规事项进行复查，如果基金管理人违规事项未予纠正，基金托管人将报告中国证监会。如果发现基金管理人投资运作有重大违规行为时，基金托管人应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正；

(3) 针对中国证监会、中国人民银行对基金投资运作监督情况的检查，应及时提供有关情况和资料。

## 五、相关服务机构

### （一）销售机构

#### 1、直销机构：

##### （1）中海基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层

办公地址：上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层

法定代表人：杨皓鹏

电话：021-68419518

传真：021-68419328

联系人：周颖

客户服务电话：400-888-9788（免长途话费）或 021-38789788

公司网址：[www.zhfund.com](http://www.zhfund.com)

##### （2）中海基金管理有限公司北京分公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 158 号 1 号楼 F218

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 158 号 1 号楼 F218

负责人：刘承来

电话：010-66493583

传真：010-66425292

联系人：郑健

客户服务电话：400-888-9788（免长途话费）

公司网站：[www.zhfund.com](http://www.zhfund.com)

#### 2、代销机构：

##### （1）上海浦东发展银行股份有限公司

住所：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：高国富

电话：021—61616193

传真：021-63604196

联系人：朱萍

客户服务电话：95528

公司网址：www.spdb.com.cn

(2)中国农业银行股份有限公司

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座

法定代表人：周慕冰

联系电话：010-66060069

传真：010-68121816

联系人：林葛

客户服务电话：95599

公司网址：www.abcchina.com

(3)交通银行股份有限公司

住所：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：彭纯

电话：021—58781234

传真：021-58408483

联系人：王菁

客户服务电话：95559

公司网址：www.bankcomm.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

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：李建红

电话：0755—83199084

传真：0755-83195049

资产托管部信息披露负责人：张燕

客户服务电话：95555

公司网址：www.cmbchina.com

(5)平安银行股份有限公司

住所：广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号

办公地址：广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号

法定代表人：谢永林

联系电话：(0755) 2219 7701

传真电话：021-50979507

联系人：高希泉

客户服务电话：95511-3

公司网址：www.bank.pingan.com

(6)上海农村商业银行股份有限公司

住所：上海市银城中路 8 号 15-20 楼、22-27 楼

办公地址：上海市银城中路 8 号 15-20 楼、22-27 楼

法定代表人：胡平西

联系人：施传荣

电话：(021) 38576666

传真：(021) 50105124

客户服务电话：(021) 962999

公司网站：www.srcb.com

(7)兴业银行股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 154 号中山大厦

办公地址：福州市湖东路 154 号中山大厦

法定代表人：高建平

联系人：李博

电话：021-52629999-218966

传真：021-62569070

客户服务电话：95561

网址：[www.cib.com.cn](http://www.cib.com.cn)

(8) 宁波银行股份有限公司

注册地址：中国浙江宁波市鄞州区宁南南路 700 号

办公地址：中国浙江宁波市鄞州区宁南南路 700 号

法定代表人：陆华裕

联系人：王海燕

电话：0574-89103171

传真：0574-89103213

客户服务电话：95574

网址：<http://www.nbcb.com.cn/>

(9) 国联证券股份有限公司

住所：无锡市太湖新城金融一街 8 号 7-9 层

办公地址：无锡市太湖新城金融一街 8 号 7-9 层

法定代表人：姚志勇

电话：0510-82831662

传真：0510-82830162

联系人：沈刚

客户服务电话：95570

公司网址：[www.glsc.com.cn](http://www.glsc.com.cn)

(10) 中国银河证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

办公地址：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

电话：010-66568430

传真：010-66568990

联系人：田薇



客户服务电话：4008-888-888

公司网址：www.chinastock.com.cn

(11)长江证券股份有限公司

住所：武汉市新华路特8号长江证券大厦

办公地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦

法定代表人：胡运钊

电话：027-65799999

传真：027-85481900

联系人：李良

客户服务电话：95579 或 4008-888-999

公司网址：www.95579.com

(12)中信建投证券股份有限公司

住所：北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址：北京市东城区朝阳门内大街188号

法定代表人：王常青

联系人：权唐、许梦园

电话：400-8888-108

开放式基金咨询电话：400-8888-108

开放式基金业务传真：010-65182261

公司网址：www.csc108.com

(13)申万宏源证券有限公司

住所：上海市徐汇区长乐路989号45层

办公地址：上海市徐汇区长乐路989号45层

法定代表人：李梅

电话：021-33389888

传真：021-33388224

联系人：黄莹

客户服务电话：95523 或 4008895523

公司网址：[www.swhysc.com](http://www.swhysc.com)

(14) 兴业证券股份有限公司

住所：福建省福州市湖东路 268 号

办公地址：上海浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 21 楼

法定代表人：兰荣

电话：021-38565785

传真：021-38565955

联系人：谢高得

客户服务电话：95562

公司网址：[www.xyzq.com.cn](http://www.xyzq.com.cn)

(15) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼

法定代表人：杨德红

电话：021-38676161

传真：021-38670161

联系人：芮敏祺

客户服务电话：400-888-8666/95521

公司网址：[www.gtja.com](http://www.gtja.com)

(16) 招商证券股份有限公司

住所：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层

法定代表人：霍达

电话：0755-82943666

传真：0755-82943636

联系人：秦湘

客户服务电话：95565

公司网址：[www.newone.com.cn](http://www.newone.com.cn)

(17) 东海证券股份有限公司

住所：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18 层

办公地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦

法定代表人：赵俊

电话：021-20333333

传真：021-50498825

联系人：王一彦

客户服务电话：95531 或 400-888-8588

公司网址：[www.longone.com.cn](http://www.longone.com.cn)

(18) 平安证券股份有限公司

住所：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场裙楼 8 楼

办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场裙楼 8 楼

法定代表人：杨宇翔

电话：4008866338

传真：0755-82400862

联系人：郑舒丽

客户服务电话：95511-8

公司网址：[stock.pingan.com](http://stock.pingan.com)

(19) 光大证券股份有限公司

住所：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：薛峰

电话：021-22169999

传真：021-22169134

联系人：刘晨

客户服务电话：95525

公司网址：[www.ebscn.com](http://www.ebscn.com)

(20) 华龙证券股份有限公司

住所：甘肃省兰州市静宁路 308 号

办公地址：兰州市城关区东岗西路 638 号财富大厦

法定代表人：李晓安

电话：0931-8784656、4890208

传真：0931-4890628

联系人：李昕田

客户服务电话：400-689-8888

公司网址：www.hlzqgs.com

(21) 华泰证券股份有限公司

住所：南京市江东中路 228 号

办公地址：南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场

法定代表人：周易

电话：0755-82492193

传真：0755-82492962

联系人：庞晓芸

客户服务电话：95597

公司网址：www.htsc.com.cn

(22) 中泰证券股份有限公司

住所：山东省济南市经七路 86 号 23 层经纪业务总部

法定代表人：李玮

电话：0531-68889115

传真：0531-68889752

联系人：吴阳

客户服务电话：95538

公司网址：www.qlzq.com.cn

(23) 第一创业证券股份有限公司

住所：广东省深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼

办公地址：广东省深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 18 楼

法定代表人：刘学民

联系人：吴军

电话：0755-23838751

传真：0755-82485081

客户服务电话：400-888-1888

公司网址：[www.firstcapital.com.cn](http://www.firstcapital.com.cn)

(24) 万联证券股份有限公司

住所：广州市中山二路 18 号广东电信广场 36、37 层

办公地址：广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 F 座 18、19 楼

法定代表人：张建军

电话：020-37865070

联系人：王鑫

开放式基金咨询电话：400-8888-133

开放式基金接收传真：020-22373718-1013

公司网址：[www.wlzq.com.cn](http://www.wlzq.com.cn)

(25) 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

办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室（邮编：830002）

法定代表人：许建平

电话：010-88085858

传真：010-88085195

联系人：李巍

客户服务电话：400-800-0562

网址：[www.hysec.com](http://www.hysec.com)

(26) 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：李飞

客户服务电话：400-8888-777

公司网址：www.gyzq.com.cn

(27) 渤海证券股份有限公司

住所：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：天津市南开区宾水西道 8 号

法定代表人：杜庆平

联系人：王兆权

电话：022-28451861

传真：022-28451892

客户服务电话：400-651-5988

公司网址：www.bhzq.com

(28) 信达证券股份有限公司

住所：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人：张志刚

联系人：唐静

联系电话：010-63081000

传真：010-63080978

客户服务电话：95321

公司网址：www.cindasc.com

(29) 中信证券股份有限公司

住所：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场(二期)北座

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人：王东明

联系电话：010-60838888

传真：010-60833739

联系人：顾凌

客户服务电话：400-889-5548

公司网址：[www.cs.ecitic.com](http://www.cs.ecitic.com)

(30) 东北证券股份有限公司

注册地址：长春市生态大街 6666 号

办公地址：长春市生态大街 6666 号

法定代表人：李福春

客服热线：95360

邮编：130119

联系人：安岩岩

联系电话：0431-85096517

传真：0431-85096795

公司网站：[www.nesc.cn](http://www.nesc.cn)

(31) 华福证券有限责任公司

住所：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层

办公地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7 至 10 层

法定代表人：黄金琳

联系人：张腾

联系电话：0591-87383623

业务传真：0591-87383610

统一客户服务电话：96326（福建省外请先拨 0591）

公司网址：[www.hfzq.com.cn](http://www.hfzq.com.cn)

(32) 天相投资顾问有限公司

住所：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701

办公地址：北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座 5 层

法定代表人：林义相

电话：010-66045529

传真：010-66045518

联系人：尹伶

客户服务电话：010-66045678

公司网址：www.txsec.com

天相基金网网址：www.jjm.com.cn

(33) 中信证券（山东）有限责任公司

住所：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼 20 层

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 20 层

法定代表人：杨宝林

联系人：吴忠超

联系电话：0532-85022326

客服电话：95548

公司网址：www.citicssd.com

(34) 华林证券有限责任公司

住所：深圳市福田区民田路 178 号华融大厦 5-6 楼

法定代表人：薛荣年

联系人：王叶平

联系电话：0755-82707705

客服电话：400-188-3888

公司网址：<http://www.chinalions.com>

(35) 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

办公地址：上海市肇嘉浜路 750 号

法定代表人：俞洋

联系人：陈敏

业务联系电话：021-64339000-807

客服热线：021-32109999；029-68918888；4001099918

公司网址：www.cfsc.com.cn



## (36) 中信期货有限公司

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

办公地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 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

客户服务电话：400-990-8826

网址：[www.citicsf.com](http://www.citicsf.com)

## (37) 华西证券股份有限公司

住所：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：周志茹

电话：028-86135991

传真：028-86150040

客户服务电话：95584 和 4008-888-818

公司网址：<http://www.hx168.com.cn>

## (38) 中国国际金融股份有限公司

住所：北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

办公地址：北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

法定代表人：丁学东

联系人：杨涵宇

联系电话：01065051166

客服电话：4009101166

公司网址：[www.cicc.com.cn](http://www.cicc.com.cn)

(39) 联讯证券股份有限公司

注册地址：广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼

办公地址：广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼

法定代表人：徐刚

联系人：彭莲

电话：0752-2119700

传真：0752-2119660

客户服务电话：95564

网址：www.lxsec.com

(40) 深圳前海凯恩斯基金销售有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市福田区深南大道6019号金润大厦23A

法定代表人：高锋

联系人：廖苑兰

电话：0755-83655588

传真：0755-83655518

客户服务电话：4008048688

网址：www.keynesasset.com

(41) 上海证券有限责任公司

住所：上海市黄浦区四川中路213号7楼

办公地址：上海市黄浦区四川中路213号7楼

法定代表人：李俊杰

联系人：邵珍珍

客户服务电话：021-962518

公司网址：www.962518.com

## (42) 深圳前海财厚资产管理有限公司

住所：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室

办公地址：深圳市南山区南山大道1088号南园枫叶大厦15层15K室

法定代表人：孙方厚

联系人：李军

客户服务电话：400-699-0071

公司网址：[www.caiho.cn](http://www.caiho.cn)

