

华夏策略精选灵活配置混合型证券投资基金  
基金合同

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

## 目 录

|                              |    |
|------------------------------|----|
| 一、前言.....                    | 1  |
| 二、释义.....                    | 2  |
| 三、基金的基本情况.....               | 5  |
| 四、基金份额的发售与认购.....            | 5  |
| 五、基金备案.....                  | 6  |
| 六、基金份额的申购、赎回与转换.....         | 7  |
| 七、基金的非交易过户、转托管、冻结与质押等业务..... | 13 |
| 八、基金合同当事人及其权利义务.....         | 13 |
| 九、基金份额持有人大会.....             | 18 |
| 十、基金管理人、基金托管人的更换条件和程序.....   | 23 |
| 十一、基金的托管.....                | 25 |
| 十二、基金的销售.....                | 25 |
| 十三、基金份额的登记结算.....            | 25 |
| 十四、基金的投资.....                | 26 |
| 十五、基金的融资、融券.....             | 33 |
| 十六、基金的财产.....                | 33 |
| 十七、基金资产估值.....               | 33 |
| 十八、基金费用与税收.....              | 36 |
| 十九、基金收益与分配.....              | 38 |
| 二十、基金的会计与审计.....             | 39 |
| 二十一、基金的信息披露.....             | 39 |
| 二十二、基金合同的变更、终止与基金财产的清算.....  | 42 |
| 二十三、违约责任.....                | 44 |
| 二十四、争议的处理.....               | 44 |
| 二十五、基金合同的效力.....             | 45 |
| 二十六、基金管理人和基金托管人签章.....       | 45 |

## 一、前言

(一)订立《华夏策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“本基金合同”)的目的、依据和原则

### 1.订立本基金合同的目的

订立本基金合同的目的是明确本基金合同当事人的权利义务、规范华夏策略精选灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)的运作,保护基金份额持有人的合法权益。

### 2.订立本基金合同的依据

订立本基金合同的依据是《中华人民共和国民法通则》、《中华人民共和国合同法》、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《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“《流动性风险管理规定》”)及其他法律法规的有关规定。

### 3.订立本基金合同的原则

订立本基金合同的原则是平等自愿、诚实信用、充分保护基金份额持有人的合法权益。

(二)本基金由基金管理人依照《基金法》、本基金合同和其他有关法律法规规定募集,并经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)核准。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做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但由于证券投资具有一定的风险,因此不保证投资于本基金一定盈利,也不保证基金份额持有人的最低收益。

(三)本基金合同是约定本基金合同当事人之间基本权利义务的法律文件,其他与本基金相关的涉及本基金合同当事人之间权利义务关系的任何文件或表述,均以本基金合同为准。本基金合同的当事人包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人。基金投资者自依本基金合同取得本基金基金份额,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本基金合同的承认和接受。基金份额持有人作为本基金合同当事人并不以在本基金合同上书面签章为必要条件。本基金合同的当事人按照《基金法》、本基金合同及其他有关法律法规规定享有权利、承担义务。

## 二、释义

本基金合同中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

|              |   |
|--------------|---|
| 基金或本基金：      | 指华夏策略精选灵活配置混合型证券投资基金；   |
| 基金合同或本基金合同：  | 指《华夏策略精选灵活配置混合型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：       | 指《华夏策略精选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》及其定期更新；  |
| 发售公告：        | 指《华夏策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金份额发售公告》；   |
| 托管协议：        | 指《华夏策略精选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》及其任何有效修订和补充；  |
| 中国证监会：       | 指中国证券监督管理委员会；   |
| 中国银监会：       | 指中国银行业监督管理委员会；  |
| 《基金法》：       | 指2003年10月28日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过的自2004年6月1日起施行的《中华人民共和国证券投资基金法》及其不时做出的修订； |
| 《销售办法》：      | 指2004年6月25日由中国证监会公布并于2004年7月1日起施行的《证券投资基金销售管理办法》及其不时做出的修订；                    |
| 《运作办法》：      | 指2004年6月29日由中国证监会公布并于2004年7月1日起施行的《证券投资基金运作管理办法》及其不时做出的修订；                    |
| 《信息披露办法》：    | 指中国证监会2004年6月8日颁布、同年7月1日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及其不时做出的修订；                         |
| 《流动性风险管理规定》： | 指中国证监会2017年8月31日颁布、同年10月1日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订；          |
| 元：           | 指人民币元；  |
| 基金管理人：       | 指华夏基金管理有限公司；  |
| 基金托管人：       | 指中国银行股份有限公司；  |
| 登记结算业务：      | 指本基金登记、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；    |
| 登记结算机构：      | 指办理本基金登记结算业务的机构。本基金的登记结算机构为华夏基金管理有限公司或接受华夏基金管理有限公司委托代为办理本基金登记结                |

|            |  |
|------------|--|
|            | 算业务的机构；  |
| 投资者：       | 指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者；                                       |
| 个人投资者：     | 指依据中华人民共和国有关法律法规可以投资于证券投资基金的自然人；   |
| 机构投资者：     | 指在中国境内合法注册登记或经有权政府部门批准设立和有效存续并依法可以投资于证券投资基金的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织；                         |
| 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》及相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者；                     |
| 基金份额持有人大会： | 指按照本基金合同第九部分之规定召集、召开并由基金份额持有人或其合法的代理人进行表决的会议；  |
| 基金募集期：     | 指基金合同和招募说明书中载明，并经中国证监会核准的基金份额募集期限，自基金份额发售之日起最长不超过 3 个月；                                  |
| 基金合同生效日：   | 指募集结束，基金募集的基金份额总额、募集金额和基金份额持有人人数符合相关法律法规和基金合同规定的，基金管理人依据《基金法》向中国证监会办理备案手续后，中国证监会的书面确认之日； |
| 存续期：       | 指本基金合同生效至终止之间的不定期期限；   |
| 工作日：       | 指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日；  |
| 认购：        | 指在基金募集期内，投资者按照本基金合同的规定申请购买本基金基金份额的行为；  |
| 申购：        | 指在本基金合同生效后的存续期间，投资者申请购买本基金基金份额的行为；   |
| 赎回：        | 指在本基金合同生效后的存续期间，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本基金基金份额的行为；                                    |
| 基金转换：      | 指基金份额持有人按基金管理人规定的条件，申请将其持有的基金管理人管理的某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的、且由同一登记结算机构办理登记结算的其他基金的基金份额的行为；   |
| 转托管：       | 指基金份额持有人将其基金账户内的某一基金的基金份额从一个销售机构托管到另一销售机构的行为；  |
| 投资指令：      | 指基金管理人在运用基金财产进行投资时，向基金托管人发出的资金划拨及实物券调拨等指令；   |
| 代销机构：      | 指符合《销售办法》和中国证监会规定的条件，取得基金代销业务资格  |

|          |   |
|----------|---|
|          | 并接受基金管理人委托，代为办理本基金认购、申购、赎回和其他基金业务的机构；   |
| 销售机构：    | 指基金管理人及本基金代销机构；   |
| 基金销售网点：  | 指基金管理人的直销中心及基金代销机构的代销网点；  |
| 指定媒体：    | 指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊和互联网网站；   |
| 基金账户：    | 指登记结算机构为基金投资者开立的记录其持有的由该登记结算机构办理登记结算的基金份额余额及其变动情况的账户；   |
| 交易账户：    | 指销售机构为投资者开立的记录投资者通过该销售机构办理认购、申购、赎回、转换及转托管等业务而引起的基金份额的变动及结余情况的账户；  |
| 开放日：     | 指为投资者办理基金申购、赎回等业务的工作日；  |
| T 日：     | 指销售机构在规定的开放时间受理投资者申购、赎回或其他业务有效申请的日期；  |
| T+n 日：   | 指 T 日后(不包括 T 日)第 n 个工作日，n 指自然数；   |
| 基金收益：    | 指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约；  |
| 基金资产总值：  | 指基金持有的各类有价证券、银行存款本息、应收申购款以及以其他资产等形式存在的基金财产的价值总和；  |
| 基金资产净值：  | 指基金资产总值减去基金负债后的价值；  |
| 基金份额净值：  | 指以计算日基金资产净值除以计算日基金份额余额所得的单位基金份额的价值；   |
| 基金资产估值：  | 指计算、评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程；   |
| 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； |
| 摆动定价机制：  | 指当开放式基金遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待；                                |
| 法律法规：    | 指中华人民共和国现行有效的法律、行政法规、司法解释、地方法规、地方规章、部门规章及其他规范性文件以及对于该等法律法规的不时修改和补充；   |

|       |   |
|-------|---|
| 业务规则: | 指《华夏基金管理有限公司开放式基金业务规则》，是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金业务方面的规则，由基金管理人和基金投资者共同遵守；                             |
| 不可抗力: | 指任何无法预见、无法克服、无法避免的事件和因素，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、疫情、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律变化、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等。 |

