

**东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金  
更新招募说明书**

—东吴基金管理有限公司 2018 年 2 号

**基金管理人：东吴基金管理有限公司**

**基金托管人：中国农业银行股份有限公司**

## 目 录

重要提示 .....	1
一、绪言 .....	2
二、释义 .....	3
三、基金管理人 .....	7
四、基金托管人 .....	<a href="#">151517</a>
五、相关服务机构 .....	<a href="#">181821</a>
六、基金的募集 .....	<a href="#">404073</a>
七、基金合同的生效 .....	<a href="#">414174</a>
八、基金份额的申购与赎回 .....	<a href="#">424275</a>
九、基金的非交易过户、转托管、定期定额投资计划及冻结等业务 .....	<a href="#">545488</a>
十、基金的投资 .....	<a href="#">555589</a>
十一、基金的业绩 .....	<a href="#">6565100</a>
十二、基金财产 .....	<a href="#">6767103</a>
十三、基金资产的估值 .....	<a href="#">6868104</a>
十四、基金的收益分配 .....	<a href="#">7272108</a>
十五、基金费用与税收 .....	<a href="#">7474110</a>
十六、基金的会计与审计 .....	<a href="#">7676112</a>
十七、基金的信息披露 .....	<a href="#">7777113</a>
十八、基金的风险揭示 .....	<a href="#">8181117</a>
十九、基金合同的变更、终止与基金财产的清算 .....	<a href="#">8484120</a>
二十、基金合同的内容摘要 .....	<a href="#">8787123</a>
二十一、基金托管协议的内容摘要 .....	<a href="#">104104140</a>
二十二、对基金份额持有人的服务 .....	<a href="#">114114150</a>
二十三、其他应披露事项 .....	<a href="#">116116152</a>
二十四、招募说明书存放及查阅方式 .....	<a href="#">118118154</a>
二十五、备查文件 .....	<a href="#">119119155</a>

## 重要提示

本基金根据 2009 年 2 月 20 日中国证券监督管理委员会《关于核准东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金募集的批复》（证监许可【2009】140 号）的核准，进行募集。

基金管理人保证《东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金招募说明书》（以下简称“《招募说明书》”或“本《招募说明书》”）的内容真实、准确、完整。本《招募说明书》经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金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新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资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特定风险，基金运作风险，包括由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，等等。此外，本基金以 1 元初始面值进行募集，在市场波动等因素的影响下，存在单位份额净值跌破 1 元初始面值的风险。

投资有风险，投资者在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》。

基金不同于银行储蓄与债券，基金投资者有可能获得较高的收益，也有可能损失本金。投资者投资于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和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。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。

本招募说明书(更新)所载内容截止日为 2018 年 11 月 6 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2018 年 9 月 30 日(财务数据未经审计)。

## 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“《流动性风险规定》”）其他有关规定及《东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金基金合同》（以下简称“本基金合同”或“基金合同”）编写。

本《招募说明书》阐述了东吴进取策略灵活配置混合型开放式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必要事项，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本《招募说明书》。

本基金管理人承诺本《招募说明书》不存在任何虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。

本基金根据本《招募说明书》所载明资料募集。本《招募说明书》由本基金管理人解释。本基金管理人没有委托或授权任何其他人对未在本《招募说明书》中载明的信息，或对本《招募说明书》作出任何解释或者说明。

本招募说明书根据基金合同编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。投资者取得依基金合同所发售的基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务；基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

## 二、释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称代表如下含义：

基金或本基金：	指东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金；
基金合同或本基金合同：	指《东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充；
招募说明书或本招募说明书：	指《东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金招募说明书》及其定期的更新；
托管协议：	指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《东吴进取策略灵活配置混合型开放式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；
《证券法》：	指《中华人民共和国证券法》；
《基金法》：	指《中华人民共和国证券投资基金法》；
《信息披露办法》	指《证券投资基金信息披露管理办法》；
《运作办法》	指《公开募集证券投资基金运作管理办法》；
《销售办法》	指《证券投资基金销售管理办法》；
《流动性风险规定》：	《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》
中国证监会或证监会：	指中国证券监督管理委员会；
基金合同当事人：	指受《基金合同》约束，根据《基金合同》享受权利并承担义务的法律主体；
基金管理人：	指东吴基金管理有限公司；
基金托管人：	指中国农业银行股份有限公司；
基金份额持有人：	指依照基金合同、招募说明书或更新后招募说明书摘要取得和持有本基金份额的基金投资者；
注册登记业务：	指基金登记、存管、清算和交收业务，具体内容包括投资者基金账户管理、基金份额注册登记、清算及基金交易确认、发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等；
注册登记机构：	指办理基金注册登记业务的机构；
基金账户：	指注册登记机构为基金投资者开立的，用以记录各自持有的基金份额余额及其变动情况的账户；

直销机构：	指东吴基金管理有限公司；
代销机构：	指符合中国证监会和中国银监会有关规定，并与基金管理人签订了销售代理协议，代为办理销售服务业务的机构；
销售机构：	指直销机构和代销机构；
个人投资者：	指符合法律法规规定的条件可以投资证券投资基金的自然人；
机构投资者：	指符合法律法规规定可以投资证券投资基金的在中华人民共和国注册登记或经政府有关部门批准设立的机构；
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暂行办法》的可投资于中国境内证券的中国境外的机构投资者；
基金投资者或投资者：	指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者；
元：	指人民币元；
募集期：	指自基金份额发售之日起到基金认购截止日的时间段，最长不超过3个月；
存续期：	指基金合同生效后合法存续的不定期之期间；
基金合同生效日：	指基金达到法律规定及基金合同规定的条件下，基金管理人聘请法定机构验资并办理完毕基金合同备案手续并获得证监会书面确认后，基金合同生效的日期；
工作日：	指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日；
开放日：	指销售机构为投资者办理申购、赎回等业务的工作日；
T日：	指销售机构受理投资者有效申请的工作日；
T+N日：	指自T日起第N个工作日（不包含T日）；
认购：	指在基金募集期内，投资者申请购买基金份额的行为；
申购：	指在本基金存续期间，投资者申请购买本基金份额的行为；
赎回：	指基金份额持有人按基金合同规定的条件，要求基金管理人购回基金份额的行为；
巨额赎回：	单个开放日针对基金的净赎回申请超过上一日该基金总份额的10%时，为该基金的巨额赎回。单个开放日的净赎回申请，是指该基金份额的赎回申请加上基金转换中该基金

	的转出申请，再扣除当日发生的该基金份额申购申请及基金转换中该基金的转入申请之和后得到的余额；
基金转换：	指在基金存续期间，基金份额持有人向基金管理人提出申请，将其持有的基金份额转换为该基金管理人管理的另一只基金的基金份额；
基金份额：	指向不特定的投资者发行的，表示持有人对基金享有资产所有权、收益分配权和其他相关权利，并承担相应义务的凭证；
基金份额发售公告：	指《东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金基金份额发售公告》
基金收益：	基金投资所得股票红利、债券利息、票据投资收益、买卖证券差价、银行存款利息以及其它收入；
基金资产总值：	指基金所购买的各类证券及票据价值、银行存款本息和本基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和；
基金资产净值：	基金资产总值减去其总负债后的价值；
基金资产估值：	指计算、评估基金资产与负债的价值，用以确定基金资产净值和收益的过程；
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；
指定媒体：	指中国证监会指定的向社会公众进行信息披露的报刊、互联网网站及其他媒体；
不可抗力：	指基金合同当事人无法预见、无法抗拒、无法避免且在基金合同由基金管理人、基金托管人签署之日后发生的，使基金合同当事人无法全部履行或无法部分履行基金合同的任何事件，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战

	争、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律法规变化、突发停电或其他突发事件、证券交易所非正常暂停或停止交易。
--	---



### 三、基金管理人

#### （一）基金管理人概况

名称：东吴基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区源深路 279 号(200135)

办公地址：上海市浦东新区源深路 279 号(200135)

法定代表人：王炯

成立日期：2004 年 9 月 2 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证券监督管理委员会证监基金字【2004】132 号

组织形式：有限责任公司（国内合资）

注册资本：1 亿元人民币

联系人：贾云鹏

电话：(021) 50509888

传真：(021) 50509884

客户服务电话：400-821-0588（免长途话费）、021-50509666

公司网址：www.scfund.com.cn

#### 1、股权结构：

持股单位	占总股本比例
东吴证券股份有限公司	70%
海澜集团有限公司	30%
合 计	100%

#### 2、简要情况介绍：

公司实行董事会领导下的总经理负责制，公司总经理下设权益投资决策、固收投资决策、专户投资决策、风险管理、基金资产估值五个专门委员会；公司设有权益投资总部、固定收益总部、专户投资总部、研究策划部、集中交易室、营销管理总部、产品策略部、信息技术部、基金事务部、综合管理部、合规风控部十一个部门。

#### （二）主要人员情况

##### 1、董事会成员

马震亚先生，董事长，硕士，高级经济师，会计师，中共党员。历任苏州市审计局科员、副主任科员；苏州证券有限责任公司财务部副总经理（主持工作）；东吴证券有限责任公司财务部总经理，财务总监，东吴证券股份有限公司党委委员、纪委书记、董事、副总裁、财务负责人，

现任东吴基金管理有限公司董事长。

汤勇先生，董事，工商管理 EMBA，注册会计师，中共党员。任江苏悦达时装有限公司财务会计、新能（张家港）能源有限公司计财处主任，现任海澜集团有限公司海澜资本投资部投资总监。

王炯先生，董事，硕士研究生、经济师，中共党员。历任苏州市统计局综合平衡处科员，东吴证券总裁办公室主任、机构客户部总经理、总裁助理、东吴证券上海分公司总经理，东吴基金管理有限公司常务副总经理。现任东吴基金管理有限公司总经理。

冯恂女士，董事，博士研究生，经济师，中共党员。历任东吴证券研究所研究员，国联证券研究所所长、总裁助理兼经管总部总经理、副总裁，东吴证券总规划师兼研究所所长、兼资产管理部总经理、总规划师，现任东吴证券股份有限公司副总裁。

陈建国先生，董事，硕士研究生，经济师，中共党员。历任昆山市信托投资公司第二证券部副经理，东吴证券昆山前进中路证券营业部副总经理、福州湖东路证券营业部总经理、昆山分公司副总经理、东吴证券经纪管理总部副总经理（主持工作），现任东吴证券人力资源部总经理。

周虹女士，董事，本科学历，现任海澜集团有限公司海澜资本投资部投资经理。

张婉苏女士，独立董事，经济法学博士。历任担任斯洛文尼亚道迈尔机电有限责任公司苏州代表处法律顾问、南京大学法学院助教、讲师，现任南京大学法学院副教授。

袁勇志先生，独立董事，教授，博士生导师。历任苏州大学管理学院教师、苏州大学人文社科处处长、苏州大学党委研究生工作部部长，现任苏州大学出版社副总编。

方志刚先生，独立董事，大学学历，民建会员。企业类会计师、中国注册会计师、澳洲注册会计师。历任上海上审会计师事务所审计员、部门经理，上海长信会计师事务所部门经理，上海锦江国旅股份有限公司财务部经理、上海实业联合集团长城药业有限公司财务总监；上海众华沪银会计师事务所高级经理，现任瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）上海分所工作，权益合伙人，兼任长方集团股份有限公司独立董事。

## 2、监事会成员

张剑宏先生，监事会主席，硕士。历任苏州物资集团公司公司政策研究室科长、财务公司证券部总经理助理、办公室副主任、主任；东吴证券三香路营业部（原苏物贸证券营业部）总经理、总裁助理兼投资银行总部总经理、风险管理部、合规法务部总经理、合规总监兼首席风险官，现任东吴证券股份有限公司首席风险官。

王菁女士，监事，本科学士学位，会计师，中共党员。历任东吴证券经纪分公司财务经理、东吴证券财务部总经理助理、副总经理，现任东吴证券股份有限公司财务部总经理。

沈清韵女士，员工监事，硕士研究生，中共党员。历任普华永道中天会计师事务所高级审计员，东吴基金管理有限公司监察稽核部副总经理，监察稽核部总经理，现任合规风控副总监兼合规风控部总经理，董事会秘书。

### 3、高管人员

马震亚先生，董事长，硕士，高级经济师，会计师，中共党员。历任苏州市审计局科员、副主任科员；苏州证券有限责任公司财务部副总经理（主持工作）；东吴证券有限责任公司财务部总经理，财务总监，东吴证券股份有限公司党委委员、纪委书记、董事、副总裁、财务负责人，现任东吴基金管理有限公司董事长。

王炯先生，董事，硕士研究生、经济师，中共党员。历任苏州市统计局综合平衡处科员，东吴证券总裁办公室主任、机构客户部总经理、总裁助理、东吴证券上海分公司总经理，东吴基金管理有限公司常务副总经理，现任东吴基金管理有限公司总经理。

徐明先生，副总经理，硕士，中共党员。历任中国银行苏州分行营业部会计；苏州华纺经济贸易有限公司财务科会计；中创证券有限责任公司苏州十全街营业部副总经理；东吴证券有限责任公司胥江路证券营业部副总经理，总经理；东吴证券股份有限公司石路证券营业部总经理，太仓分公司总经理，常熟分公司总经理；东吴基金管理有限公司营销总监兼营销管理部总经理，现任东吴基金管理有限公司副总经理兼营销管理部总经理。

吕晖先生，督察长，大专，历任苏州商业大厦业务员，苏州证券公司交易员，苏州证券登记公司总经理助理，东吴证券资产管理总部副总经理，东吴证券吴江盛泽西环路营业部、吴江中山北路营业部总经理，东吴基金管理有限公司总经理助理、运营总监、东吴基金管理有限公司副总经理，现任东吴基金管理有限公司督察长。

### 4、基金经理

赵梅玲女士，硕士，2007年7月至2012年6月就职于安信证券股份有限公司，任行业分析师，2012年7月加入东吴基金管理有限公司，一直从事投资研究工作，曾任研究员、基金经理助理，自2018年3月12日起担任东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金基金经理，其中，2016年5月10日至2018年4月19日担任东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金（2017年12月25日由原东吴配置优化混合型证券投资基金转型）基金经理。

历任基金经理：

王炯女士，2009年5月6日至2011年5月14日。

朱昆鹏先生，2009年12月23日至2012年4月6日。

唐祝益先生，2012年4月6日至2014年1月24日。

凌鹏先生，2014年1月9日至2015年2月10日。

王立立，2015年2月6日至2018年10月13日。

#### 5、投资决策委员会成员

（1）权益投资决策委员会：王炯、彭敢、程涛、杨庆定、杜毅、付琦、刘元海、戴斌、王立立。王炯任权益投资决策委员会主席，彭敢、程涛为权益投资决策委员会副主席。

（2）固收投资决策委员会：王炯、杨庆定、付琦、周明。王炯任固收投资决策委员会主席，杨庆定、周明为固收投资决策委员会副主席。

上述人员之间不存在近亲属关系。

### （三）基金管理人的职责

基金管理人应严格依法履行下列职责：

- 1、依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
- 2、办理基金备案手续；
- 3、自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责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、计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；
- 9、采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；
- 10、按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
- 11、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- 12、编制中期和年度基金报告；
- 13、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；
- 14、保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、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，不得向他人泄露；

- 15、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；
- 16、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；
- 17、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；
- 18、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；
- 19、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；
- 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，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- 21、基金托管人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托管人追偿；
- 22、按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；
- 23、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；
- 24、执行生效的基金份额持有人大会决议；
- 25、不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；
- 26、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，不谋求对上市公司的控股和直接管理；
- 27、法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

#### **（四）基金管理人承诺**

- 1、基金管理人将根据基金合同的规定，按照招募说明书列明的投资目标、理念、策略及限制等全权处理本基金的投资。
- 2、基金管理人严格遵守《证券法》、《基金法》、《信息披露办法》、《运作办法》、《销售办法》，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止以下《基金法》及有关法规禁止的行为发生：
  - （1）将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
  - （2）不公平地对待其管理的不同基金财产；
  - （3）利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；
  - （4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
  - （5）承销证券；
  - （6）向他人贷款或者提供担保；
  - （7）从事承担无限责任的投资；
  - （8）买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；

(9) 向本基金管理人、基金托管人出资或者买卖本基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；

(10) 买卖与本基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与本基金管理人、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；

(11) 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；

(12) 依照法律、行政法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

法律法规或监管部门对上述限制另有规定时从其规定。

3、基金管理人将加强人员管理，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，不从事以下行为：

(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合同当事人的合法权益；

(4) 在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；

(5) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；

(6) 玩忽职守、滥用职权；

(7) 泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；

(8) 违反证券交易场所业务规则，利用对敲、对倒、对仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；

