

---

# 上投摩根全球天然资源混合型证券投资基金

## 招募说明书（更新）

基金合同生效日期:2012年3月26日  
基金管理人:上投摩根基金管理有限公司  
基金托管人:中国银行股份有限公司

### 重要提示:

1. 基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整;
2. 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;
3. 投资有风险,投资人认购(或申购)基金时应当认真阅读本招募说明书;
4. 基金的过往业绩并不预示其未来表现;
5. 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。
6. 本招募说明书根据中国证监会于2019年7月26日颁布、同年9月1日实施的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的规定以及本基金的基金合同及托管协议的修订更新了相关章节,并更新了“基金管理人”章节中的相关内容,截止日为2020年3月31日;本招募说明书所载其他内容截止日为2019年3月25日,基金投资组合及基金业绩的数据截止日为2018年12月31日。

二〇二〇年四月

---

## 目 录

一、绪言.....	3
二、释义.....	3
三、风险揭示.....	8
四、基金的投资.....	12
五、基金的业绩.....	27
六、基金管理人.....	28
七、境外投资顾问及境外托管人.....	37
八、基金的募集及基金合同的生效.....	46
九、基金的申购与赎回.....	47
十、基金的费用与税收.....	58
十一、基金的资产.....	61
十二、基金资产的估值.....	62
十三、基金的收益分配.....	66
十四、基金的会计与审计.....	67
十五、基金的信息披露.....	68
十六、基金合同的终止与基金资产的清算.....	73
十七、基金托管人.....	76
十八、相关服务机构.....	77
十九、基金合同的内容摘要.....	89
二十、基金托管协议的内容摘要.....	106
二十一、对基金份额持有人的服务.....	121
二十二、招募说明书的存放及查阅方式.....	122
二十三、其他应披露事项.....	122
二十四、备查文件.....	123

---

## 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》）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》（以下简称《试行办法》）、《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》）及其他有关法律法规以及《上投摩根全球天然资源混合型证券投资基金基金合同》编写。

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的资料申请募集。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书作任何解释或者说明。

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

## 二、释义

基金招募说明书中除非文意另有所指，下列词语具有如下含义：

- |               |  |
|---------------|--|
| 基金或本基金：       | 指上投摩根全球天然资源混合型证券投资基金；                      |
| 基金合同：         | 指《上投摩根全球天然资源混合型证券投资基金基金合同》及对该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《上投摩根全球天然资源混合型证券投资基金招募说明书》及其更新；           |

---

托管协议：	指《上投摩根全球天然资源混合型证券投资基金托管协议》及其任何有效修订和补充；
发售公告：	指《上投摩根全球天然资源混合型证券投资基金发售公告》；
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；
外管局：	指国家外汇管理局；
《证券法》：	指《中华人民共和国证券法》；
《合同法》：	指《中华人民共和国合同法》；
《基金法》：	指《中华人民共和国证券投资基金法》；
《信息披露办法》：	指中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布并于 2019 年 9 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及不时作出的修订；
元：	如无特指，指人民币；
基金合同当事人：	指受本《基金合同》约束，根据本《基金合同》享受权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人；
基金管理人：	指上投摩根基金管理有限公司；
基金托管人：	指中国银行股份有限公司；
境外托管人：	指基金托管人委托的、负责基金境外财产的保管、存管、清算等业务的金融机构；
投资顾问：	是指符合《试行办法》规定的条件，根据合同为基金管理人境外证券投资提供证券买卖建议或投资组合管理等服务并取得收入的境外金融机构；
注册登记业务：	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；
注册登记机构：	指办理本基金注册登记业务的机构。本基金的注册登

---

	记机构为上投摩根基金管理有限公司或接受上投摩根基金管理有限公司委托代为办理本基金注册登记业务的机构；
投资者：	指个人投资者、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；
合格境外机构投资者：	指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理办 法》及相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法 募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者；
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；
基金合同当事人：	指受基金合同约定，根据基金合同享有权利并承担义 务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金 份额持有人；
基金份额持有人：	指依招募说明书和基金合同合法取得本基金基金份 额的投资者；
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 不超过三个月；
基金合同生效日：	基金募集达到法律规定及基金合同约定的条件，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,获得中国证监会书面确认之日；
存续期：	指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；
开放日：	指销售机构办理本基金份额申购、赎回等业务的工作 日；
认购：	指在基金募集期内，投资者按照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卖出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其他基金的基金份额的行为；
定期定额投资：	指投资者通过有关销售机构提出申请，约定每期扣款日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资者指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式；
转托管：	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：	指基金管理人或其委托的第三方机构在运用基金资产进行投资时，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其他条件，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；
指定媒介：	指中国证监会指定的用以进行信息披露的全国性报刊、互联网网站（包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介；
基金产品资料概要	指《上投摩根全球天然资源混合型证券投资基金基金产品资料概要》及其更新；
基金账户：	指注册登记机构为基金投资者开立的记录其持有的由该注册登记机构办理注册登记的基金份额余额及

---

	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；
T 日：	指销售机构受理投资者申购、赎回或其他业务申请的工作日；
T+n 日：	指自 T 日起第 n 个工作日（不包括 T 日）
基金收益：	指基金投资所得红利、股息、买卖证券价差、银行存款利息及其他合法收入；
基金资产总值：	指基金购买的各类证券、银行存款本息、应收申购款以及其他资产等形式存在的基金资产的价值总和；
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总额后得出的基金份额财产净值；
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；
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；
不可抗力：	指基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件。
《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；
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。

### 三、风险揭示

本基金作为一种新兴的大众投资工具，具有自身的优势和巨大的发展潜力。但本基金并不同于银行存款或国债等无风险的投资工具，它不能保证投资人一定获得盈利，也不保证最低收益，是一种收益共享、风险共担的集合投资工具。投资本基金主要面临以下风险：

#### （一）本基金特有风险

##### 1、大宗商品价格波动风险

本基金主要投资于全球天然资源领域内的从事天然资源的勘探、开发、生产及销售，或是向天然资源行业提供服务的上市公司，主要包括三大行业：（1）能源，如石油和天然气的开采、加工、销售及运输等；能源设备及服务；（2）基本金属和矿石，如铜、铝等基本金属的采矿与加工生产；（3）贵金属，如黄金、铂等。这些行业的盈利与前景与全球大宗商品市场的价格表现息息相关，大宗商品价格的上涨和下跌都将影响到天然资源行业上市公司的经营业绩，进而影响到其股价表现。由于全球大宗商品市场是一个价格波动频繁的市场，而且大宗商品的价格受到包括经济周期、汇率、供求众多因素的影响，因而在大宗商品价格大幅波动的情况下，从事与大宗商品有关的天然资源行业的企业也面临着来自大宗商品市场的风险。

##### 2、配置风险

配置风险是指本基金投资组合由于（1）法律、法规限定等无法配置到业绩比较基准中的部分投资品种，或者（2）比较基准的相关市场没有合适的匹配品种反映该市场的表现，或者（3）本管理人基于研究判断希望通过主动投资管理来追寻超额收益，从而带来的本基金投资组合与比较基准偏离的风险。