### 三、基金的基本情况

#### (一)基金名称

华夏策略精选灵活配置混合型证券投资基金。

#### (二)基金的类别

混合型，灵活配置混合型，股票投资占基金资产的比例范围为 30%~80%。

#### (三)基金的运作方式

契约型、开放式

#### (四)基金投资目标

通过灵活运用多种投资策略，充分挖掘和利用市场中潜在的投资机会，谋求基金资产的长期、持续增值。

#### (五)基金份额初始面值

人民币 1.00 元

#### (六)基金最低募集份额总额和最低募集金额

本基金的募集份额总额应不少于 2 亿份，基金募集金额不少于 2 亿元人民币。

#### (七)基金存续期限

不定期

### 四、基金份额的发售与认购

#### (一)发售时间

本基金募集期限自基金份额发售之日起不超过 3 个月，具体发售时间由基金管理人根据相关法律法规以及本基金合同的规定确定，并在基金份额发售公告中披露。

#### (二)发售方式

本基金通过各销售机构的基金销售网点向投资者公开发售。

### (三)发售对象

本基金的发售对象为个人投资者、机构投资者(有关法律法规规定禁止购买证券投资基金者除外)和合格境外机构投资者,以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者。

### (四)发售规模

本基金可根据市场情况,对基金发售规模进行限制。具体规模限制可在招募说明书或基金份额发售公告中约定。

### (五)基金认购费用

本基金认购费率不高于认购金额(含认购费)的 2%,实际执行费率在招募说明书中载明。认购费用用于本基金的市场推广、销售、登记结算等募集期间发生的各项费用。

### (六)募集期间认购资金利息的处理方式

本基金的认购款项在基金募集期间产生的利息在基金合同生效后将折算为基金份额,归基金份额持有人所有。利息的具体金额,以登记结算机构的记录为准。

### (七)基金认购的具体规定

投资者认购原则、认购限额、认购份额的计算公式、认购时间安排、投资者认购应提交的文件和办理的手续等事项,由基金管理人根据相关法律法规以及本基金合同的规定确定,并在招募说明书和基金份额发售公告中披露。

## 五、基金备案

### (一)基金备案的条件

本基金募集期限届满,具备下列条件的,基金管理人应当按照规定办理验资和基金备案手续:

- 1.基金募集份额总额不少于 2 亿份,基金募集金额不少于 2 亿元人民币;
- 2.基金份额持有人的人数不少于 200 人。

### (二)基金的备案

基金募集期限届满,具备上述基金备案条件的,基金管理人应当自募集期限届满之日起 10 日内聘请法定验资机构验资,自收到验资报告之日起 10 日内,向中国证监会提交验资报告,办理基金备案手续。

### (三)基金合同的生效

- 1.自中国证监会书面确认之日起,基金备案手续办理完毕,基金合同生效;



2.基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日对基金合同生效事宜予以公告。

#### (四)基金募集失败的处理方式

基金募集期限届满，不能满足基金备案的条件的，则基金募集失败。基金管理人应当：

- 1.以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；
- 2.在基金募集期限届满后 30 日内退还投资者已缴纳的认购款项，并加计银行同期存款利息。

#### (五)基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

本基金合同生效后的存续期内，基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元的，基金管理人应当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和报送解决方案。

法律法规或监管部门另有规定的，按其规定办理。

## 六、基金份额的申购、赎回与转换

### (一)申购与赎回的场所

本基金的销售机构包括基金管理人和基金管理人委托的代销机构。具体的销售网点将由基金管理人在招募说明书、基金份额发售公告或其他公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减代销机构，并予以公告。投资者可以在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金的申购与赎回。

### (二)申购与赎回办理的开放日及时间

#### 1.开放日及开放时间

本基金的开放日为上海证券交易所和深圳证券交易所同时开放交易的工作日。具体业务办理时间以销售机构公布时间为准。

若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整并公告。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资者在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请的，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.申购与赎回的开始时间

本基金自基金合同生效日起不超过 3 个月的时间开始办理赎回。

在确定申购开始时间与赎回开始时间后，由基金管理人最迟于申购或赎回开始前 2 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。

### (三) 申购与赎回的原则

1.“未知价”原则，即基金的申购与赎回价格以受理申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算；

2.基金采用金额申购和份额赎回的方式，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3.投资者办理申购、赎回等业务时应提交的文件和办理手续、办理时间、处理规则等在遵守基金合同和招募说明书规定的前提下，以各销售机构的具体规定为准；

4.当日的申购与赎回申请可以在当日开放时间结束前撤销，在当日的开放时间结束后不得撤销；

5.基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可更改上述原则，但最迟应在新的原则实施前3个工作日予以公告。

### (四) 申购与赎回的程序

#### 1. 申购与赎回申请的提出

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内提出申购或赎回的申请。

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. 申购与赎回申请的确认

基金管理人应在法律法规规定的时限内对基金投资者申购、赎回申请的有效性进行确认。

#### 3. 申购与赎回申请的款项支付

申购采用全额交款方式，若资金在规定时间内未全额到账则申购不成功，已交付的申购款项将退回投资者账户。

投资者赎回申请成交后，基金管理人应按规定向投资者支付赎回款项，赎回款项在自受理基金投资者有效赎回申请之日起不超过7个工作日内划往投资者银行账户。在发生巨额赎回时，赎回款项的支付办法按本基金合同和有关法律法规规定处理。

### (五) 申购与赎回的数额限制

1.本基金申购和赎回的数额限制由基金管理人确定并在招募说明书中列示。

2.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，具体请参见相关公告。

3.基金管理人可根据市场情况，合理调整对申购金额和赎回份额的数量限制，基金管理人进行

前述调整必须提前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定媒体上刊登公告。

#### (六)申购份额与赎回金额的计算方式

1. 申购份额的计算方式：申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除前端申购费用后，以申请当日基金份额净值为基准计算，各计算结果均按照四舍五入方法，保留小数点后两位，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。

2. 赎回金额的计算方式：赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以申请当日基金份额净值的金额，净赎回金额为赎回金额扣除赎回费用、后端申购费用(如有)的金额，各计算结果均按照四舍五入方法，保留小数点后两位，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。

3、当发生大额申购或赎回情形时，按照法律法规及监管要求，在履行适当程序后，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性，具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。

#### (七)申购和赎回的费用及其用途

1. 本基金申购费率最高不超过申购金额的 5%，赎回费率最高不超过赎回金额的 5%。

2. 本基金申购费可在投资者申购基金份额和/或在投资者赎回基金份额时收取。在申购时收取的申购费称为前端申购费，在赎回时收取的申购费称为后端申购费。实际执行的申购费率和收费方式在招募说明书中载明。

3. 本基金的赎回费在投资者赎回基金份额时收取。实际执行的赎回费率和收费方式在招募说明书中载明。

4. 本基金的申购费用由申购人承担，主要用于本基金的市场推广、销售、登记结算等各项费用，不列入基金财产。

本基金的赎回费用由基金份额持有人承担，其中不低于 25% 的部分归入基金财产，其余部分用于支付登记结算费等相关手续费。

本基金对持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5% 的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产。法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

5. 基金管理人可以在法律法规和本基金合同规定范围内调整申购费率、赎回费率或收费方式。费率或收费方式如发生变更，基金管理人应在调整实施 3 个工作日前在至少一种中国证监会指定媒体上刊登公告。

6. 基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对以特定交易方式(如网上交易、电话交易等)等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，经相关销售机构同意，并按相关监管部门要求履行必要