## (43) 东莞证券股份有限公司

住所：广东省东莞市莞城区可园南路一号

办公地址：广东省东莞市莞城区可园南路一号金源中心22楼

联系人：李荣

电话：0769-22115712

传真：0769-22115712

客户服务电话：95328

公司网址：<http://www.dgzq.com.cn/>

## (44) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

住所：杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1幢202室

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼

法定代表人：陈柏青

联系人：韩爱彬

客服电话：4000-766-123

公司网址：[www.fund123.cn](http://www.fund123.cn)

## (45) 深圳众禄基金销售股份有限公司

住所：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼

办公地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼

法定代表人：薛峰

联系人：童彩平

联系电话：0755-33227950

客服电话：4006-788-887

公司网址：www.zlfund.cn 及 www.jjmmw.com

(46) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

住所：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区东方路 1267 号 11 层

法定代表人：张跃伟

业务联系人：郑茵华

联系电话：021-20691831

客服电话：400-089-1289

公司网址：www.erichfund.com

(47) 诺亚正行基金销售有限公司

住所：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：余翼飞

联系电话：021-80358749

客服电话：400-821-5399

公司网址：www.noah-fund.com

(48) 和讯信息科技有限公司

住所：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

办公地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

法定代表人：王莉

联系人：刘洋

联系电话：021-20835787

客服电话：400-920-0022/ 021-20835588

公司网址：licaike.hexun.com

(49) 上海天天基金销售有限公司

住所：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号金座

法定代表人：其实

联系人：朱玉

联系电话：021-54509977

客服电话：400-1818-188

公司网址：www.1234567.com.cn

(50) 众升财富（北京）基金销售有限公司

住所：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

法定代表人：李招娣

联系人：李艳

联系电话：010-59497361

客服电话：400-876-9988

公司网址：www.wy-fund.com

(51) 上海好买基金销售有限公司

住所：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：王诗琦

联系电话：021-20613999

客服电话：400-700-9665

公司网址：www.ehowbuy.com

(52) 上海利得基金销售有限公司

住所：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 10 楼

法定代表人：李兴春

联系人：郑茂

联系电话：021-50583533

传真：021-50583535

客服电话：400-921-7755

公司网址：www.leadfund.com.cn

(53) 北京增财基金销售有限公司

住所：北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208 号

办公地址：北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208-1209 号

法定代表人：罗细安

联系人：史丽丽

联系电话：010-67000988

客服电话：400-001-8811

公司网址：www.zcvc.com.cn

(54) 北京恒天明泽基金销售有限公司

住所：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中路 20 号乐成中心 A 座 23 层

法定代表人：梁越

联系人：周斌

联系电话：010-57756019

客服电话：400-786-8868-5

公司网址：www.chtfund.com

(55) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

住所：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006#

办公地址：北京市西城区宣武门外大街 10 号庄胜广场中央办公楼东翼  
7 层 727 室

法定代表人：杨懿

联系人：刘宝文

联系电话：010-63130889-8369

客服电话：400-166-1188

公司网址：8.jrj.com.cn

(56) 浙江同花顺基金销售有限公司

住所：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903 室

办公地址：浙江省杭州市翠柏路 7 号杭州电子商务产业园 2 号楼 2 楼

法定代表人：凌顺平

联系人：胡璇

联系电话：0571-88911818

客服电话：4008-773-772

公司网址：www.5ifund.com

(57) 中期资产管理有限公司

住所：北京市朝阳区建国门外光华路 14 号 1 幢 11 层 1103 号

办公地址：北京市朝阳区建国门外光华路 14 号中期大厦 8 层

法定代表人：姜新

联系人：方艳美

联系电话：010-65807865

客服电话：010-65807865

公司网址：www.cifcofund.com

(58) 浙江金观诚财富管理有限公司

住所：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

联系电话：0571-88337717

客服电话：400-068-0058

公司网址：www.jincheng-fund.com

(59) 上海汇付基金销售有限公司

住所：上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼

办公地址：上海市宜山路 700 号普天信息产业园 2 期 C5 栋汇付天下总

部大楼 2 楼

法定代表人：金佶

联系人：臧静

联系电话：13818223736

客服电话：400-820-2819

公司网址：<https://www.hotjijin.com>

(60) 泰诚财富基金销售（大连）有限公司

住所：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园 3 号

办公地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园 3 号

法定代表人：林卓

联系人：徐江

联系电话：0411-88891212-119

传真：0411-84396536

客服电话：400-0411-001

公司网址：[www.taichengcaifu.com](http://www.taichengcaifu.com)

(61) 上海陆金所基金销售有限公司

住所：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 号西裙楼

法定代表人：胡学勤

联系人：宁博宇

联系电话：021-20665952

传真：021-22066653

客服电话：4008219031

公司网址：[www.lufunds.com](http://www.lufunds.com)

(62) 北京虹点基金销售有限公司

住所：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

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：董浩



联系人：陈铭洲

联系电话：010-65951887

传真：010-65951887

客服电话：4000681176

公司网址：www.hongdianfund.com

(63) 大泰金石基金销售有限公司

住所：南京市建邺区江东中路 222 号南京奥体中心现代五项馆 2105 室

办公地址：上海市浦东新区峨山路 505 号东方纯一大厦 15 楼

法定代表人：袁顾明

联系人：孟召社

联系电话：021-20324176

传真：021-20324199

客服电话：400-928-2266

公司网址：www.dtfunds.com

(64) 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

办公地址：上海市黄浦区延安东路 1 号凯石大厦 4 楼

法定代表人：陈继武

联系人：高皓辉

联系电话：021-63333389

传真：021-63333390

客服电话：4006-433-389

公司网址：www.vstonewealth.com

(65) 珠海盈米财富管理有限公司

住所：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

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

B1201-1203

法定代表人：肖雯

联系人：黄敏嫦

联系电话：020-89629099

传真：020-89629011

客服电话：020-89629066

公司网址：www.yingmi.cn

(66) 奕丰基金销售有限公司

住所：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入住深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市南山区海德三道航天科技广场A座17楼1704室

法定代表人：TEO WEE HOWE

联系人：叶健

联系电话：0755-89460500

传真：0755-21674453

客服电话：400-684-0500

公司网址：www.ifastps.com.cn

(67) 安粮期货股份有限公司

住所：安徽省合肥市包河区芜湖路168号同济大厦10-11层

办公地址：安徽省合肥市包河区芜湖路168号同济大厦10-11层(总部)

法定代表人：朱中文

联系人：梁蕾

联系电话：0551-62870125

传真：0551-62870131

客服电话：400 626 9988

公司网址：<http://www.alqh.com/>

(68) 上海联泰资产管理有限公司

住所：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：陈东

联系电话：021-52822063

传真：021-52975270

客服电话：4000-466-788

公司网址：[www.66zichan.com](http://www.66zichan.com)

(69) 北京钱景基金销售有限公司

住所：北京市海淀区丹棱街丹棱 soho10 层

办公地址：北京市海淀区丹棱街丹棱 soho10 层

法定代表人：赵荣春

联系人：陈剑炜

联系电话：010-57418813

客服电话：400-893-6885

公司网址：[www.qianjing.com](http://www.qianjing.com)

(70) 北京展恒基金销售股份有限公司

住所：北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号

办公地址：北京市朝阳区安苑路 15-1 号邮电新闻大厦 2 层

法定代表人：闫振杰

电话：010-59601366

传真：010-62020355

联系人：翟文

客户服务电话：4008188000

公司网址：[www.myfund.com](http://www.myfund.com)

(71) 深圳市金斧子基金销售有限公司

住所：深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路 15 号科兴科学园 B 栋  
3 单元 11 层

办公地址：深圳市南山区粤海街道科苑路科兴科学园 B3 单元 7 楼

法定代表人：赖任军

电话：0755-29330513

传真：0755-26920530

联系人：刘昕霞

客户服务电话：400-930-0660

公司网址：[www.jfzinv.com](http://www.jfzinv.com)

(72) 北京广源达信基金销售有限公司

住所：北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座六层 605 室

办公地址：北京市朝阳区望京东园四区 13 号楼浦项中心 B 座 19 层

法定代表人：齐剑辉

电话：4006236060

传真：010-82055860

联系人：王英俊

客户服务电话：400-623-6060

公司网址：[www.niuniufund.com](http://www.niuniufund.com)

(73) 上海中正达广基金销售有限公司

住所：上海市徐汇区龙腾大道 2815 号 302 室

办公地址：上海市徐汇区龙腾大道 2815 号 302 室

法定代表人：黄欣

电话：021-33768132

传真：021-33768132-802

联系人：戴珉微

客户服务电话：4006767523

公司网址：[www.zhongzhengfund.com](http://www.zhongzhengfund.com)

(74) 乾道盈泰基金销售（北京）有限公司

办公地址：北京市西城区德外大街合生财富广场 1302 室

住所：北京市西城区德外大街合生财富广场 1302 室

法定代表人：王兴吉

联系人：高雪超

联系电话：18601207732

传真：010-82057741

客服电话：4000888080

公司网址：www.qiandaojr.com

（75）上海基煜基金销售有限公司

住所：上海市崇明县长兴镇路潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室（上海泰和经济发展区）

办公地址：上海市杨浦区昆明路 518 号 A1002 室

法定代表人：王翔

联系人：蓝杰

电话：021-65370077-220

传真：021-55085991

客户服务电话：021-65370077

网址：www.jiyufund.com.cn

（76）北京懒猫金融信息服务有限公司

住所：北京市石景山区石景山路 31 号院盛景国际广场 3 号楼 1119

办公地址：北京市朝阳区四惠东通惠河畔产业园区 1111 号

法定代表人：许现良

电话：010-57649619

传真：010-57649620

联系人：朱翔宇

客户服务电话：010-57649619

公司网址：www.lanmao.com

（77）一路财富（北京）信息科技有限公司

住所：北京市西城区阜成门大街 2 号万通新世界广场 A 座 2208

办公地址：北京市西城区阜成门大街 2 号万通新世界广场 A 座 2208

法定代表人：吴雪秀

电话：+86(10)88312877

传真：+86(10)88312877

联系人：徐越

客户服务电话：400-001-1566

公司网址：<http://www.yilucaifu.com/>

(78) 南京苏宁基金销售有限公司

住所：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

法定代表人：王锋

电话：025-66996699-887226

传真：025-66008800-887226

联系人：张慧

客户服务电话：95177

公司网址：[www.snjijin.com](http://www.snjijin.com)

(79) 北京蛋卷基金销售有限公司

住所：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：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507

法定代表人：钟斐斐

电话：010-61840688

传真：010-61840699

联系人：吴季林

客户服务电话：4000618518

公司网址：<https://danjuanapp.com>

(80) 上海景谷基金销售有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 958 号华能联合大厦 402k

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 958 号华能联合大厦 402k

法定代表人：袁飞

电话：61621602

传真：61621602\*819

联系人：袁振荣

客户服务电话：61621602

公司网址：www.g-fund.com.cn

(81) 北京汇成基金销售有限公司

住所：北京市海淀区中关村大街 11 号 A 座 1108 室

办公地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 A 座 1108 室

法定代表人：王伟刚

电话：010-56251471

传真：010-62680827

联系人：熊小满

客户服务电话：400-619-9059

公司网址：www.hcjijin.com

(82) 厦门市鑫鼎盛控股有限公司

住所：厦门市思明区鹭江道 2 号第一广场 15 楼

办公地址：厦门市思明区鹭江道 2 号第一广场 15 楼

法定代表人：陈洪生

电话：0592-3122672

传真：0592-3122701

联系人：梁云波

客户服务电话：400-9180808

公司网址：www.xds.com.cn

(83) 北京新浪仓石基金销售有限公司

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

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

电话：010-62676405

传真：8610-62675979

联系人：付文红

客户服务电话：010-62675369

公司网址：www.xincai.com

（84）天津国美基金销售有限公司

住所：天津经济技术开发区南港工业区综合服务区办公楼 D 座二层  
202-1 室

办公地址：北京市朝阳区霄云路 26 号鹏润大厦 B 座 19 层

法定代表人：丁东华

电话：010-59287984

传真：010-59287825

联系人：郭宝亮

客服电话：400-111-0889

公司网址：www.gomefund.com

（85）上海华信证券有限责任公司

住所：上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 9 楼

办公地址：上海市黄浦区南京西路 399 号明天广场 20 楼

法定代表人：郭林

电话：021-63898427

传真：021-68776977-8427

联系人：徐璐

客户服务电话：400-820-5999

公司网址：www.shhxzq.com

（86）凤凰金信（银川）基金销售有限公司

住所：宁夏回族自治区银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路 142 号 14  
层 1402