#### （二）境外投资风险

证券市场价格会因为国际政治环境、宏观和微观经济因素、国家政策、投资人风险收益偏好和市场流动程度等各种因素的变化而波动，将对本基金资产产生潜在风险，这种风险主要包括：



---

## 1、海外市场风险

由于本基金投资于海外证券市场，因此基金的投资绩效将受到不同国家或地区的金融市场和总体经济趋势的影响，而且适用的法律法规可能会与国内证券市场有诸多不同。例如，各国对上市公司的会计准则和信息披露要求均存在较大的区别，投资市场监管严格的发达国家比投资经济状况波动较大的发展中国家市场风险要小。此外，相对于国内市场的规则来说，由于有的国家或地区对每日证券交易价格并无涨跌幅上下限的规定，因此这些国家或地区证券的每日涨跌幅空间相对较大。以上所述因素可能会带来市场的急剧下跌，从而带来投资风险的增加。

## 2、政治风险

政治风险是指基金投资的某些境外国家或地区出现大的变化，如政府更迭、政策调整、制度变革、国内出现动乱、对外政治关系发生危机等，这些事件都会甚至造成限制资金自由流动等结果。当以上这些与当地政治环境有关的事件在本基金所投资的国家或地区发生时，当地证券市场价格因而发生波动，基金的投资收益会受到影响。

## 3、经济周期风险

证券市场受宏观经济运行的影响，而经济运行具有周期性的特点。随着经济运行的周期性变化，国家或地区经济、各个行业及上市公司的盈利水平也呈周期性变化，从而影响到证券市场走势，对基金收益产生影响。

## 4、汇率风险

指经济主体持有或运用外汇的经济活动中，因汇率变动而蒙受损失的可能性。投资者使用人民币申购本基金，本基金将人民币换为外币后投入境外市场，投资者赎回本基金时获得的为人民币。由于人民币汇率在未来存在不确定性，因此，投资本基金存在一定的汇率风险。

## 5、利率风险

金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。息票利率、期限和到期收益率水平都将影响债券的利率风险水平，企业的融资成本和利润。基金投资于债券和债券回购，其收益水平可能会受到利率变化和货币市场供求状况的影响。

### **(三) 开放式基金风险**

#### 1、流动性风险

---

开放式基金要随时应对投资者的赎回，如果基金资产不能迅速转变成现金，或者变现为现金时使资金净值产生不利的影响，都会影响基金运作和收益水平。尤其是在发生巨额赎回时，如果基金资产变现能力差，可能会产生基金仓位调整的困难，导致流动性风险，可能影响基金份额净值。同时，由于本基金涉及跨境交易，其赎回到帐期通常需要比现有开放式基金更长的时间。

## 2、操作风险

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

## 3、大额赎回风险

本基金为开放式基金，基金规模将随着投资人对基金单位的申购赎回而不断变化，若是由于投资人的连续大量赎回而导致基金管理人被迫以低于目标价格抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响。

## 4、交易结算风险

在基金的投资交易中，因交易的对手方无法履行对一位或多位的交易对手的支付义务而使得基金在投资交易中蒙受损失的可能性。

## 5、会计核算风险

会计核算风险主要是指由于会计核算及会计管理上违规操作形成的风险或错误，通常是指基金管理人在计算、整理、制证、填单、登账、编表、保管及其相关业务处理中，由于客观原因与非主观故意（包括但不限于信息的准确性，及时性，完整性）所造成的行为过失，从而对基金收益造成影响的风险。

## 6、税务风险

税务风险指在基金投资中与股息收入和资本利得相关的税法发生变化、令股票的吸引力减弱或者股票的回报减少的风险。

基金投资者应知悉并自主判断在其营运地、住所地、居住地、国籍所在地或成立地对认购、持有、转让、赎回本基金份额以及本基金的分红（任一前述事项称为“相关事项”）相关的税收。基金及基金管理人均不对与任一相关事项（或相关事项的组合）有关的税收后果作出任何陈述与保证或承担任何责任。且基金及基金管理人在此进一步明确将拒绝承担任何与任一签署相关事项（或相关事项的

---

组合)有关的税收后果所导致的责任或损失。

## 7、金融模型风险

投资管理人在有时会使用金融模型来进行资产定价、趋势判断、风险评估等辅助其做出投资决策。但是金融模型通常是建立在一系列的学术假设之上的,投资实践和学术假设之间存在一定的差距;而且金融模型结论的准确性往往受制于模型使用的数据的精确性。因此,投资者在使用金融模型时,面临出现错误结论的可能性,从而承担投资损失的风险。

## 8、衍生品投资风险

### (1) 衍生品流动性风险

指衍生工具持有者不能以合理的价格迅速地卖出或将该工具转手而导致损失的可能性,包括不能对头寸进行冲抵或套期保值的风险。一般说来,采用在价格不变或较小价位波动的情况下,能够卖出或买入衍生工具的数量或金额来衡量流动性的大小。如果能够卖出或买入的数量或金额较大,则该衍生工具的流动性较好;反之,流动性则较差。

### (2) 衍生品操作风险

指在金融衍生交易和结算中,由于内部控制系统不完善或缺乏必要的后台技术支持而导致的风险。具体包括两类:一是由于内部监管体系不完善、经营管理上出现漏洞、工作流程不合理等带来的风险;二是由于各种偶发性事故或自然灾害,如电脑系统故障、通讯系统瘫痪、地震、火灾等给衍生品交易者造成损失的可能性。决定营运风险的形成及大小的主要因素包括管理漏洞和内部控制失当、交易员操作不当以及会计处理偏差等。

### (3) 法律风险

指由于衍生合约在法律上无效、合约内容不符合法律的规定,或者由于税制、破产制度的改变等法律上的原因,给衍生工具交易者带来损失的可能性。法律风险主要发生在柜台市场交易中。

法律风险主要来自两个方面:一是衍生合约的不可实施性,包括合约潜在的非法性,对手缺乏进行衍生交易的合法资格,以及现行的法律法规发生变更而使衍生合约失去法律效力等;二是交易对手因经营不善等原因失去清偿能力或不能依照法律规定对其为清偿合约进行对冲平仓。

## 9、信用风险

---

信用风险是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,都可能导致基金资产损失和收益变化。一般认为:国债的信用风险较低,而其它债券的信用风险可按专业机构的信用评级确定,信用等级变化或市场对某一信用等级水平下债券率的变化都会迅速的改变债券的价格,从而影响到基金资产。通常来讲,低信用级别机构所发行的债券会提供高于其他优质信用级别债券的回报,但也会伴随着更大的损失的风险。

#### 10、不可抗力风险

战争、自然灾害、政府行为等不可抗力可能导致基金资产有遭受损失的风险,以及证券市场、基金管理人可能因不可抗力无法正常工作,从而有影响基金的赎回按正常时限完成的风险。