手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率、赎回费率。

#### (八)申购与赎回的登记结算

1.经基金销售机构同意，基金投资者提出的申购和赎回申请，在基金管理人规定的时间之前可以撤销。

2.投资者 T 日申购基金成功后，基金登记结算机构在 T+1 日为投资者增加权益并办理登记结算手续，投资者自 T+2 日起有权赎回该部分基金份额。

3.投资者 T 日赎回基金成功后，基金登记结算机构在 T+1 日为投资者扣除权益并办理相应的登记结算手续。

4.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，并最迟于开始实施前 3 个工作日予以公告。

#### (九)巨额赎回的认定及处理方式

##### 1.巨额赎回的认定

单个开放日中，本基金的基金份额净赎回申请(赎回申请总份额扣除申购总份额后的余额)与净转出申请(转出申请总份额扣除转入申请总份额后的余额)之和超过上一日基金总份额的 10%，为巨额赎回。

##### 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，或认为兑付投资者的赎回申请进行的资产变现可能使基金资产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，应当按单个基金份额持有人申请赎回份额占当日申请赎回总份额的比例，确定该基金份额持有人当日受理的赎回份额；未受理部分除投资者在提交赎回申请时选择将当日未获受理部分予以撤销者外，延迟至下一开放日办理。转入下一开放日的赎回申请不享有赎回优先权，赎回价格为下一个开放日的价格，以此类推，直到全部赎回为止。

(3)当发生巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或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，说明有关处理方法，同时在至少一种中国证监会指定媒体予以公告。

(4)暂停接受和延缓支付：本基金连续 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，但延缓期限不得超过 20 个工作日，并应当在至少一种中国证监会指定媒体公告。

(5)如果基金发生巨额赎回，在单个基金份额持有人超过基金总份额 20% 以上的大额赎回申请情形下，如果基金管理人认为支付全部投资人的赎回申请有困难或认为因支付全部投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人可以延期办理赎回申请。具体分为两种情况：

①如果基金管理人认为有能力支付其他投资人的全部赎回申请，为了保护其他赎回投资人的利益，对于其他投资人的赎回申请按正常程序进行。对于单个投资人超过基金总份额 20% 以上的大额赎回申请，基金管理人在剩余支付能力范围内对其按比例确认当日受理的赎回份额，未确认的赎回部分作自动延期处理。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时选择取消赎回的，则当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。

②如果基金管理人认为仅支付其他投资人的赎回申请也有困难时，则所有投资人的赎回申请（包括单个投资人超过基金总份额 20% 以上的大额赎回申请和其他投资人的赎回申请）都按照上述“（2）部分延期赎回”的约定一并办理。

(十)拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理

1.在如下情况下，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管理人无法受理投资者的申购申请；

(2)证券交易场所交易时间临时停市，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；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；

(4)根据市场情况，基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人的利益的情形；

(5)因基金收益分配、或基金投资组合内某个或某些证券进行权益分派等原因，使基金管理人认为短期内继续接受申购可能会影响或损害现有基金份额持有人利益的；

(6)基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害其他基金份额持有人利益的；

(7)基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过 50%，或者变相规避 50% 集中度的情形时；

(8)法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

基金管理人决定拒绝或暂停接受某些投资者的申购申请时，申购款项将退回投资者账户。基金管理人决定暂停接受全部或部分申购申请时，应当依法公告。在暂停申购的情形消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理并予以公告。

2.在如下情况下，基金管理人可以暂停接受投资者的赎回申请：

(1)因不可抗力导致基金管理人无法支付赎回款项；

(2)证券交易场所交易时间临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；

(3)基金连续 2 个开放日以上发生巨额赎回，根据本基金合同规定，可以暂停接受赎回申请的情况；

(4)发生本基金合同规定的暂停基金资产估值的情况；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赎回申请或延缓支付赎回款项；

(5)法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一的，基金管理人应当在当日向中国证监会备案，并及时公告。已接受的赎回申请，基金管理人应当足额支付；如暂时不能足额支付，应当按单个赎回申请人已被接受的赎回申请量占已接受的赎回申请总量的比例分配给赎回申请人，其余部分在后续开放日予以支付。

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及时公告。

3.暂停基金的申购、赎回时，基金管理人应按规定公告并报中国证监会备案。

4.暂停申购或赎回期间结束，基金重新开放时，基金管理人应按规定公告并报中国证监会备案。

(1)如果发生暂停的时间为一天，基金管理人将于重新开放日，在至少一种中国证监会指定报刊或其他相关媒体，刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并公告最近一个开放日的基金份额净值。

(2)如果发生暂停的时间超过一天但少于两周，暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人将提前一个工作日，在至少一种中国证监会指定报刊或其他相关媒体，刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近一个开放日的基金份额净值。

(3)如果发生暂停的时间超过两周，暂停期间，基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次；当连续暂停时间超过两个月时，可对重复刊登暂停公告的频率进行调整。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 日，在至少一种中国证监会指定报刊或其他相关媒体刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近一个开放日的基金份额净值。

(十一)基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及本基金合同的规定，在条件成熟的情况下提供本基金与基金管理人管理的、且由同一登记结算机构办理登记结算的其他基金之间的转换服务。基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人根据相关法律法规及本基金合同的规定制定并公告。

## 七、基金的非交易过户、转托管、冻结与质押等业务

(一)基金登记结算机构只受理继承、捐赠、司法强制执行和经登记结算机构认可的其他情况下的非交易过户。其中：

“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”仅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的情形；

“司法强制执行”是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人、社会团体或其他组织的情形。

办理非交易过户业务必须提供基金登记结算机构规定的相关资料。

(二)符合条件的非交易过户申请自申请受理日起 2 个月内办理；申请人按基金登记结算机构规定的标准缴纳过户费用。

(三)基金份额持有人可以办理其基金份额在不同销售机构之间的转托管手续。办理转托管业务的基金份额持有人需在原销售机构办理转托管转出手续后 20 个工作日内到新选择的销售机构办理转托管转入手续。对于有效的基金转托管申请，基金份额将在办理转托管转入手续后转入其指定的销售机构。投资者需按销售机构的规定交纳一定的手续费。

(四)基金登记结算机构只受理国家有权机关依法要求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，被冻结部分产生的权益(仅限于红利再投资，不包括现金分红)一并冻结。

(五)根据相关法律法规的规定，登记结算机构将可以办理基金份额的质押业务或其他基金业务，并制定和实施相应的业务规则。

## 八、基金合同当事人及其权利义务

(一)基金管理人

1.基金管理人基本情况

名称：华夏基金管理有限公司

住所：北京市顺义区天竺空港工业区 A 区

法定代表人：杨明辉

成立日期：1998 年 4 月 9 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字[1998]16 号文

组织形式：有限责任公司

注册资本：2.38 亿元人民币

存续期限：100 年

联系电话：400-818-6666

## 2.基金管理人的权利

(1)依法募集基金，办理基金备案手续；

(2)依照法律法规和基金合同独立管理运用基金财产；

(3)在符合法律法规规定的前提下，制订、修改并公布有关基金认购、申购、赎回、转托管、基金转换、非交易过户、冻结、收益分配等方面的业务规则；

(4)在符合法律法规和基金合同的规定的规定的前提下，决定本基金的相关费率结构和收费方式，获得基金管理费，收取认购费、申购费、赎回费及其他经事先核准或公告的合理费用以及法律法规规定的其他费用；

(5)根据法律法规和基金合同的规定销售基金份额；

(6)在本基金合同的有效期限内，在不违反公平、合理原则以及不妨碍基金托管人遵守相关法律法规及其行业监管要求的基础上，基金管理人有权对基金托管人履行本基金合同的情况进行必要的监督，如认为基金托管人违反了法律法规或基金合同规定，对基金财产、其他基金合同当事人的利益造成重大损失的，应及时呈报中国证监会和中国银监会，并采取其他必要措施以保护本基金及相关基金合同当事人的利益；