办公地址：北京市朝阳区紫月路 18 号院 朝来高科技产业园 18 号楼

法定代表人：程刚

电话：010-58160168



传真：010-58160173

联系人：张旭

客户服务电话：400-810-5919

公司网址：www.fengfd.com

(87) 上海云湾基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路 27 号 13 号楼 2 层

办公地址：上海市浦东新区锦康路 308 号 6 号楼 6 楼

法定代表人：戴新装

电话：021-20538888

传真：021-20538999

联系人：江辉

客户服务电话：400-820-1515

公司网址：www.zhengtongfunds.com

(88) 南京途牛金融信息服务有限公司

注册地址：南京市玄武区玄武大道 699-1 号

办公地址：南京市玄武区玄武大道 699-1 号

法定代表人：宋时琳

联系人：张士帅

联系电话：025-86853969

客服电话：4007-999-999

公司网址：<http://jr.tuniu.com>

(89) 上海万得基金销售有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

办公地址：上海市浦东新区浦明路 1500 号万得大厦 11 楼

法定代表人：王廷富

联系人：徐亚丹

联系电话：021-51327185

传真：021-50710161

客服电话：400-821-0203

公司网址：www.520fund.com.cn

(90) 杭州科地瑞富基金销售有限公司

住所：杭州市下城区武林时代商务中心 1604 室

办公地址：杭州市下城区上塘路 15 号武林时代 20 楼

法定代表人：陈刚

联系人：张丽琼

联系电话：0571-85262700

传真：0571-85269200

客服电话：0571-86915761

公司网址：www.cd121.com

(91) 北京植信基金销售有限公司

住所：北京市密云县兴盛南路 8 号院 2 号楼 106 室-67

办公地址：北京市朝阳区惠河南路盛世龙源 10 号

法定代表人：杨纪锋

联系人：吴鹏

电话：010-56075718

传真：010-67767615

客服电话：400-680-2123

网址：www.zhixin-inv.com

(92) 北京肯特瑞基金销售有限公司

住所：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 号院京东集团总部 A 座

法定代表人：江卉

联系人：赵德赛

电话：4000988511/ 4000888816

传真：010-89188000

客服电话：95118

网址：<http://fund.jd.com/>

(93) 上海朝阳永续基金销售有限公司

住所：浦东新区上丰路 977 号 1 幢 B 座 812 室

办公地址：上海市浦东新区碧波路 690 号 4 号楼 2 楼

法定代表人：廖冰

联系人：裘爱萍

联系电话：021-80234888

传真：021-80234898

客服电话：4006991888

公司网址：[www.998fund.com](http://www.998fund.com)

(94) 中证金牛（北京）投资咨询有限公司

住所：北京市丰台区东管头 1 号 2 号楼 2-45 室

办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲 1 号环球财讯中心 A 座 5 层

法定代表人：钱昊旻

联系人：徐英

电话：010-59336539

传真：010-59336500

客服电话：4008-909-998

(95) 上海华夏财富投资管理有限公司

住所：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 8 层

法定代表人：毛淮平

联系人：仲秋玥

电话：010-88066632

传真：010-63136184

客服电话：400-817-5666

网址：[www.amcfortune.com](http://www.amcfortune.com)

(96) 武汉市伯嘉基金销售有限公司

住所：湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际 SOHO 城（一期）  
第七幢 23 层 1 号 4 号

办公地址：湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际 SOHO 城（一期）第七幢 23 层 1 号 4 号

法定代表人：陶捷

联系人：陆锋

客户服务电话：4000279899

公司网址：[www.buyfunds.cn](http://www.buyfunds.cn)

(97) 和耕传承基金销售有限公司

住所：郑州市郑东新区东风南路康宁街互联网金融大厦六层

办公地址：郑州市郑东新区东风南路康宁街互联网金融大厦六层

法定代表人：李淑慧

联系人：罗聪

客户服务电话：0371-85518396

公司网址：[www.hgccpb.com](http://www.hgccpb.com)

(98) 徽商期货有限责任公司

住所：安徽省合肥市芜湖路 258 号 3 号楼 4、6、7 层，6 号楼 1、2 层

办公地址：安徽省合肥市芜湖路 258 号 3 号楼 4、6、7 层，6 号楼 1、2 层

法定代表人：吴国华

联系人：申倩倩

客户服务电话：4008878707

公司网址：[www.hsqh.net](http://www.hsqh.net)

(99) 北京微动利基金销售有限公司

住所：北京市石景山区古城西路 113 号景山财富中心 341

办公地址：北京市石景山区古城西路 113 号景山财富中心 341

法定代表人：梁洪军

联系人：季长军

客户服务电话：400-819-6665

公司网址：[www.buyforyou.com.cn](http://www.buyforyou.com.cn)

（100）成都华羿恒信基金销售有限公司

住所：中国（四川）自由贸易试验区成都高新区蜀锦路 88 号 1 号楼 32 楼 2 号

办公地址：中国（四川）自由贸易试验区成都高新区蜀锦路 88 号 1 号楼 32 楼 2 号

法定代表人：赵壁

联系人：徐莉

客户服务电话：400-8010-009

公司网址：<http://www.huayihengxin.com>

（101）上海挖财基金销售有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 层 01、02、03 室

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 层 01、02、03 室

法定代表人：冷飞

联系人：李娟

联系电话：021-50810687

客服电话：021-50810673

公司网址：[www.wacaijijin.com](http://www.wacaijijin.com)

（102）上海大智慧基金销售有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 428 号 1 号楼 1102 单元

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 428 号 1 号楼 1102 单元

法定代表人：申健

联系人：宋楠

联系电话：021-20219988

客服电话：021-20292031

网址：<https://www.wg.com.cn/>

（103）北京加和基金销售有限公司

注册地址：北京市西城区车公庄大街 4 号 5 号楼一层

办公地址：北京市西城区北礼士路甲 129 号文化创新工场四层 404

法定代表人：徐福星

联系人：李美

电话：010-68292940

传真：010-68292964

客户服务电话：400-600-0030

网址：[www.bzfunds.com](http://www.bzfunds.com)

（104）北京晟视天下投资管理有限公司

注册地址：北京市怀柔区九渡河镇黄坎村 735 号 03 室

办公地址：北京市朝阳区朝外大街甲六号万通中心 D 座 21 层&28 层

法定代表人：蒋煜

联系人：刘聪慧/徐晓荣

电话：010-58170905/010-58170876

传真：010-58100800

客户服务电话：400-818-8866

网址：[www.shengshiview.com.cn](http://www.shengshiview.com.cn)

（105）北京格上富信基金销售有限公司

住所：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

客户服务电话：400-066-8586

公司网址：[www.igesafe.com](http://www.igesafe.com)

## (106) 北京电盈基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区呼家楼（京广中心）1 号楼 36 层 3603 室

办公地址：北京市朝阳区呼家楼（京广中心）1 号楼 36 层 3603 室

法定代表人：程刚

联系人：赵立芳

客户服务电话：400-100-3391

公司网址：<http://www.dianyingfund.com/>

## (107) 天津万家财富资产管理有限公司

住所：天津自贸区（中心商务区）迎宾大道 1988 号滨海浙商大厦公寓  
2-2413 室

办公地址：北京市西城区丰盛胡同 28 号太平洋保险大厦 5 层

法定代表人：李修辞

联系人：邵玉磊

客户服务电话：010-59013825

公司网址：<http://www.wanjiawealth.com/>

基金管理人可根据有关法律法规要求，根据实际情况选择其他符合要求的机构代理销售本基金或变更上述代销机构，并及时公告。

## (二) 登记机构

名称：中海基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层

办公地址：上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层

法定代表人：杨皓鹏

总经理：杨皓鹏

成立日期：2004 年 3 月 18 日

电话：021-38429808

传真：021-68419328

联系人：周琳

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

法定代表人：韩炯

电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：黎明

经办律师：吕红、黎明

（四）审计基金财产的会计师事务所

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室

办公地址：北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室

执行事务合伙人：毛鞍宁

联系电话：010-58153000

传真：010-58153000

联系人：徐艳

经办会计师：徐艳、朱昀



## 六、基金的历史沿革

中海策略精选灵活配置混合型证券投资基金由中海安鑫保本混合型证券投资基金转型而来。中海安鑫保本混合型证券投资基金的设立申请经中国证监会《关于核准中海安鑫保本混合型证券投资基金募集的批复》（证监许可[2013]369号）和《关于中海安鑫保本混合型证券投资基金募集时间安排的确认函》（基金部函【2013】484号）的核准募集，《中海安鑫保本混合型证券投资基金基金合同》于2013年7月31日正式生效。

中海安鑫保本混合型证券投资基金基金管理人为中海基金管理有限公司、基金托管人为上海浦发银行股份有限公司、基金担保人为中国投资担保有限公司。中海安鑫保本混合型证券投资基金于基金合同生效日（即2013年7月31日）开始第一个保本周期，第一个保本周期自基金合同生效之日起至2个公历年后对应日（即2015年7月31日）止。自2015年9月8日起进入第二个保本周期，第二个保本周期为2015年9月8日至2个公历年后对应日（即2017年9月8日）止。

由于第二个保本周期到期，中海安鑫保本混合型证券投资基金未能符合保本基金存续条件，按照《中海安鑫保本混合型证券投资基金基金合同》的规定，经基金管理人和基金托管人同意，并报中国证监会备案，本基金管理人对《中海安鑫保本混合型证券投资基金基金合同》进行了修改，修改的内容包括但不限于基金名称、投资目标、投资范围、投资限制、投资策略、业绩比较基准、基金费率、收益分配条款等事项，并根据现行有效的法律法规规定，在对基金份额持有人利益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。中海安鑫保本混合型证券投资基金在保本期满后转型为非保本的混合型证券投资基金，基金名称相应变更为“中海策略精选灵活配置混合型证券投资基金”。

## 七、基金的存续

《基金合同》生效后，连续二十个工作日基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续六十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、基金份额的申购和赎回

### （一）申购与赎回场所

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招募说明书或其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并予以公告。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）申购与赎回的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

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

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

#### 2、申购、赎回开始日及业务办理时间

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

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

在确定申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在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。基金投资者在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的，其基金份额申购、赎回价格为

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、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销。

4、基金份额持有人在赎回基金份额时，基金管理人按先进先出的原则，即对该基金份额持有人在销售机构托管的基金份额进行赎回处理时，申购确认日期在先的基金份额先赎回，申购确认日期在后的基金份额后赎回，以确定所适用的赎回费率。

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

### （四）申购与赎回的程序

#### 1、申购和赎回的申请方式

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

#### 2、申购和赎回的款项支付

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

基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；登记机构确认赎回时，赎回生效。

投资人赎回申请成功后，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有效申购和赎回申请的当天作为

申购或赎回申请日(T日),在正常情况下,本基金登记机构在T+1日内对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请,投资人应在T+2日后(包括该日)到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功,则申购款项退还给投资人。