## 四、基金的投资

### (一) 投资目标

本基金主要投资于全球范围内从事天然资源的勘探、开发、生产及销售,或是向天然资源行业提供服务的公司的股票,通过积极主动的资产配置和组合管理,在风险可控的前提下以获取长期资产增值。

### (二) 基准货币

人民币

### (三) 投资范围

本基金投资组合中股票及其它权益类证券市值占基金资产的 60%-95%,现金、债券及中国证监会允许投资的其它金融工具市值占基金资产的 5%-40%,并保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股票及其他权益类证券包括中国证监会允许投资的普通股、优先股、存托凭证、公募股票基金等。现金、债券及中国证监会允许投资的其它金融工具包括银行存款、可转让存单、回购协议、短期政府债券等货币市场工具;政府债券、公司债券、可转换债券、债券基金、货

---

币基金等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；中国证监会认可的境外交易所上市交易的金融衍生产品等。

本基金将投资于全球多元化的股票组合，本基金股票及其它权益类资产中将有不低于80%的部分投资于全球天然资源领域内从事天然资源的勘探、开发、生产及销售，或是向天然资源行业提供服务的上市公司，主要包括三大行业：（1）能源，如石油和天然气的开采、加工、销售及运输等；能源设备及服务；（2）基本金属和矿石，如铜、铝等基本金属的采矿与加工生产；（3）贵金属，如黄金、铂等。所投资的股票在GICS行业分类标准中分类为：能源和原材料。

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。

#### **（四）投资理念**

随着全球人口数量的增长和社会经济的发展，全球对天然资源的需求正与日俱增，特别是以新兴市场为代表的广大发展中国家和地区正成为石油、天然气、矿产品等天然资源消耗的主要地区。天然资源的稀缺及不可再生性与需求不断扩大之间的矛盾正日益突显其战略价值，从长期来看天然资源的价值在逐渐提升。从近期来看，由于全球金融危机后各国政府尤其是欧美国家在市场上投放大量流动性，实行宽松的货币政策，造成大量资金进入到大宗商品领域，更推高了各大宗资源品的价格，这使得从事天然资源的勘探、开发、生产及销售，或是向天然资源行业提供服务的公司获益明显。本基金通过深入挖掘发现全球天然资源领域内相关行业上市公司的投资机会，优化资产配置，采用行业和企业相结合的寻股方式，实现资产的增值。

#### **（五）投资策略**

全球天然资源的稀缺与人类对其需求的不断增长的矛盾日益突显，这显示了天然资源具有极大的战略价值，该行业的相关上市公司也具有良好的投资机会。本基金将充分分享全球天然资源行业未来的高增长成果，审慎把握全球天然资源的投资机会，争取为投资者带来长期稳健回报。

总体上本基金将采取自上而下与自下而上相结合的投资策略。首先通过考察

---

不同国家的发展趋势及不同行业的景气程度，决定地区与板块的基本布局；其次采取自下而上的选股策略，在对股票进行基本面分析的同时，通过深入研究股票的价值与动量特性，选取目标投资对象。在固定收益类投资部分，本基金将综合考虑资产布局的安全性、流动性与收益性，并结合现金管理要求等来制订具体策略。

## 1、股票投资策略

### 1) 国家与行业分析

本基金将对重点考察不同国家和地区的宏观经济发展趋势、经济结构、行业景气、劳动力水平等指标，同时比较不同国家和地区股票市场的整体估值，为估值水平进行排序，选取出具备明显国际比较优势和投资价值的国家和地区。同时，对不同国家或地区的资本市场状况进行回顾和预测，判断在投资期间内该国或地区的资本市场是否会发生有利或不利变化，进而影响在该市场交易的天然资源类相关股票的市场表现。在行业层面，主要分析影响投资范围内各行业景气程度和商品价格涨跌的驱动因素，进而分析该驱动因素对各个相关行业、相关商品以及相关上市公司带来的影响，分析投资于某种资源类商品相关上市公司的相对价值，确定基金资产在不同行业内的配置。同时针对在全球经济一体化的条件下，不同行业周期、各国家与地区行业政策以及不同行业当前发展趋势，加强配置发展前景良好或景气程度上升的行业。

### 2) 价值与动量分析

基于本基金投资理念，主要利用价值及动量指标对初选股票进行排序，精选出同时具备投资价值和趋势明确的个股。具体来说，本基金首先基于公司财务数据，运用价值型股票选股模型，选取具有估值优势的股票。价值型股票的研判指标主要包括：市净率(P/B ratio)、市盈率(P/E ratio)、市值与现金盈利率(P/CE ratio)及股利收益率(Dividend Yield)等。利用估值指标对个股排序，精选出预期未来具备长期投资价值的股票。同时，本基金将深入研究股票的历史走势，通过分析股票的长期、中期及短期价格变动(Price yield)，结合对股价未来走势的预测，筛选出具备明确上升惯性趋势的股票。

### 3) 基本面分析

本基金将利用基本面分析研判市场结构性变化与长期趋势，进一步改善投资策略模型的选股结果。国家/地区行业分析师将从区域角度甄别企业经营特质、

---

企业财务质量、企业管理能力等，结合具体市场特征优化股票选择。企业经营特质的分析要点包括公司的经营模式、资源储量、产量增长、市场地位及发展前景等；企业财务质量分析要点包括公司的盈利能力及资产质量等；企业管理能力分析要点包括管理团队的领导能力、计划实施能力及资金管理能力等。通过多方面进行综合分析和对比，对公司层面各种因素做出整体判断，筛选投资机会。

#### 4) 股票组合构建

股票组合构建将进一步体现本基金投资理念，利用价值与动量择股策略，挖掘多重独立超额收益来源，同时综合考虑市场流动性、汇率风险、组合集中度等，优化组合风险收益特征，构建出能够持续创造超额回报的股票投资组合。

### 2、固定收益类投资策略

本基金将根据风险防御及现金替代性管理的需要，适度进行债券投资。本基金将分别对对新兴市场 and 成熟市场中不同国家和地区宏观经济发展情况、财政政策、货币政策、以及利率走势进行分析的基础上，综合考查利率风险、信用和流动性风险对债券内在价值的影响，构建固定收益类投资组合，以追求长期低波动率的稳健回报。

### 3、衍生品投资策略

本基金将以组合避险或有效管理为目标，本着谨慎原则，进行风险识别，适度参与衍生品投资。本基金的衍生品投资方向主要包括以下：

汇率衍生品：本基金将在宏观经济、货币政策、市场环境分析的基础上，结合专业判断从事远期合约、外汇期货、外汇互换等操作，以控制外汇汇兑风险。

指数衍生品：通过分析各市场走势，结合量化模型预测，参与指数期货或指数期权的投资，主要目的用于套期保值及有效组合管理。

本基金衍生品投资不表示组合风险得以完全规避。

## (六) 业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：欧洲货币矿产、黄金及能源指数（Euromoney Mining, Gold&Energy Index）。

欧洲货币矿产、黄金及能源指数将矿产类、黄金类和能源类公司的股票进行计算并编制，能够有效地反映出全球天然资源行业股票的价格走势。如果今后有

---

更具有代表性的、更适合用于本基金的业绩比较基准，本基金将根据实际情况予以调整，在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