(7)根据基金合同的规定选择适当的基金代销机构，并有权依照代销协议和有关法律法规对基金代销机构行为进行必要的监督和检查；

(8)自行担任基金登记结算机构或选择、更换基金登记结算代理机构，办理基金登记结算业务，并按照基金合同规定对基金登记结算代理机构进行必要的监督和检查；

(9)在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回的申请；

(10)在法律法规允许的前提下，为基金份额持有人的利益依法为基金进行融资、融券；

(11)依据法律法规和基金合同的规定，制订基金收益分配方案；

(12)依据法律法规，代表基金对被投资企业行使股东权利，代表基金行使因投资于其他证券所



产生的权利；

- (13)在基金托管人职责终止时，提名新的基金托管人；
- (14)依据法律法规和基金合同的规定，召集基金份额持有人大会；
- (15)选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构并确定有关费率；
- (16)法律法规、基金合同规定的其他权利。

### 3.基金管理人的义务

(1)依法募集基金，办理或者委托经国务院证券监督管理机构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)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；

(3)办理基金备案手续；

(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)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；

(7)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；

(8)进行基金会计核算并编制基金的财务会计报告；

(9)依法接受基金托管人的监督；

(10)编制中期和年度基金报告；

(11)采取适当合理的措施使计算开放式基金份额认购、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；

(12)计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；

(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以保密，不得向他人泄露；

(15)按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

(16)保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表、代表基金签订的重大合同和其他相关资料；

(17)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；

(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的合法权益，应承担赔偿责任，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)法律法规、基金合同及国务院证券监督管理机构规定的其他义务。

## (二)基金托管人

### 1.基金托管人基本情况

名称：中国银行股份有限公司

住所：北京市复兴门内大街1号

法定代表人：陈四清

成立日期：1983年10月31日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整

存续期间：持续经营

经营范围：吸收人民币存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；从事同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱服务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外币兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代营外汇买卖；外汇信用卡的发行和代理国外信用卡的发行及付款；资信调查、咨询、见证业务；组织或参加银团贷款；国际贵金属买卖；海外分支机构经营与当地法律许可的一切银行业务；在港澳地区的分行依据当地法令可发行或参与代理发行当地货币；经中国人民银行批准的其他业务。

### 2.基金托管人的权利

(1)依据法律法规和基金合同的规定安全保管基金财产；

(2)依照基金合同的约定获得基金托管费；

(3)监督基金管理人对本基金的投资运作；

- (4)在基金管理人职责终止时，提名新的基金管理人；
- (5)依据法律法规和基金合同的规定，召集基金份额持有人大会；
- (6)法律法规、基金合同规定的其他权利。

### 3.基金托管人的义务

- (1)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)按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；
- (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)对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整和独立；
- (6)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；
- (7)保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- (8)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；
- (9)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以保密，不得向他人泄露；
- (10)办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
- (11)对基金财务会计报告、中期和年度基金报告的相关内容出具意见，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；
- (12)建立并保存基金份额持有人名册；
- (13)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；
- (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)按照规定监督基金管理人的投资运作；
- (18)因违反基金合同导致基金财产损失，应承担赔偿责任，其责任不因其退任而免除；
- (19)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；
- (20)法律法规、基金合同及国务院证券监督管理机构规定的其他义务。

### (三)基金份额持有人

1.基金投资者购买本基金基金份额的行为即视为对基金合同的承认和接受，基金投资者自依据基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同当事人。基金份额持有人作为当事人并不以在基金合同上书面签章为必要条件。每份基金份额具有同等的合法权益。

#### 2.基金份额持有人的权利

- (1)分享基金财产收益；
- (2)参与分配清算后的剩余基金财产；
- (3)依法申请赎回其持有的基金份额；
- (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、基金份额销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；
- (9)法律法规、基金合同规定的其他权利。

#### 3.基金份额持有人的义务

- (1)遵守法律法规、基金合同、业务规则以及其他有关规定；
- (2)缴纳基金认购、申购款项及基金合同规定的费用；
- (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利益的活动；
- (5)执行基金份额持有人大会的决议；
- (6)返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人、基金托管人及其他基金份额持有人处获得的不当得利；
- (7)法律法规及基金合同规定的其他义务。

## 九、基金份额持有人大会

(一)本基金的基金份额持有人大会，由本基金的基金份额持有人或其合法的代理人组成。

(二)有以下情形之一时，应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.提高基金管理人、基金托管人的报酬标准;
- 4.更换基金管理人、基金托管人;
- 5.变更基金类别;
- 6.变更基金投资目标、范围或策略;
- 7.变更基金份额持有人大会程序;
- 8.本基金与其他基金合并;
- 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.法律法规或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

(三)有以下情形之一的,不需召开基金份额持有人大会:

- 1.调低基金管理费率、基金托管费率;
- 2.在法律法规和基金合同规定的范围内变更本基金的申购费率、赎回费率或收费方式;
- 3.经中国证监会允许,基金推出新业务或服务;
- 4.经中国证监会允许,基金管理人、登记结算机构、代销机构在法律法规规定的范围内调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则;
- 5.因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改;
- 6.对基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化;
- 7.对基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响;
- 8.除法律法规或基金合同规定应当召开基金份额持有人大会以外的其他情形。

(四)召集方式

- 1.除法律法规或基金合同另有约定外,基金份额持有人大会由基金管理人召集。
- 2.基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的,应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集,并书面告知基金托管人。

基金管理人决定召集的,应当自出具书面决定之日起 60 日内召开;基金管理人决定不召集,基金托管人仍认为有必要召开的,应当自行召集。

3.代表基金份额 10% 以上(含 10%)的基金份额持有人认为有必要召开基金份额持有人大会的,应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集,并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。

基金管理人决定召集的,应当自出具书面决定之日起 60 日内召开;基金管理人决定不召集,代表基金份额 10% 以上(含 10%)的基金份额持有人仍认为有必要召开的,应当向基金托管人提出书

面提议。

基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开。

4.代表基金份额 10%以上(含 10%)的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，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(含 10%)的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。

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。

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

#### (五)通知

召开基金份额持有人大会，召集人应当于会议召开前 30 天，在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告通知。基金份额持有人大会通知将至少载明以下内容：

- 1.会议召开的时间、地点、方式；
- 2.会议拟审议的主要事项、议事程序和表决方式；
- 3.代理投票授权委托书送达时间和地点；
- 4.会务常设联系人姓名、电话；
- 5.确定有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
- 6.如采用通讯表决方式，还应载明具体通讯方式、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和收取方式、投票表决的截止日以及表决票的送达地址等内容。

采用通讯方式开会并进行表决的情况下，如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。

#### (六)开会方式

基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会。现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席；通讯方式开会指按照基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。会议的召开方式由召集人确定，但决定基金管理人的更换或基金托管人的更换、转换基金运作方式和终止基金合同事宜必须以现场开会方式召开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：

1.亲自出席会议者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、本基金合同和会议通知的规定；

2.经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，全部有效凭证所对应的基金份额占权益登记日基金总份额的 50%以上(含 50%)。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

- 1.召集人按基金合同规定公布会议通知后，在两个工作日内连续公布相关提示性公告；
- 2.召集人在公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见；
- 3.召集人按基金合同规定通知基金托管人或/和基金管理人(分别或共同地称为“监督人”)到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；

4.本人直接出具有效书面意见或授权他人代表出具有效书面意见的基金份额持有人所持有的基金份额占权益登记日基金总份额的 50%以上(含 50%)；

5.直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证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；

6.会议通知公布前已报中国证监会备案。

如果开会条件达不到上述的条件，则召集人可另行确定并公告重新表决的时间，且确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日应保持不变。

采取通讯方式进行表决时，符合法律法规、基金合同和会议通知规定的书面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，但应当计入出具有效书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

#### (七)议事内容与程序

##### 1.议事内容及提案权

(1)议事内容限为本条前述第(二)款规定的基金份额持有人大会召开事由范围内的事项。

(2)基金管理人、基金托管人、代表基金份额 10%以上(含 10%)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。

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

①关联性。大会召集人对于基金份额持有人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。

②程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题做出决定。如将其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。

(4)基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后，如果对原有提案进行修改，应当在基金份额持有人大会召开前及时公告。

(5)基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

## 2. 议事程序

在现场开会的方式下，首先由召集人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议，报经中国证监会核准或备案后生效。在通讯表决开会的方式下，首先由召集人在会议通知中公布提案，在所通知的表决截止日期第二个工作日，在公证机关及监督人的监督下，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，则在公证机关监督下形成的决议有效。决议报经中国证监会核准或备案后生效。