(9) 在公开信息披露中故意含有虚假、误导、欺诈成分；

(10) 其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

#### 4、基金经理承诺

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

(2) 不利用职务之便为自己、被代理人、被代表人、受雇人或任何其他第三人谋取不当利益；

(3) 不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。

#### (五) 基金管理人的内部控制制度

##### 1、风险管理的理念

- (1) 风险管理是业务发展的保障；
- (2) 最高管理层负最终责任；
- (3) 分工明确、相互牵制的组织结构是前提；
- (4) 制度建设是基础；
- (5) 制度执行监督是保障；

## 2、风险管理的原则

(1) 健全性原则：风险控制必须覆盖公司的各项业务、各个部门和各级人员，并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个经营环节；

(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：公司设风险管理委员会、督察长和合规风控部，各风险控制机构和人员具有并保持高度的独立性和权威性，负责对公司各部门风险控制工作进行监察和稽核；

(4) 相互制约原则：公司内部部门和岗位的设置必须权责分明、相互制约，同时强化合规风控部对各部门的监察稽核职能；

(5) 防火墙原则：公司基金投资业务和公司自有资金投资业务应在空间上和制度上适当隔离，投资决策和交易清算应严格分离。对因业务需要知悉内幕信息的人员，应对其相应行为制定严格的审批程序和过失处罚措施。

(6) 适时性原则：公司内部控制制度的制定应具有前瞻性，并且随着公司经营战略、经营方针、经营管理等内部环境的变化和国家法律、法规、政策制度等外部环境的改变而及时进行相应的修改和完善。

(7) 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。

## 3、风险管理和内部风险控制体系结构

公司的风险管理体系结构是一个分工明确、相互牵制的组织结构，由最高管理层对风险管理负最终责任，各个业务部门负责本部门的风险评估和监控，合规风控部负责监察公司的风险管理措施的执行。具体而言，包括如下组成部分：

- (1) 董事会：负责制定公司的风险管理政策，对风险管理负完全的和最终的责任。
- (2) 风险管理委员会：作为总经理领导下的专门委员会之一，风险管理委员会负责协助经营管理层建立健全内部控制制度，保证公司内控制度适应业务发展的需要，制定公司的业务风险管理政策，主持重大业务的可行性论证，协助经营管理层处理其他有关内部控制方面的重大事项。

（3）督察长：独立行使督察权利；直接对董事会负责；按季向风险控制委员会提交独立的风险管理报告和风险管理建议。

（4）合规风控部：合规风控部负责公司内控机制与制度的建立、监察、评估和建议。

（5）业务部门：风险管理是每一个业务部门最首要的责任。部门经理对本部门的风险负全部责任，负责履行公司的风险管理程序，负责本部门的风险管理系统的开发、执行和维护，用于识别、监控和降低风险。

#### 4、风险管理和内部风险控制的措施

（1）建立内控结构，完善内控制度：公司建立、健全了内控结构，高管人员关于内控有明确的分工，确保各项业务活动有恰当的组织和授权，确保监察活动是独立的，并得到高管人员的支持，同时置备操作手册，并定期更新。

（2）建立相互分离、相互制衡的内控机制：建立、健全了各项制度，做到基金经理分开，投资决策分开，基金交易集中，形成不同部门、不同岗位之间的制衡机制，从制度上减少和防范风险。

（3）建立、健全岗位责任制：建立、健全了岗位责任制，使每个员工都明确自己的任务、职责，并及时将各自工作领域中的风险隐患上报，以防范和减少风险。

（4）建立风险分类、识别、评估、报告、提示程序：建立了评估风险的委员会，使用适合的程序，确认和评估与公司运作有关的风险；公司建立了自下而上的风险报告程序，对风险隐患进行层层汇报，使各个层次的人员及时掌握风险状况，从而以最快速度作出决策。

（5）建立有效的内部监控系统：建立了足够、有效的内部监控系统，如电脑预警系统、投资监控系统，能对可能出现的各种风险进行全面和实时的监控。

（6）使用数量化的风险管理手段：采取数量化、技术化的风险控制手段，建立数量化的风险管理模型，用以提示指数趋势、行业及个股的风险，以便公司及时采取有效的措施，对风险进行分散、控制和规避，尽可能地减少损失。

（7）提供足够的培训：制定了完整的培训计划，为所有员工提供足够和适当的培训，使员工明确其职责所在，控制风险。

#### 5、基金管理人关于内部合规控制声明书

（1）本公司承诺以上关于内部控制的披露真实、准确；

（2）本公司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）基金托管人情况

#### 1、基本情况

名称：中国农业银行股份有限公司（简称中国农业银行）

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

成立日期：2009 年 1 月 15 日

批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复[2009]13 号

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]23 号

注册资本：32,479,411.7 万元人民币

存续期间：持续经营

联系电话：010-66060069

传真：010-68121816

联系人：贺倩

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分，总行设在北京。经国务院批准，中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于 2009 年 1 月 15 日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡，成为国内网点最多、业务辐射范围最广，服务领域最广，服务对象最多，业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外，中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉，每年位居《财富》世界 500 强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行，中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念，坚持审慎稳健经营、可持续发展，立足县域和城市两大市场，实施差异化竞争策略，着力打造“伴你成长”服务品牌，依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品，致力为广大客户提供优质的金融服务，与广大客户共创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行，经验丰富，服务优质，业绩突出，2004 年被英国《全球托管人》评为中国“最佳托管银行”。2007 年中国农业银行通过了美国 SAS70 内部控制审计，并获得无保留意见的 SAS70 审计报告。自 2010 年起中国农业银行连续通过托管业务国际内控标准（ISAE3402）认证，表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设，品牌声誉进

一步提升，在 2010 年首届“‘金牌理财’ TOP10 颁奖盛典”中成绩突出，获“最佳托管银行”奖。2010 年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的“最佳资产托管奖”。2012 年荣获第十届中国财经风云榜“最佳资产托管银行”称号；2013 年至 2017 年连续荣获上海清算所授予的“托管银行优秀奖”和中央国债登记结算有限责任公司授予的“优秀托管机构奖”称号；2015 年、2016 年荣获中国银行业协会授予的“养老金业务最佳发展奖”称号；2018 年荣获中国基金报授予的公募基金 20 年“最佳基金托管银行”奖。

中国农业银行证券投资基金托管部于 1998 年 5 月经中国证监会和中国人民银行批准成立，2014 年更名为托管业务部/养老金管理中心，内设综合管理部、业务管理部、客户一部、客户二部、客户三部、客户四部、风险合规部、产品研发与信息技术部、营运一部、营运二部、市场营销部、内控监管部、账户管理部，拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

## 2、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工近 240 名，其中具有高级职称的专家 30 余名，服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强，高级管理层均有 20 年以上金融从业经验和高级技术职称，精通国内外证券市场的运作。

## 3、基金托管业务经营情况

截止到 2018 年 9 月 30 日，中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共 419 只。

### **（二）基金托管人的内部控制制度说明**

#### 1、内部控制目标

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

#### 2、内部控制组织结构

风险管理委员会总体负责中国农业银行的风险管理与内部控制工作，对托管业务风险管理和内部控制工作进行监督和评价。托管业务部专门设置了风险管理处，配备了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权。

#### 3、内部控制制度及措施

具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理实行严格的复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保

管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

### （三）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

基金托管人通过参数设置将《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议规定的投资比例和禁止投资品种输入监控系统，每日登录监控系统监督基金管理人的投资运作，并通过基金资金账户、基金管理人的投资指令等监督基金管理人的其他行为。

当基金出现异常交易行为时，基金托管人应当针对不同情况进行以下方式的处理：

- 1、电话提示。对媒体和舆论反映集中的问题，电话提示基金管理人；
- 2、书面警示。对本基金投资比例接近超标、资金头寸不足等问题，以书面方式对基金管理人进行提示；
- 3、书面报告。对投资比例超标、清算资金透支以及其他涉嫌违规交易等行为，书面提示有关基金管理人并报中国证监会。

## 五、相关服务机构

### （一）基金份额发售机构

#### 1、直销机构：

东吴基金管理有限公司直销中心

注册地址：上海市浦东新区源深路 279 号（200135）

办公地址：上海市浦东新区源深路 279 号（200135）

法定代表人：王炯

联系人：贾云鹏

直销电话：（021）50509880

传真：（021）50509884

客户服务电话：400-821-0588（免长途话费）、021-50509666

网站：www.scfund.com.cn

#### 2、代销机构：

##### （1）中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号（100005）

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号（100005）

法定代表人：姜建清

客服电话：95588

公司网址：www.icbc.com.cn

##### （2）中国农业银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：周慕冰

客服电话：95599

公司网址：www.abchina.com

##### （3）中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：王洪章

客服电话：95533

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

（4）交通银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：彭纯

客服电话：95559

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

（5）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

客服电话：95555

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

（6）中信银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

法定代表人：田国立

客服电话：95558

公司网址：<http://bank.ecitic.com>

（7）中国民生银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：洪崎

客服电话：95568

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

（8）中国邮政储蓄银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 3 号

办公地址：北京市西城区金融大街 3 号

法定代表人：李国华

客服电话：95580

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

（9）华夏银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 22 号（100005）

办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号（100005）

法定代表人：李民吉

客户服务电话：95577

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

（10）平安银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南中路 1099 号平安银行大厦

办公地址：深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦

法定代表人：谢永林

客服电话：40066-99999（免长途费）0755-961202

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

（11）宁波银行股份有限公司

注册地址：宁波市江东区中山东路 294 号

办公地址：宁波市鄞州区宁南南路 700 号宁波银行大楼

法定代表人：陆华裕

客服电话：96528，上海地区 962528

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

（12）温州银行股份有限公司

注册地址：温州市车站大道华海广场 1 号楼

办公地址：温州市车站大道 196 号

法定代表人：邢增福

客服电话：0577-96699

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

（13）烟台银行股份有限公司

注册地址：烟台市芝罘区海港路 25 号

办公地址：烟台市芝罘区海港路 25 号

法定代表人：叶文君

客服电话：4008-311-777

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

（14）江苏银行股份有限公司

注册地址：南京市中华路 26 号

办公地址：南京市中华路 26 号

法定代表人：夏平

客服热线：95319

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

（15）苏州银行股份有限公司

注册地址：江苏省苏州工业园区钟园路 728 号

办公地址：江苏省苏州市工业园区钟园路 728 号

法定代表人：王兰凤

客服热线：96067

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

（16）天相投资顾问有限公司

注册地址：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701

办公地址：北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座 505

法定代表人：林义相

公司网址：<http://www.txsec.com>

（17）和讯信息科技有限公司

注册地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号 1002 室

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

客服热线：400-920-0022

公司网址：<http://licaike.hexun.com/>

（18）诺亚正行基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

办公地址：上海市杨浦区秦皇岛路 32 号 c 栋

法定代表人：汪静波

客服热线：400-821-5399

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

（19）深圳众禄基金销售股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区梨园路8号HALO广场4楼

办公地址：深圳市罗湖区梨园路8号HALO广场4楼

法定代表人：薛峰

客服热线：4006-788-887

公司网址：[www.zlfund.cn](http://www.zlfund.cn) 及 [www.jjmmw.com](http://www.jjmmw.com)

（20）上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层

办公地址：上海市徐汇区宛平南路88号东方财富大厦

法定代表人：其实

客服热线：95021/400-1818-188

公司网址：<http://fund.eastmoney.com>

（21）上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号

办公地址：上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903~906室

法定代表人：杨文斌

客服热线：400-700-9665

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

（22）蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

注册地址：杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1栋202室

办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路18号黄龙时代广场B座

法定代表人：陈柏青

客服热线：4000766123

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

（23）上海长量基金销售投资顾问有限公司

代销机构：上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路526号2幢220室

办公地址：上海市浦东新区东方路1267号11层

法定代表人：张跃伟

客服电话：400-820-2899



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

（24）浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市西湖区文二西路1号元茂大厦903室

办公地址：杭州市余杭区五常街道同顺路18号同花顺大楼

法定代表人：凌顺平

客服热线：4008-773-772

公司网址：[www.5ifund.com](http://www.5ifund.com)

（25）上海利得基金销售有限公司

注册地址：上海市宝山区蕴川路5475号1033室

办公地址：上海市浦东新区峨山路91弄61号10号楼14层

法定代表人：李兴春

客服电话：400-921-7755

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

（26）浙江金观诚基金销售有限公司

注册地址：杭州市拱墅区登云路45号（锦昌大厦）1幢10楼1001室

办公地址：杭州市拱墅区登云路45号锦昌大厦一楼金观诚财富

法定代表人：蒋雪琦

客服热线：400-068-0058

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

（27）宜信普泽投资顾问（北京）有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809

办公地址：北京市朝阳区建国路88号SOHO现代城C座1809

法定代表人：戎兵

客服热线：400-6099-200

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

（28）南京苏宁基金销售有限公司

注册地址：南京市玄武区苏宁大道1-5号

办公地址：南京市玄武区苏宁大道1-5号

法定代表人：王锋

客服热线：95177

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

(29) 北京恒天明泽基金销售有限公司

注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室

办公地址：北京市朝阳区东三环北路甲 19 号 SOHO 嘉盛中心 30 层 3001 室

法定代表人：周斌

客服热线：4008980618

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

(30) 北京汇成基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 E 世界财富中心 A 座 11 层 1108 号

办公地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 E 世界财富中心 A 座 11 层

法定代表人：王伟刚

客服热线：400-619-9059

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

(31) 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：北京市朝阳区万通中心 D 座 21&28 层

法定代表人：蒋煜

客服热线：010-58170761

公司网址：<http://www.shengshiview.com.cn/>

(32) 一路财富（北京）信息科技有限公司

注册地址：北京市西城区阜成门大街 2 号万通新世界广场 A 座 2208

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

客服热线：400-001-1566

公司网址：<http://www.yilucaifu.com>

(33) 北京钱景基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012

办公地址：北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012

法定代表人：赵荣春

客服热线：400-678-5095

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

(34) 北京唐鼎耀华基金销售有限公司

注册地址：北京市延庆县延庆经济开发区百泉街10号2栋236室

办公地址：北京市朝阳区建国门外大街19号A座1505室

法定代表人：张冠宇

客服热线：400-819-9868

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

(35) 成都华羿恒信基金销售有限公司

注册地址：成都市高新区蜀锦路88号新中泰国际大厦1号楼32F2号

办公地址：成都市高新区蜀锦路88号新中泰国际大厦1号楼32F2号

法定代表人：赵璧

客服热线：028-87326832

公司网址：<http://www.huayihengxin.com>

(36) 北京加和基金销售有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街11号7层703室

办公地址：北京市西城区金融大街11号7层703室

法定代表人：曲阳

客服热线：400-803-1188

公司网址：<http://www.bzfunds.com/>

(37) 杭州科地瑞富基金销售有限公司

注册地址：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20F

法定代表人：陈刚

客服热线：0571-86915761

公司网址：[www.cd121.com](http://www.cd121.com)

(38) 上海万得基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路33号11楼B座

办公地址：上海市浦东新区福山路33号8楼

法定代表人：王廷富

客服热线：400-821-0203

（39）上海联泰资产管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室

办公地址：上海市长宁区福泉北路 518 号 8 座 3 层

法定代表人：燕斌

客服热线：400-166-6788

公司网址：<http://www.66zichan.com>

（40）上海汇付基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区黄河路 333 号 201 室 A 区 056 单元

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

客服热线：400-821-3999

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

（41）北京微动利基金销售有限公司

注册地址：北京市石景山区古城西路 113 号 3 层 342 室

办公地址：北京市石景山区古城西路 113 号 3 层 342 室

法定代表人：季长军

客服热线：400-188-5687

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

（42）上海基煜基金销售有限公司

注册地址：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：上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 1503 室

法定代表人：王翔

客服热线：400-820-5369

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

（43）上海陆金所基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

法定代表人：王之光

客户服务电话：4008219031

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

## （44）大泰金石基金销售有限公司

注册地址：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：姚杨

客服热线：021-22267943

公司网址：<http://www.dtfortune.com/>

## （45）珠海盈米财富管理有限公司

注册地址：珠海市横琴区宝华路 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 1201-1203 室（邮编：510308）