### **（七）风险收益特征**

本基金为混合型投资基金，主要投资于海外市场的天然资源行业的股票，本基金的业绩表现在大多数的情况下与国际大宗商品价格的走势具有较高的相关性。本基金的预期风险收益水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金，属于较高风险和较高预期收益的基金品种。本基金风险收益特征会定期评估并在公司网站发布，请投资者关注。

### **（八）投资决策**

#### **1、投资决策模式**

本基金的投资决策采用投资决策委员会集体决策与基金经理授权决策相结合的分级模式。由投资决策委员会决定资产配置、投资原则等宏观决策；由基金经理负责组合构建、品种选择、汇率管理等具体决策。投资决策委员会由公司总经理、主管投资的副总经理、投资总监、资深基金经理、研究总监等组成，投资决策委员会定期举行会议，讨论决定境外投资基金的股票、固定收益、现金的资产配置比例、地区资产配置、行业配置、金融衍生产品使用、避险保值策略和外汇管理等重大策略。基金经理向投资决策委员会汇报投资运作情况，并提出建议；基金经理可以邀请境外投资顾问的代表列席参加投资决策委员会，提供建议；投资决策委员会对所议内容在成员间达成共识后形成决议，无法达成共识时，由投资决策委员会主席做最后裁定。投资决策委员会应就每次会议决议情况制作书面报告，向总经理提交，并为监察稽核提供查核依据。

#### **2、境外投资顾问协助**

本基金境外投资顾问将提供海外市场投资建议。投资团队会不定期通过参加不同区域研讨会、亲自拜访投资标的进行投资分析以及参考券商研究成果外，也将定期通过会议与境外投资顾问交流分析所投资市场、产业与各股的投资前景，境外投资顾问藉此协助本基金投研团队检视与监督本基金组合中的投资项目。境



---

外投资顾问在投资流程中提供的协助以投资顾问协议为准。

### 3、投资管理运作

构建投资组合是基金经理职责，构建过程中有如下基本原则：

（1）遵守基金目标，基于收益预期、风险预测和可供参考的业绩比较基准的深入了解与分析；

（2）遵守投资决策委员会对资产配置、国家配置、行业配置、金融衍生品、避险保值和外汇管理方面的决议；

（3）参考来自境外投资顾问的投资观点，来自全球多资产小组的资产配置建议，来自全球货币小组的汇率管理建议，来自各个国家/地区研究专员对投资范围内的公司进行策略评级和股票评级。

（4）允许基金经理在基金风险预测允许的情况下进行判断，对于高风险承受能力的基金给予较高判断空间。允许判断对于那些积极、有创造力的基金经理很重要，但需受到投资总监严密监控。

（5）基金经理在地区权重、策略分类和股票评级的基础上决定每只股票在组合中的仓位，并在等级评定和组合要求之间出现反常因素时进行调整，以符合本基金投资组合的管理需求。

### 4、投资组合风险管理

本基金在投资组合的风险控制上将重点关注两个指标，跟踪误差（Tracking Error）和标准差（Standard Deviation）。本基金根据以上两个指标，对基金投资组合的风险进行评估，并且根据控制流程，对风险进行适当管理。

针对上述风险控制指标，本基金将执行一套行之有效的风险监控体系。首先，本基金将通过 Barra Aegis 股票投资组合风险管理系统，定期（每月）观察上述风险控制指标。其次，本基金对风险指标进行量化分析，产生风险报表，并通过多因素模型（MFM）进一步分析，提供风险分解、风险指标的暴露度、行业的

---

暴露度与边际风险贡献的丰富数据，以辅助基金管理人动态和更加合理地实现投资组合风险管理。最后，本基金将进行关键风险控制指标的逐月比较，对于发生较大变化的风险控制指标，将向投资决策委员会进行汇报，以检讨基金的实际运作是否存在问题。

## （九）投资限制

### 1.组合限制

本基金在投资策略上兼顾投资原则以及开放式基金的固有特点，通过分散投资降低基金资产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。基金的投资组合将遵循以下限制：

(1) 本基金持有同一家银行的存款不得超过基金净值的 20%，银行应当是中资商业银行在境外设立的分行或在最近一个会计年度达到中国证监会认可的信用评级机构评级的境外银行，但在基金托管账户的存款不受此限制。

(2) 本基金持有同一机构（政府、国际金融组织除外）发行的证券市值不得超过基金净值的 10%；

(3) 本基金持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产市值不得超过基金资产净值的 10%，其中持有任一国家或地区市场的证券资产市值不得超过基金资产净值的 3%；

(4) 本基金不得购买证券用于控制或影响发行该证券的机构或其管理层。同一境内机构投资者管理的全部基金不得持有同一机构 10% 以上具有投票权的证券发行总量；

前项投资比例限制应当合并计算同一机构境内外上市的总股本，同时应当一并计算全球存托凭证和美国存托凭证所代表的基础证券，并假设对持有的股本权证行使转换；

---

(5) 本基金持有非流动性资产市值不得超过基金净值的 10%；

前项非流动性资产是指法律或基金合同规定的流通受限证券以及中国证监会认定的其他资产；

(6) 同一境内机构投资者管理的全部基金持有任何一只境外基金，不得超过该境外基金总份额的 20%；

(7) 本基金持有境外基金的市值合计不得超过本基金净值的 10%，持有货币市场基金不受上述限制。

(8) 本基金投资组合中股票及其它权益类证券市值占基金资产的 60%-95%，现金、债券及中国证监会允许投资的其它金融工具市值占基金资产的 5%-40%；

(9) 保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

(10) 本基金的金融衍生品全部敞口不得高于本基金资产净值的 100%；

(11) 本基金投资期货支付的初始保证金、投资期权支付或收取的期权费、投资柜台交易衍生品支付的初始费用的总额不得高于基金资产净值的 10%；

(12) 本基金投资于远期合约、互换等柜台交易金融衍生品，应当符合以下要求：

(a) 所有参与交易对手方（中资商业银行除外）应当具有不低于中国证监会认可的信用评级机构评级。

(b) 交易对手方应当至少每个工作日对交易进行估值，并且基金可在任何时候以公允价值终止交易。

(c) 任一交易对手方的市值计价敞口不得超过基金资产净值的 20%。

(13) 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股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 15%；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。

(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) 相关法律法规、基金合同及中国证监会的其他规定。

为有效管理投资组合和规避风险，本基金可适当投资于远期合约、期货合约、期权、掉期等衍生金融工具。金融衍生品投资应当符合法律法规及中国证监会有关规定。

法律法规或中国有关监管部门取消上述限制，本基金不受上述限制。《基金法》及其他有关法律法规或监管部门调整上述限制的，履行适当程序后，基金可依据届时有有效的法律法规适时合理地调整上述限制。

因证券市场波动、上市公司合并分拆、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定的投资比例的，除上述第（9）、（14）、（15）条所述情况外，基金管理人应当在 30 个工作日内进行调整。但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