#### (五) 申购与赎回的数额限制

1、通过销售机构首次申购单笔最低金额及追加金额为人民币10元,各销售机构对申购金额及交易级差有规定的,以各销售机构为准。通过本公司网上直销平台首次申购单笔最低金额为人民币10元;通过本公司直销柜台首次申购单笔最低金额为人民币100,000元,追加申购单笔最低金额为人民币10,000元。

2、投资者可多次申购,对单个投资者累计持有基金份额的比例或数量不设上限限制,但单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的50%(在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过50%的除外)。法律法规、中国证监会另有规定的除外。

3、投资者可将其全部或部分基金份额赎回,单笔最低赎回份额为1份(除非该账户在销售机构或网点托管的基金份额余额不足1份);若某笔赎回或转换导致基金份额持有人在该销售机构或网点托管的基金份额余额少于1份,剩余部分基金份额必须一起赎回;赎回金额计量单位为人民币元,按四舍五入法保留到小数点后两位。

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

5、基金管理人可在法律法规允许的情况下,调整上述对申购的金额和赎回的份额的数量限制,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公告并报中国证监会备案。

### （六）申购费用和赎回费用

1、本基金的申购费用由申购本基金的投资者承担，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。赎回费用由赎回本基金的基金份额持有人承担。

2、基金份额持有人可将其持有的全部或部分基金份额赎回。本基金的赎回费用在基金份额持有人赎回本基金份额时收取，其中对于持续持有期少于7日的投资者收取不少于1.5%的赎回费并全额计入基金财产；对于持续持有期不少于7日的投资者，扣除用于市场推广、注册登记费和其他手续费后的余额归基金财产，赎回费归入基金财产的比例不得低于25%。

#### 3、申购费用

本基金申购费用采取前端收费模式，申购费率按照申购金额递减，即申购金额越大，所适用的申购费率越低。投资者在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。

本基金对通过直销中心申购的养老金客户与除此之外的其他投资者实施差别的申购费率。

养老金客户指基本养老金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金，包括全国社会保障基金、可以投资基金的地方社会保障基金、企业年金单一计划以及集合计划。如将来出现可以投资基金的住房公积金、享受税收优惠的个人养老账户、经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，基金管理人可在招募说明书更新时或发布临时公告将其纳入养老金客户范围，并按规定向中国证监会备案。非养老金客户指除养老金客户外的其他投资者。

通过基金管理人的直销中心申购本基金份额的养老金客户申购费率见下表：（单位：元）

申购金额（M）	申购费率
M<100万	0.60%

100 万 $\leq$ M<300 万	0.30%
300 万 $\leq$ M<500 万	0.12%
M $\geq$ 500 万	每笔 1000 元

其他投资者申购本基金基金份额申购费率见下表：（单位：元）

申购金额（M）	申购费率
M<100 万	1.50%
100 万 $\leq$ M<300 万	1.00%
300 万 $\leq$ M<500 万	0.60%
M $\geq$ 500 万	每笔 1000 元

#### 4、赎回费用

本基金赎回费用按基金份额持有人持有该部分基金份额的时间分段设定，其中对于持续持有期少于 7 日的投资者收取不少于 1.5%的赎回费并全额计入基金财产，具体赎回费率如下：

持有期限（Y）	赎回费率	赎回费计入基金资产比例
Y<7日	1.50%	100%
7日 $\leq$ Y<30日	0.75%	100%
30日 $\leq$ Y<3个月	0.50%	75%
3个月 $\leq$ Y<6个月	0.50%	50%
Y $\geq$ 6个月	0	0

（注：1 个月=30 日）

5、基金管理人可以根据《基金合同》的相关约定调整费率或收费方式，基金管理人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公告。

6、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性，摆动定价机制的处理原则与操作规范参见法律法规和自律组织的规定，具体见基金管理人届时

的相关公告。

7、基金管理人可以在不违背法律法规规定及《基金合同》约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对以特定交易方式（如网上交易、电话交易等）等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行相关手续后基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

#### （七）申购份额与赎回金额的计算

##### 1、本基金申购份额的计算：

基金的申购金额包括申购费用和净申购金额。申购份额的计算公式为：

当申购费用适用比例费率时：

净申购金额 = 申购金额 / (1 + 申购费率)；

申购费用 = 申购金额 - 净申购金额；

申购份额 = 净申购金额 / 申购当日基金份额净值。

当申购费用适用固定金额时：

申购费用 = 固定金额；

净申购金额 = 申购金额 - 申购费用；

申购份额 = 净申购金额 / 申购当日基金份额净值。

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

例：某非养老金客户投资者投资 10,000 元申购本基金，申购费率为 1.50%，假定申购当日基金份额净值为 1.0500 元，则可申购基金份额为：

净申购金额 = 10,000 / (1 + 1.50%) = 9,852.22 元

申购费用 = 10,000 - 9,852.22 = 147.78 元

申购份额 = 9,852.22 / 1.0500 = 9,383.07 份

即：该投资者投资 10,000 元申购本基金，可得到 9,383.07 份基金份额。



## 2、本基金赎回金额的计算：

采用“份额赎回”方式，赎回价格以 T 日的基金份额净值为基准进行计算，赎回金额的计算公式为：

赎回总金额=赎回份额×T 日基金份额净值

赎回费用=赎回总金额×赎回费率

净赎回金额=赎回总金额-赎回费用

例：某投资者赎回本基金 1 万份基金份额，持有时间为 3 个月，对应的赎回费率为 0.50%，假设赎回当日基金份额净值是 1.1000 元，则其可得到的赎回金额为：

赎回总额=10,000×1.1000=11,000.00 元

赎回费用=11,000.00×0.50%=55.00 元

净赎回金额=11,000.00-55.00=10,945.00 元

即：该投资者赎回本基金 1 万份基金份额，持有时间为 6 个月可得到赎回金额 10,945.00 元。

## 3、本基金基金份额净值的计算：

基金份额净值的计算公式：

T 日基金份额净值=T 日基金资产净值总额/T 日基金份额总数；

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。本基金基金份额净值的计算，保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

## 4、申购份额、余额的处理方式：

申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后，以当日基金份额净值为基准计算，申购份额计算结果保留到小数点后 2 位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

## 5、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乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用，计算结果保留到小数点后 2 位，小数点后两位以后的部分四舍

五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

#### （八）申购和赎回的登记

投资者申购基金成功后，基金登记机构在 T+1 日为投资者登记权益并办理登记手续，投资者自 T+2 日（含该日）后有权赎回该部分基金份额。

投资者赎回基金成功后，基金登记机构在 T+1 日为投资者办理扣除权益的登记手续。

基金管理人可以在法律法规允许的范围内，依法对上述登记办理时间进行调整，但不得实质影响投资者的合法权益，并最迟于开始实施前 3 个工作日在指定媒介公告。

#### （九）拒绝或暂停申购的情形及处理方式

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转。
- 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。
- 3、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
- 4、基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。
- 5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人利益的情形。
- 6、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过 50%，或者变相规避 50% 集中度的情形时。
- 7、申请超过基金管理人设定的基金总规模、单日净申购比例上限、单个投资人单日或单笔申购金额上限的。
- 8、当前一估值日基金资产净值 50% 以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管

人协商确认后，基金管理人应当暂停接受申购申请。

9、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第 1、2、3、5、8、9 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人的申购申请时，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全部或部分拒绝的，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

(十) 暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。

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

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

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接受投资人的赎回申请时，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，并以后续开放日的基金份额净值为依据计算赎回金额。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。

### （十一）巨额赎回的情形及处理方式

#### 1、巨额赎回的认定

本基金单个开放日，基金份额净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一开放日基金总份额的 10%时，即认为发生了巨额赎回。

#### 2、巨额赎回的处理方式

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

（3）若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额的 10%，基金管理人有权先行对该单个基金份额持有人超出 10%的赎回申请实施延期办理，而对该单个基金份额持有人 10%以内（含 10%）的赎回申请与其他投资者的赎回申请按前述条款处理，具体

见招募说明书或相关公告。

(4) 暂停赎回：连续 2 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。

(5) 巨额赎回的公告：

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

(十二) 暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

1、发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人当日应立即向中国证监会备案，并在规定期限内指定媒介上刊登暂停公告。

2、如发生暂停的时间为 1 日，基金管理人应于重新开放日，在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 个开放日的基金份额净值。

3、如发生暂停的时间超过 1 日，暂停期间，基金管理人应每 2 周至少刊登暂停公告 1 次；暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近一个开放日的基金份额净值。

(十三) 基金的转换

为方便基金份额持有人，本基金已于 2013 年 9 月 18 日起开通基金转换业务。基金转换的数额限制、转换费率等具体规定详见基金转换公告。

(十四) 基金份额的转让

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

前公告，基金份额持有人应根据基金管理人公告的业务规则办理基金份额转让业务。

#### （十五）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。

#### （十六）定期定额投资计划

本基金已于 2013 年 9 月 18 日开通定期定额申购业务，基金定投的数额限制、业务规则等请参见基金定投相关公告。

#### （十七）基金的非交易过户

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

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

#### （十八）基金份额的冻结与解冻

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。

## 九、基金的投资

### （一）投资目标

本基金通过多种投资策略，在控制风险的前提下，谋求基金资产的长期稳定增值，回报投资人。

### （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，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、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)。

本基金固定收益类资产主要投资于国债、央行票据、中期票据、金融债、公司债、企业债、政府机构债、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、可交换债券、债券回购、短期融资券、次级债、银行存款、资产支持证券、货币市场工具等品种。

本基金所投的货币市场工具包括现金；期限在 1 年以内（含 1 年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单；剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券；中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

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

基金的投资组合比例为：股票、权证等权益类资产占基金资产的比例为 0—50%，债券等固定收益类资产占基金资产的比例不低于 50%，权证投资占基金资产净值的比例为 0—3%，本基金保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

### （三）投资策略

#### 1、大类资产配置策略

本基金将深入分析宏观经济、政策层面、市场估值及市场情绪四方面的情况，通过对各种因素的综合分析，优化大类资产配置，即增加该阶段下市场表现优于其他资产类别的资产的配置，减少市场表现相对较差的资产类别的配置，以规避或分散市场风险，提高基金经风险调整后的收益。

#### 2、行业轮动策略

本基金在股票投资过程中注重行业轮动策略的应用，主要从定性和定量分析，重点选择景气处于上升、利润增长趋势向好、估值水平低的行业。

定性分析：本基金在分析国内宏观经济周期不同阶段（衰退、复苏、过热和滞胀）的行业景气轮动规律的基础上，结合国内当前和未来经济周期的情况，选择符合宏观经济发展趋势和国家产业政策扶持的行业。

定量分析：对照市场的整体情况，分析各行业的利润增长趋势及估值水平。衡量行业利润增长趋势的指标主要包括行业的营业收入增长率、主营业务利润增长率和净资产收益率等指标；衡量行业估值水平的指标主要包括PE、PB、PEG等指标。

#### 3、股票投资策略

在股票投资中，本基金采用定量分析与定性分析相结合的方法，选择其中经营稳健、具有核心竞争优势的上市公司进行投资。其间，本基金也将积极关注上市公司基本面发生改变时所带来的投资交易机会。

##### （1）定量分析

本基金通过综合考察上市公司的财务优势、估值优势和成长优势来进行个股的筛选。

本基金考察的财务指标主要包括：净资产收益率、资产负债率。

本基金考察的估值指标主要包括：市盈率、市净率和市销率。

本基金考察的成长指标主要包括：营业收入增长率、净利润增长率。

本基金将结合市场形势综合考虑上市公司在各项指标的综合得分，按照总分的高低在各行业内进行排序，选取各行业排名靠前的股票。



## （2）定性分析

本基金主要通过实地调研等方法，综合考察评估公司的经营情况，重点投资具有较高进入壁垒、在行业中具备比较优势、经营稳健的公司，并坚决规避那些公司治理混乱、管理效率低下的公司，以确保最大程度地规避投资风险。