### (八) 表决

1. 基金份额持有人所持每份基金份额享有平等的表决权。

2. 基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

#### (1) 特别决议

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

#### (2) 一般决议

一般决议应当经参加大会的基金份额持有人及代理人所持表决权的 50% 以上多数(不含 50%)通过。

更换基金管理人或者基金托管人、转换基金运作方式或终止基金合同应当以特别决议通过方为有效，其他事项均以一般决议的方式通过即为有效。

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。

### (九) 计票

#### 1. 现场开会

(1)基金份额持有人大会的主持人为召集人授权出席大会的代表，如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推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(如果基金管理人为召集



人，则监督员由基金托管人担任；如基金托管人为召集人，则监督员由基金托管人在出席会议的基金份额持有人中指定)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和代理人中推举两名基金份额持有人代表与基金管理人、基金托管人授权的一名监督员共同担任监票人，但如基金管理人和基金托管人的授权代表未出席，则大会主持人可自行宣布在出席会议的基金份额持有人中推举三名基金份额持有人代表担任监票人。

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

(3)如果大会主持人对于提交的表决结果有怀疑，可以对所投票数进行重新清点；如果大会主持人未进行重新清点，而出席大会的基金份额持有人或者基金份额持有人代理人对大会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，大会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。

## 2.通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在监督人派出的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；如监督人经通知但拒绝到场监督，则大会召集人可自行授权3名监督员进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

## (十)生效与公告

1.基金份额持有人大会按照《基金法》和有关法律法规规定表决通过的事项，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。

2.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、基金托管人均有法律约束力。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。

3.基金份额持有人大会决议应当自中国证监会核准或出具无异议意见后2日内，由基金份额持有人大会召集人在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

4.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。

(十一)法律法规或监管机关对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

## 十、基金管理人、基金托管人的更换条件和程序

### (一)基金管理人和基金托管人的更换条件

1.有下列情形之一的，基金管理人职责终止，须更换基金管理人：

- (1)基金管理人被依法取消基金管理资格；
- (2)基金管理人依法解散、依法被撤销或被依法宣告破产；
- (3)基金管理人被基金份额持有人大会解任；
- (4)法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

2.有下列情形之一的，基金托管人职责终止，须更换基金托管人：

- (1)基金托管人被依法取消基金托管资格；
- (2)基金托管人依法解散、依法被撤销或被依法宣告破产；
- (3)基金托管人被基金份额持有人大会解任；
- (4)法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

(二)基金管理人和基金托管人的更换程序

1.基金管理人的更换程序

原基金管理人退任后，基金份额持有人大会需在 6 个月内选任新基金管理人。在新基金管理人产生前，中国证监会可指定临时基金管理人。

(1)提名：新任基金管理人由基金托管人或代表 10%以上(含 10%)基金份额的基金份额持有人提名。

(2)决议：基金份额持有人大会对更换基金管理人形成有效决议。

(3)核准并公告：基金份额持有人大会决议自通过之日起 5 日内，由大会召集人报中国证监会核准，并应自中国证监会核准后 2 日内在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体上公告。

(4)交接：原基金管理人职责终止的，应当妥善保管基金管理业务资料，及时办理基金管理业务的移交手续，新基金管理人或者临时基金管理人应当及时接收，并与基金托管人核对基金资产总值和净值。

(5)审计并公告：原基金管理人职责终止的，应当按照规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报中国证监会备案。

(6)基金名称变更：基金管理人更换后，本基金应替换或删除基金名称中与原基金管理人有关的名称或商号字样。

2.基金托管人的更换程序

原基金托管人退任后，基金份额持有人大会需在 6 个月内选任新基金托管人。在新基金托管人产生前，中国证监会可指定临时基金托管人。

(1)提名：新任基金托管人由基金管理人或代表 10%以上(含 10%)基金份额的基金份额持有人提

名。

(2)决议：基金份额持有人大会对更换基金托管人形成有效决议。

(3)核准并公告：基金份额持有人大会决议自通过之日起 5 日内，由大会召集人报中国证监会核准，并应自中国证监会核准后 2 日内在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体上公告。

(4)交接：原基金托管人职责终止的，应当妥善保管基金财产和基金托管业务资料，及时办理基金财产和基金托管业务的移交手续，新基金托管人或者临时基金托管人应当及时接收，并与基金管理人核对基金资产总值和净值。

(5)审计并公告：原基金托管人职责终止的，应当按照规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报中国证监会备案。

## 十一、基金的托管

本基金财产由基金托管人依法保管。基金管理人应与基金托管人按照《基金法》、本基金合同及其他有关法律法规规定订立《华夏策略精选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》，以明确基金管理人及基金托管人之间在基金份额持有人名册登记、基金财产的保管、基金财产的管理和运作及相互监督等相关事宜中的权利、义务及职责，确保基金财产的安全，保护基金份额持有人的合法权益。

## 十二、基金的销售

(一)本基金的销售业务指接受投资者申请为其办理的本基金的认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管、定期定额投资和客户服务等业务。

(二)本基金的销售业务由基金管理人及基金管理人委托的其他符合条件的机构办理。基金管理人委托其他机构办理本基金认购、申购、赎回等业务的，应与代理机构签订委托代理协议，以明确基金管理人和代销机构之间在基金份额认购、申购、赎回等事宜中的权利和义务，以确保基金财产的安全，保护基金投资者和基金份额持有人的合法权益。销售机构应严格按照法律法规和本基金合同规定的条件办理本基金的销售业务。

## 十三、基金份额的登记结算

(一)本基金基金份额的登记结算业务指本基金登记、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。

(二)本基金的登记结算业务由基金管理人或基金管理人委托的其他符合条件的机构办理。基金管理人委托其他机构办理本基金登记结算业务的，应与代理机构签订委托代理协议，以明确基金管理人和代理机构在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、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等事宜中的权利和义务，保护基金投资者和基金份额持有人的合法权益。

(三)登记结算机构履行如下职责：

- 1.建立和保管基金份额持有人开户资料、交易资料、基金份额持有人名册等；
- 2.配备足够的专业人员办理本基金的登记结算业务；
- 3.严格按照法律法规和本基金合同规定的条件办理本基金的登记结算业务；
- 4.接受基金管理人的监督；
- 5.保持基金份额持有人名册及相关的申购与赎回等业务记录 15 年以上；
- 6.对基金份额持有人的基金账户信息负有保密义务，因违反该保密义务对投资者或基金带来的损失，须承担相应的赔偿责任，但司法强制检查及按照法律法规的规定进行披露的情形除外；
- 7.按本基金合同及招募说明书、定期更新的招募说明书的规定，为投资者办理非交易过户、转托管等业务，提供基金收益分配等其他必要的服务；
- 8.在法律法规允许的范围内，制定和调整登记结算业务的相关规则；
- 9.法律法规规定的其他职责。

(四)登记结算机构履行上述职责后，有权取得登记结算费。

## 十四、基金的投资

(一)投资目标

通过灵活运用多种投资策略，充分挖掘和利用市场中潜在的投资机会，谋求基金资产的长期、持续增值。

(二)投资范围

本基金可投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法上市交易的股票、债券、资产支持证券、权证及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。在金融衍生产品(如股指期货)推出后，本基金还可依据法律法规的规定履行适当程序后，运用金融衍生产品进行投资风险管理。

其中，本基金股票投资占基金资产的比例范围为 30%~80%，债券投资占基金资产的比例范围

为 0~70%，资产支持证券投资占基金资产净值的比例范围为 0~20%，权证投资占基金资产净值的比例范围为 0~3%，现金以及到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

此外，如法律法规或中国证监会允许基金投资其他品种的，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入本基金的投资范围；如法律法规或中国证监会变更对权证或资产支持证券等投资的比例限制的，基金管理人可在履行适当程序后调整本基金的投资比例上限规定。

### (三)投资策略

#### 1.资产配置策略

本基金将结合宏观经济环境、政策形势、证券市场走势的综合分析，主动判断市场时机，进行积极的资产配置，合理确定基金在股票、债券等各类资产类别上的投资比例，以最大限度地降低投资组合的风险、提高收益。