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 个工作日内增加 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 30 个工作日延长到 3 个月。

#### （十）禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金资产不得用于下列投资或者活动：

- 1、购买不动产。
- 2、购买房地产抵押按揭。
- 3、购买贵金属或代表贵金属的凭证。
- 4、购买实物商品。
- 5、除应付赎回、交易清算等临时用途以外，借入现金。该临时用途借入现金的比例不得超过本基金资产净值的 10%。
- 6、利用融资购买证券，但投资金融衍生品除外。
- 7、参与未持有基础资产的卖空交易。
- 8、从事证券承销业务。
- 9、向他人贷款或者提供担保；
- 10、从事承担无限责任的投资；
- 11、买卖其他基金份额，但是监管部门另有规定的除外；
- 12、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、境外资产托管人发行的股票或者债券；
- 13、买卖与其基金管理人、基金托管人、境外资产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；

14、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；

15、不公平对待不同客户或不同投资组合。

16.除法律法规规定以外，向任何第三方泄露客户资料。

17、依照法律法规有关规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

(十一) 若法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更，致使现行法律法规的投资禁止行为和投资组合比例限制被修改或取消，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。

#### (十二) 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。因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资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30个交易日内进行调整。法律法规另有规定时，从其规定。

#### (十三) 基金管理人代表基金行使所投资证券产生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债权人权利，保护基金投资者的利益；

2、有利于基金资产的安全与增值。

#### (十四) 基金的投资组合报告

##### 1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	105,144,719.90	92.44

	其中：普通股	93,938,705.78	82.59
	存托凭证	11,206,014.12	9.85
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	8,406,902.74	7.39
8	其他各项资产	192,677.36	0.17
9	合计	113,744,300.00	100.00

## 2 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家（地区）	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例（%）
美国	37,449,558.73	33.37
英国	36,310,966.83	32.36
加拿大	17,356,606.57	15.47
瑞典	4,875,908.29	4.34
澳大利亚	2,881,791.07	2.57
葡萄牙	2,786,336.97	2.48
挪威	2,741,410.04	2.44

中国香港	742,141.40	0.66
合计	105,144,719.90	93.69

注：国家（地区）类别根据其所在的证券交易所确定，ADR、GDR按照存托凭证本身挂牌的证券交易所确定。

### 3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
金属与采矿	57,659,789.31	51.38
石油、天然气与消费用燃料	46,394,420.96	41.34
化学制品	1,090,509.63	0.97
合计	105,144,719.90	93.69

注：行业分类标准：MSCI

### 4 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及存托凭证投资明细

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券 代码	所在 证 券市 场	所属 国家 (地 区)	数量 (股)	公允价值(人 民币元)	占基金 资产净 值比例 (%)
1	BHP Billiton plc	必和 必拓	BLT LN	伦敦 证 券 交 易 所	英国	83,118.00	11,910,486.85	10.61
2	Rio Tinto plc	力拓 有 限 公 司	RIO LN	伦敦 证 券 交 易 所	英国	20,353.00	6,586,683.86	5.87



3	Exxon Mobil Corp	埃克森美孚	XOM US	纽约证券交易所	美国	13,490.00	6,313,341.69	5.63
4	Glencore plc	嘉能可	GLEN LN	伦敦证券交易所	英国	232,590.00	5,879,435.34	5.24
5	Royal Dutch Shell plc	荷兰皇家壳牌	RDSB LN	伦敦证券交易所	英国	25,251.00	5,126,535.79	4.57
6	Total SA	道达尔	TOT US	纽约证券交易所	美国	11,901.00	4,262,007.26	3.80
7	Vale SA	淡水河谷	VALE US	纽约证券交易所	美国	46,677.00	4,225,463.80	3.77
8	BP plc	英国石油	BP US	纽约证券交易所	美国	79,772.00	3,432,558.32	3.06
9	Chevron Corp	雪佛龙	CVX US	纽约证券交易所	美国	4,529.00	3,381,566.65	3.01
10	Lundin	-	LUPE	斯德	瑞典	16,833.00	2,884,997.33	2.57

	Petroleum AB		SS	哥 尔 摩 证 券 交 易 所				
--	-----------------	--	----	--------------------------------------	--	--	--	--

注：1. 所用证券代码采用 Ticker 代码。

2. 所属国家（地区）列示证券挂牌的证券交易所所在国家（地区）。

#### 5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资 投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资 投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

#### 9 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基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

#### 10 投资组合报告附注

10.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

10.2 报告期内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。

10.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	102,122.83
4	应收利息	614.00
5	应收申购款	89,940.53
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	192,677.36

#### 10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入的原因，投资组合报告中分项之和与合计数可能存在尾差。

## 五、基金的业绩

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

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
2012/03/26-2012/12/31	-1.70%	1.08%	-3.75%	1.20%	2.05%	-0.12%
2013/01/01-2013/12/31	-20.96%	1.07%	-22.00%	1.24%	1.04%	-0.17%

2014/01/01-2014/12/31	-18.40%	0.93%	-14.11%	1.03%	-4.29%	-0.10%
2015/01/01-2015/12/31	-28.55%	1.50%	-25.00%	1.78%	-3.55%	-0.28%
2016/01/01-2016/12/31	44.15%	1.34%	66.91%	1.64%	-22.76%	-0.30%
2017/01/01-2017/12/31	9.95%	0.87%	13.21%	0.84%	-3.26%	0.03%
2018/01/01-2018/12/31	-10.72%	1.08%	-5.17%	1.05%	-5.55%	0.03%

## 六、基金管理人

### (一) 基金管理人简况

本基金的基金管理人为上投摩根基金管理有限公司，基本信息如下：

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富城路 99 号震旦国际大楼 25 层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区富城路 99 号震旦国际大楼 25 层

法定代表人：陈兵

总经理：王大智

成立日期：2004 年 5 月 12 日

实缴注册资本：贰亿伍仟万元人民币

股东名称、股权结构及持股比例：

上海国际信托有限公司 51%

JPMorgan Asset Management (UK) Limited 49%

上投摩根基金管理有限公司是经中国证监会证监基字[2004]56 号文批准，于 2004 年 5 月 12 日成立的合资基金管理公司。2005 年 8 月 12 日，基金管理人完成了股东之间的股权变更事项。公司注册资本保持不变，股东及出资比例分别由上海国际信托有限公司 67%和摩根资产管理（英国）有限公司 33%变更为目前的 51%和 49%。

2006 年 6 月 6 日，基金管理人的名称由“上投摩根富林明基金管理有限公司”变更为“上投摩根基金管理有限公司”，该更名申请于 2006 年 4 月 29 日获得中国证监会的批准，并于 2006 年 6 月 2 日在国家工商总局完成所有变更相关手续。

2009 年 3 月 31 日，基金管理人的注册资本由一亿五千万人民币增加到二亿五千万人民币，公司股东的出资比例不变。该变更事项于 2009 年 3 月 31 日在国家工商总局完成所有变更相关手续。