### 4、债券投资策略（可转换债券除外）

在宏观分析和久期及期限结构配置的基础上，本基金对不同类型债券的信用风险、市场流动性、市场风险等因素进行分析，以其历史价格关系的数量分析为依据，同时兼顾其基本面分析，综合分析各品种的利差和变化趋势。在信用利差水平较高时持有金融债、公司债（企业债）、资产支持证券等信用品种，在信用利差水平较低时持有国债、央行票据等利率品种，从而确定整个债券组合中各类别债券投资比例。

本基金将借助公司内部的行业及公司研究员的专业研究能力，并综合参考外部研究机构的研究成果，对发债主体企业进行深入的基本面分析，主要包括经营历史、行业地位、竞争实力、公司治理、股东或地方政府的实力以及支持力度等；并结合债券的发行条款，综合考虑信用等级、期限、流动性、市场分割、息票率、税赋特点、提前偿还和赎回等因素的基础上以确定信用品种的实际信用风险状况及其信用利差水平，投资于信用风险相对较低、信用利差收益相对较大的优质品种。

### 5、可转换债券投资策略

可转换债券兼具债券和股票的相关特性，其投资风险和收益介于股票和债券之间。在进行可转债筛选时，本基金将首先对可转债自身的内在债券价值（如票面利息、利息补偿及无条件回售价格）、保护条款的适用范围、流动性等方面进行研究；然后对可转债的基础股票的基本面进行分析，形成对基础股票的价值评估；最后将可转债自身的基本面评分和其基础股票的基本面评分结合在一起以确定投资的可转换债券品种。

### 6、权证投资策略

本基金将运用期权估值模型，根据隐含波动率、剩余期限、正股价格走

势，并结合本基金的资产组合状况进行权证投资。

#### （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）本基金股票、权证等权益类资产占基金资产的比例为 0—50%，债券等固定收益类资产占基金资产的比例不低于 50%；

（2）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，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

（3）本基金持有一家公司发行的证券，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%；本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；

（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%；债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

(15) 基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

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

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

(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。

除上述第 (2)、(12)、(16)、(17) 项外，因证券市场波动、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。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基金合

同生效之日起开始。

如果法律法规对基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。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。

法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

## (五) 业绩比较基准

本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×30%+中证全债指数收益率×70%。

本基金为混合型基金，权益类资产占基金资产的比例为 0-50%，固定收益类资产占基金资产的比例不低于 50%，选择 30%作为基准指数中权益类资产所代表的长期平均权重，选择 70%作为固定收益类资产所代表的长期平均权重。

如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩比较基准时,本基金管理人与基金托管人协商一致,本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告,而无需召开基金份额持有人大会。

#### (六) 风险收益特征

本基金是一只混合型基金,其预期收益和预期风险水平高于货币市场基金、债券型基金,而低于股票型基金,在证券投资基金中属于中等风险收益品种。

#### (七) 投资决策依据和程序

##### 1、投资决策依据

(1) 依据投资研究人员对国内宏观经济、政策行业和上市公司的综合分析研究进行决策;

(2) 依据对国内证券市场的阶段表现、活跃程度和发展趋势判断进行决策;

(3) 依据国家有关法律、法规和《基金合同》的定进行决策;

(4) 风险控制贯穿投资过程各环节。

##### 2、投资程序

为明确投资各环节的业务职责,防范投资风险,基金管理人建立规范的投资程序。

(1) 投资决策委员会定期召开会议确定股票/债券资产投资比例,形成基金投资的投资决议。

(2) 研究部和金融工程部剔除个股、行业选择、数量化投资方案,为基金经理和投资决策委员会提供投资参考依据。

(3) 基金经理根据投资决策委员会的决议,在研究部和金融工程部提出的方案的基础上构建投资组合。

(4) 交易部依据基金经理的指令,执行交易,交易进行过程中,交易

员及时反馈市场信息。

(5) 风险管理部对基金投资组合的风险进行跟踪、评估、控制，对投资组合的绩效进行分析。

(八) 基金管理人代表基金行使股东及债权人权利的处理原则及方法

1、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；

2、有利于基金资产的安全与增值；

3、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金份额持有人的利益。

4、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利，保护基金份额持有人的利益。

(九) 基金投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本基金投资组合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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据基金合同规定，于2018年9月26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为截至2018年6月30日报告期末的半年报数据。

#### 1、基金资产组合情况

截至2018年6月30日，中海策略精选灵活配置混合型证券投资基金资产净值为47,541,491.90元，基金份额净值为0.9838元，累计基金份额净值为1.3655元。其资产组合情况如下：

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	19,850,135.00	38.40
	其中：股票	19,850,135.00	38.40

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	24,404,145.40	47.21
	其中：债券	24,404,145.40	47.21
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	6,499,676.62	12.57
8	其他资产	938,145.83	1.81
9	合计	51,692,102.85	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	9,705,553.00	20.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	984,300.00	2.07
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	9,160,282.00	19.27
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	19,850,135.00	41.75

### 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	002373	千方科技	145,100	1,893,555.00	3.98
2	300373	扬杰科技	63,700	1,821,820.00	3.83
3	300451	创业软件	100,400	1,566,240.00	3.29
4	300059	东方财富	113,300	1,493,294.00	3.14
5	300047	天源迪科	90,600	1,413,360.00	2.97
6	002293	罗莱生活	91,500	1,375,245.00	2.89
7	300003	乐普医疗	35,400	1,298,472.00	2.73
8	600845	宝信软件	48,300	1,272,705.00	2.68
9	002371	北方华创	25,000	1,241,750.00	2.61
10	002456	欧菲科技	65,400	1,054,902.00	2.22

### 4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	4,137,980.00	8.70
	其中：政策性金融债	4,137,980.00	8.70
4	企业债券	8,244,633.50	17.34
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	12,021,531.90	25.29
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	24,404,145.40	51.33

### 5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	122394	15 中银债	40,000	3,999,600.00	8.41
2	124688	PR 潜城投	64,230	3,946,933.50	8.30



3	128015	久其转债	24,030	2,249,208.00	4.73
4	018005	国开1701	21,000	2,107,980.00	4.43
5	018002	国开1302	20,000	2,030,000.00	4.27

#### 6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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名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

##### 1.1.1 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合约。

##### 1.1.2 9.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

##### 1.1.2.1.1.1 10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 1.1.3 10.1 本期国债期货投资政策

根据基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

##### 1.1.4 10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

## 10.3 本期国债期货投资评价

根据基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

## 11、投资组合报告附注

(1) 报告期内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本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

(2) 报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

(3) 截至 2018 年 6 月 30 日，本基金的其他资产项目构成如下：

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	105,865.86
2	应收证券清算款	547,068.39
3	应收股利	-
4	应收利息	285,092.40
5	应收申购款	119.18
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	938,145.83

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	128015	久其转债	2,249,208.00	4.73
2	128022	众信转债	910,530.00	1.92
3	123006	东财转债	841,890.00	1.77
4	110034	九州转债	812,350.00	1.71
5	128027	崇达转债	585,939.00	1.23
6	113503	泰晶转债	418,488.00	0.88
7	123002	国祯转债	355,985.00	0.75

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 1.1.5 (6) 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金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。

## 十、基金的业绩

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

基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较（截止日期2018年6月30日）：

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
2017.9.16-2017.12.31	1.14%	0.46%	1.20%	0.23%	-0.06%	0.23%
2018.1.1-2018.6.30	-5.01%	0.79%	-0.98%	0.35%	-4.03%	0.44%
自基金成立以来至今	-3.93%	0.68%	0.21%	0.31%	-4.14%	0.37%

注：本基金合同生效日为2017年9月16日，基金的过往业绩并不预示其未来表现。

## 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。除依法律法规和《基金合同》的规定处分外，基金财产不得被处分。

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

## 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、其它投资等资产及负债。

### （三）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。

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。

### （四）估值方法

本基金按以下方式进行估值：

#### 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) 交易所市场上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种和不含权固定收益品种(本基金基金合同另有约定的除外),选取第三方估值机构提供的相应品种的估值净价确定公允价值;

(3) 交易所上市的可转债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、因持有股票而享有的配股权,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。

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

7、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。

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，按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。

#### （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。

基金合同的当事人应按照以下约定处理：

##### 1、估值错误类型

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

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

##### 2、估值错误处理原则



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

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

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

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

### 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

(4) 根据估值错误处理的方法，需要修改基金登记机构交易数据的，

由基金登记机构进行更正，并就估值错误的更正向有关当事人进行确认。

#### 4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

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

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

(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交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

3、占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障投资人的利益，决定延迟估值；

4、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商一致的，基金管理人应当暂停基金估值；

5、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，由基金管理人对基金净值予以公布。

## 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 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 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：

本基金收益分配方式分为两种，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 个工作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）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。

现金红利转基金份额视同申购，但不收取申购费。

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 1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

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，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25%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，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

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，根据《中海安鑫保本混合型证券投资基金基金合同》的约定执行。
- 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、基金的会计与审计

### （一）基金会计政策

- 1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；
- 2、基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日；
- 3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
- 4、会计制度执行国家有关会计制度；
- 5、本基金独立建账、独立核算；
- 6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；
- 7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

### （二）基金的年度审计

- 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的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个工作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、招募说明书、《基金合同》、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网站上，将更新后的招募说明书摘要登载在指定报刊上；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》摘要登载在指定报刊上；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，通过网站、基金份额销售网点以及其他媒介，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报刊和网站上。

### 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网点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网站上，将年度报告摘要登载在指定报刊上。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报刊上。

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报刊和网站上。

《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。

报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情形，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文件中“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及产品的特有风险。

本基金持续运作过程中，应当在基金年度报告和半年度报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。

### 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) 发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；
- (26) 基金管理人采用摆动定价机制进行估值；
- (27) 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、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

需要在其他公共媒介披露信息,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住所,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住所,以供公众查阅、复制。

## 十七、风险揭示

### （一）市场风险

本基金为混合型证券投资基金，投资组合主要由股票等权益类资产和债券等固定收益类资产组成，证券市场价格受到各种因素的影响，导致基金收益水平变化而产生风险，主要包括：

1、政策风险。因国家的各项宏观政策，如货币政策、财政政策、产业政策、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。随着经济运行的周期性变化，各行业和证券市场的收益水平也呈周期性变化。基金投资于股票和债券，收益水平也会随之变化，从而产生风险。

3、利率风险。市场利率的波动会影响企业的融资成本和利润水平等，并导致证券价格的变动，进而对本基金的收益水平产生影响，从而产生风险。

4、通货膨胀风险。如果发生通货膨胀，基金投资于证券所获得的收益可能会被通货膨胀抵消，从而影响基金资产的保值增值。

5、信用风险。信用风险主要指信用证券发行主体信用状况恶化，导致信用评级下降甚至到期不能履行合约进行兑付的风险，另外，信用风险也包括证券交易对手因违约而产生的证券交割风险。

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

### （二）合规性风险

合规性风险是指本基金的投资运作不符合相关法律、法规的规定和《基金合同》的要求而带来的风险。

### （三）管理风险

在基金管理运作过程中，由于基金管理人的知识、经验、判断、决策、

技能等主观因素的限制而影响其对信息的占有以及对经济形势、证券价格走势的判断,或者由于基金数量模型设计不当或实施差错导致基金收益水平偏离业绩基准的风险。对主要业务人员(如基金经理)的依赖也可能产生管理风险。

#### (四) 流动性风险

流动性风险是指因证券市场交易量不足,导致证券不能迅速、低成本地变现的风险。流动性风险还包括基金出现巨额赎回,致使没有足够的现金应付赎回支付所引致的风险。

##### 1、基金申购、赎回安排

本基金的申购、赎回安排详见本招募说明书“八、基金份额的申购和赎回”章节。

##### 2、本基金拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

###### (1) 投资市场的流动性风险评估

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、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)。上述资产均存在规范的交易场所,运作时间长,市场透明度较高,运作方式规范,历史流动性状况良好,正常情况下上述资产流动性风险可控,当发生极端市场情况时,基金管理人会按照相关法律法规及基金合同的规定,及时启动流动性风险应对措施,保护基金份额持有人的权益。