法定代表人：肖雯

客户服务电话：020-89629066

网址：<http://www.yingmi.cn/>

## （46）奕丰基金销售有限公司

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：TEOWEEHOWE（张伟豪）

客服热线：400-684-0500

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

## （47）中民财富管理（上海）有限公司

注册地址：上海市黄浦区中山南路 100 号 7 层 05 单元

办公地址：上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 27 层

法定代表人：弭洪军

客服热线：400-876-5716

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

## （48）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

客户服务电话：400-990-8826

网址：www.citicsf.com

（49）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

客户服务热线：95521/4008888666

公司网址：<http://www.gtja.com>

（50）中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝内大街 188 号

法定代表人：张佑君

客服电话：400-8888-108

公司网址：[www.csc108.com](http://www.csc108.com)

（51）国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人：何如

客服电话：95536

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

（52）招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

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

客服电话：95565、4008881111

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

（53）广发证券股份有限公司

注册地址：广州天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼（4301-4316 房）

办公地址：广东省广州天河北路大都会广场 5、18、19、36、38、39、41、42、43、44 楼

法定代表人：孙树明

客服电话：95575 或致电各地营业网点

公司网址：www.gf.com.cn

（54）中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座

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：张佑君

客服热线：95548

公司网址：www.cs.ecitic.com

（55）中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街35号2-6层

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：陈共炎

客服电话：4008-888-888 或 95551

公司网址：www.chinastock.com.cn

（56）海通证券股份有限公司

注册地址：上海市广东路689号

办公地址：上海市广东路689号

法定代表人：周杰

客服电话：021-23219000

公司网址：www.htsec.com

（57）申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路989号45层

办公地址：上海市徐汇区长乐路989号45层（邮编：200031）

客服电话：95523 或 4008895523

公司网址：www.swhysc.com

联系人：黄莹

（58）兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路268号

办公地址：上海市浦东新区长柳路36号

法定代表人：杨华辉

客服电话：95562

公司网址：www.xyzq.com

（59）长江证券股份有限公司

注册地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦

办公地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦

法定代表人：尤习贵

客服电话：95579 或 4008-888-999

公司网址：www.95579.com

（60）安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02

办公地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02

法定代表人：王连志

客服电话：95517

公司网址：www.essence.com.cn

（61）西南证券股份有限公司

注册地址：重庆市江北区桥北苑8号

办公地址：重庆市江北区桥北苑8号西南证券大厦

法定代表人：吴坚

客服热线：95355、4008096096

公司网址：www.swsc.com.cn

（62）湘财证券股份有限公司

注册地址：湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼

办公地址：湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼

法定代表人：孙永祥

客服电话：95351

公司网址：www.xcsc.com

（63）万联证券股份有限公司

注册地址：广东省广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F座18、19层

办公地址：广东省广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F座18、19层



法定代表人：张建军

客服热线：4008888133

公司网址：www.wlzq.com.cn

（64）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

办公地址：安徽省合肥市寿春路 179 号

法定代表人：凤良志

客服电话：95578

公司网址：www.gyzq.com.cn

（65）渤海证券股份有限公司

注册地址：天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

办公地址：天津市南开区宾水西道 8 号

法定代表人：王春峰

客服电话：400-6515-988

公司网址：www.ewww.com.cn

（66）华泰证券股份有限公司

注册地址：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

客服电话：95597

公司网址：www.htsc.com.cn

（67）中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001

办公地址：青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座 5 层

法定代表人：姜晓林

客服电话：95548

公司网址：www.zxzqsd.com.cn

（68）东吴证券股份有限公司

注册地址：苏州工业园区星阳街 5 号

办公地址：苏州工业园区星阳街 5 号

法定代表人：范力

客服电话：0512-3339628895530

公司网址：www.dwzq.com.cn

（69）信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

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

客服电话：95321

公司网址：www.cindasc.com

（70）东方证券股份有限公司

注册地址：上海市中山南路318号2号楼22层、23层、25-29层

办公地址：上海市中山南路318号2号楼22层、23层、25-29层

法定代表人：潘鑫军

客服电话：95503

公司网址：www.dfzq.com.cn

（71）长城证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦16-17楼

办公地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦16-17楼

法定代表人：丁益

客服电话：400-6666-888

公司网址：www.cgws.com

（72）光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路1508号

办公地址：上海市静安区新闻路1508号

法定代表人：周健男

客服电话：95525

公司网址：www.ebscn.com

（73）广州证券股份有限公司

注册地址：广州市珠江西路5号广州国际金融中心主塔19、20楼

办公地址：广州市珠江西路5号广州国际金融中心主塔19、20楼

法定代表人：邱三发

客服电话：020-961303

公司网址：www.gzs.com.cn

（74）南京证券股份有限公司

注册地址：南京市江东中路 389 号

办公地址：南京市江东中路 389 号

法定代表人：步国旬

客服电话：95386

公司网址：www.njq.com.cn

（75）上海证券有限责任公司

注册地址：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

传真：021-53686100，021-53686200

网址：www.shzq.com

（76）国联证券股份有限公司

注册地址：无锡市金融一街 8 号

办公地址：无锡市金融一街 8 号国联大厦

法定代表人：姚志勇

客服电话：95570

公司网址：www.glsc.com.cn

（77）平安证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

办公地址：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层（518048）

法定代表人：谢永林

客服热线：95511-8

公司网址：www.PINGAN.com

（78）华安证券股份有限公司

注册地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

办公地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

法定代表人：章宏韬

客服电话：95318

公司网址：www.hazq.com

（79）国海证券股份有限公司

注册地址：广西桂林市辅星路 13 号

办公地址：广西南宁市滨湖路 46 号

法定代表人：何春梅

客服热线：95563

公司网址：www.ghzq.com.cn

（80）财富证券有限责任公司

注册地址：长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 楼

办公地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26-28 楼

法定代表人：蔡一兵

客服电话：95317

公司网址：www.cfzq.com

（81）东海证券股份有限公司

注册地址：江苏省常州延陵西路 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

客服电话：95531；400-8888-588

网址：www.longone.com.cn

（82）中银国际证券有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39F

办公地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39-40F

法定代表人：许刚

客户服务电话：4006208888

公司网址：www.bocichina.com

（83）恒泰证券股份有限公司

注册地址：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街 111 号

办公地址：内蒙古呼和浩特市新城区东风路 111 号

法定代表人：鞠瑾

客服电话：0471-4961259

公司网址：www.cnht.com.cn

（84）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：韩志谦

客户服务电话：400-800-0562

网址：www.hysec.com

（85）中泰证券股份有限公司

注册地址：山东省济南市经七路86号23层

办公地址：山东省济南市经七路86号23层

法定代表人：李玮

客服电话：95538

公司网址：www.qlzq.com.cn

（86）世纪证券有限责任公司

注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦40-42层

办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦40-42层

法定代表人：姜昧军

客服电话：4008323000

公司网址：www.csc.com.cn

（87）金元证券股份有限公司

注册地址：海南省海口市南宝路36号证券大厦4层

办公地址：深圳市福田区深南大道4001号时代金融中心17层

法定代表人：王作义

客服电话：95372

公司网址：www.jyzq.com.cn

（88）中航证券有限公司

注册地址：江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦A座41楼

办公地址：北京市朝阳区望京东园四区 2 号中航资本大厦 35 层

法定代表人：王晓峰

客服电话：95335

公司网址：www.avicsec.com

（89）华福证券有限责任公司

注册地址：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 层至 10 层

法定代表人：黄金琳

客服电话：0591—96326（福建省外请先拨 0591）

公司网址：www.hfzq.com.cn

（90）上海华信证券有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 9 楼

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 9 楼

法定代表人：罗浩

客服热线：68777877

公司网址：www.cf-clsa.com

（91）五矿证券有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4028 号荣超经贸中心 47 层

办公地址：深圳市福田区金田路 4028 号荣超经贸中心 47-49 层

法定代表人：张永衡

客服热线：40018-40028

公司网址：www.wkzq.com.cn

（92）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：上海市徐汇区宛平南路 8 号

法定代表人：俞洋

客户服务电话：95323；4001099918

公司网站：www.cfsc.com.cn

（93）中国中投证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18-21 层及第 04 层 01、

02、03、05、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、23 单元

办公地址：深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 4、18 层至 21 层

法定代表人：龙增来

客服热线：4006008008

公司网址：[www.china-invs.cn](http://www.china-invs.cn)

（94）九州证券股份有限公司

注册地址：青海省西宁市南川工业园区创业路 108 号

办公地址：北京市朝阳区安立路 30 号仰山公园东一门 2 号楼

法定代表人：魏先锋

客服热线：95305

公司网址：<http://www.jzsec.com>

（95）国金证券股份有限公司

注册地址：四川省成都市东城根上街 95 号

办公地址：四川省成都市东城根上街 95 号

法定代表人：冉云

客服热线：95310

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

（96）华宝证券有限责任公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号 57 层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号 57 层

法定代表人：陈林

客服电话：4008209898

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

（97）长城国瑞证券有限公司

注册地址：厦门市思明区莲前西路 2 号莲富大厦 17 楼

办公地址：厦门市思明区深田路 46 号深田国际大厦 20 楼

法定代表人：王勇

客服热线：400-0099-886

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

（98）爱建证券有限责任公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1600 号 1 幢 32 楼

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1600 号 1 幢 32 楼

法定代表人：祝健

客服电话：4001962502

公司网址：www.ajzq.com

（99）金惠家保险代理有限公司

注册地址：北京市西城区阜成门外大街 2 号 19 层 A2107

办公地址：北京市西城区阜成门外大街 2 号 19 层 A2107

法定代表人：夏予柱

客服热线：400-8557333

公司网址：www.jhjfund.com

3、基金管理人可根据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》和基金合同等的规定，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时履行公告义务。

## （二）注册登记机构：东吴基金管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区源深路 279 号（200135）

办公地址：上海市浦东新区源深路 279 号（200135）

法定代表人：王炯

联系人：贾云鹏

电话：021-50509888

传真：021-50509884

客户服务电话：021-50509666

网站：www.scfund.com.cn

## （三）律师事务所和经办律师

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：俞卫锋

电话：（021）31358666

传真：（021）31358600

联系人：陆奇



经办律师：黎明、陆奇

**（四）会计师事务所和经办注册会计师**

名称：安永华明会计师事务所有限责任公司

注册地址：北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼16层

办公地址：上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心50楼

法定代表人：葛明

联系电话：021-22288888

传真：021-22280000

联系人：徐艳

经办注册会计师：徐艳、蒋燕华

## 六、基金的募集

本基金由管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定，并经中国证监会证监许可[2009]140号文核准募集。

### （一）基金类别

混合型

### （二）基金运作方式

契约型开放式

### （三）基金存续期限

不定期

### （四）募集情况

东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会证监许可[2009]140号文批准，于2009年03月30日起向社会公开募集。截止到2009年04月30日，基金募集工作已顺利结束。

经江苏公证天业会计师事务所有限公司验资，本次募集的净认购金额为1,048,456,890.45人民币元，利息共计161,474.84人民币元。上述资金已于2009年05月05日划入本基金在基金托管人中国农业银行股份有限公司开立的基金托管专户。

本次募集有效认购户数为25,557户，按照每份基金份额面值1.00元人民币计算，本息合计募集基金份额总额为1,048,618,365.29份，已全部计入投资者账户，归投资者所有。其中东吴基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）于2009年4月30日认购本基金，持有的基金份额总额为29,999,000.00份（含募集期利息结转的份额），认购费用为1,000.00元。

## 七、基金合同的生效

### （一）基金合同生效时间

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法规和《东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的募集情况已符合基金合同生效的条件。本基金于 2009 年 05 月 06 日得到中国证监会书面确认，基金备案手续办理完毕，基金合同自该日起正式生效。自基金合同生效之日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

### （二）基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

本基金合同生效后，基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5,000 万元的，基金管理人应当及时报告中国证监会；连续 20 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会说明原因并报送解决方案。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。

## 八、基金份额的申购与赎回

### （一）申购和赎回的场所

申购与赎回应当在本基金的销售机构办理。本基金的销售机构包括基金管理人和基金管理人委托或授权的销售代理人。基金管理人可根据实际情况变更或增减基金销售代理人，并予以公告。销售机构名单和联系方式见本基金《发售公告》。

投资人应该在销售机构指定的营业场所按照指定的方式和程序办理申购赎回等业务。若基金管理人或其指定的代销机构开通电话、传真或网上等交易方式，投资人可以通过上述方式进行申购与赎回，具体办法由基金管理人另行公告。

### （二）申购和赎回的办理时间

#### 1、开放日及开放时间

本基金开放日为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日。具体业务办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的交易时间。但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

基金合同生效以后，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体上公告。

基金投资者在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或者转换申请的，其基金份额申购、赎回价格为下次办理基金份额申购、赎回时间所在开放日的价格。

#### 2、申购的开始日及业务办理时间

基金合同生效日后不超过3个月的时间起开始办理申购。具体业务办理时间在申购开始公告中规定。

#### 3、赎回的开始日及业务办理时间

基金合同生效日后不超过3个月的时间起开始办理赎回。具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。

在确定申购开始与赎回开始时间后，由基金管理人于申购或赎回开始前两个工作日内在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体上公告。

### （三）申购与赎回的原则

- 1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日的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、赎回遵循“先进先出”原则，即按照基金投资者认购、申购的先后次序进行顺序赎回；

4、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；

5、基金管理人可根据基金运作的实际情况并不影响投资者实质利益的前提下调整上述原则。基金管理人必须在新规则开始实施 3 个工作日前在至少一种中国证监会指定的媒体上刊登公告。

#### （四）申购和赎回的数额限制

1、投资者每次最低申购金额为 1,000 元（含申购费）。

2、基金份额持有人在销售机构赎回时，每次赎回申请不得低于 1,000 份基金份额。基金份额持有人赎回时或赎回后在销售机构（网点）保留的基金份额余额不足 1,000 份的，在赎回时需一次全部赎回。

3、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，具体规定请参见相关公告。

4、基金管理人可以根据实际情况对以上限制进行调整，最迟在调整生效前 3 个工作日前在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

#### （五）申购和赎回的程序

##### 1、申购和赎回申请的提出

基金投资者须按销售机构规定的手续，在开放日的业务办理时间提出申购或赎回的申请。如投资者是首次申购本基金，可能需要申请开立东吴基金管理有限公司基金账户或销售机构交易账户。投资者申购本基金时，须按销售机构规定的方式全额交付申购款项。投资者提交赎回申请时，其在销售机构（网点）必须有足够的基金份额余额。

##### 2、申购和赎回申请的确认与通知

投资者 T 日申购基金成功后，登记结算机构在 T+1 日为投资者办理增加权益的登记手续，投资者自 T+2 日起有权赎回该部分基金份额。投资者 T 日赎回基金成功后，登记结算机构在 T+1 日为投资者办理扣除权益的登记手续。

T 日规定时间受理的申请，正常情况下投资者可在 T+2 日通过本公司客户服务电话或到其办理业务的销售网点查询确认情况，打印确认单。

基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述登记结算办理时间进行调整并公告。但基金管理人最迟须于受理申购、赎回申请之日起 3 个工作日内，对申请的有效性进行确认。

##### 3、申购和赎回申请的款项支付

申购采用全额缴款方式，若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功。若申购不成功

或无效，基金管理人或基金管理人指定的代销机构将基金投资者已缴付的申购款项本金退还给投资者。

基金投资者赎回申请成功后，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，赎回款项的支付办法参照本基金《基金合同》和有关法律法规规定处理。

### （六）申购费与赎回费

1、本基金申购费由申购人承担，用于市场推广、销售、登记结算等各项费用。

2、具体申购费率如下

申购金额（含申购费）	申购费率
100万元以下	1.50%
100万元以上（含）-200万元以下	1.20%
200万元以上（含）-500万元以下	0.80%
500万元以上（含）	1000元/笔

3、赎回费随基金持有时间的增加而递减，费率如下：

持有时间	赎回费率
7天以内（不含7天）	1.50%
7天到1年（含1年）	0.50%
1年-2年（含2年）	0.25%
2年以上	0

4、本基金赎回费由赎回人承担，在投资者赎回基金份额时收取。其中，须依法扣除所收取赎回费总额的 25%归入基金资产，其余用于支付登记结算费、销售手续费等各项费用。对持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5%的赎回费并全额计入基金财产，具体费率详见招募说明书。

5、基金管理人可以调整申购费率、赎回费率或收费方式，并最迟将于新的费率或收费方式开始实施前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

### （七）申购份数与赎回金额的计算方式

1、申购份数的计算

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

申购份数=净申购金额/ T 日基金份额净值

基金份额以四舍五入的方法保留小数点后两位，由此误差产生的损失或收益归入基金资产。

例二：假定 T 日的基金份额净值为 1.300 元，四笔申购金额分别为 1,000 元、150 万元、300 万元和 1000 万元，则各笔申购负担的前端申购费用和获得的基金份额计算如下：