基金管理人无任何受处罚记录。

---

## (二)主要人员情况

### 1. 董事会成员基本情况:

**董事长：陈兵**

博士研究生，高级经济师。

曾任上海浦东发展银行大连分行资金财务部总经理，上海浦东发展银行总行资金财务部总经理助理，上海浦东发展银行总行个人银行总部管理会计部、财富管理部总经理，上海国际信托有限公司副总经理兼董事会秘书，上海国际信托有限公司党委副书记、总经理。

现任上海国际信托有限公司党委书记、总经理；上投摩根基金管理有限公司董事长。

**董事：Paul Bateman**

大学本科学位。

曾任 Chase Fleming Asset Management Limited 全球总监、摩根资产管理全球投资管理业务行政总裁。

现任摩根资产管理全球主席、资产管理营运委员会成员及投资委员会成员。

**董事：Daniel J. Watkins**

学士学位。

曾任欧洲业务副首席执行官、摩根资产欧洲业务首席运营官、全球投资管理运营总监、欧洲运营总监、欧洲注册登记业务总监、卢森堡运营总监、欧洲注册登记业务及伦敦投资运营经理、富林明投资运营团队经理等职务。

现任摩根资产管理亚洲业务首席执行官、资产管理运营委员会成员、集团亚太管理团队成员。

**董事：Richard Titherington**

牛津大学政治、哲学和经济硕士学位。

曾任摩根资产管理环球新兴市场股票投资部总监。

现任摩根资产管理董事总经理、新兴市场及亚太股票组别投资总监。

**董事：王大智**

学士学位。

曾任摩根资产管理香港及中国基金业务总监、摩根投信董事长暨摩根资产管

---

理集团台湾区负责人。

现任上投摩根基金管理有限公司总经理。

董事：陈海宁

研究生学历、经济师。

曾任上海浦东发展银行金融部总经理助理、公投总部贸易融资部总经理、武汉分行副行长、武汉分行党委书记、行长。

现任上海浦东发展银行总行资产负债管理部总经理。

董事：丁蔚

硕士研究生。

曾就职于中国建设银行上海分行个人银行业务部副总经理，上海浦东发展银行个人银行总部银行卡部总经理，个人银行总部副总经理兼银行卡部总经理。

现任上海浦东发展银行总行零售业务部总经理。

董事：林仪桥

硕士研究生、会计师、经济师。

曾任浦发银行总行资金总部投资组合业务部总经理助理，浦发银行总行金融市场部总经理助理，海口分行行长助理(挂职)，浦发银行总行金融机构部总经理助理。

现任浦发银行总行金融机构部副总经理和金融市场部（深圳）副总经理。

独立董事：刘红忠

国际金融系经济学博士。

现任复旦大学经济学院教授，复旦大学金融研究中心副主任；同时兼任华泰证券股份有限公司、上海农村商业银行股份有限公司、申银万国期货有限责任公司、东海期货有限责任公司及兴业证券股份有限公司独立董事、上海建工集团股份有限公司外部董事。

独立董事：汪棣

美国加州大学洛杉矶分校金融专业工商管理硕士学位，并先后获得美国加州注册会计师执照和中国注册会计师证书。

曾担任普华永道金融服务部合伙人及普华永道中国投资管理行业主管合伙人。

现担任招商证券股份有限公司、复星联合健康保险股份有限公司、亚太财产

---

保险有限公司及 51 信用卡有限公司独立董事、中国台湾旭昶生物科技股份有限公司监事。

独立董事：曾翀

英国特许公认会计师公会资深会员。

曾任香港赛马会集团财务总监，香港证监会产品咨询委员会委员，协康会名誉司库和执行委员会和投资小组委员会成员，戴麟趾爵士康乐基金、警察子女教育信托基金和警察教育及福利信托基金投资咨询委员会主席，香港房屋协会资金管理特设委员会成员，以及另类投资管理协会（AIMA）全球投资者指导委员会成员。

现为独立顾问，宝积资本控股有限公司独立非执行董事以及安联环球投资香港有限公司兼职顾问。

## 2. 监事会成员基本情况：

监事会主席：赵峥嵘

硕士学位，高级经济师。

历任工商银行温州分行副行长、浦发银行温州分行副行长、行长及杭州分行行长等职务。现任上海国际信托有限公司监事长、党委副书记。

监事：梁斌

学士学位。

曾在高伟绅律师事务所（香港）任职律师多年。

现任摩根大通集团中国法律总监。

监事：张军

曾任上投摩根基金管理有限公司交易部总监、基金经理、投资组合管理部总监、投资绩效评估总监、国际投资部总监、组合基金投资部总监。

现任上投摩根基金管理有限公司投资董事，管理上投摩根亚太优势混合型证券投资基金、上投摩根全球天然资源混合型证券投资基金和上投摩根全球多元配置证券投资基金（QDII）。

监事：万隽宸

曾任上海国际集团有限公司高级法务经理，上投摩根基金管理有限公司首席风险官，尚腾资本管理有限公司董事。

现任尚腾资本管理有限公司总经理。

---

### 3. 总经理基本情况:

王大智先生，总经理  
学士学位。

曾任摩根资产管理香港及中国基金业务总监、摩根投信董事长暨摩根资产管理集团台湾区负责人。

### 4. 其他高级管理人员情况:

杨红女士，副总经理

毕业于同济大学，获技术经济与管理博士

曾任招商银行上海分行稽核监督部业务副经理、营业部副经理兼工会主席、零售银行部副总经理、消费信贷中心总经理；曾任上海浦东发展银行上海分行个人信贷部总经理、个人银行发展管理部总经理、零售业务管理部总经理。

杜猛先生，副总经理

毕业于南京大学，获经济学硕士学位。

历任天同证券、中原证券、国信证券、中银国际研究员；上投摩根基金管理有限公司行业专家、基金经理助理、基金经理、总经理助理/国内权益投资一部总监兼资深基金经理。

孙芳女士，副总经理

毕业于华东师范大学，获世界经济学硕士学位。

历任华宝兴业基金研究员；上投摩根基金管理有限公司行业专家、基金经理助理、研究部副总监、基金经理、总经理助理/国内权益投资二部总监兼资深基金经理。

郭鹏先生，副总经理

毕业于上海财经大学，获企业管理硕士学位。

历任上投摩根基金管理有限公司市场经理、市场部副总监，产品及客户营销部总监、市场部总监兼互联网金融部总监、总经理助理。

刘鲁旦先生，副总经理。

博士研究生。

历任华夏基金管理有限公司固定收益总监、中国国际金融股份有限公司资产管理部固定收益总监/董事总经理。

邹树波先生，督察长。



---

获管理学学士学位。

曾任天健会计师事务所高级项目经理，上海证监局主任科员，上投摩根基金管理有限公司监察稽核部副总监、监察稽核部总监。

#### 5. 本基金基金经理

基金经理张军先生，毕业于上海复旦大学。曾担任上海国际信托有限公司国际业务部经理，交易部经理。2004年6月加入上投摩根基金管理有限公司，先后担任交易部总监、投资经理、基金经理、投资组合管理部总监、投资绩效评估总监、国际投资部总监、组合基金投资部总监，现担任投资董事。2008年3月起担任上投摩根亚太优势混合型证券投资基金基金经理，自2012年3月起同时担任上投摩根全球天然资源混合型证券投资基金基金经理，自2016年12月起同时担任上投摩根全球多元配置证券投资基金基金经理，自2018年10月起担任上投摩根欧洲动力策略股票型证券投资基金（QDII）基金经理，自2019年7月起同时担任上投摩根日本精选股票型证券投资基金（QDII）基金经理。