###### (2) 投资行业的流动性风险评估

本基金在投资运作过程中将在综合考虑宏观因素、行业基本面及市场环境变化的前提下灵活地进行行业配置,同时本基金基于分散投资的原则,不以投资于某一单一行业为投资目标,在行业 and 个券方面未有高集中度的特征,受到投资行业所带来的流动性风险影响较小。

###### (3) 投资资产的流动性风险

本基金严格控制投资于流动性受限资产和非上市交易的股票、债券及不

存在活跃市场需要采用估值技术确定公允价值的投资品种的比例，以降低基金的流动性风险。

综上所述，正常情况下本基金拟投资市场、行业及资产的流动性良好，流动性风险相对可控。当发生极端市场情况时，基金管理人会按照相关法律法规及基金合同的规定，及时启动流动性风险应对措施，保护基金份额持有人的权益。

### 3、巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

当本基金出现巨额赎回情形时，本基金管理人经内部决策，并与基金托管人协商一致后，将运用多种流动性风险管理工具对赎回申请进行适度调整，以应对流动性风险，保护基金份额持有人的利益，包括但不限于：

- (1) 延缓办理巨额赎回申请；
- (2) 暂停接受赎回申请；
- (3) 延缓支付赎回款项；
- (4) 中国证监会认可的其他措施。

具体措施，详见本招募说明书“八、基金份额的申购和赎回”中“(十一) 巨额赎回的情形及处理方式”的相关内容。

### 4、实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响

基金管理人经与基金托管人协商，在确保投资者得到公平对待的前提下，可依照法律法规及基金合同的约定，综合运用各类流动性风险管理工具，对赎回申请等进行适度调整，作为特定情形下基金管理人流动性风险管理的辅助措施，包括但不限于：

- (1) 延期办理巨额赎回申请

具体措施，详见招募说明书“八、基金份额的申购和赎回”中“(十一) 巨额赎回的情形及处理方式”的相关内容。

- (2) 暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项

上述具体措施，详见招募说明书“八、基金份额的申购和赎回”中“(十) 暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式”的相关内容。

- (3) 收取短期赎回费

对持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5% 的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产。



#### （4）暂停基金估值

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

#### （5）摆动定价

当基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性，具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及自律组织规定。

当本基金出现上述情形时，本基金可能无法及时满足所有投资者的赎回申请，投资者收到赎回款项的时间也可能晚于预期或可能增加投资者赎回的成本。

#### （五）本基金特有风险

本基金可投资资产支持证券，资产支持证券具有一定的价格波动风险、流动性风险、信用风险等风险，本公司将本着谨慎和控制风险的原则进行资产支持证券投资，请基金份额持有人关注包括投资资产支持证券可能导致的基金净值波动在内的各项风险。

（六）本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险

本基金法律文件投资章节有关风险收益特征的表述是基于投资范围、投资比例、证券市场普遍规律等做出的概述性描述，代表了一般市场情况下本基金的长期风险收益特征。销售机构(包括基金管理人直销机构和其他销售机构)根据相关法律法规对本基金进行风险评价，不同的销售机构采用的评价方法也不同，因此销售机构的风险等级评价与基金法律文件中风险收益特征的表述可能存在不同，投资人在购买本基金时需按照销售机构的要求完成风险承受能力与产品风险之间的匹配检验。

#### （七）其他风险

- 1、因技术因素而产生的风险，如计算机系统不可靠产生的风险；

2、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；

3、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本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表决通过后生效，自决议生效后两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）基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

#### 1、基金份额持有人的权利与义务

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

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。

（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》；

- 2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，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、赎回款项及法律法规和《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定；
- 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。

## 2、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) 召集基金份额持有人大会；
- 6) 依据《基金合同》及有关法律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》及有关法律的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、融券;
- 14) 以基金管理人的名义, 代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为;
- 15) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构;
- 16) 在符合有关法律、法规的前提下, 制订和调整有关基金申购、赎回、转换和非交易过户的业务规则;
- 17) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

- 1) 依法募集资金, 办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的申购、赎回和登记事宜;
- 2) 办理基金备案手续;
- 3) 自《基金合同》生效之日起, 以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产;
- 4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策, 以专业化的经营方式管理和运作基金财产;
- 5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度, 保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立, 对所管理的不同基金分别管理, 分别记账, 进行证券投资;
- 6) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外, 不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益, 不得委托第三人运作基金财产;
- 7) 依法接受基金托管人的监督;
- 8) 采取适当合理的措施使计算基金份额申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定, 按有关规定计算并公告基金资产净值,

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。

### 3、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；

4) 根据相关市场规则，为基金开设证券账户、为基金办理证券交易资金清算；

5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

2) 设立专门的基金托管部门，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和证券账户,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定;

22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## (二) 基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

1、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。

### 2、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;
- 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;

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》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率;

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。

### 3、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。

#### 4、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书面表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。

#### 5、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 50%（含 50%）。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 50% (含 50%);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(含三分之一)以上基金份额的持有人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见;

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

(3) 在法律法规或监管机构允许的情况下,经会议通知载明,基金份额持有人也可以采用网络、电话或其他方式进行表决,或者采用网络、电话或其他方式授权他人代为出席会议并表决。

## 6、议事内容与程序

### (1) 议事内容及提案权

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

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

## (2) 议事程序

### 1) 现场开会

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

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

### 2) 通讯开会

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

## 7、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 50%以上(含 50%)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 2/3 以上（含 2/3）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》、本基金与其他基金合并以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

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

## 8、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。

## 9、生效与公告

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

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 日内在指定媒介上公告。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。

## （三）基金合同的解除和终止的事由、程序

### 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表决通过后生效，自决议生效后两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，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上海仲裁委员会，仲裁地点为上海市，仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有法律约束力，仲裁费用由败诉方承担。

《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、基金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：中海基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层

办公地址：上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层

成立时间：2004 年 3 月 18 日

批准设立机关：中国证监会

批准设立文号：证监基金字[2004]24 号

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、中国证监会许可的其它业务

组织形式：有限责任公司（中外合资）

注册资本：1.466667 亿元人民币

存续期间：持续经营

#### 2、基金托管人

名称：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

成立日期：1992 年 10 月 19 日

基金托管业务资格批准机关：中国证监会

基金托管业务资格文号：证监基金字[2003]105 号

组织形式：股份有限公司（上市）

经营期限：永久存续

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；

提供保险箱业务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外币兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代客外汇买卖；资信调查、咨询、见证业务；离岸银行业务；证券投资基金托管业务；信托投资公司资金信托托管业务；专项委托资金托管业务；中比产业投资基金托管业务；全国社会保障基金托管业务；农村养老保险基金托管；合格境外机构投资者（QFII）境内证券投资托管业务；企业年金账户管理业务；短期融资券承销业务；中央单位预算外资金收入收缴代理业务；网上银行业务；网上支付税费业务；产业（创业）投资基金托管业务；网上银行（外汇）结售付汇业务；信贷资产证券化业务；保险资产托管业务；保险资本金存款行业业务；企业年金托管业务；经中国人民银行批准的其他业务。

## （二）基金托管人对基金管理人的业务监督与核查

### 1、基金托管人对基金投资范围、投资对象的监督

基金托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定，对下述基金投资范围、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。

基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、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）。

本基金固定收益类资产主要投资于国债、央行票据、中期票据、金融债、公司债、企业债、政府机构债、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、可交换债券、债券回购、短期融资券、次级债、银行存款、资产支持证券、货币市场工具等品种。

本基金所投的货币市场工具包括现金；期限在 1 年以内（含 1 年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单；剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券；中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

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

基金的投资组合比例为：股票、权证等权益类资产占基金资产的比例为 0—50%，债券等固定收益类资产占基金资产的比例不低于 50%，权证投资占基金资产净值的比例为 0—3%，本基金保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

## 2、基金托管人对投融资比例的监督

本基金投资组合应遵循以下限制：

1) 本基金股票、权证等权益类资产占基金资产的比例为 0—50%，债券等固定收益类资产占基金资产的比例不低于 50%；

2) 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，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

3) 本基金持有一家公司发行的证券，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%；本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；

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%; 债券回购最长期限为 1 年, 债券回购到期后不得展期;

15) 基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%;

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

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

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。

除上述第 2)、12)、16)、17) 项外, 因证券市场波动、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。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基金合同生效之日起开始。

如果法律法规对基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。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、对基金投资禁止行为的监督

为维护基金份额持有人的合法权益，根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金禁止从事下列行为：

- (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，但是法律法规或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，由中国证监会规定及基金合同约定禁止的其他活动；

若法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，基金管理人在履行适当程序后，本基金投资可不受上述规定限制。

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，加盖公章或托管部章并书面提交。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。对于基金管理人交易所场内已成交的关联交易，基金托管人应按相关法律法规和交易所规则的规定进行结算，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、银行间债券市场信用风险控制

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。基金托管人通过电话与基金管理人确认收到该名单。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、对基金管理人选择存款银行的监督

基金管理人应根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，确定符合条件的所有存款银行的名单，并于每季度前五个工作日内向基金托管人提供符合条件的所有存款银行名单，基金托管人应据以对基金投资银行存款的交易对手是否符合有关规定进行监督。

#### 6、对基金投资流通受限证券的监督

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

(2) 流通受限证券与上文所述的流动性受限资产并不完全一致，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。

(3) 基金管理人应在基金首次投资流通受限证券前，向基金托管人提供经基金管理人董事会批准的有关基金投资流通受限证券的投资决策流程、风险控制制度。基金投资非公开发行股票，基金管理人还应提供基金管理人董事会批准的流动性风险处置预案。上述资料应包括但不限于基金投资流通受限证券的投资额度和投资比例控制情况。

基金管理人应至少于首次执行投资指令之前两个工作日将上述资料书面发至基金托管人，保证基金托管人有足够的时间进行审核。基金托管人应

在收到上述资料后两个工作日内，以书面或其他双方约定的方式确认收到上述资料。

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

(5) 基金托管人应对基金管理人是否遵守法律法规、投资决策流程、风险控制制度、流动性风险处置预案情况进行监督，并审核基金管理人提供的有关书面信息。基金托管人认为上述资料可能导致基金出现风险的，有权要求基金管理人在投资流通受限证券前就该风险的消除或防范措施进行补充书面说明，并保留查看基金管理人风险管理部门就基金投资流通受限证券出具的风险评估报告等备查资料的权利。否则，基金托管人有权拒绝执行有关指令。因拒绝执行该指令造成基金财产损失的，基金托管人不承担任何责任，并有权报告中国证监会。

如基金管理人和基金托管人无法达成一致，应及时上报中国证监会请求解决。如果基金托管人切实履行监督职责，则不承担任何责任。如果基金托管人没有切实履行监督职责，导致基金出现风险，基金托管人应承担连带责任。

## 7、基金托管人对基金投资中期票据的监督

基金管理人应当对投资中期票据业务进行研究，认真评估中期票据投资业务的风险，本着审慎、勤勉尽责的原则进行中期票据的投资业务。基金管理人根据法律、法规、监管部门的规定，制定基金投资中期票据相关制度（以下简称“《制度》”），以规范对中期票据的投资决策流程、风险控制。基金管理人《制度》的内容与本协议不一致的，以本协议的约定为准。

(1) 基金投资中期票据应遵循以下投资限制：

1) 中期票据属于固定收益类证券，基金投资中期票据应符合法律、法规及《基金合同》中关于该基金投资固定收益类证券的相关比例及期限限制；

2) 基金管理人管理的全部公募基金投资于一家企业发行的单期中期票据合计不超过该期证券的 10%；

(2) 基金托管人对基金管理人流动性风险处置的监督职责限于：

基金托管人对基金投资中期票据是否符合比例限制进行事后监督，如发现异常情况，应及时以书面形式通知基金管理人。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人接到通知后应及时核对并向基金托管人说明原因和解决措施。基金托管人有权随时对所通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人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。