#### 2.股票投资策略

本基金将灵活运用多种投资策略，充分挖掘和利用市场中潜在的投资机会，实现基金投资目标。其中，基金将综合运用主题和成长两个主要策略，在自上而下的投资主题分析框架下，结合对行业和企业成长性的基本面研究，追求有远见地、准确地把握经济发展和变更中的个股投资机会；基金还将综合运用领先和动量两个辅助性策略，通过对市场氛围和个股价格走势的短期、中期分析，追求更好地把握组合买卖时机和调整节奏。

##### (1)主题策略

投资主题是影响经济发展或企业盈利前景的关键性和趋势性因素，具有动态、前瞻、跨行业或跨地区等特征。主题策略是基于自上而下的投资主题分析框架，综合运用定量和定性分析方法，通过对经济发展过程中的制度性、结构性或周期性趋势的研究和分析，深入挖掘上述趋势得以产生和持续的内在驱动因素以及潜在的投资主题，并选择那些受惠于投资主题的公司进行投资。

主题策略的关键步骤如下：

①主题挖掘：遵循自上而下的分析模式，从经济体制变革、产业结构调整、技术发展创新等多个角度出发，分析经济结构、产业结构或企业商业运作模式变化的根本性趋势以及导致上述根本性变化的关键性驱动因素，从而前瞻性地发掘经济发展过程中的投资主题；

②主题投资：通过对投资主题的全面分析和评估，明确投资主题所对应的主题行业或主题板块，从而确定受惠于相关主题的企业。在此基础上，依据企业对投资主题敏感程度、反应速度以及获益水平等指标，精选个股。那些敏感程度高、反应速度快、获益水平高的企业将是本基金的投资重点。

③主题转换：经济发展呈现多元化动态发展特征，而投资主题可能会随着社会和经济的发展而

有所变化。通过紧密跟踪经济发展趋势及其内在驱动因素的变化，不断地挖掘和研究新的投资主题，并对主题投资方向做出适时调整，从而准确把握新旧投资主题的转换时机，充分分享不同投资主题兴起所带来的投资机遇。

## (2)成长策略

在未来较长时期内，我国经济仍将保持稳定、良好的发展趋势。投资预期利润或收入具有良好增长潜力的成长型公司能够最大限度地分享中国经济成长的成果。

本基金对成长型企业的投资以新兴产业、处于周期性景气上升阶段的拐点行业以及持续增长的传统产业为重点，并精选其中行业代表性高、潜在成长性好、估值具有吸引力的个股进行投资。对于新兴产业，在对产业结构演变趋势进行深入研究和分析的基础上，准确把握新兴产业的发展方向，重点投资体现行业发展方向、拥有核心技术、创新意识领先并已经形成明确盈利模式的公司；对于拐点产业，依据对行业景气变化趋势的研究，结合投资增长率等辅助判断指标，提前发现景气度进入上升周期的行业，重点投资拐点行业中景气敏感度高的公司；对于传统产业，主要关注产业增长的持续性、企业的竞争优势、发展战略以及潜在发展空间，重点投资具有清晰商业模式、增长具有可持续性和不可复制性的企业。

此外，本基金还将以上市公司过去两年的历史成长性和未来两年的预期成长性为核心，通过对上市公司所处行业成长性及其在行业中的竞争地位、包括盈利能力和偿债能力在内的财务状况、企业的经营管理能力及研发能力等多方面的因素进行分解分析，对上市公司的成长性、成长性的可靠性和持续性以及成长性的合理性进行全面评估，更深层次地理解企业成长的基本特征，把握企业高速增长成长阶段的投资时机。

## (3)领先策略

领先策略是对国际上流行的均值反转策略的一种积极运用。国际市场投资经验表明，从长期来看，股票收益率存在均值反转现象，收益率高的股票会逐渐走低，而收益率低的股票会逐渐走高，并均趋向于平均收益。因此，在市场取得一致认识之前，超前发现和介入价值被低估的行业和个股，就可以充分利用市场的均值反转规律，从其价值回归过程中获益。

## (4)动量策略

国际和国内市场的投资经验均表明，个股股价走势在短期内具有连续性。一般来说，收益率高的股票在未来3至12个月的时间内仍然可以保持较高的收益率。因此，利用股价走势的短期连续性特征，适度跟踪当期的市场热点，特别是周期性个股，可以获取一定的短期超额收益。

## 3.债券投资策略

本基金将采取多种积极管理策略，通过严谨的研究发现价值被低估的债券和市场投资机会，构

建收益稳定、流动性良好的债券组合。

#### (1)久期调整策略

根据对市场利率水平的预期，在预期利率下降时，增加组合久期，以较多地获得债券价格上升带来的收益；在预期利率上升时，减小组合久期，以规避债券价格下降的风险。

#### (2)收益率曲线配置策略

在久期确定的基础上，根据对收益率曲线形状变化的预测，采用子弹型策略、哑铃型策略或梯形策略，在长期、中期和短期债券间进行配置，以从长、中、短期债券的相对价格变化中获利。

#### (3)债券类属配置策略

根据国债、金融债、企业债、可转债、资产支持证券等不同债券板块之间的相对投资价值分析，增持价值被相对低估的债券板块，减持价值被相对高估的债券板块，借以取得较高收益。其中，随着债券市场的发展，基金将加强对企业债、可转债、资产支持证券等新品种的投资，主要通过信用风险、内含选择权的价值分析和管理的，获取超额收益。

#### 4.权证投资策略

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

此外，本基金还将积极参与风险低且可控的新股申购、债券回购等投资，以增加收益。未来，随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等，基金还将积极寻求其他投资机会，履行适当程序后更新和丰富组合投资策略。

#### (四)投资管理体制

公司实行投资决策委员会领导下的投资总监负责制。投资决策委员会是公司的最高投资决策机构，负责资产配置和重大投资决策等；投资总监全面负责公司的投资、研究、交易工作，向投资决策委员会报告；基金经理负责所管理基金的日常投资运作；交易管理部负责所有交易的集中执行。

#### (五)投资管理程序

研究、决策、组合构建、交易、评估、组合调整的有机配合共同构成了本基金的投资管理程序。严格的投资管理程序可以保证投资理念的正确执行，避免重大风险的发生。

#### 1.研究

本基金股票投资研究依托公司整体的研究平台，同时整合了外部信息以及券商等外部研究力量的研究成果。公司研究员按行业分工，负责对各行业以及行业内个股进行跟踪研究。在财务指标分析、实地调研和价值评估的基础上，研究员对所研究的股票、行业提交投资建议报告，供基金经理

和投资决策委员会参考。此外，公司有专门的宏观经济研究员，负责分析消费、投资、进出口、就业、利率、汇率以及政府政策等因素，为资产配置决策提供支持。公司还设有固定收益部，专门负责债券投资研究。

## 2. 资产配置决策

投资决策委员会负责判断一段时间内证券市场的基本走势，决定基金资产在股票、债券等资产类别间的分配比例范围。基金经理在投资决策委员会决定的资产配置比例范围内，决定基金的具体资产配置。

## 3. 组合构建

基金经理根据研究员提交的投资报告，结合自身的研究判断，决定具体的投资品种并决定买卖时机，其中重大单项投资决定需经投资决策委员会审批。对于拟投资的个股，基金经理将采取长期关注、择机介入的方法，以降低买入成本、控制投资风险。对于买入的股票，基金的持有周期一般较长，长期持有的操作策略可有效降低基金的交易费用和变现成本，从而提高基金的收益水平。

## 4. 交易执行

交易管理部负责具体的交易执行，同时履行一线监控的职责，监控内容包括基金资产配置、个股投资比例等。

## 5. 风险与绩效评估

风险管理部定期和不定期对基金进行风险和绩效评估，并提供相关报告。风险报告使得投资决策委员会和基金经理能够随时了解组合承担的风险水平以及是否符合既定的投资策略。绩效评估能够确认组合是否实现了投资预期、组合收益的来源及投资策略成功与否，基金经理可以据以检讨投资策略，进而调整投资组合。