	申购1	申购2	申购3	申购4
申购金额(元, A)	1,000.00	1,500,000.00	3,000,000.00	10,000,000.00
适用申购费率(B)	1.5%	1.2%	0.8%	固定费用1000元-
净申购金额(C=A/(1+B))	985.22	1,482,213.44	2,976,190.48	9,999,000.00
申购费(D=A-C)	14.78	17,789.56	23,809.52	1,000.00
申购份额(=C/1.300)	757.86	1,140,164.18	2,289,377.29	7,692,230.77

## 2、赎回金额的计算

如果投资者在认购/申购时选择交纳认购/申购费，在先进先出的原则下，赎回金额的计算方法如下：

赎回总额=赎回份数×T 日基金份额净值

赎回费用=赎回总额×赎回费率

赎回金额=赎回总额-赎回费用

例三：1) 假定某投资者在持有本基金不超过一年时间内的 T 日赎回 10,000.00 份，其赎回费率为 0.5%，现假定该日基金份额净值为 1.450 元，则其获得的净赎回金额计算如下：

赎回金额=10,000.00×1.450=14,500.00 元

赎回费用=14,500.00×0.5%=72.50 元

净赎回金额=14,500.00-72.50=14,427.50 元

2) 假定某投资者在持有本基金的超过一年、但不超过两年时间内的 T 日赎回 10,000.00 份，其赎回费率为 0.25%，现假定该日基金份额净值为 1.350 元，则其获得的净赎回金额计算如下：

赎回金额=10,000.00×1.350=13,500.00 元

赎回费用=13,500.00×0.25%=33.75 元

净赎回金额=13,500.00-33.75=13,466.25 元

3) 假定某投资者在持有本基金的超过一年、但不超过两年时间内的 T 日赎回 10,000.00 份，其赎回费率为 0%，现假定该日基金份额净值为 1.300 元，则其获得的净赎回金额计算如下：

赎回金额=10,000.00×1.300=13,000.00 元

赎回费用=13,000.00×0=0 元

净赎回金额=13,000.00-0=13,000.00 元

3、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，并报中国证监会备案。

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，计算结果保留到小数点后二位，第三位四舍五入，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

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以当日基金份额净值为基准并扣除相应的费用，计算结果保留到小数点后二位，第三位四舍五入，由此产生的误差在基金资产中列支。本基金份额净值的计算，保留到小数点后四位，小数点后第五位四舍五入。

6、本基金的申购费用应在投资者申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，赎回费总额的25%归基金财产，75%用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

7、本基金的申购费率最高不超过申购金额的2%，赎回费率最高不超过基金份额赎回金额的1%。基金管理人可以在履行相关手续后，在基金合同约定的范围内调整申购、赎回费率或调整收费方式，基金管理人依照有关规定在最迟应于新的费率或收费方式实施日前在指定媒体和基金管理人网站上公告。

8、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况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）进行基金交易的基金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，基金管理人可以在按中国证监会要求履行必要手续后，对基金投资者适当调整基金申购费率、赎回费率和转换费率。

#### （八）拒绝或暂停申购的情形

在发生下列情形时，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资者的申购申请：

- 1、因不可抗力导致基金无法正常运作；
- 2、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；
- 3、发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况；
- 4、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或基金管理人认为会损害已有基金份额持有人利益的申购；
- 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，基金管理人应当暂停接受基金申购申请；

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数的比例达



到或者超过基金份额总数的 50%，或者有可能导致投资者变相规避前述 50%比例要求的情形；

7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述暂停申购情形时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒体和基金管理人网站上刊登暂停申购公告。如果基金投资者的申购申请全部或部分被拒绝的，被拒绝的申购款项将退还给投资者。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

#### （九）暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受基金投资者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、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；
- 3、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回；
- 4、发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况；

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。

发生上述情形时，基金管理人应在当日向中国证监会报告，已接受的赎回申请，基金管理人应按时足额支付；如暂时不能足额支付，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，若连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回，延期支付最长不得超过 20 个工作日，并依照《信息披露办法》在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。投资者在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

#### （十）巨额赎回的情形及处理方式

##### 1、巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过前一日的基金总份额的 10%，即认为是发生了巨额赎回。

##### 2、巨额赎回的处理方式

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接受全额赎回或部分延期赎回。

（1）接受全额赎回：当基金管理人认为有能力兑付投资者的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

（2）部分延期赎回：当基金管理人认为兑付投资者的赎回申请有困难，或认为支付投资者的赎回申请进行的资产变现可能使基金份额净值发生较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一日基金总份额 10%的前提下，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；基金投资者未能赎回部分，投资者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，当日未获赎回的部分申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以该开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额。如基金投资者在提交赎回申请时未作明确选择，投资者未能赎回部分作自动延期赎回处理。

（3）如发生单个开放日内单个基金份额持有人申请赎回的基金份额占前一开放日基金总份额的比例超过 20%时，本基金管理人可以对该单个基金份额持有人超过前述约定比例的赎回申请实施延期赎回。

对该单个基金份额持有人不超过前述比例的赎回申请，与当日其他赎回申请一起，按上述“（1）全额赎回”或“（2）部分延期赎回”方式处理。如下一开放日，该单一基金份额持有人剩余未赎回部分仍旧超出前述比例约定的，继续按前述规则处理，直至该单一基金份额持有人单个开放日内申请赎回的基金份额占前一开放日基金总份额的比例低于前述比例。

在不违反法律法规的前提下，基金管理人在履行适当程序后，有权根据当时市场环境调整前述比例及处理规则，并在指定媒介上进行公告。

当发生巨额赎回并部分延期赎回时，基金管理人应在 2 日内通过中国证监会指定媒体、基金管理人的公司网站或代销机构的网点刊登公告，并在公开披露日向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，并通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个工作日内通知基金份额持有人，并说明有关处理方法。

本基金连续 2 个或 2 个开放日以上发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过正常支付时间 20 个工作日，并应当在指定媒体和基金管理人网站上进行公告。

#### （十一）申购和赎回暂停期间与重新开放的公告

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，并依照有关规定在指定媒体和基金管理人网站上刊登暂停公告。

2、如发生暂停的时间为 1 日，第 2 个工作日基金管理人应依照有关规定在指定媒体和基金管理人网站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 日但少于 2 周，暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 2 个工作日在指定媒体和基金管理人网站上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近 1 个开放日的基金份额净值。

4、如发生暂停的时间超过 2 周，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 2 个工作日在指定媒体和基金管理人网站上连续刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近 1 个开放日的基金份额净值。

## （十二）基金转换

### 1、基金转换业务的适用范围

本基金已与本基金管理人旗下基金：东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金(基金代码：580001)、东吴价值成长双动力混合型证券投资基金(基金代码：580002)、东吴行业轮动混合型证券投资基金(基金代码：580003)、东吴新经济混合型证券投资基金(基金代码：580006)、东吴安享量化灵活配置混合型证券投资基金(基金代码：580007)、东吴新产业精选混合型证券投资基金(基金代码：580008)、东吴中证新兴产业指数证券投资基金(基金代码：585001)、东吴优信稳健债券型证券投资基金 A(基金代码：582001)、东吴优信稳健债券型证券投资基金 C(基金代码：582201)、东吴增利债券型证券投资基金 A(基金代码：582002)、东吴增利债券型证券投资基金 C(基金代码：582202)、东吴货币市场证券投资基金 A(基金代码：583001)、东吴货币市场证券投资基金 B(基金代码：583101)、东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金(基金代码：582003)、东吴多策略灵活配置混合型证券投资基金(基金代码：580009)、东吴阿尔法灵活配置混合型证券投资基金(基金代码：000531)、东吴移动互联灵活配置混合型证券投资基金 A(基金代码：001323)、东吴新趋势价值线灵活配置混合型证券投资基金(基金代码：001322)、东吴国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金(基金代码：002159)、东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金(基金代码：002270)、东吴鼎元双债债券型证券投资基金 A(基金代码：000958)、东吴鼎元双债债券型证券投资基金 C(基金代码：000959)、东吴安鑫量化灵活配置混合型证券投资基金(基金代码：002561)、东吴智慧医疗量化策略灵活配置混合型证券投资基金(基金代码：002919)、东吴增鑫宝货币市场基金 A(基金代码：003588)、东吴增鑫宝货币市场基金 B(基金代码：003589)、东吴优益债券型证券投资基金 A(基金代码：005144)、东吴优益债券型证券投资基金 C(基金代码：005145)、东吴双三角股票型证券投资基金 A(基金代码：005209)、东吴双三角股票型证券投资基金 C(基金代码：005210)、东吴悦秀纯债债券型证券投资基金 A(基金代码：005573)、东吴悦秀

纯债债券型证券投资基金C（基金代码：005574）的基金转换业务。

基金管理人今后发行的开放式基金将根据具体情况确定是否适用于基金转换业务，并将另行公告。

## 2、使用销售机构

投资者可通过基金管理人的直销渠道和以下代销机构办理以上基金的基金转换业务：

中国工商银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、中国邮政储蓄银行股份有限公司、华夏银行股份有限公司、平安银行股份有限公司、宁波银行股份有限公司、温州银行股份有限公司、烟台银行股份有限公司、江苏银行股份有限公司、苏州银行股份有限公司、天相投资顾问有限公司、和讯信息科技有限公司、诺亚正行基金销售有限公司、深圳众禄基金销售股份有限公司、上海天天基金销售有限公司、上海好买基金销售有限公司、蚂蚁（杭州）基金销售有限公司、上海长量基金销售投资顾问有限公司、浙江同花顺基金销售有限公司、上海利得基金销售有限公司、浙江金观诚基金销售有限公司、宜信普泽投资顾问（北京）有限公司、南京苏宁基金销售有限公司、北京恒天明泽基金销售有限公司、北京汇成基金销售有限公司、北京晟视天下投资管理有限公司、一路财富（北京）信息科技有限公司、北京钱景基金销售有限公司、北京唐鼎耀华基金销售有限公司、成都华羿恒信基金销售有限公司、北京加和基金销售有限公司、杭州科地瑞富基金销售有限公司、上海万得基金销售有限公司、上海联泰资产管理有限公司、上海汇付基金销售有限公司、北京微动利基金销售有限公司、上海基煜基金销售有限公司、大泰金石基金销售有限公司、珠海盈米财富管理有限公司、奕丰基金销售有限公司、中民财富管理（上海）有限公司、中信期货有限公司、国泰君安证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、兴业证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、西南证券股份有限公司、湘财证券股份有限公司、万联证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、东吴证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、长城证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、广州证券股份有限公司、南京证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、国联证券股份有限公司、平安证券股份有限公司、华安证券股份有限公司、国海证券股份有限公司、财富证券有限责任公司、东海证券股份有限公司、中银国际证券有限责任公司、恒泰证券股份有限公司、申万宏源（西部）证券有限公司、中泰证券股份有限公司、世纪证券有限责任公司、金元证券股份有限公司、中航

证券有限公司、华福证券有限责任公司、上海华信证券有限责任公司、华鑫证券有限责任公司、中国中投证券有限责任公司、九州证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、华宝证券有限责任公司、长城国瑞证券有限公司、爱建证券有限责任公司、金惠家保险代理有限公司。

根据业务需要，本基金管理人还将会选择其他销售机构开办此业务并将按有关规定予以公告。

### 3、业务办理时间

基金办理转换业务的开放日为上海证券交易所和深圳证券交易所交易日（本公司公告暂停转换时除外）。具体业务办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的交易时间。

### 4、基金转换业务规则

（1）基金转换是指开放式基金份额持有人将其持有的某只基金的部分或全部份额转换为同一基金管理人管理的另一只开放式基金的份额；

（2）基金转换只能转换为基金管理人管理的、同一注册登记人登记存管的、同一基金账户下的基金份额，并只能在同一销售机构进行，且该销售机构须同时代理拟转出基金及拟转入基金的销售；

（3）拟转出的基金必须处于可赎回状态，拟转入的基金必须处于可申购状态；

（4）目前只开通前端收费模式下进行基金转换，而不能将前端收费基金份额转换为后端收费基金份额，或将后端收费基金份额转换为前端收费基金份额。如今后开通后端收费模式基金的转换业务，具体转换业务规则以相关公告内容为准；

（5）基金转换遵循“份额转换”的原则，转换申请份额精确到小数点后 2 位，单笔转换申请份额不得低于 100 份。单笔转入申请不受转入基金最低申购限额限制和转出基金最低赎回数额限制。

（6）对于基金分红时，权益登记日申请转换转出的基金份额享有该次分红权益，权益登记日申请转换转入的基金份额不享有该次分红权益；

（7）基金转换采取未知价法，即基金的转换价格以转换申请受理当日各转出、转入基金的份额净值为基准进行计算；

（8）转换业务遵循“先进先出”的业务规则，先确认的认购或者申购的基金份额在转换时先转换；

（9）单个开放日基金净赎回份额及净转换转出申请份额之和超出上一开放日基金总份额的 10%时，为巨额赎回。发生巨额赎回时，基金转出与基金赎回具有相同的优先级，基金管理人可根据基金资产组合情况，决定全额转出或部分转出，并且对于基金转出和基金赎回，将采取相同的比例确认。在转出申请得到部分确认的情况下，未确认的转出申请将不予以顺延；

(10) 转入基金的持有时间将重新计算，与转出基金的持有时间无关；

(11) 投资者在 T 日办理的基金转换申请，基金注册登机构在 T + 1 日内为投资者对该交易的有效性进行确认，在 T + 2 日后（包括该日）投资者可通过基金份额发售机构或以基金份额发售机构规定的其他方式查询成交情况；

(12) 基金转换费用由基金持有人承担；

(13) 基金管理人将根据今后发行的其他开放式基金的具体情况对本业务规则进行补充和调整。

## 5、基金转换费及份额计算方法

(1) 基金转换费用由转出基金的赎回费和转出与转入基金的申购费补差两部分构成，具体收取情况视每次转换时两只基金的申购费率差异情况和赎回费率而定。基金转换费用由基金份额持有人承担。

转换公式如下：

1) 转出金额 = 转出基金份额 × 转出基金 T 日基金份额净值（此处的 T 日指基金转换申请日，下同）

2) 转出赎回费 = 转出金额 × 转出基金赎回费率（注：转出赎回费的 25% 将归入转出方基金的基金财产）

3) 转入金额 = 转出金额 - 转出赎回费

4) 如果，转出基金的申购费率 < 转入基金的申购费率，

申购补差费率 = 转入基金的申购费率 - 转出基金的申购费率

申购补差费 = 转入金额 × 申购补差费率 / (1 + 申购补差费率)

转入净额 = 转入金额 - 申购补差费

如果，转出基金的申购费率 ≥ 转入基金的申购费率，

转入净额 = 转入金额

5) 转入份额 = 转入净额 ÷ 转入基金 T 日基金份额净值

其中，转入基金的申购费率和转出基金的申购费率均以转出金额为确定依据。

(2) 转出金额、转出基金转换费的计算保留小数点后两位，第三位四舍五入，由此产生的误差在转出基金资产中列支；转入份额、申购补差费的计算保留小数点后两位，第三位四舍五入，由此产生的误差在转入基金资产中列支。

(3) 对于实行级差申购费率（不同申购金额对应不同申购费率）的基金，以转入总金额对应的转出基金申购费率、转入基金申购费率计算申购补差费用；如转入总金额对应转出基金申购费

或转入基金申购费为固定费用时，申购补差费用视为 0。

（4）计算基金转换费用所涉及的申购费率和赎回费率均按基金合同、更新的招募说明书规定费率执行，对于通过基金管理人网上交易、费率优惠活动期间发生的基金转换业务，按照基金管理人最新公告的相关费率计算基金转换费用。

## 九、基金的非交易过户、转托管、定期定额投资计划及冻结等业务

### （一）基金的非交易过户

基金的非交易过户指基金注册登记机构受理继承、捐赠、司法强制执行而产生的非交易过户和经注册登记机构认可、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投资者。

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关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注册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注册登记机构的规定办理，并按基金注册登记机构规定的标准收费。

### （二）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

### （三）定期定额投资计划

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

### （四）基金的冻结和解冻

基金账户和基金份额冻结、解冻的业务，由注册登记机构办理。

基金注册登记机构只受理国家有关机关依法要求的基金账户或基金份额的冻结与解冻以及注册登记机构认可的、符合法律法规的其他情况的基金账户或基金份额的冻结与解冻。基金账户或基金份额被冻结的，被冻结基金份额所产生的权益一并冻结，法律法规、中国证监会或法院判决、裁定另有规定的除外。