(3) 如因市场变化，基金管理人投资的中期票据超过投资比例的，基金托管人有权要求基金管理人在 10 个交易日内将中期票据调整至规定的比例要求。

#### 8、基金托管人的其他监督事项

基金托管人根据《基金法》等法律法规及《基金合同》的规定，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的基金业绩表现数据等事项的合法、合规性进行监督和核查。

若基金宣传推介材料中需登载本基金业绩表现，基金管理人应根据《销售办法》等相关法规编制本基金业绩表现，并及时提交基金托管人复核，基金托管人按照《销售办法》对本基金业绩表现的真实性和准确性进行复核。

#### 9、基金托管人发现基金管理人投资运作违规时的处理方式和程序

基金托管人发现基金管理人的指令或其实际投资运作违反《基金法》、《基金合同》、基金托管协议及其他有关规定时，应及时采取电话、邮件、书面等形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在限期内，基金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。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人有权报告中国证监会。

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

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

基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查，包括但不限于在规定时间内答复基金托管人并改正，就基金托管人的疑义进行解释或举证，对基金托管人按照法规要求需向中国证监会报送基金监督报告以及其他履行基金托管人监督职责的行为，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠基金托管人根据相关法规、《基金合同》及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，情节严重或经监督方提出警告仍不改正的，监督方有权报告中国证监会。

### （三）基金管理人对于基金托管人的业务核查

1、根据《基金法》、《基金合同》及其它有关规定，基金管理人对于基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括但不限于基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、根据基金管理人的合法合规指令办理清算交收、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的合法合规的资金划拨等指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、《基金合同》、本托管协议及其他有关规定时，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。在限期内,基金管理人有权随时对通知事项进行复查,督促基金托管人改正。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的,基金管理人有权报告中国证监会。基金管理人发现基金托管人有重大违法违规行为,有权立即报告中国证监会,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。基金管理人有权要求基金托管人赔偿基金、基金管理人因此所遭受的直接损失。

基金管理人发现基金托管人有重大违规行为,应立即报告中国证监会和银行业监督管理机构,同时通知基金托管人限期纠正。

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。

基金托管人无正当理由,拒绝、阻挠基金管理人根据相关法规、《基金合同》及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,情节严重或经监督方提出警告仍不改正的,监督方有权报告中国证监会。

#### (四) 基金财产的保管

##### 1、基金财产保管的原则

(1) 本基金财产应独立于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的固有财产。

(2) 基金托管人应按本协议规定安全保管本基金的财产。未经基金管理人的正当指令,不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。托管人不对处于自身实际控制之外的账户及财产承担责任。

(3) 基金托管人按照相关法律法规以及本协议的规定开设基金的资金账户和证券账户。

(4) 基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户,与基金托管人的其他业务和其他基金的托管业务实行严格的分账管理,确保基金财产的

完整与独立。

(5) 对于因基金申购、基金投资过程中产生的应收财产，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，由基金管理人负责催收，因基金应收资产未及时到账给基金造成的损失，基金管理人负责向有关当事人追偿。

## 2、基金的资产托管专户的开立和管理

(1) 基金托管人负责按相关规定在基金托管人的营业机构开立资产托管专户。该资产托管专户是指基金托管人在集中托管模式下，代表所托管的基金与中国证券登记结算有限责任公司进行一级结算的专用银行存款账户。该账户的开设和管理由基金托管人承担。本基金的一切货币收支活动，均需通过基金托管人的资产托管专户进行。基金管理人应及时向基金托管人提供开户所需资料并提供其他协助。基金托管人根据基金管理人合法合规的指令办理基金银行存款账户的资金划付。

(2) 基金的资产托管专户印章由基金托管人保管和使用。基金银行存款账户的开立和使用，限于满足开展基金业务的需要。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，亦不得使用本基金的任何账户进行基金业务以外的活动。

(3) 基金资产托管专户的开立和管理应符合《人民币银行结算账户管理办法》、《现金管理条例》、《人民币利率管理规定》、《利率管理暂行规定》、《关于大额现金支付管理的通知》、《支付结算办法》以及银行业监督管理机构的其他相关规定。

## 3、基金证券账户和结算备付金账户的开立和管理

(1) 本基金在中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中登公司”)上海分公司、深圳分公司以本基金和基金托管人联名的名义开立证券账户，该账户用于本基金证券投资的交割和存管。基金托管人负责办理证券账户的开立事宜，并对证券账户业务发生情况根据中登公司上海分公司、深圳分公司发送数据进行如实记录。



(2) 基金证券账户的开立和使用，限于满足开展该基金业务的需要。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本基金的任何证券账户，亦不得使用本基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

(3) 基金证券账户的开立由基金托管人负责，管理和运用由基金管理人负责。

(4) 基金托管人保管证券账户卡原件。

(5) 基金托管人以基金托管人的名义在中登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和基金托管人为履行特别结算参与人的义务所制定的业务规则执行。

(6) 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、银行间债券托管专户的开立和管理

《基金合同》生效后，基金托管人根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司、上海清算所的有关规定，以本基金的名义分别在中央国债登记结算有限责任公司、上海清算所开立债券托管账户，并代表基金进行银行间市场债券的结算。

#### 5、其它账户的开立和管理

(1) 因业务发展而需要开立的其它账户，可以根据《基金合同》或有关法律法规的规定，经基金管理人和基金托管人协商一致后，由基金托管人负责为基金开立。新账户按有关规则使用并管理。

(2) 法律、法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

#### 6、基金投资银行存款账户的开立和管理

基金投资银行定期存款，基金管理人与基金托管人应比照证监会的规定，就本基金银行存款业务签订书面协议。

基金投资银行定期存款应由基金管理人与存款银行总行或其授权分行签订总体合作协议，并将资金存放于存款银行总行或其授权分行指定的分支机构。存款账户必须以本基金名义开立，账户名称为本基金名称，存款账户开户文件上加盖本基金预留印鉴及基金管理人公章。

本基金投资银行存款时，基金管理人应当与存款银行签订具体存款协议，明确存款的类型、期限、利率、金额、账号、对账方式、支取方式、账户管理等细则。为防范特殊情况下的流动性风险，定期存款协议中应当约定提前支取条款。

基金所投资定期存款存续期间，基金管理人、基金托管人应当与存款银行建立定期对账机制，确保基金银行存款业务账目及核对的真实、准确。

#### 7、基金资产投资的有关有价凭证的保管

实物证券、银行存款定期存单等有价凭证由基金托管人存放于托管银行的保管库，也可以存入中央国债登记结算有限责任公司、中登公司上海分公司/深圳分公司或票据营业中心及其他有权保管机构的代保管库中。保管凭证由基金托管人持有。实物证券等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证券不承担保管责任。

#### 8、与基金资产有关的重大合同的保管

基金管理人代表基金签署与基金投资有关的各类合同并及时通知基金托管人。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由基金管理人保管。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。重大合同由基金管理人按规定保管 15 年。由于合同产生的问题，由合同签署方负责处理。

### （五）基金资产净值计算与复核

#### 1、基金资产净值的计算

### （1）基金资产净值的计算、复核的时间和程序

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

基金份额净值是指基金资产净值除以基金份额总数，基金份额净值的计算，精确到 0.0001 元，小数点后第五位四舍五入，国家另有规定的，从其规定。

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，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。

### （2）复核程序

基金管理人每个工作日对基金资产进行估值后，将基金资产净值、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，按照基金管理人对于基金资产净值的计算结果对外予以公布。

## 2、基金资产估值和特殊情形的处理

### （1）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、其它投资等资产及负债。

### （2）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交易所市场上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种和不含权固定收益品种（本基金基金合同另有约定的除外），选取第三方估值机构提供的相应品种的估值净价确定公允价值；

③交易所上市的可转债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) 因持有股票而享有的配股权，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。

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

格估值。

7) 当本基金发生大额申购或赎回情形时, 基金管理人可以在履行适当程序后, 采用摆动定价机制, 以确保基金估值的公平性。

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、基金份额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見, 按照基金管理人对基金资产净值、基金份额净值的计算结果对外予以公布。

### 3、基金份额净值错误的处理方式

(1) 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)发生差错时, 视为基金份额净值错误。

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

(2) 当基金份额净值计算差错给基金和基金份额持有人造成损失需要进行赔偿时, 基金管理人和基金托管人应根据实际情况界定双方承担的责任, 经确认后按以下条款进行赔偿:

1) 本基金的基金会计责任方由基金管理人担任, 与本基金有关的会计问题, 如经双方在平等基础上充分讨论后, 尚不能达成一致时, 按基金管理人的建议执行, 由此给基金份额持有人和基金财产造成的损失, 由基金管理人负责赔付。

2) 若基金管理人计算的基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告, 而且基金托管人未对计算过程提出疑义或要求基金管理人书面说明, 基金份

额净值出错且造成基金份额持有人损失的,应根据法律法规的规定对基金份额持有人或基金支付赔偿金,就实际向基金份额持有人或基金支付的赔偿金额,基金管理人与基金托管人按照管理费和托管费的比例承担相关责任。

3) 如基金管理人和基金托管人对基金份额净值的计算结果,虽然多次重新计算和核对,尚不能达成一致时,为避免不能按时公布基金份额净值的情形,以基金管理人的计算结果对外公布,由此给基金份额持有人和基金造成的损失,由基金管理人负责赔付。

4) 由于基金管理人提供的信息错误(包括但不限于基金申购或赎回金额等),进而导致基金份额净值计算错误而引起的基金份额持有人和基金财产的损失,由基金管理人负责赔付。

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

(4) 前述内容如法律法规或者监管部门另有规定的,从其规定。

#### 4、暂停估值与公告基金份额净值的情形

(1) 基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;

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

(3) 占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变,而基金管理人为保障投资人的利益,决定延迟估值;

(4) 当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时,经与基金托管人协商一致的,基金管理人应当暂停基金估值;

(5) 中国证监会和基金合同认定的其它情形。

#### 5、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 7) 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,或由于证券交易所及登记结算公司发送的数

据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等，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。但基金管理人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

## 6、基金会计制度

按国家有关部门规定的会计制度执行。

## 7、基金会计核算

### (1) 基金账册的建立

基金会计核算由基金管理人承担，基金托管人复核。基金托管人也应按双方约定的同一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本基金的全套账册；双方管理或托管的不同基金的会计账册，应完全分开，单独编制和保管。

若基金管理人和基金托管人对会计处理方法存在分歧，应以基金管理人的处理方法为准。若当日核对不符，暂时无法查找到错账的原因而影响基金资产净值的计算和公告的，以基金管理人的账册为准。

### (2) 会计数据和财务指标的核对

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

证券交易凭证由基金托管人和基金管理人分别保管并据此核算。

基金管理人按日编制基金估值表，与基金托管人核对，从而核对证券交易账目。

基金托管人办理基金的资金收付、证券实物出入库所获得的凭证，由基金托管人保管原件并记账，每日将指令回执和单据复印件传真给基金管理人。

基金管理人与基金托管人对基金账册每月核对一次。经对账发现双方的账目存在不符的，基金管理人和基金托管人应及时查明原因并纠正，保持双方的账册记录完全相符。

### (3) 基金财务报表与定期报告的编制和复核

#### 1) 财务报表的编制

基金财务报表由基金管理人、基金托管人分别负责按有关规定编制，基金托管人负责复核基金管理人编制的基金财务报表。

## 2) 报表复核

基金托管人在收到基金管理人编制的基金财务报表后,进行独立的复核。核对不符时,应及时通知基金管理人共同查出原因,进行调整,直至双方数据完全一致。核对无误后,在核对过的基金财务报表上加盖基金托管人和基金管理人的业务章,各留存一份。

## 3) 报表报告的编制与复核时间安排

月度报表的编制,应于每月结束后5个工作日内完成;季度报告在《基金合同》生效后每季度结束之日起15个工作日内编制完成并公告;招募说明书应当在《基金合同》生效后每六个月结束之日起45日内更新并公告;半年度报告应当在上半年结束之日起60日内编制完成并公告;年度报告在每年结束之日起90日内编制完成并公告。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。《基金合同》生效不足两个月的,基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。以上报告的具体公告时间以证监会的要求为准。