## 6. 组合监控与调整

基金经理将跟踪经济状况、证券市场和上市公司的发展变化，结合基金申购和赎回的现金流量情况，以及组合风险与绩效评估的结果，对投资组合进行监控和调整，使之不断得到优化。

基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下，有权根据环境变化和实际需要对上述投资程序做出调整，并在基金招募说明书及其更新中公告。

## (六) 业绩比较基准

本基金股票投资的业绩比较基准为沪深 300 指数，债券投资的业绩比较基准为上证国债指数。基金整体业绩比较基准构成为：

$$\text{基准收益率} = \text{沪深 300 指数收益率} \times 55\% + \text{上证国债指数收益率} \times 45\%$$

未来，如基金变更投资比例范围，或市场中出现代表性更强、投资者认同度更高的指数，或原



指数供应商变更或停止原指数的编制及发布，经基金托管人同意，基金管理人履行适当程序后，可变更本基金的基准指数或权重构成。

#### (七)风险收益特征

本基金是灵活配置型混合基金，混合基金的风险高于货币市场基金和债券基金，低于股票基金；而灵活配置型混合基金的资产配置比例可灵活调整，在混合基金中也属于较高风险、较高收益的品种。

#### (八)投资禁止行为与限制

##### 1.禁止用本基金财产从事以下行为：

- (1)承销证券；
- (2)向他人贷款或者提供担保；
- (3)从事承担无限责任的投资；
- (4)买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
- (5)向其基金管理人、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、行政法规有关规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

##### 2.基金投资组合比例限制

- (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)本基金与本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券总和，不超过该证券的 10%；
- (3)基金财产参与股票发行申购时，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)本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%；
- (5)本基金持有的全部权证市值不得超过基金资产净值的3%；
- (6)本基金与由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%；
- (7)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%；
- (8)本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；

(9)本基金与本基金管理人管理的其他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%；

(10)本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

(11)现金以及到期日在 1 年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；

(12)本基金管理人管理的全部开放式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%；

(13)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%；

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

(15)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；

(16)法律法规和基金合同规定的其他限制。

3.若将来法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更，致使本款前述约定的投资禁止行为和投资组合比例限制被修改或取消的，基金管理人在履行适当程序后，本基金可相应调整禁止行为和投资限制规定。

#### (九)投资组合比例调整

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约定。除 (11)、(14)、(15) 项另有约定外，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不符合基金合同约定的投资比例规定的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

对于因基金份额拆分、大比例分红等集中持续营销活动引起的基金净资产规模在 10 个交易日内增加 10 亿元以上的情形，而导致证券投资比例低于基金合同约定的，基金管理人同基金托管人协商一致并及时书面报告中国证监会后，可将调整时限从 10 个交易日延长到 3 个月。法律法规另有规定时，从其规定。

## 十五、基金的融资、融券

本基金可以按照国家的有关法律法规规定进行融资、融券。

## 十六、基金的财产

### (一)基金资产总值

本基金基金资产总值包括基金所持有的各类有价证券、银行存款本息、基金的应收款项和其他投资所形成的价值总和。

### (二)基金资产净值

本基金基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

### (三)基金财产的账户

本基金根据相关法律法规、规范性文件开立基金资金账户以及证券账户，上述账户与基金管理人和基金托管人自有的财产账户以及其他基金财产账户独立。

### (四)基金财产的保管及处分

- 1.本基金财产独立于基金管理人及基金托管人的固有财产，并由基金托管人保管。
- 2.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，归基金财产。
- 3.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范围。
- 4.基金财产的债权不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债务相抵销；不同基金财产的债权债务，不得相互抵销。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

## 十七、基金资产估值

### (一)估值目的

基金资产的估值目的是客观、准确地反映基金资产的价值，并为基金份额的申购、赎回、转换等提供计价依据。

### (二)估值日

本基金合同生效后，每个开放日对基金财产进行估值。

### (三)估值对象

基金所持有的股票、债券和银行存款本息、应收款项和其他投资等资产。

#### (四)估值方法

##### 1.股票估值方法

(1)上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值。

(2)未上市股票的估值：

①首次发行未上市的股票，按成本或估值技术确定公允价值；

②送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价估值；

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估值；

④非公开发行有明确锁定期的流通受限股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

(3)在任何情况下，基金管理人如采用本项第(1)、(2)小项规定的方法对基金财产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人有足够的理由认为按本项第(1)、(2)小项规定的方法对基金财产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

(4)国家有最新规定的，按其规定进行估值。

##### 2.债券估值方法：

(1)证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价(净价)估值；

(2)证券交易所市场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（自债券计息起始日或上一付息日至估值当日的利息）得到的净价进行估值，估值日没有交易的，以最近交易日计算的净价估值；

(3)交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用成本或估值技术确定公允价值；

(4)未上市债券采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量；

(5)在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；

(6)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；

(7)在任何情况下，基金管理人如采用本项第(1)-(6)小项规定的方法对基金财产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人有足够的理由认为按本项第(1)-(6)小项规定的方法对基金财产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人在综合考虑市场成交价、市场

报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上形成债券估值，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值；

(8)国家有最新规定的，按其规定进行估值。

### 3.权证估值方法

(1)基金持有的权证，从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的权证按估值日在证券交易所挂牌的该权证的收盘价估值；

未上市交易的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，按成本计量；因持有股票而享有的配股权，采用估值技术确定公允价值。

(2)在任何情况下，基金管理人如采用本项第(1)小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人有足够的理由认为按本项第(1)小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值；

(3)国家有最新规定的，按其规定进行估值。

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

### 5.其他资产的估值方法

其他资产按照国家有关规定或行业约定进行估值。

### (五)估值程序

基金日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行。基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以书面形式报给基金托管人，基金托管人按本基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人，由基金管理人对外公布。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)暂停估值的情形

- 1.基金投资所涉及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财产价值时；
- 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确认后，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。

### (七)基金份额净值的确认

用于基金信息披露的基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人进行复核。基金管理人

应于每个开放日交易结束后计算当日的基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金份额净值予以公布。

基金份额净值的计算精确到 0.001 元，小数点后第四位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

#### (八)估值错误的处理

1.当基金资产的估值导致基金份额净值小数点后 3 位（含第 3 位）内发生差错时，视为基金份额净值估值错误。

2.基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当计价错误达到或超过基金份额净值的 0.25%时，基金管理人应当报中国证监会备案；当计价错误达到或超过基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告，并报中国证监会备案。

3.前述内容如法律法规或监管机构另有规定的，按其规定处理。

#### (九)特殊情形的处理

1.基金管理人按本条第(四)款有关估值方法规定的第 1 项中的第(3)小项条款、第 2 项中的第(7)小项条款、第 3 项中的第(2)小项条款进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

2.由于不可抗力原因，或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

## 十八、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.因基金的证券交易或结算而产生的费用(包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费及其他类似性质的费用等)；
- 4.基金合同生效以后的信息披露费用；
- 5.基金份额持有人大会费用；
- 6.基金合同生效以后的会计师费和律师费；
- 7.基金的资金汇划费用；

8.按照国家有关法律法规规定或经中国证监会认定可以列入的其他费用。

在中国证监会允许的前提下，本基金可以在履行适当程序后从基金财产中计提销售服务费，具体计提方法、计提标准在招募说明书或相关公告中载明。

## (二)基金费用计提方法、计提标准和支付方式

### 1.基金管理人的管理费

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的1.5%年费率计提。

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：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

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，基金托管人复核后于次月首日起10个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

### 2.基金托管人的托管费

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的0.25%年费率计提。

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：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，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，基金托管人复核后于次月首日起10个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

3.本条第(一)款第3至第8项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付，并列入或摊入当期基金费用。

## (三)不列入基金费用的项目

本条第(一)款约定以外的其他费用，以及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等不列入基金费用。

## (四)基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。

## (五)税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

## 十九、基金收益与分配

### (一)收益的构成

1.基金收益包括：基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券差价、银行存款利息以及其他收入。

2.因运用基金财产带来的成本或费用的节约应计入收益。

3.基金净收益为基金收益扣除按照有关法律法规规定可以在基金收益中扣除的费用等项目后的余额。

### (二)收益分配原则

1.每一基金份额享有同等分配权；

2.基金当期收益先弥补前期亏损后，方可进行当期收益分配；

3.基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；

4.如果基金投资当期出现亏损，则不进行收益分配；

5.在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年最多分配 12 次，每次基金收益分配比例不低于可分配收益的 20%；