当基金份额处于冻结状态时，基金注册登记机构或其他相关机构应拒绝该部分基金份额的赎回申请、非交易过户以及基金的转托管。



## 十、基金的投资

### （一）投资目标

本基金为混合型基金，在适度控制风险并保持良好流动性的前提下，以成长股作为投资对象，并对不同成长类型股票采取不同操作策略，追求超额收益。

### （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、债券、权证、以及法律法规或经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金为灵活配置混合型基金，投资组合中股票类资产投资比例为基金资产的 30%-80%，固定收益类资产投资比例为基金资产的 0-70%，现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金投资于权证、以及其它金融工具投资比例遵从法律法规及监管机构的规定。

对于中国证监会允许投资的创新类金融产品（包括未来将推出的股指期货等衍生金融产品），将依据有关法律法规进行投资管理。如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

### （三）投资策略

本基金采取自上而下策略，根据对宏观经济、政策和证券市场走势的综合分析，对基金资产在股票、债券、现金和衍生产品上的投资比例进行灵活配置。在股票投资策略上，本基金根据上市公司成长特征，将上市公司分成三种类型：长期快速成长型公司；周期成长型公司；转型成长型公司。对于不同成长类型的股票，本基金将采取买入持有操作策略（兼顾波段操作策略）、或者周期持有策略进行投资组合管理，提高投资收益。

本基金的投资策略主要体现在资产配置策略、选股策略、股票操作策略、债券投资策略、权证投资策略等几方面。

#### 1、资产配置策略

对于大类资产的配置，本基金主要是由投资研究团队根据宏观经济运行态势、宏观经济政策变化、证券市场运行状况、国际市场变化情况等因素的深入研究，判断证券市场的发展趋势和风险收益水平。在各大类资产投资比例限制前提下，根据大类资产风险收益分析结果，并结合本基金风险收益目标，灵活确定基金资产在股票、债券、现金和衍生产品上的配置比例。

#### 2、选股策略

本基金以成长为导向，选取未来快速成长的股票作为投资对象。企业业绩成长可以分为两类：内涵式增长和外延式增长。内涵式增长是指企业依靠自身技术、管理等能力而获得业绩的增长。

根据企业成长对宏观经济的敏感性不同，内涵式增长又可分为稳定型增长和周期型增长。稳定型增长是指企业业绩增长与经济周期敏感性相对较低；周期型增长是指企业业绩增长与经济周期敏感性相对较高。外延式增长是指企业通过收购、兼并、或者重组等方式带来业绩增长，这类增长方式能带来企业业绩短期爆发增长。

根据上市公司成长特征，可将成长型上市公司分成三种类型：长期快速成长型公司；周期成长型公司；转型成长型公司。对于不同成长型公司，本基金将根据相应价值投资评价体系精选投资价值高的股票，进入本基金的股票池。

### 3、股票操作策略

对于不同成长特征的股票，在经济周期不同阶段内，其股价表现是不同的。本基金根据以上三种类型股票股价与经济周期之间的关系，确定股票资产的配置。具体策略是：

(1) 在经济周期上升阶段，加大周期成长型股票配置比例，并保持适度的稳定型行业中快速成长型股票的配置比例。

(2) 在经济周期下降阶段，加大稳定型行业中快速成长型股票的配置比例；降低周期型股票配置比例。

(3) 对于转型类股票的配置，由于其股价走势基本不受经济周期的约束，所以，只要能够确定转型成功，并将使公司业绩发生根本变化，就可以买入持有，但最高配置比例不超过股票资产的30%。

为了规避股票资产配置过度集中于某一类型股票而带来投资风险，本基金对不同成长类型股票投资比例进行了一定限制：

(1) 对于长期快速成长型股票，配置比例不低于股票资产的30%；

(2) 对于周期成长型股票，最高配置比例不超过股票资产的60%；

(3) 对于转型成长型股票，最高配置比例不超过股票资产的30%。

从实际投资经验看，股票操作策略主要有两种：一种是买入持有操作策略；另一种是周期持有策略。本基金对具有不同成长特征的股票将采取不同操作策略进行投资组合管理，具体原则是：

(1) 对于快速成长型股票，采取中长期买入持有操作策略，但不片面强调中长期静态持有。具体而言：本基金根据对上市公司成长性动态变化的分析预测，兼顾考虑当时的市场趋势，通过对股票价格与价值相对偏离程度的分析，对快速成长型股票适时进行一定比例仓位的波段操作。

(2) 对于周期成长型股票，采取周期持有策略。在行业景气复苏和上升阶段，逐步增加周期型股票配置比例；在行业景气达到顶峰之前逐步降低周期型股票配置比例。

(3) 对转型成长型股票，采取中短期买入持有操作策略。

#### 4、债券投资策略

本基金将根据利率变化的大周期、市场运行的小周期和中国债券市场的扩张特征，制定相应的债券投资策略，以获取利息收益为主、资本利得为辅。

#### 5、权证投资策略

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

### **(四) 投资决策流程**

本基金具有严密科学的投资决策流程和明确的分级授权体系，具体如下：

1、投资决策委员会：决策基金总体战略、资产配置、审议基金的债券（股票）池、对基金经理提出的仓位与组合预案进行审议与决策，就风险事项与风险管理委员会沟通；

2、基金经理：参与构建基金的债券（股票）池、提出资产配置方案、实施具体投资计划。基金经理必须严格按照《投资管理流程》进行操作，资产配置方案经投资决策委员会审议通过后，以《资产配置方案决议》的形式形成书面结果，作为基金经理投资操作的依据，同时给投资总监、风险控制部门等备案，以便监控。

3、集中交易室：执行基金经理的交易指令、反馈交易指令的执行情况、监督交易指令的合规合法性；

4、研究平台：构建债券（股票）池、为投资决策委员会提供投资决策咨询支持、为基金经理投资提供支持；

5、金融工程小组：通过对投资组合的跟踪与评估，为投资决策委员会和基金经理提供投资实际效果的反馈意见，以优化改进投资决策；

6、风险控制部门：由风险管理委员会、合规风控部等构成。合规风控部对投资决策及实际投资进行稽查并定期和不定期向风险管理委员会提供相关报告，定期评估投资组合风险与收益水平并向风险管理委员会提供投资组合风险评估报告。风险管理委员会就风险事项和风险评估报告进行审议并与投资决策委员会沟通，以监控投资决策流程和各级决策权限的行使是否合法合规及科学合理。

### **(五) 业绩比较基准**

本基金的业绩比较基准为：65%\*沪深 300 指数+35%\*中证全债指数。

本基金投资组合中股票类资产投资比例为基金资产的 30%-80%，固定收益类资产投资比例为基金资产的 0-70%，现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，根据相关法律法规定义，本基金为混合型基金。因此，本基金总体业绩比较基准中，股票类资产业绩比较

基准给予了 65%的权重，而固定收益类资产业绩比较基准给予了 35%的权重。本基金选择沪深 300 指数作为股票类资产业绩比较基准，沪深 300 指数成份股涵盖沪深两市，是由沪深两市流通市值最大并且流动性好、业绩良好的股票组成，代表性强；并且该指数采用流通市值分级靠档加权方式编制，能够真实反映沪深两市市场走势。因此，本基金股票类资产业绩比较基准选择沪深 300 指数。本基金的固定收益类资产业绩比较基准为中证全债指数，中证全债指数是中证指数公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数，该指数的样本由银行间市场和沪深交易所市场的国债、金融债券及企业债券组成，能够反应本基金对债券配置的业绩。

如果指数编制单位停止计算编制该指数或更改指数名称、或有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，经与基金托管人协商一致，基金管理人履行相关的程序后，可变更业绩比较基准并及时公告。

## （六）风险收益特征

本基金是一只进行主动投资的混合型基金，其风险和预期收益要低于股票型基金，高于货币市场基金和债券型基金，在证券投资基金中属于风险较高、预期收益也较高的基金产品。

## （七）投资限制

1、本基金的投资组合将遵循以下限制：

（1）本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%；

（2）本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；

（3）进入全国银行间同业市场的债券回购融入的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；

（4）本基金参与股票发行申购，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；

（5）本基金股票类资产投资比例为基金资产的 30%-80%，固定收益类资产投资比例为基金资产的 0-70%，现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

（6）本基金投资股权分置改革中产生的权证，在任何交易日买入的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，本基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%。投资于其他权证的投资比例，遵从法律法规或监管部门的相关规定。

（7）本基金投资资产支持证券的，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%；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，不得超过该基金资产净值的 10%；基金管理人管理的全部证券投资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%；本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过该基金资产净值的 20%。

(8) 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%；

(9) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的 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；

(10) 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；

(11) 本基金不得违反基金合同中有关投资范围、投资策略、投资比例的规定；

(12) 法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。在符合相关法律法规规定的前提下，除第（5）项中“现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%”及第（9）、（10）项外，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等非本基金管理人的因素致使基金的投资组合不符合上述规定的投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

若法律法规或监管部门取消上述限制，履行适当程序后，本基金投资可不受上述规定限制。

## 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；

(9) 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。

#### （七）基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

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

2、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；

3、有利于基金财产的安全与增值；

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

#### （八）基金的融资、融券

本基金可以按照国家的有关规定进行融资、融券。

#### （九）基金投资组合报告

东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金(以下简称“本基金”)基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本基金的托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至2018年9月30日(未经审计)。

##### 1、报告期末基金资产组合情况:

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	70,339,811.21	48.04
	其中:股票	70,339,811.21	48.04
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	35,342,046.60	24.14
	其中:债券	35,342,046.60	24.14
	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	40,351,676.28	27.56
8	其他资产	371,443.04	0.25
9	合计	146,404,977.13	100.00

## 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

### 2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	6,934,488.28	4.76
C	制造业	35,598,661.74	24.44
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	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	6,875,674.64	4.72
K	房地产业	13,678,043.51	9.39
L	租赁和商务服务业	1,640,438.34	1.13
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,171,000.00	0.80
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	4,441,504.70	3.05
S	综合	-	-
	合计	70,339,811.21	48.29

### 2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

## 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	600048	保利地产	639,403	7,781,534.51	5.34
2	600028	中国石化	728,269	5,185,275.28	3.56
3	600875	东方电气	598,525	4,656,524.50	3.20
4	000333	美的集团	113,300	4,565,990.00	3.13
5	601952	苏垦农发	479,800	3,824,006.00	2.63
6	600036	招商银行	105,800	3,247,002.00	2.23
7	000002	万科 A	124,900	3,035,070.00	2.08
8	300133	华策影视	302,200	2,895,076.00	1.99
9	001979	招商蛇口	153,100	2,861,439.00	1.96
10	600585	海螺水泥	68,722	2,528,282.38	1.74

## 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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	35,342,046.60	24.26
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	35,342,046.60	24.26

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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	132004	15 国盛 EB	100,450	9,542,750.00	6.55
2	132006	16 皖新 EB	84,440	8,485,375.60	5.83



3	113008	电气转债	79,660	8,058,405.60	5.53
4	132007	16 凤凰 EB	63,000	5,953,500.00	4.09
5	110031	航信转债	31,110	3,302,015.40	2.27

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细：**

本基金本报告期末未持有贵金属。

**8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细：**

本基金本报告期末未持有权证。

**9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明：**

**9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未持有股指期货。

**9.2 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金本报告期末投资股指期货。

**10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明：**

**10.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期末投资国债期货。

**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。

**10.3 本期国债期货投资评价**

本基金本报告期末投资国债期货。

**11、投资组合报告附注**

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

(2) 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

(3) 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	129,312.87
2	应收证券清算款	-

3	应收股利	-
4	应收利息	219,000.28
5	应收申购款	23,129.89
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	371,443.04

## (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	132006	16 皖新 EB	8,485,375.60	5.83
2	113008	电气转债	8,058,405.60	5.53
3	132007	16 凤凰 EB	5,953,500.00	4.09
4	110031	航信转债	3,302,015.40	2.27

## (5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000333	美的集团	4,565,990.00	3.13	资产重组

## (6) 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## 十一、基金的业绩

本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,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,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

### （一）东吴进取策略基金历史时间段净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较

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
2009.05.06-2009.12.31	6.94%	1.11%	20.31%	1.28%	-13.37%	-0.17%
2010.01.01-2010.12.31	21.24%	1.30%	-7.43%	1.03%	28.67%	0.27%
2011.01.01-2011.12.31	-30.45%	1.22%	-14.93%	0.85%	-15.52%	0.37%
2012.01.01-2012.12.31	-0.93%	1.04%	6.32%	0.83%	-7.25%	0.21%
2013.01.01-2013.12.31	31.59%	1.27%	-4.35%	0.91%	35.94%	0.36%
2014.01.01-2014.12.31	9.15%	0.84%	36.87%	0.81%	-27.72%	0.03%
2015.01.01-2015.12.31	29.53%	3.14%	6.26%	1.62%	23.27%	1.52%
2016.01.01-2016.12.31	-6.33%	1.88%	-6.63%	0.91%	0.30%	0.97%
2017.01.01-2017.12.31	2.57%	0.95%	14.04%	0.42%	-11.47%	0.53%
2018.01.01-2018.09.30	-14.13%	0.92%	-7.53%	0.79%	-6.60%	0.13%
2009.05.06-2018.09.30	37.10%	1.54%	31.17%	0.99%	5.93%	0.55%

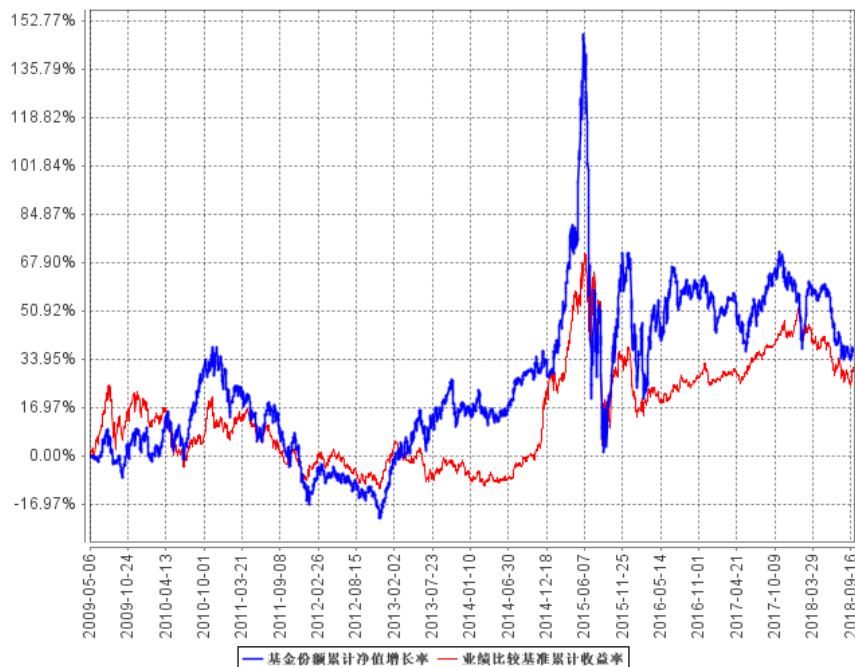
注：统计截至2018年9月30日，比较基准=65%\*沪深300指数+35%\*中证全债指数。

**（二）东吴进取策略灵活配置混合基金累计净值增长率历史走势图**

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

（2009年05月06日至2018年9月30日）

**基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图**



注：比较基准=65%\*沪深 300 指数+35%\*中证全债指数

## 十二、基金财产

### （一）基金资产总值

基金资产总值是指基金拥有的各类证券及票据、银行存款本息和基金应收的基金申购款以及其他资产的价值总和。

其构成主要有：

- 1、银行存款及其应计利息；
- 2、清算备付金及其应收利息；
- 3、根据有关规定缴纳的保证金；
- 4、应收证券交易清算款；
- 5、应收基金申购款；
- 6、股票投资及其估值调整；
- 7、债券投资及其估值调整和应计利息；
- 8、权证投资及其估值调整；
- 9、其他投资及其估值调整；
- 10、其他资产等。

### （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）基金财产的帐户

基金开立专用银行存款账户和证券账户，与基金管理人、基金托管人、基金代销机构、注册登记机构自有资产账户以及其他基金的资产账户相独立。基金专用账户须报中国证监会备案。

### （四）基金财产的保管和处分

本基金财产独立于基金管理人、基金托管人和基金代销机构的固有财产，并由基金托管人保管，基金管理人、基金托管人不得将基金财产归入其固有财产。基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益，归入基金财产。

基金管理人、基金托管人和基金代销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、扣押或其它权利。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。除依据《基金法》、《运作办法》、《基金合同》及其它有关规定承担基金财产本身债务之外，基金财产不得被强制执行。