#### 6. 基金管理人投资决策委员会成员的姓名和职务

杜猛，副总经理兼投资总监；孙芳，副总经理兼投资副总监；刘鲁旦，副总经理兼债券投资总监；张军，投资董事、国际投资部总监、投资绩效评估总监兼高级基金经理；朱晓龙，研究部总监兼基金经理；陈圆明，绝对收益投资部总监兼基金经理；聂曙光，债券投资部总监兼资深基金经理；孟晨波，总经理助理/货币市场投资部总监兼资深基金经理；任翔，固收研究部总监兼基金经理；钟维伦，资深投资经理；刘凌云，组合基金投资部总监兼基金经理；张文峰，组合基金投资部副总监兼投资经理；孟鸣，基金经理兼资深投资组合经理；叶承焘，投资经理；陈晨，投资经理。

上述人员之间不存在近亲属关系。

### （三）基金管理人的职责

- 1、依法募集基金，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、办理基金备案手续；
- 3、对所管理的不同基金资产分别管理、分别记账，进行证券投资；
- 4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有

---

人分配收益；

- 5、 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
  - 6、 编制中期和年度基金报告；
  - 7、 计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回价格；
  - 8、 办理与基金资产管理业务活动有关的信息披露事项；
  - 9、 召集基金份额持有人大会；
  - 10、 保存基金资产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
  - 11、 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- 12、 国务院证券监督管理机构规定的其他职责。

#### **（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、策略及限制全权处理本基金的投资。

2、基金管理人不得从事违反《中华人民共和国证券法》（以下简称：《证券法》）及其他有关法律法规的行为，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反《证券法》及其他有关法律法规行为的发生。

3、基金管理人不得从事下列违反《基金法》的行为，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止法律法规规定的禁止行为的发生：

- （1） 投资于其它基金，但是法律法规或基金合同另有规定的除外；
- （2） 违反基金份额持有人的利益，将基金资产用于向第三人抵押、担保、资金拆借或者贷款，按照国家有关规定进行融资担保的除外；
- （3） 从事有可能使基金承担无限责任的投资；
- （4） 从事证券承销行为；
- （5） 将基金资产投资于与基金托管人或基金管理人有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；
- （6） 违反证券交易业务规则，操纵和扰乱市场价格；
- （7） 违反法律法规而损害基金份额持有人利益的；
- （8） 法律、法规及监管机关规定禁止从事的其它行为。

4、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) 违反基金合同或基金托管协议；
  - (3) 故意损害基金份额持有人或其它基金相关机构的合法利益；
  - (4) 在向中国证监会报送的材料中弄虚作假；
  - (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；
  - (8) 违反证券交易场所业务规则，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) 其它法律法规以及中国证监会禁止的行为。

#### 5、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、代理人、代表人、受雇人或任何其它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；
- (4) 不以任何形式为其它组织或个人进行证券交易。

#### **(五) 内部控制制度：**

##### 1、内部控制的原则：

基金管理人内部控制遵循以下原则：

- (1) 健全性原则。内部控制应当包括基金管理人的各项业务、各个部门或机构和各级人员，并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个环节。
- (2) 有效性原则。通过科学的内控手段和方法，建立合理的内控程序，维护内控制度的有效执行。
- (3) 独立性原则。基金管理人各机构、部门和岗位职责应当保持相对独立，基金管理人基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离。
- (4) 相互制约原则。基金管理人内部部门和岗位的设置应当权责分明、相

---

互制衡。

- (5) 成本效益原则。基金管理人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。

## 2、制订内部控制制度应当遵循以下原则：

- (1) 合法合规性原则。基金管理人内控制度应当符合国家法律、法规、规章和各项规定。
- (2) 全面性原则。内部控制制度应当涵盖基金管理人经营管理的各个环节，不得留有制度上的空白或漏洞。
- (3) 审慎性原则。制定内部控制制度应当以审慎经营、防范和化解风险为出发点。
- (4) 适时性原则。内部控制制度的制定应当随着有关法律法规的调整和基金管理人经营战略、经营方针、经营理念等内外部环境的变化进行及时的修改或完善。

## 3、基金管理人关于内部合规控制声明书：

- (1) 基金管理人承诺以上关于内部控制的披露真实、准确；
- (2) 基金管理人承诺根据市场的变化和基金管理人的发展不断完善内部合规控制。

## 4、风险管理体系：

(1) 董事会下设风险管理委员会，主要负责基金管理人风险管理战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。

(2) 董事会下设督察长，负责对基金管理人各业务环节合法合规运作的监督检查和基金管理人内部稽核监控工作，并可向基金管理人董事会和中国证监会直接报告。

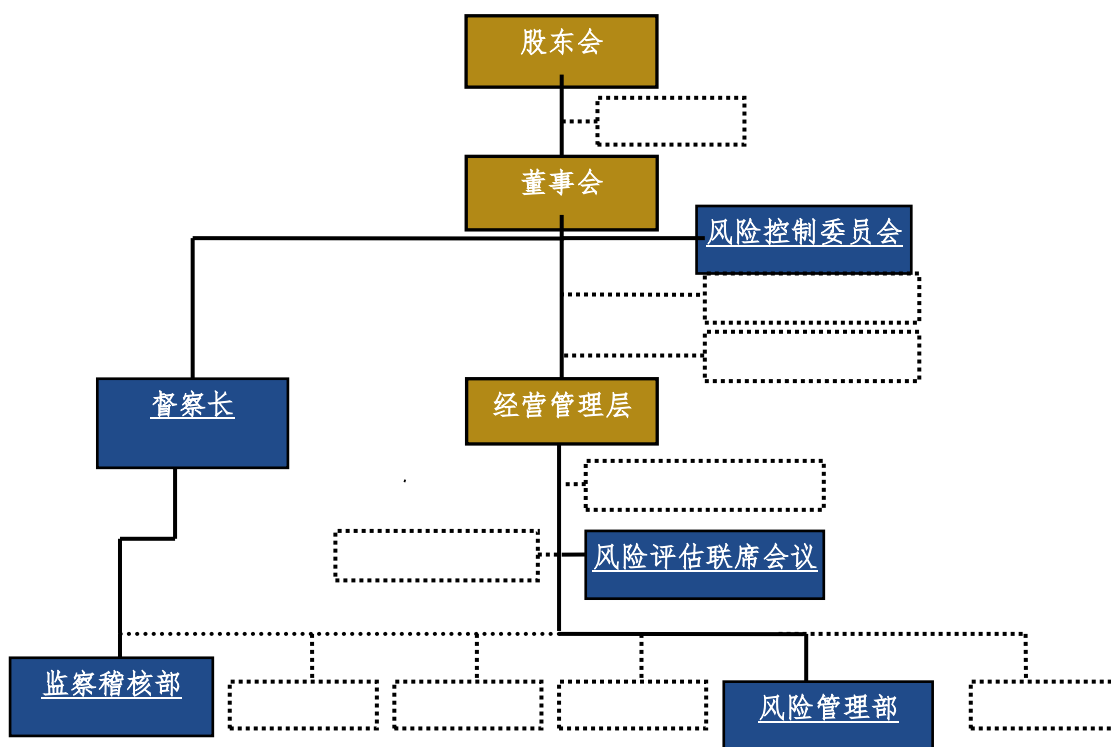
(3) 经营管理层下设风险评估联席会议，进行各部门管理程序的风险确认，评估成员包括经营管理层、督察长、稽核、风险管理、基金交易、基金运作等各部门主管。风险评估联席会议对各类风险予以事先充分的评估和防范， 并进行