6.基金份额持有人可以选择取得现金或将所获红利再投资于本基金。选择采取红利再投资形式的，分红资金将按分红权益再投资日的基金份额净值转成相应的基金份额(具体以届时的基金分红公告为准)；如果基金份额持有人未选择收益分配方式，则默认为现金方式；

7.法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

### (三)收益分配方案

基金收益分配方案中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、分配方式及有关手续费等内容。

### (四)收益分配方案的确定与公告

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，基金管理人按法律法规的规定向中国证监会备案并公告。

### (五)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，登记结算机构自动将该基金份额持有人的现金红利按分红权益再投资日的基金份额净值转为基金份额(具体以届时的基金分红公告为准)。



## 二十、基金的会计与审计

### (一)基金会计政策

- 1.基金的会计年度为公历每年1月1日至12月31日。
- 2.基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位。
- 3.会计核算制度按国家有关的会计核算制度执行。
- 4.本基金独立建账、独立核算。
- 5.本基金会计责任人为基金管理人。
- 6.基金管理人应保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关法律法规规定编制基金会计报表，基金托管人定期与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

### (二)基金审计

- 1.基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相独立的、具有从事证券相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师等对基金年度财务报表及其他规定事项进行审计；
- 2.会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意；
- 3.基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须经基金托管人同意，并报中国证监会备案。基金管理人应在更换会计师事务所后2日内公告。

## 二十一、基金的信息披露

本基金的信息披露按照《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》及其实施准则、本基金合同及其他有关规定办理。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至少一种中国证监会指定媒体披露，并保证投资者能够按照基金合同约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

### (一)基金招募说明书、基金合同、基金托管协议

基金募集申请经中国证监会核准后，基金管理人应当在基金份额发售的3日前，将招募说明书、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各自公司网站上。

基金合同生效后，基金管理人应当在每6个月结束之日起45日内，更新招募说明书并登载在网站上，将更新后的招募说明书摘要登载在指定报刊上。基金管理人应当在公告的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。

## (二)基金份额发售公告

基金管理人应当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。

## (三)基金合同生效公告

基金管理人应当在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。

## (四)基金资产净值、基金份额净值公告

基金合同生效后,在开始办理基金份额申购或者赎回前,基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值。

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

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前述最后一个市场交易日的次日,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。

## (五)定期报告

基金定期报告由基金管理人按照法律法规和中国证监会颁布的有关证券投资基金信息披露内容与格式的相关文件的规定编制,由基金托管人按照法律法规的规定对相关内容进行复核。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。

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

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

3.基金季度报告:基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内,编制完成基金季度报告,并将季度报告登载在指定报刊和网站上。

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

4.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。

如报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额20%的情形,为保障其他投资者的权益,基金管理人至少应当在基金定期报告“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产品的特有风险,中国证监会

认定的特殊情形除外。

5.法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定。

#### (六)临时报告与公告

基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在2日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。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事件，包括：

- 1.基金份额持有人大会的召开；
- 2.终止基金合同；
- 3.转换基金运作方式；
- 4.更换基金管理人、基金托管人；
- 5.基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- 6.基金管理人股东及其出资比例发生变更；
- 7.基金募集期延长；
- 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50%；
- 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30%；
- 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0.5%；
- 18.基金改聘会计师事务所；
- 19.基金变更、增加、减少基金代销机构；
- 20.基金更换基金登记结算机构；
- 21.基金开始办理申购、赎回；
- 22.基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；

- 23.基金发生巨额赎回并延期支付;
- 24.基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请;
- 25.基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回;
- 26.基金推出新业务或服务;
- 27.基金份额持有人大会的决议;
28. 本基金发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项;
- 29.基金管理人采用摆动定价机制进行估值;
- 30.中国证监会规定的其他事项。

#### (七)信息披露文件的存放与查阅

招募说明书公布后,应当分别置备于基金管理人、基金托管人和基金代销机构的住所,投资者可免费查阅。投资者在支付工本费后,可在合理时间内取得上述文件复印件。

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,投资者可免费查阅。投资者在支付工本费后,可在合理时间内取得上述文件复印件。

## 二十二、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### (一)基金合同的变更

1.变更基金合同涉及法律法规规定或本基金合同第九条第(二)款约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的,应召开基金份额持有人大会决议通过。

2.变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案,并自中国证监会核准或出具无异议意见之日起生效。

3.但如变更基金合同的事项属于本基金合同第九条第(三)款约定的情形,可不经基金份额持有人大会决议,而经基金管理人和基金托管人同意修改后公布,并报中国证监会备案。

### (二)基金合同的终止

有下列情形之一的,本基金合同应当终止:

- 1.基金份额持有人大会决定终止的;
- 2.因重大违法、违规行为,被中国证监会责令终止的;
- 3.基金管理人、基金托管人职责终止,在6个月内没有新基金管理人、基金托管人承接的;
- 4.法律法规规定和经中国证监会认定的其他情形。

### (三)基金财产的清算

1.基金合同终止时，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。

## 2.基金财产清算组

(1)自基金合同终止事由发生之日起 30 个工作日内，由基金管理人组织成立基金财产清算组。在基金财产清算组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

(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。

## 3.清算程序

(1)基金合同终止情形发生后，由基金财产清算组统一接管基金财产；

(2)基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；

(3)基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；

(4)对基金财产进行评估和变现；

(5)制作清算报告；

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

(7)将清算报告报中国证监会备案并公告；

(8)对基金财产进行分配。

## 4.清算费用

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

## 5.基金剩余财产的分配

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)、(2)、(3)项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

## 6.基金财产清算的公告

基金财产清算组做出的清算报告经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，报中国

证监会备案并公告。

7.基金财产清算账册及文件由基金托管人保存 15 年以上。

### 二十三、违约责任

(一)本基金合同当事人不履行本基金合同或履行本基金合同不符合约定的，应当承担违约责任。

(二)因基金管理人或基金托管人违约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。

(三)一方当事人违反本基金合同，给其他基金合同当事人或基金财产造成损失的，应承担相应的赔偿责任。

(四)发生下列情况的，当事人可以免责：

1.不可抗力：基金管理人及基金托管人因不可抗力不能履行本基金合同的，可根据不可抗力的影响部分或全部免除责任，但法律法规另有规定的除外；任何一方迟延履行基金合同后发生不可抗力的，不能免除责任；

2.基金管理人和/或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.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。

(五)在发生一方或多方当事人违约的情况下，基金合同能够继续履行的应当继续履行。

(六)本基金合同当事人一方违约后，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。

### 二十四、争议的处理

(一)本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

(二)本基金合同的当事人之间因本基金合同产生的或与本基金合同有关的争议可通过友好协商解决，但若自一方书面提出协商解决争议之日起 60 日内争议未能以协商方式解决的，则任何一方有权将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会，根据提交仲裁时该会的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。

(三)除争议所涉内容之外，本基金合同的其他部分应当由本基金合同当事人继续履行。

## 二十五、基金合同的效力

(一)本基金合同是基金合同当事人之间的法律文件。基金合同于投资者缴纳认购的基金份额的款项时成立，自基金募集结束报中国证监会备案并获中国证监会书面确认后生效。

(二)本基金合同的有效期限自其生效之日起至本基金财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止。

(三)本基金合同自生效之日起对包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人在内的基金合同各方当事人具有同等的法律约束力。

(四)本基金合同正本一式六份，除上报有关监管机构一式二份外，基金管理人、基金托管人各持有二份，每份具有同等的法律效力。

(五)本基金合同存放在基金管理人和基金托管人住所。投资者可登录基金管理人和基金托管人网站查询。

## 二十六、基金管理人和基金托管人签章

见下页。

(本页为《华夏策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》签署页，无正文)

基金管理人：华夏基金管理有限公司 (盖章)

法定代表人或其授权代表(签字):

签订地：北京市

签订日： 年 月 日

基金托管人：中国银行股份有限公司(盖章)

法定代表人或其授权代表(签字):

签订地：北京市

签订日： 年 月 日