## 十三、基金资产的估值

### （一）估值目的

基金资产估值的目的是客观、准确地反映基金资产是否保值、增值，依据经基金资产估值后确定的基金资产净值而计算出的基金份额净值，是计算基金申购与赎回价格的基础。

### （二）估值日

本基金的估值日为相关的证券交易所的正常营业日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非营业日。

### （三）估值对象

基金所拥有的股票、债券、权证和银行存款本息等资产和负债。

### （四）估值程序

基金日常估值由基金管理人进行。基金管理人完成估值后，将估值结果加盖业务公章以书面形式加密传真至基金托管人，基金托管人按法律法规、《基金合同》规定的估值方法、时间、程序进行复核，复核无误后在基金管理人传真的书面估值结果上加盖业务公章返回给基金管理人，由基金管理人依据本基金合同和有关法律法规的规定予以公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

### （五）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，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的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

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

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

(4) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

(1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价（收盘价）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市价（收盘价）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、因持有股票而享有的配股权，从配股除权日起到配股确认日止，如果收盘价高于配股价，按收盘价高于配股价的差额估值。收盘价等于或低于配股价，则估值为零。

4、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。

5、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。

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、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。

根据《基金法》，基金管理人计算并公告基金资产净值，基金托管人复核、审查基金管理人计算的基金资产净值。因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对于基金资产净值的计算结果对外予以公布。

#### **(六) 基金份额净值的确认和估值错误的处理**

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。当估值或份额净值计价错误实际发生时，基金管理人应当立即纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。当错误达到或超过基金资产净值的 0.25% 时，基金管理人应报中国证监会备案；当估值错误偏差达到基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应当公告，并报中国证监会备案。因基金估值错误给投资者造成损失的，应先由基金管理人承担，基金管理人对其不应由其承担的责任，有权向过错人追偿。

关于差错处理，本基金合同的当事人按照以下约定处理：

## 1、差错类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或注册登记机构、或代销机构、或投资者自身的过错造成差错，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该差错遭受损失的当事人（“受损方”）按下述“差错处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

上述差错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；对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平不能预见、不能避免、不能克服，则属不可抗力，按照下述规定执行。

由于不可抗力原因造成投资者的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

## 2、差错处理原则

（1）差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已产生的差错，给当事人造成损失的，由差错责任方承担；若差错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。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正；

（2）差错的责任方对可能导致有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对差错的有关直接当事人负责，不对第三方负责；

（3）因差错而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但差错责任方仍应对差错负责。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，则差错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差错责任方；

（4）差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式；

（5）差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人的行为造成基金财产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人的行为造成基金财产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。基金管理人和托管人之外的第三方造成基金财产的损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错方追偿；追偿过程中产生的有关费用，应列入基金费用，从基金资产中支付；



(6) 如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿，并且依据法律法规、基金合同或其他规定，基金管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任，则基金管理人有权向有责任的当事人进行追索，并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失；

(7) 按法律法规规定的其他原则处理差错。

### 3、差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

(1) 查明差错发生的原因，列明所有的当事人，并根据差错发生的原因确定差错的责任方；

(2) 根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；

(3) 根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失；

(4) 根据差错处理的方法，需要修改基金注册登记机构交易数据的，由基金注册登记机构进行更正，并就差错的更正向有关当事人进行确认；

(5) 基金管理人及基金托管人基金份额净值计算错误偏差达到基金份额净值的 0.25%时，基金管理人应当报告中国证监会；基金管理人及基金托管人基金份额净值计算错误偏差达到基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告并报中国证监会备案。

#### (七) 暂停估值的情形

1、与本基金投资有关的证券交易场所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

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

3、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后，基金管理人应当暂停基金估值；

4、中国证监会认定的其他情形。

#### (八) 特殊情形的处理

1、基金管理人按估值方法的第 6 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、由于证券交易所及其登记结算公司发送的数据错误，或由于其他不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

## 十四、基金的收益分配

### （一）基金收益的构成

- 1、买卖证券差价；
- 2、基金投资所得红利、股息、债券利息；
- 3、银行存款利息；
- 4、已实现的其他合法收入。

因运用基金财产带来的成本或费用的节约应计入收益。

### （二）基金净收益

基金净收益为基金收益扣除按国家有关规定可在基金收益中扣除的费用后的余额。

### （三）基金收益分配原则

本基金收益分配应遵循下列原则：

- 1、本基金的每份基金份额享有同等分配权；
- 2、基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值；收益分配时所发生的银行转帐或其他手续费用由投资人自行承担，当投资人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转帐或其他手续费用时，基金注册登记机构可将投资人的现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额；
- 3、若基金合同生效不满3个月，可不进行收益分配；
- 4、基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；
- 5、基金当期收益应先弥补上期累计亏损后，才可进行收益分配；
- 6、本基金收益每年最多分配八次，每次基金收益分配比例不低于可分配收益的25%；
- 7、本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，基金投资者可选择现金红利或将现金红利按除息日的基金份额净值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；
- 8、法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

在不影响投资者利益的情况下，基金管理人可在法律法规允许的前提下酌情调整以上基金收益分配原则，但应于变更实施日前在指定媒体和基金管理人网站公告。

### （四）收益分配方案的确定与公告

基金收益分配方案中应载明基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式、支付方式等内容。本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人核实后确定，在报中国证监会备案后5个工作日内公告，请投资者留意本基金指定的信息披露媒体。

### （五）基金收益分配中发生的费用

- 1、收益分配采用红利再投资方式免收再投资的费用。
- 2、收益分配时发生的银行转账等手续费用由基金份额持有人自行承担；如果基金份额持有人所获现金红利不足支付前述银行转账等手续费用，注册登记机构自动将该基金份额持有人的现金红利按除权日的基金份额净值转为基金份额。

## 十五、基金费用与税收

### （一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金合同生效后的信息披露费用；
- 4、基金份额持有人大会费用；
- 5、基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
- 6、基金的证券交易费用；
- 7、基金财产拨划支付的银行费用；
- 8、按照国家有关规定可以在基金财产中列支的其他费用。

（二）上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

### （三）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

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}, \text{ 本基金年管理费率为 } 1.5\%$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

#### 2、基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}, \text{ 本基金年托管费率为 } 0.25\%$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

3、上述（一）中 3 到 7 项费用由基金托管人根据其他有关法律法规及相应协议的规定，按费

用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

#### **(四) 不列入基金费用的项目**

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，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金募集期间所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付，基金收取认购费的，可以从认购费中列支。

**(五) 基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。降低基金管理费率和基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率实施日前在指定媒体和基金管理人网站上刊登公告。**

#### **(六) 与基金销售有关的费用**

本基金申购费、赎回费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式，以及基金转换费及份额计算方法请详见本招募说明书“八、基金份额的申购与赎回”中的相关规定。

#### **(七) 基金税收**

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

## 十六、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；本基金首次募集的会计年度按如下原则：如果基金合同生效少于3个月，可以并入下一个会计年度；
- 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、本基金托管人与本基金管理人就本基金的基金资产净值、基金份额净值、报表等进行核对并确认。

### （二）基金审计

- 1、本基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相独立的、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和基金托管人同意，并报中国证监会备案。
- 3、基金管理人（或基金托管人）认为有充足理由更换会计师事务所，须经基金托管人（或基金管理人）同意，并报中国证监会备案后可以更换。  
更换会计师事务所在2个工作日内公告。

## 十七、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》、本基金合同及其他有关规定；**

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的全国性报刊（以下简称“指定报刊”）和基金管理人、基金托管人的互联网网站（以下简称“网站”）等媒介披露，并保证基金投资者能够按照本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；

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。

**（二）公开披露的基金信息包括：**

1、基金招募说明书、基金合同、基金托管协议；

本基金募集申请经中国证监会核准后，基金管理人在基金份额发售的3日前，将基金招募说明书、基金合同摘要登载在指定报刊和网站上；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。

（1）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，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容；

本基金合同生效后，基金管理人在每六个月结束之日起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日前向中国证监会报送更新的招募说明书，并就有关更新内容提供书面说明。

（2）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；

（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。

2、基金份额发售公告；

基金管理人就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于指定报刊和网站上。

3、基金募集情况；

4、基金合同生效公告；

基金管理人在本基金合同生效的次日在指定报刊和网站上登载基金合同生效公告。

5、基金份额上市交易公告书；

基金份额获准在证券交易所上市交易时，基金管理人在基金份额上市交易的 3 个工作日前，将基金份额上市交易公告书登载在指定报刊和网站上。

6、基金资产净值、基金份额净值；

本基金合同生效后，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；

基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发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。

7、基金份额申购、赎回价格；

基金管理人在本基金合同、本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，并保证基金投资者能够在基金份额发售网点查阅或者复制前述信息资料。

8、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；

如基金合同生效不足两个月，本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本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和书面报告两种方式。

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



监会认定的特殊情形除外。

本基金持续运作过程中，基金管理人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。

#### 9、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两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本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；

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）提前终止本基金合同；
- （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）基金募集期延长；
- （8）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；
- （9）基金管理人的董事在一年内变更超过百分之五十；
- （10）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；
- （11）涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼；
- （12）基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查；
- （13）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；
- （14）重大关联交易事项；
- （15）基金收益分配事项；
- （16）管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- （17）基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；
- （18）基金改聘会计师事务所；
- （19）变更基金份额发售机构；
- （20）基金更换注册登记机构；

- (21) 本基金开始办理申购、赎回；
- (22) 本基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；
- (23) 本基金发生巨额赎回并延期支付；
- (24) 本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；
- (25) 本基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；
- (26) 发生涉及本基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；
- (27) 中国证监会规定和基金合同约定的其他事项。

#### 10、澄清公告：

在本基金合同存续期限内，任何公共媒体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、基金上市交易的证券交易所。

#### 11、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，应当依法报国务院证券监督管理机构核准或者备案，并予以公告；

召开基金份额持有人大会的，召集人应当至少提前 30 日公告基金份额持有人大会的召开时间、会议形式、审议事项、议事程序和表决方式等事项；

基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会，本基金管理人、本基金托管人对基金份额持有人大会决定的事项不依法履行信息披露义务的，召集人应当履行相关信息披露义务。

#### 12、中国证监会规定的其他信息。

### （三）信息披露事务管理

1、定期更新的招募说明书公布后，应当分别置备于基金管理人、基金托管人和基金份额发售机构的住所，供公众查阅、复制；

2、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，以及基金上市交易的证券交易所，供公众查阅、复制。

3、招募说明书、基金定期报告、基金资产净值公告公布后，投资者可以免费查阅。在支付工本费后可在合理时间获得上述文件的复制件或复印件。基金管理人和基金托管人应保证文本定的内容与所公告的内容完全一致。

## 十八、基金的风险揭示

本基金是一只进行主动投资的混合型基金，其风险和预期收益要低于股票型基金，高于货币市场基金和债券型基金，在证券投资基金中属于风险较高、预期收益也较高的基金产品。

### （一）市场风险

金融市场价格受经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响，导致基金收益水平变化，产生风险，主要包括：

#### 1、政策风险

货币政策、财政政策、产业政策和证券市场监管政策等国家政策的变化对证券市场产生一定的影响，可能导致市场价格波动，从而影响基金收益。

#### 2、利率风险

金融市场利率波动会导致股票市场及利息收益的价格和收益率的变动，同时直接影响企业的融资成本和利润水平。基金投资于股票和债券，收益水平会受到利率变化的影响。

#### 3、信用风险

指基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，或者上市公司信息披露不真实、不完整，都可能导致基金资产损失和收益变化。

#### 4、通货膨胀风险

由于通货膨胀率提高，基金的实际投资价值会因此降低。

#### 5、再投资风险

再投资风险反映了利率下降对固定收益证券和回购等利息收入再投资收益的影响。当利率下降时，基金从投资的固定收益证券和回购所得的利息收入进行再投资时，将获得比以前少的收益率。

#### 6、法律风险

由于法律法规方面的原因，某些市场行为受到限制或合同不能正常执行，导致了基金资产损失的风险。

### （二）管理风险

在基金管理运作过程中基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的占有和对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平。因此，本基金可能因为基金管理人和基金托管人的管理水平、管理手段和管理技术等因素影响基金收益水平。

### （三）流动性风险

本基金属于开放式基金，基金份额可以在基金合同约定的时间和场所进行申购和赎回，因此

会面临一定的流动性风险。所谓流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。在基金交易过程中，可能会发生巨额赎回的情形，从而导致基金仓位调整的困难，引发流动性风险，甚至影响基金份额净值。

#### 1、本基金拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

(1) 拟投资市场的流动性风险：本基金拟投资于 A 股市场股票、银行间和交易所债券、货币市场工具等投资品种。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，正常情况下能够及时满足基金变现需求，保证基金按时应对赎回要求。极端市场情况下，上述资产可能出现流动性不足，导致基金资产无法变现，从而影响投资者按时收到赎回款项。根据过往经验统计，绝大部分时间上述资产流动性充裕，流动性风险可控，当遇到极端市场情况时，基金管理人会按照基金合同及相关法律法规要求，及时启动流动性风险应对措施，保护基金投资者的合法权益。

(2) 拟投资行业的流动性风险：股票投资方面，本基金将在考虑行业生命周期、景气程度、估值水平以及股票市场行业轮动规律的基础上决定行业的配置，同时本基金将根据宏观经济和证券市场环境的变化，及时对行业配置进行动态调整。债券投资方面，本基金通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势以及不同类属的收益率水平、流动性和信用风险等因素，以久期控制和结构分布策略为主，以收益率曲线策略、利差策略等为辅，构造能够提供稳定收益的债券和货币市场工具组合。因此本基金在投资运作过程中的行业配置较为灵活，在综合考虑宏观因素及行业基本面的前提下进行配置，不以投资于某单一行业为投资目标，行业分散度较高，受到单一行业流动性风险的影响较小。

(3) 投资资产的流动性风险：本基金针对流动性较低资产的投资进行了严格的限制，以降低基金的流动性风险：本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。本基金绝大部分基金资产投资于 7 个工作日可变现资产，包括可在交易所、银行间市场正常交易的股票、债券、非金融企业债务融资工具及同业存单，7 个工作日内到期或可支取的逆回购、银行存款，7 个工作日内能够确认收到的各类应收款项等，上述资产流动性情况良好。

#### 2、实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响：

(1) 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，基金管理人应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金申购赎回申请的措施。基金份额持有人存在不能及时赎回基金份额的风险。

(2) 若本基金发生了巨额赎回，基金管理人有可能采取延缓支付赎回款项的措施以应对巨

额赎回，具体措施请见基金合同及招募说明书中“基金份额的申购与赎回”部分“巨额赎回的处理方式”。因此在巨额赎回情形发生时，基金份额持有人存在不能及时赎回基金份额的风险。

(3) 本基金基金份额，对持续持有期少于7日的投资人，收取1.5%的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产。赎回费在投资人赎回基金份额时收取。

#### **(四) 策略风险**

本基金存在投资策略风险，即本基金的业绩表现不一定领先于市场平均水平。另外，在精选个股的实际操作过程中，基金管理人可能限于知识、技术、经验等因素而影响其对相关信息、经济形势和证券价格走势的判断，其精选出的个股的业绩表现不一定持续优于其他股票。

#### **(五) 其它风险**

##### **1、技术风险**

计算机、通讯系统、交易网络等技术保障系统或信息网络支持出现异常情况，可能导致基金日常的申购赎回无法按正常时限完成、注册登记系统瘫痪、核算系统无法按正常时限显示产生净值、基金的投资交易指令无法及时传输等风险。

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

3、金融市场危机、行业竞争、代理机构违约、托管行违约等超出基金管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致基金或者基金份额持有人的利益受损。

#### **(六) 声明**

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

2、除基金管理人直接办理本基金的销售外，本基金还通过中国农业银行等代销机构代理销售，但是，基金并不是代销机构的存款或负债，也没有经代销机构担保或者背书，代销机构并不能保证其收益或本金安全。

3、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新基金业绩表现的保证。

## 十九、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、下列涉及到基金合同内容变更的事项应召开基金份额持有人大会并经基金份额持有人大会决议同意：

(1) 终止基金合同；

(2) 转换基金运作方式；

(3) 变更基金类别；

(4) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略；

(5) 变更基金份额持有人大会议事程序；

(6) 更换基金管理人、基金托管人；

(7) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准。但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；

(8) 本基金与其他基金的合并；

(9) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响，需召开基金份额持有人大会的变更基金合同等其他事项；

(10) 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；

(11) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

但出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会决议，由基金管理人和基金托管人同意变更后公布经修订的基金合同，并报中国证监会备案：