基金管理人应留足充分的时间,便于基金托管人复核相关报表及报告。基金管理人应在月度报告内容截止日后的3个工作日内完成在月度报表编制,加盖公章后,以传真方式将有关报表提供基金托管人复核;基金托管人应在2个工作日内完成复核,并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人应在半年度报告内容截止日的30日内完成报告的编制,将有关报告提供基金托管人复核,基金托管人在收到后20日内完成复核,并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人应在年度报告内容截止日的50日内完成报告的编制,将有关报告提供基金托管人复核,基金托管人在收到后30日内完成复核,并将复核结果书面通知基金管理人。基金托管人在复核过程中,发现双方的报表存在不符时,基金管理人和基金托管人应共同查明原因,进行调整,调整以国家有关规定为准。核对无误后,基金托管人在基金管理人提供的报告上加盖公章,双方各留存一份。



## （六）基金份额持有人名册的保管

### 1、基金份额持有人名册的内容

基金份额持有人名册的内容包括但不限于持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册包括以下几类：

- （1）《基金合同》生效日的基金份额持有人名册；
- （2）基金份额持有人大会权益登记日的基金份额持有人名册；
- （3）每季度最后一个交易日的基金份额持有人名册。

### 2、基金份额持有人名册的提供

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，开放式基金的管理人应于每季度前3个工作日内以双方约定的方式向基金托管人提供上季度最后一个交易日的基金份额持有人名册电子数据。在《基金合同》生效日、基金份额持有人大会权益登记日等日期，基金管理人应向基金托管人提供上述日期的基金份额持有人名册。基金管理人应对基金份额持有人名册的真实性和完整性负责。

### 3、基金份额持有人名册的保管

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。保管方式可以采用电子或文档的形式。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。

基金托管人应当根据有关法律法规以及本协议的规定妥善保管基金份额持有人名册。如基金托管人无法妥善保存持有人名册，基金管理人有权向中国证监会报告，并应代为履行保管基金份额持有人名册的职责。基金托管人应对基金管理人由此产生的合理费用给予补偿。

为基金托管人履行有关法律法规、《基金合同》规定的职责之目的，基

金管理人以及基金管理人委托的登记机构应当提供任何必要的协助。

### （七）争议解决方式

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

双方当事人同意，因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议，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上海仲裁委员会，按其届时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为上海市，仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有法律约束力，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》和本协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

### （八）托管协议的变更、终止与基金财产的清算

#### 1、基金托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致，在符合法律法规和《基金合同》的前提下，可以对协议进行变更。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应当报中国证监会备案。

#### 2、发生以下情况，本协议终止：

- （1）本基金的《基金合同》终止；
- （2）基金托管人解散、依法被撤销、破产或由其它基金托管人接管基金资产；
- （3）基金管理人解散、依法被撤销、破产或由其它基金管理人接管其基金管理权；
- （4）发生《基金法》、《基金合同》或其它法律法规规定的终止事项。

#### 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) 对基金财产进行分配。

(5) 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。

(6) 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。

(7) 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。

(8) 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。

## 二十一、对基金份额持有人的服务

对于基金份额持有人和潜在投资者，基金管理人将根据具体情况提供一系列的服务，并将根据基金份额持有人的需要和市场的变化，增加或变更服务项目。主要服务内容如下：

### （一）基金份额持有人登记服务

基金管理人为基金份额持有人提供登记服务。基金管理人配备安全、完善的电脑系统及通讯系统，准确、及时地为基金投资者办理基金账户的建立和管理、基金份额的登记、管理、托管与转托管；基金转换和非交易过户；基金份额持有人名册的管理；权益分配时红利的登记派发；基金交易份额的清算过户和基金交易资金的交收等服务。

### （二）交易资料的寄送

1、账户资料：基金投资者开户申请被受理的2个工作日后（T+2日后），可以到销售网点查询和打印基金账户开户确认资料。基金成立后的30个工作日内，基金管理人将向定制纸质对账单的投资者寄送包含基金账户信息在内的对账单。

2、基金交易确认查询服务：基金投资者在交易申请被受理的2个工作日后（T+2日后），可以到销售网点查询和打印该项交易的确认资料。基金成立后的30个工作日内，基金管理人将向定制纸质对账单的投资者寄送包含基金认购确认信息在内的对账单。

3、每季度结束后20个工作日内，基金管理人将向该季度发生过交易的定制纸质对账单的投资者邮寄该季度对账单。每年度结束后30个工作日内，向所有定制纸质对账单的基金份额持有人寄送年度对账单。

4、对于未主动定制对账单服务的投资者，基金管理人将统一提供电子对账单（包含电子邮件或短信形式，按账户资料完善程度，优先提供电

子邮件对账单)。

### (三) 客户服务中心电话服务

客户服务中心提供24小时自动语音查询服务。持有人可进行基金账户余额、申购与赎回交易情况查询、基金产品与传真服务等信息的查询。

客户服务中心提供每周五天，每天不少于8小时的人工热线咨询服务。持有人可通过客服热线电话：400-888-9788或021-38789788享受业务咨询、信息查询、服务投诉、信息定制、对账单寄送地址资料修改等专项服务。

### (四) 网上交易服务

基金管理人已开通个人投资者网上交易业务。个人投资者通过基金管理人网上交易平台可以办理基金认购、申购、赎回、分红方式修改、账户资料修改、交易密码修改、交易申请查询和账户资料查询等各类业务。个人投资者可以直接登录基金管理人网站www.zhfund.com办理“网上开户”和“网上交易”业务，适用银行卡详见基金管理人网站www.zhfund.com网上交易平台。

在技术条件成熟时，基金管理人还将提供支持其他银行卡种的网上交易业务。

### (五) 定期定额投资计划

基金管理人可通过基金管理人网站（[www.zhfund.com](http://www.zhfund.com)）和销售机构为投资者提供定期定额投资服务。通过定期定额投资计划，投资者可以通过销售渠道定期定额申购基金份额。本基金已于2013年9月18日开通定期定额申购业务，基金定投的数额限制、业务规则等请参见基金定投相关公告。

### (六) 信息定制服务

基金持有人可以登录基金管理人网站或拨打客服热线电话提交信息定制申请。基金管理人通过手机短信、电子邮件或其他方式按持有人的定

制提供信息。可定制的信息包括：电子对账单、每周基金净值、交易确认信息、投资者服务刊物、分红公告、公司公告等。基金管理人可以根据实际业务需要，调整定制信息的条件、方式和内容。

#### （七）投资者投诉受理服务

投资者可以通过代销机构网点或基金管理人客服热线电话、基金管理人网站留言栏目、信函及电子邮件等形式对基金管理人或销售网点所提供的服务进行投诉。

客服热线电话投诉、电子邮件投诉、信函投诉、网站留言是主要投诉受理渠道，基金管理人客户服务部负责管理投诉电话、投诉邮箱。现场投诉和意见簿投诉是补充投诉渠道，由各代销机构和基金管理人分别管理。

对于工作日期间受理的投诉，原则上是及时回复；对于不能及时回复的投诉，基金管理人承诺在投诉送达基金管理人的两个工作日之内做出回复。对于非工作日提出的投诉，顺延至下一工作日完成回复。

客户服务部邮箱：[service@zhfund.com](mailto:service@zhfund.com)

（八）如本招募说明书存在任何您/贵机构无法理解的内容，请联系本公司客户服务热线。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、其他应披露的事项

- 1、2018-03-16 中海策略精选灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书(2018年第1号)
- 2、2018-03-16 中海策略精选灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书摘要(2018年第1号)
- 3、2018-03-24 中海基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金修改基金合同、托管协议并收取短期赎回费的提示性公告
- 4、2018-03-27 中海基金管理有限公司高级管理人员变更公告
- 5、2018-03-27 中海基金管理有限公司关于旗下三十一只基金修订基金合同及托管协议等法律文件的公告
- 6、2018-03-27 中海策略精选灵活配置混合型证券投资基金修订后的基金合同
- 7、2018-03-27 中海策略精选灵活配置混合型证券投资基金修订后的托管协议
- 8、2018-03-29 中海策略精选灵活配置混合型证券投资基金2017年年度报告
- 9、2018-03-29 中海策略精选灵活配置混合型证券投资基金2017年年度报告摘要
- 10、2018-03-31 中海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基金申购及定期定额投资费率优惠活动的公告
- 11、2018-03-31 中海基金管理有限公司关于旗下部分基金参加东海证券股份有限公司基金申购费率优惠活动的公告



- 12、2018-03-31 中海基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行股份有限公司手机银行基金申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告
- 13、2018-04-23 中海策略精选灵活配置混合型证券投资基金2018年第一季度报告
- 14、2018-05-18 中海基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国银河证券股份有限公司基金申购及定期定额投资费率优惠活动的公告
- 15、2018-05-18 中海基金管理有限公司关于旗下部分基金参加华鑫证券有限责任公司基金申购及定期定额投资费率优惠活动的公告
- 16、2018-06-12 中海基金管理有限公司关于旗下部分基金新增万联证券股份有限公司为销售机构并开通基金定期定额投资业务及相关费率优惠活动的公告
- 17、2018-06-30 中海基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行股份有限公司费率优惠活动的公告
- 18、2018-07-04 关于非自然人客户受益所有人身份识别的公告
- 19、2018-07-26 中海基金管理有限公司关于旗下基金新增上海挖财基金销售有限公司为销售机构并开通基金转换及定期定额投资业务的公告
- 20、2018-07-26 中海基金管理有限公司关于旗下部分基金在奕丰金融服务（深圳）有限公司参与转换费率优惠活动的公告
- 21、2018-07-27 中海基金管理有限公司关于旗下部分基金参与国联证券股份有限公司基金申购及定期定额投资费率优惠活动的公告
- 22、2018-08-04 中海基金管理有限公司关于旗下部分基金参与第一创业证券股份有限公司基金申购及定期定额投

## 资费率优惠活动的公告

- 23、2018-08-11 中海基金管理有限公司关于旗下部分基金参加东北证券股份有限公司基金申购及定期定额投资费率优惠活动的公告
- 24、2018-08-14 中海基金管理有限公司关于旗下基金新增上海大智慧基金销售有限公司为销售机构并开通基金转换及定期定额投资业务的公告
- 25、2018-08-28 中海基金管理有限公司关于旗下部分基金参加东海证券股份有限公司基金定期定额申购费率优惠活动的公告
- 26、2018-08-28 中海基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国国际金融股份有限公司基金定期定额申购费率优惠活动的公告
- 27、2018-08-28 中海策略精选灵活配置混合型证券投资基金2018年半年度报告
- 28、2018-08-28 中海策略精选灵活配置混合型证券投资基金2018年半年度报告摘要

## 二十三、招募说明书存放及查阅方式

本基金招募说明书存放于基金管理人和基金托管人的办公场所、登记机构、基金销售机构处，投资者可在营业时间免费查阅。基金投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得招募说明书的复印件。对投资者按上述方式所获得的文件及其复印件，基金管理人和基金托管人保证与所公告文本的内容完全一致。

投资者还可以直接登录基金管理人的网站([www.zhfund.com](http://www.zhfund.com))查阅和下载招募说明书。

## 二十四、备查文件

### （一）备查文件目录

- 1、中国证监会核准中海安鑫保本混合型证券投资基金募集的文件。
- 2、《中海策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。
- 3、《中海策略精选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》。
- 4、法律意见书。
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照。
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照。
- 7、中国证监会要求的其他文件。

### （二）存放地点

备查文件存放于基金管理人和基金托管人的住所。

### （三）查阅方式

投资者可到基金管理人和基金托管人的办公场所、营业场所及网站免费查阅备查文件。

中海基金管理有限公司

二〇一八年十月三十日