1) 调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；

2) 在法律法规和本基金合同规定的范围内变更基金的申购费率、调低赎回费率或收费方式；

3) 因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；

4) 对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化；

5) 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；

6) 按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

2、关于变更基金合同的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准或备案，并经中国证监会核准或出具无异议意见之日起生效。基金管理人应在上述基金份额持有人大会决议生效后 2 日内在指定媒体和基金管理人网站公告。

### （二）本基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同经中国证监会核准后将终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在 6 个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务；
- 3、基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而在 6 个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务；
- 4、中国证监会规定的其他情况。

### **(三)基金财产的清算**

#### **1、基金财产清算组**

(1)基金合同终止时，成立基金财产清算组，基金财产清算组在中国证监会的监督下进行基金清算。

(2)基金财产清算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。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

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

#### **2、基金财产清算程序**

基金合同终止，应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。基金财产清算程序主要包括：

- (1)基金合同终止后，发布基金财产清算公告；
- (2)基金合同终止时，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- (3)对基金财产进行清理和确认；
- (4)对基金财产进行估价和变现；
- (5)聘请会计师事务所对清算报告进行审计；
- (6)聘请律师事务所出具法律意见书；
- (7)将基金财产清算结果报告中国证监会；
- (8)参加与基金财产有关的民事诉讼；
- (9)公布基金财产清算结果；
- (10)对基金剩余财产进行分配。

#### **3、清算费用**

清算费用是指基金财产清算组在进行基金财产清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由

基金财产清算组优先从基金财产中支付。

4、基金财产按下列顺序清偿：

- (1) 支付清算费用；
- (2) 交纳所欠税款；
- (3) 清偿基金债务；
- (4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款(1)－(3)项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

5、基金财产清算的公告

基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算组公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算结果经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，由基金财产清算组报中国证监会备案并公告。

6、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。



## 二十、基金合同的内容摘要

### （一）基金管理人、基金托管人、基金份额持有人的权利、义务

#### 1、基金管理人的权利

- （1）自本基金合同生效之日起，依照有关法律法规和本基金合同的规定独立运用基金财产；
- （2）获得基金管理人报酬；
- （3）依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- （4）在符合有关法律法规和本基金合同的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则，决定基金的除调高托管费和管理费之外的费率结构和收费方式；
- （5）根据本基金合同及有关规定监督基金托管人，对于基金托管人违反了本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金财产、其他基金当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会和银行业监督管理机构，并采取必要措施保护基金及相关基金当事人的利益；
- （6）在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购、赎回和转换申请；
- （7）自行担任基金注册登记机构或选择、更换注册登记机构，并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查；
- （8）选择、更换代销机构，并依据销售代理协议和有关法律法规，对其行为进行必要的监督和检查；
- （9）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- （10）依法召集基金份额持有人大会；
- （11）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；
- （12）根据国家有关规定，在法律法规允许的前提下，以基金的名义依法为基金融资、融券；
- （13）法律法规规定的其他权利。

#### 2、基金管理人的义务

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）依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；如认为基金代销机构违反基金合同、基金销售与服务代理协议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；
- （2）办理基金备案手续；
- （3）自基金合同生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；

(4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

(5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；

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

(7) 依法接受基金托管人的监督；

(8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回的价格；

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(10) 编制中期和年度基金报告；

(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；但因第三方责任导致基金财产或基金份额持有人利益受到损失，而基金管理人首先承担了责任的情况下，基金管理人有权向第三方追偿；

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

(24) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，基金合同不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人；

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；

(26) 建立并保存基金份额持有人名册，根据托管协议的约定向基金托管人提供基金份额持有人名册；

(27) 法律法规、基金合同规定的以及中国证监会要求的其他义务。

### 3、基金托管人的权利

(1) 获得基金托管费；

(2) 监督基金管理人对本基金的投资运作；

(3) 自本基金合同生效之日起，依法保管基金财产；

(4) 在基金管理人更换时，提名新任基金管理人；

(5) 根据本基金合同及有关规定监督基金管理人，对于基金管理人违反本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金财产、其他基金合同当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关基金合同当事人的利益；

(6) 依法召集基金份额持有人大会；

(7) 按规定取得基金份额持有人名册；

(8) 法律法规规定的其他权利。

### 4、基金托管人的义务

(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，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；对所托管的不同基金财产分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在名册登记、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；

(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应予保密，不得向他人泄露；

(8) 对基金财务会计报告、中期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；

(9) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料不少于 15 年；

(10) 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；

(11) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

(12) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值和基金份额申购、赎回价格；

(13) 按照规定监督基金管理人的投资运作；

(14) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

(15) 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；

(16) 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；

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

(18) 按规定监督基金管理人按照法律法规规定和基金合同履行其义务，基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿；

(19) 根据本基金合同和托管协议规定建立并保存基金份额持有人名册；

(20) 参加基金财产清算组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

(21) 面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告中国证监会和中国银监会，并通知基金管理人；

(22) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；

(23) 法律法规、基金合同规定的以及中国证监会要求的其他义务。

## 5、基金份额持有人的权利

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关法律法规的规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：

- (1) 分享基金财产收益；
- (2) 参与分配清算后的剩余基金财产；
- (3) 依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；
- (4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会；
- (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、基金份额代销机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；
- (9) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

#### 6、基金份额持有人的义务

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关法律法规的规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：

- (1) 遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；
- (2) 缴纳基金认购、申购款项及法律法规、基金合同和招募说明书规定的费用；
- (3) 在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；
- (4) 不从事任何有损基金及其他基金份额持有人合法权益的活动；
- (5) 执行生效的基金份额持有人大会决议；
- (6) 返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人、基金托管人及基金管理人的代理人处获得的不当得利；
- (7) 法律法规和基金合同规定的其他义务。

#### (二) 基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人或基金份额持有人的合法授权代表共同组成。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

##### 1、召开事由

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) 转换基金运作方式；
- (3) 变更基金类别；
- (4) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略；

- (5) 变更基金份额持有人大会议事程序；
- (6) 更换基金管理人、基金托管人；
- (7) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准。但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；
- (8) 本基金与其他基金的合并；
- (9) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项，需召开基金份额持有人大会的变更基金合同等其他事项；
- (10) 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；
- (11) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

出现以下情形之一的，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、其他应由基金或基金份额持有人承担的费用；
- (2) 在法律法规和本基金合同规定的范围内调整基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式；
- (3) 因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；
- (4) 法律法规要求增加的基金费用的收取；
- (5) 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基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化；
- (6) 按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会以外的其他情形。

## 2、召集人和召集方式

(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；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。

(2) 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十日内决定是否召集，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六十日内召开；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。

(3) 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十日内决定是否召集，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六十日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额10%（含10%）以上的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起十日内决定是否召集，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六十日内召开。

（4）代表基金份额10%以上的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，代表基金份额10%以上的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会，但应当至少提前30日向中国证监会备案。

（5）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。

### 3、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

基金份额持有人大会的召集人（以下简称“召集人”）负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。召开基金份额持有人大会，召集人必须于会议召开日前30日在指定媒体和基金管理人网站公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容：

- （1）会议召开的时间、地点和出席方式；
- （2）会议拟审议的主要事项；
- （3）会议形式；
- （4）议事程序；
- （5）有权出席基金份额持有人大会的权益登记日；
- （6）授权委托书的内容要求（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；
- （7）表决方式；
- （8）会务常设联系人姓名、电话；
- （9）出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- （10）召集人需要通知的其他事项。

采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定通讯方式和书面表决方式，并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、书面表决意见的寄交的截止时间和收取方式。

### 4、会议的召开方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式或通讯开会方式召开。

- （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书委派代表出席，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。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：

第一，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书符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定；

第二，经核对，汇总到会者出示的在权利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%）。

（2）通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人或其受托人将其对表决事项的投票在表决截止日以前送达至召集人指定的地址。

在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

1) 召集人按本基金合同规定公布会议通知后，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和统计基金份额持有人的表决意见，基金管理人或基金托管人经通知拒不参加收取和统计表决意见的，不影响表决效力；

3) 本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额应占权益登记日基金总份额的 50%以上；

4) 直接出具表决意见的基金份额持有人或受托代表他人出具表决意见的代表，同时提交的持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与登记注册机构记录相符；

5) 会议通知公布前报中国证监会备案。

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；表面符合法律法规和会议通知规定的表决意见即视为有效的表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

## 5、议事内容与程序

（1）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。

（2）基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日基金总份额 10%（含 10%）以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案；也可以在会议通知发出后向大会召集人提交临时提案，临时提案应当在大会召



开日至少 35 天前提交召集人并由召集人公告。

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日 30 天前公告。

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。

召集人对于基金管理人、基金托管人和基金份额持有人提交的临时提案进行审核，符合条件的应当在大会召开日 30 天前公告。

(3) 对于基金份额持有人提交的提案(包括临时提案)，大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

关联性。大会召集人对于提案涉及事项与基金有直接关系，并且不超出法律法规和《基金合同》规定的基金份额持有人大会职权范围的，应提交大会审议；对于不符合上述要求的，不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会上解释和说明。

程序性。大会召集人可以对提案涉及的程序性问题做出决定。如将提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会做出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

单独或合并持有权利登记日基金总份额 10%（含 10%）以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，或基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于六个月。法律法规另有规定的除外。

#### (4) 议事程序

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 7 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。

通讯开会：

在通讯表决开会的方式下，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第 2

日在公证机构监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。如监督人经通知但拒绝到场监督，不影响决议效力。

## 6、表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

（1）一般决议，一般决议须经参加大会的基金份额持有人所持表决权的 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所持表决权的三分之二（含三分之二）以上通过方可做出。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、决定终止基金合同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，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，符合会议通知规定的表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

## 7、计票

### （1）现场开会

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，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，不影响计票的效力及表决效力。

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。

如果会议主持人或基金份额持有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。如会议主持人未进行重新清点，而出席会议的基金份额持有人或代理人对会议主持人宣布的表决结果有异议，其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点，会议主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

计票过程应由公证机关予以公证。

## （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不派代表监督计票的，不影响计票效力及表决效力。但基金管理人或基金托管人应当至少提前两个工作日通知召集人，由召集人邀请无直接利害关系的第三方担任监督计票人员。

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、公证机关、公证员姓名等一同公告。

## 8、生效与公告

基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议，召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效，并在生效后方可执行。

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。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定。

基金份额持有人大会决议自生效之日起2个工作日内在指定媒体和基金管理人网站公告。

## （三）基金的投资

### 1、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、债券、权证、以及法律法规或经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金为灵活配置混合型基金，投资组合中股票类资产投资比例为基金资产的30%–80%，固定收益类资产投资比例为基金资产的0–70%，现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金投资于权证、及其它金融工具投资比例遵从法律法规及监管机构的规定。

对于中国证监会允许投资的创新类金融产品（包括未来将推出的股指期货等衍生金融产品），将依据有关法律法规进行投资管理。如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

### 2、投资组合限制

基金的投资组合将遵循以下限制：

- （1）本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的10%；
- （2）本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的10%；

(3) 进入全国银行间同业市场的债券回购融入的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；

(4) 本基金参与股票发行申购，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；

(5) 本基金股票类资产投资比例为基金资产的 30%-80%，固定收益类资产投资比例为基金资产的 0-70%，现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

(6) 本基金投资股权分置改革中产生的权证，在任何交易日买入的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，本基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%。投资于其他权证的投资比例，遵从法律法规或监管部门的相关规定。

(7) 本基金投资资产支持证券的，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%；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，不得超过该基金资产净值的 10%；基金管理人管理的全部证券投资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%；本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过该基金资产净值的 20%。

(8) 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%；

(9) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的 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；

(10) 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；

(11) 本基金不得违反基金合同中有关投资范围、投资策略、投资比例的规定；

(12) 法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。在符合相关法律法规规定的前提下，除第（5）项中“现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%”及第（9）、（10）项外，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等非本基金管理人的因素致使基金的投资组合不符合上述规定的投资比例的，基金管理人

应当在 10 个交易日内进行调整。

若法律法规或监管部门取消上述限制，履行适当程序后，本基金投资可不受上述规定限制。

### 3、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

(1) 承销证券；

(2) 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；

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

## （四）基金费用与税收

### 1、基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

### 2、基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。

### 3、其他费用

除管理费和托管费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

### 4、不列入基金费用的项目

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，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金募集期间所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付，基金收取认购费的，可以从认购费中列支。

## （五）基金收益分配原则、执行方式

### 1、基金收益分配原则：

本基金收益分配应遵循下列原则：

- （1）本基金的每份基金份额享有同等分配权；
- （2）基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值；收益分配时所发生的银行转帐或其他手续费用由投资人自行承担，当投资人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转帐或其他手续费时，基金注册登记机构可将投资人的现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额；
- （3）若基金合同生效不满 3 个月，可不进行收益分配；
- （4）基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；
- （5）基金当期收益应先弥补上期累计亏损后，才可进行收益分配；
- （6）本基金收益每年最多分配八次，每次基金收益分配比例不低于可分配收益的 25%；
- （7）本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，基金投资者可选择现金红利或将现金红利按除息日的基金份额净值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；
- （8）法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

在不影响投资者利益的情况下，基金管理人可在法律法规允许的前提下酌情调整以上基金收益分配原则，但应于变更实施日前在指定媒体和基金管理人网站公告。

### 2、收益分配方案

基金收益分配方案中应载明基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式、支付方式等内容。

### 3、收益分配的时间和程序

(1) 本基金收益分配方案由基金管理人拟定、由基金托管人核实后确定，基金管理人按法律法规的规定公告并向中国证监会备案。

(2) 在分配方案公布后(依据具体方案的规定)，基金管理人就支付的现金红利向基金托管人发送划款指令，基金托管人按照基金管理人的指令及时进行分红资金的划付。

## (六) 基金合同的解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

1、有下列情形之一的，本基金合同经中国证监会核准后将终止：

(1) 基金份额持有人大会决定终止的；

(2) 基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在 6 个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务；

(3) 基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而在 6 个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务；

(4) 中国证监会规定的其他情况。

2、基金资产清算：

(1) 基金资产清算组：基金合同终止时，成立基金清算小组，基金清算小组在中国证监会的监督下进行基金清算。

(2) 基金资产清算组组成：基金资产清算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、律师组成。基金资产清算组可以聘用必要的工作人员。

(3) 基金资产清算组职责：基金资产清算组负责基金资产的保管、清理、估价、变现和分配。基金资产清算组可以依法以自己的名义进行必要的民事活动。

(4) 基金资产清算程序

1) 基金合同终止后，发布基金财产清算公告；

2) 基金合同终止时，由基金财产清算组统一接管基金财产；

3) 对基金财产进行清理和确认；

4) 对基金财产进行估价和变现；

5) 聘请会计师事务所对清算报告进行审计；

6) 聘请律师事务所出具法律意见书；

7) 将基金财产清算结果报告中国证监会；

8) 参加与基金财产有关的民事诉讼；

9) 公布基金财产清算结果；

10) 对基金剩余财产进行分配。

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

基金财产按如下顺序进行清偿：1) 支付基金财产清算费用；2) 缴纳基金所欠税款；3) 清偿基金债务；4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产清算报告于基金合同终止并报中国证监会备案后5个工作日内由基金清算小组公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算结果由基金财产清算小组经中国证监会备案后3个工作日内公告。

### （七）违约责任

1、基金管理人、基金托管人在履行各自职责的过程中，违反《基金法》规定或者本基金合同约定，给基金财产或者基金份额持有人造成损害的，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任；因共同行为给基金财产或者基金份额持有人造成损害的，应当承担连带赔偿责任。但是发生下列情况的，当事人可以免责：

（1）不可抗力；

（2）基金管理人和/或基金托管人按照有效的法律法规或中国证监会的规定作为或不作为而造成的损失等；

（3）在没有故意或重大过失的情况下，基金管理人由于按照基金合同规定的投资原则行使或不行使其投资权而造成的损失等。

2、基金合同当事人违反基金合同，给其他当事人造成经济损失的，应当承担赔偿责任。在发生一方或多方违约的情况下，基金合同能继续履行的，应当继续履行。

3、本基金合同当事一方造成违约后，其他当事方应当采取适当措施防止损失的扩大；没有采取适当措施致使损失扩大的，不得就扩大的损失要求赔偿。守约方因防止损失扩大而支出的合理费用由违约方承担。

4、因当事人之一违约而导致其他当事人损失的，基金份额持有人应先于其他受损方获得赔偿。

5、由于基金管理人、基金托管人不可控制的因素导致业务出现差错，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现错误的，由此造成基金财产或投资人损失，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但是基金管理人和基金托管人应积极采



取必要的措施消除由此造成的影响。

#### **（八）争议解决方式**

对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。

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

本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

#### **（九）基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式。**

本基金合同存放在本基金管理人、基金托管人、销售代理人和注册登记机构的办公场所，投资者可在办公时间免费查阅；按支付工本费后，可在合理时间内取得本基金合同复制件或复印件。投资人也可在基金管理人指定的网站上进行查阅。基金管理人和基金托管人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

## 二十一、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：东吴基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区源深路 279 号(200135)

办公地址：上海市浦东新区源深路 279 号(200135)

法定代表人：王炯

电话：(021) 50509888

传真：(021) 50509884

联系人：贾云鹏

成立时间：2004 年 9 月 2 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证券监督管理委员会证监基金字【2004】132 号

组织形式：有限责任公司（国内合资）

注册资本：1 亿元人民币

存续期间：持续经营

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、中国证监会许可的其他业务

#### 2、基金托管人

名称：中国农业银行股份有限公司（简称中国农业银行）

注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座九层

邮政编码：100031

法定代表人：周慕冰

成立时间：2009 年 1 月 15 日

基金托管资格批准文号：中国证监会证监基字[1998]23 号

组织形式：股份有限公司

注册资金：32,479,411.7 万元人民币

存续期间：持续经营

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；结汇、售汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理

收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；代理资金清算；各类汇兑业务；代理政策性银行、外国政府和国际金融机构贷款业务；贷款承诺；组织或参加银团贷款；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇借款；发行、代理发行、买卖或代理买卖股票以外的外币有价证券；外汇票据承兑和贴现；自营、代客外汇买卖；外币兑换；外汇担保；资信调查、咨询、见证业务；企业、个人财务顾问服务；证券公司客户交易结算资金存管业务；证券投资基金托管业务；企业年金托管业务；产业投资基金托管业务；合格境外机构投资者境内证券投资托管业务；代理开放式基金业务；电话银行、手机银行、网上银行业务；金融衍生产品交易业务；经国务院银行业监督管理机构等监管部门批准的其他业务。

## （二）基金托管人对基金管理人的业务监督、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及基金合同的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、权证、以及法律法规或经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金为灵活配置混合型基金，投资组合中股票类资产投资比例为基金资产的 30%-80%，固定收益类资产投资比例为基金资产的 0-70%，现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金投资于权证、以及其它金融工具投资比例遵从法律法规及监管机构的规定。

对于中国证监会允许投资的创新类金融产品（包括未来将推出的股指期货等衍生金融产品），将依据有关法律法规进行投资管理。如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种，基金管理人履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

### 2、基金托管人对基金投融资比例的监督

基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资、融券比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督：

(1) 本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%；

(2) 本基金与本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过该证券的 10%；

(3) 本基金参与股票发行申购，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；

(4) 进入全国银行间同业市场的债券回购融入的资金余额不超过基金资产净值的 40%；

(5) 本基金投资权证目前遵循下述投资比例限制，若相关法律法规有所修改，本基金权证投资比例限制自动按相关法律法规进行修订，不受下述条款限制：(a) 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 5%；(b) 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%，(c) 本基金与本基金管理人管理的其他基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

(6) 本基金投资资产支持证券目前遵循下述投资比例限制，若相关法律法规有所修改，本基金资产支持证券投资比例限制自动按相关法律法规进行修订，不受下述条款限制：(a) 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%；(b) 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，不得超过该基金资产净值的 10%；(c) 本基金管理人管理的全部证券投资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%；(d) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过该基金资产净值的 20%；

(7) 本基金股票类资产投资比例为基金资产的 30%-80%，固定收益类资产投资比例为基金资产的 0-70%，现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

(8) 本基金管理人管理的、且由本基金托管人托管的全部开放式基金（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、且由本基金托管人托管的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；

(9) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的 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；

(10) 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；

(11) 本基金不得违反基金合同中有关投资范围、投资策略、投资比例的规定；

(12) 法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。

除第 7 项中“现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%”及第 9、10 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的投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内

进行调整。

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。

上述投资组合限制条款中，若属法律法规的强制性规定，则当法律法规或监管部门取消上述限制，本基金自上述限制被取消之日起，不再受上述限制约束。

### 3、基金托管人对基金投资禁止行为及关联交易行为的监督

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。

### 4、基金托管人对基金管理人参与银行间债券市场的监督

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。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进行更新，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，应向基金托管人说明理由，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，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。因交易对手不履行合同造成的基金财产的损失，基金托管人不承担责任并向中国证监会报告。

5、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查。

如果基金管理人未经基金托管人的审核擅自将不实的业绩表现数据印制在宣传推介材料上，则基金托管人对此不承担任何责任，并将在发现后立即报告中国证监会。

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

7、对基金托管人按照法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

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

### （三）基金管理人

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

2、基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、基金合同、本协议及其他有关规定时，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正。基金托管人收到通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金管理人发出回函，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复基金管理人并改正。

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

### （四）基金财产的保管

#### 1、基金财产保管的原则

（1）基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。

（2）基金托管人应安全保管基金财产。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。如果基金财产（包括实物证券）在基金托管人保管期间损坏、灭失的，应由该基金托管人承担赔偿责任。

（3）基金托管人按照规定开设基金财产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，确保基金财产的完整与独立。

（5）基金托管人根据基金管理人的指令，按照基金合同和本协议的约定保管基金财产，如有

特殊情况双方可另行协商解决。

(6) 对于因为基金投资产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金账户的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金财产造成损失的，基金托管人对此不承担任何责任。

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

## 2、募集资金的验资

(1) 基金募集期间的资金应存于基金管理人在具有托管资格的商业银行开设的基金认购专户。该账户由基金管理人开立并管理。

(2) 基金募集期满或基金停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，基金管理人应将属于基金财产的全部资金划入基金托管人开立的基金银行账户，同时在规定时间内，聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的 2 名或 2 名以上中国注册会计师签字方为有效。

(3) 若基金募集期限届满，未能达到基金合同生效的条件，由基金管理人按规定办理退款等事宜，基金托管人应提供充分协助。

## 3、基金的银行账户的开设和管理

(1) 基金托管人应负责本基金的银行账户的开设和管理。

(2) 基金托管人可以本基金的名义在其营业机构开设本基金的银行账户，并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。本基金的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益、收取申购款，均需通过本基金的银行账户进行。

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

(4) 基金资金账户的开立和管理应符合相关法律法规的有关规定。

(5) 在符合法律法规规定的条件下，基金托管人可以通过基金托管人专用账户办理基金资产的支付。

## 4、基金证券账户的开设和管理

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

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

(3) 基金托管人以自身法人名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户，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。结算备付金的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

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

(5) 在本托管协议生效日之后，本基金被允许从事其他投资品种的投资业务，涉及相关账户的开设、使用的，按有关规定开设、使用并管理；若无相关规定，则基金托管人应当比照并遵守上述关于账户开设、使用的规定。

#### 5、债券托管专户的开设和管理

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的有关规定，在中央国债登记结算有限责任公司开立债券托管与结算账户，并代表基金进行银行间市场债券的结算。基金管理人和基金托管人同时代表

基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议。

#### 6、其他账户的开设和管理

因业务发展需要而开立的其他账户，可以根据法律法规和基金合同的规定，在基金管理人和基金托管人商议后由基金托管人负责开立。新账户按有关规则使用并管理。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。

#### 7、基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的有关实物证券、银行定期存款存单等有价凭证由基金托管人负责妥善保管，保管凭证由基金托管人持有。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。属于基金托管人实际有效控制下的实物证券在基金托管人保管期间的损坏、灭失，由此产生的责任应由基金托管人承担。托管人对托管人以外机构实际有效控制的证券不承担保管责任。

#### 8、与基金有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的与基金财产有关的重大合同的原件分别由基金托管人、基金管理人保管。除本协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时，应保证基金一方持有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。如上述合同只有一份正本先由基金管理人取得，则基金管理人应在合同签署后5个工作日内通过专人送



达、挂号邮寄等安全方式将合同原件送达基金托管人处。合同原件应存放于基金管理人和基金托管人各自文件保管部门 15 年以上。

#### （五）基金资产净值计算与会计核算

##### 1、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的金额。

基金份额净值是指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，由此产生的误差计入基金财产。国家另有规定的，从其规定。

每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、复核程序

基金日常估值由基金管理人进行。基金管理人完成估值后，将估值结果加盖业务公章以书面形式加密传真至基金托管人，基金托管人按法律法规、《基金合同》规定的估值方法、时间、程序进行复核，复核无误后在基金管理人传真的书面估值结果上加盖业务公章返回给基金管理人，由基金管理人依据本基金合同和有关法律法规的规定予以公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

#### （六）基金份额持有人名册的保管

本基金的基金管理人和基金托管人须分别妥善保管的基金份额持有人名册，包括基金合同生效日、基金合同终止日、基金权益登记日、基金份额持有人大会权益登记日、每年 6 月 30 日、12 月 31 日的基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容至少应包括持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册由注册登记机构编制，由基金管理人审核并提交基金托管人保管。基金托管人有权要求基金管理人提供任意一个交易日或全部交易日的基金份额持有人名册，基金管理人应及时提供，不得拖延或拒绝提供。

基金管理人应及时向基金托管人提交基金份额持有人名册。每年 6 月 30 日和 12 月 31 日的基金份额持有人名册应于下月前十个工作日内提交；基金合同生效日、基金合同终止日等涉及到基金重要事项日期的基金份额持有人名册应于发生日后十个工作日内提交。

基金管理人和基金托管人应妥善保管基金份额持有人名册，保存期限为 15 年。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。若基金管理人或基金托管人由于自身原因无法妥善保管基金份额持有人名册，应按有关法规规定各自承担相应的责任。

#### （七）托管协议的变更与终止

### 1、托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议的内容进行变更。变更后的托管协议，其内容不得与基金合同的规定有任何冲突。基金托管协议的变更报中国证监会核准后生效。

### 2、基金托管协议终止的情形

发生以下情况，本托管协议终止：

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

## （八）违约责任

1、基金管理人、基金托管人不履行本协议或履行本协议不符合约定的，应当承担违约责任。

2、基金管理人、基金托管人在履行各自职责的过程中，违反《基金法》或者基金合同和本托管协议约定，给基金财产或者基金份额持有人造成损害的，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任；因共同行为给基金财产或者基金份额持有人造成损害的，应当承担连带赔偿责任。

3、当事人违约，给另一方当事人造成损失的，应就直接损失进行赔偿；给基金资产造成损失的，应就直接损失进行赔偿，另一方当事人有权利及义务代表基金向违约方追偿。如发生下列情况，当事人可以免责：

（1）不可抗力；

（2）基金管理人及基金托管人按照当时有效的法律法规或中国证监会的规定作为或不作为而造成的损失等；

（3）在没有故意或重大过失的情况下，基金管理人由于按照基金合同规定的投资原则投资或不投资造成的直接损失或潜在损失等；

4、当事人违约，另一方当事人在职责范围内有义务及时采取必要的措施，尽力防止损失的扩大。

5、违约行为虽已发生，但本托管协议能够继续履行的，在最大限度地保护基金份额持有人利益的前提下，基金管理人和基金托管人应当继续履行本协议。若基金管理人或基金托管人因履行本协议而被起诉，另一方应提供合理的必要支持。

6、由于基金管理人、基金托管人不可控制的因素导致业务出现差错，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现错误的，由此造成基金财产或投资人损失，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但是基金管理人和基金托管人应积极采

取必要的措施消除由此造成的影响。

#### （九）争议解决方式

因本协议产生或与之相关的争议，双方当事人应通过协商、调解解决，协商、调解不能解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，仲裁地点为北京市，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。

争议处理期间，双方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责，各自继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和本托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本协议适用中华人民共和国法律并从其解释。

## 二十二、对基金份额持有人的服务

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

### （一）持有人注册登记服务

基金管理人委托注册登记人为基金份额持有人提供注册登记服务。基金注册登记人配备安全、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、基金份额的登记、管理、托管与转托管，股东名册的管理，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）持有人交易记录查询及定期对账单服务

1、本基金份额持有人可通过基金管理人的客户服务中心查询历史交易记录。

2、定期对账单服务

基金管理人设立客户服务部门。对账单服务分为电子对账单服务和纸质对账单服务。每月度、季度、年度结束后 10 个工作日内，客户服务部门将通过邮件向所有选择电子对账单服务的基金份额持有人发送电子对账单，记录该持有人最近一月度、或一季度或一年度内所有申购、赎回、非交易过户等交易发生的时间、金额、数量、价格以及当前账户的余额等。每年度结束后 30 个工作日内，客户服务部门将向本年度有交易的或持有份额的，且选择纸质对账单服务的基金份额持有人寄送该持有人最近一年度纸质对账单。基金份额持有人也可以通过基金公司网站下载电子对账单或拨打基金公司客服热线索取电子或纸质对账单，亦可通过销售机构网点进行查询。

### （三）红利再投资服务

若基金份额持有人选择红利再投资形式进行基金收益分配，该持有人当期分配所得基金收益将按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额，且不收取任何申购费用。若基金份额持有人不选择此项服务，本基金将按照默认的现金分红方式对红利予以发放。

### （四）定期定额投资计划

在技术条件成熟时，基金管理人可利用直销网点或代理销售网点为投资者提供定期定额投资的服务。通过定期定额投资计划，投资者可以通过固定的渠道，定期定额申购基金份额，具体方法另行公告。

### （五）客户服务中心（Call Center）及网络查询服务

基金份额持有人可以拨打东吴基金管理有限公司的客户服务电话（4008210588）或登录公司网站（www.scfund.com.cn）查询基金账户状况、余额、交易记录、盈亏统计和其他相关基金知识以及进行投诉。

## （六）网络服务

公司网站可为客户提供下列服务：信息定制、在线账户查询、信息下载、专家在线咨询、举办网上活动等。

客户还可通过公司网站直接进行网上交易，享受一站式服务。

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

## 二十三、其他应披露事项

(1) 2018年05月18日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所（巨潮资讯网）等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于参加中国银河证券股份有限公司费率优惠的公告》；

(2) 2018年06月11日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所（巨潮资讯网）等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司旗下基金投资资产支持证券的公告》；

(3) 2018年06月19日在中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站等媒体上公告了《东吴进取策略灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书以及摘要》；

(4) 2018年06月21日在中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站、深交所（巨潮资讯网）等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值方法变更的公告》；

(5) 2018年06月22日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所（巨潮资讯网）等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下基金新增中民财富基金销售（上海）有限公司为代销机构并推出定期定额业务及转换业务的公告》；

(6) 2018年06月22日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所（巨潮资讯网）等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于参加中民财富基金销售（上海）有限公司费率优惠的公告》；

(7) 2018年06月30日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所（巨潮资讯网）等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加交通银行股份有限公司手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告》；

(8) 2018年07月02日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所（巨潮资讯网）等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司管理的基金2018年半年度资产净值公告》；

(9) 2018年07月20日在中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站等媒体上公告了《东吴进取策略灵活配置混合型证券投资基金2018年第2季度报告》；

(10) 2018年07月27日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所（巨潮资讯网）等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于参加国联证券股份有限公司费率优惠的公告》；

(11) 2018年08月16日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所（巨潮资讯网）等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于公司副总经理变更的公告》；

(12) 2018年08月29日在中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站等媒体上公告了

《东吴进取策略灵活配置混合型证券投资基金 2018 年半年度报告及摘要》；

（13）2018 年 08 月 31 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所（巨潮资讯网）等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于公司董事长变更的公告》；

（14）2018 年 09 月 07 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所（巨潮资讯网）等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金开通在东海证券股份有限公司定期定额业务的公告》；

（15）2018 年 09 月 29 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所（巨潮资讯网）等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加交通银行股份有限公司手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告》；

（16）2018 年 10 月 13 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站等媒体上公告了《东吴进取策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告》；

（17）2018 年 10 月 16 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值方法变更的公告》；

（18）2018 年 10 月 17 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值方法变更的公告》；

（19）2018 年 10 月 25 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站等媒体上公告了《东吴进取策略灵活配置混合型证券投资基金 2018 年第 3 季度报告》。

## 二十四、招募说明书存放及查阅方式

本招募说明书存放在本基金管理人、基金托管人、销售代理人和注册登记机构的办公场所，投资者可在办公时间免费查阅；按支付工本费后，可在合理时间内取得本基金招募说明书复制件或复印件。投资人也可在基金管理人指定的网站上进行查阅。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。



## 二十五、备查文件

- (一)中国证监会核准“东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金”募集的文件
- (二)《东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金基金合同》
- (三)《东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金托管协议》
- (四)法律意见书
- (五)基金管理人业务资格批件、营业执照
- (六)基金托管人业务资格批件、营业执照
- (七)中国证监会要求的其他文件

东吴基金管理有限公司

二零一八年十二月二十日