及时控制和采取应急措施。

(4) 监察稽核部负责基金管理人各部门的风险控制检查，定期不定期对业务部门内部控制制度执行情况和遵循国家法律、法规及其他规定的执行情况进行检查，并适时提出修改建议。

(5) 风险管理部负责投资限制指标体系的设定和更新，对于违反指标体系的投资进行监督和风险评估的评估。

(6) 风险管理部负责协助各部门修正、修订内部控制作业制度，并对各部门的日常作业，依风险管理的考评，定期或不定期对各项风险指标进行控管，并提出内控建议。



## 七、境外投资顾问及境外托管人

### (一) 境外投资顾问

#### 1、境外投资顾问基本情况

名称：摩根资产管理(英国)有限公司(JP Morgan Asset Management (UK) Co.,

---

Ltd.)

注册地址：25 Bank Street Canary Wharf London E14 5JP

办公地址：125 London Wall, London, EC2Y 5AJ

Finsbury Dials, 20 Finsbury Street, London EC2Y 9AQ

法定代表人：Martin Porter

成立时间：1974年2月27日

联系人：Neil Gregson

联系电话：44 020 7742 6000

摩根资产管理是综合实力处于世界领先水平的全球性金融集团之一的摩根大通集团下属专营资产管理的公司，成立至今已逾一百五十余年，位居世界最大的资产管理公司之一。摩根资产管理在各类股票、固定收益、房地产、另类投资、多元资产等领域具有非常丰富的专业投资经验，其目前为全球 3,000 多名机构客户投资者(包括养老基金、慈善基金、公司、中央银行等)和数以百万计的私人客户投资者提供专业的资产管理及理财服务，主要通过卢森堡的 SICAVs、英国的 OEICs、投资信托及香港注册的 JF 基金等进行投资。

## 2、主要负责人基本情况

Neil Gregson,董事总经理，是总部位于伦敦的全球股票投资团队的组合经理，同时也是负责全球天然资源行业投资运作的团队的成员。Neil 2010年加入摩根资产管理集团，之前任职于CQS资产管理集团，担任高级组合经理和多头业务的负责人，并拥有天然资源行业的投资经验。在这之前，Neil 担任瑞信资产管理集团负责新兴市场投资的负责人同时管理了黄金和资源类股票型基金。Neil 在其职业生涯中管理过众多覆盖资源和矿业类公司的股票组合，同时还担任过南非一家金矿公司的分析师。

Neil 是一位资深矿业工程师，并拥有英国诺丁汉大学矿业工程专业学士学位。

## (二) 境外资产托管人

### 一、中银香港概况

名称：[中国银行(香港)有限公司]

住所：[香港中环花园道 1 号中银大厦]  
 办公地址：[香港中环花园道 1 号中银大厦]  
 法定代表人：[高迎欣总裁]  
 成立时间：[1964 年 10 月 16 日]  
 组织形式：[股份有限公司]  
 存续期间：[持续经营]  
 联系人：[黄晚仪 副总经理 托管业务主管]  
 联系电话：[852-3982-6753]

中国银行(香港)有限公司（“中银香港”）已于 1964 年成立，并在 2001 年 10 月 1 日正式重组为中国银行(香港)有限公司，是一家在香港注册的持牌银行。其控股公司-中银香港(控股)有限公司（“中银香港(控股)”）-则于 2001 年 2 日在香港注册成立，并于 2002 年 7 月 25 日开始在香港联合交易所主板上市，2002 年 12 月 2 日被纳入为恒生指数成分股。中银香港目前主要受香港金管局、证监会以及联交所等机构的监管。

截至 2017 年末，中银香港(控股)有限公司的总资产超过 23,399 亿港元，资本总额超过 2,417.4 亿港元，总资本比率为 21.76%。中银香港(控股)的财务实力及双 A 级信用评级，可媲美不少大型全球托管银行，其最新信评如下(截至 2017 年 12 月 31 日):

	穆迪投资服务	标准普尔	惠誉国际评级
评级展望	稳定	稳定	稳定
长期	Aa3	A+	A
短期	P-1	A-1	F1
展望	稳定	稳定	稳定

中银香港作为香港第二大银行集团，亦为三家本地发钞银行之一，拥有最庞大分行网络与广阔的客户基础，且连续四年成为“亚太及香港区最稳健银行”《银行间杂志》，并三度获得“香港区最佳银行”《银行家杂志》等。

---

托管服务是中银香港企业银行业务的核心产品之一，目前为超过六十万企业及工商客户提供一站式的证券托管服务。对于服务国内企业及机构性客户(包括各类 QDII 及其各类产品等)，亦素有经验，于行业处于领先地位，包括于 2006 年被委任为国内首只银行类 QDII 产品之境外托管行，于 2007 年被委任为国内首只券商类 QDII 集成计划之境外托管行，另于 2010 年服务市场首宗的跨境 QDII-ETF 等；至于服务境外机构客户方面亦成就显著：



在“债券通”的领域 =>自开通至今,持续维持最大的市场份额

在人民币合格境外机构投资者(RQFII)的领域 =>成为此类人民币产品的最大香港服务商



在离岸人民币 CNH 公募基金的领域 =>成为市场上首家服务商(2010 年 8 月)  
=>目前亦为最大的服务商


在港上市的交易所买卖基金(ETF) =>中资发行商的最大服务商之一

在离岸私募基金的领域 =>新募长仓基金的最大服务商之一

在非上市的股权/债权投资领域 =>香港少有的服务商之一

其业务专长及全方位的配备,令中银香港成为目前本地唯一的中资全面性专业全球托管银行,亦是唯一获颁行业奖项的中资托管行:

专业杂志	所获托管奖项
	亚洲投资人杂志 (Asian Investors) 服务提供者奖项: - 最佳跨境托管亚洲银行 (2012)
	财资杂志(The Asset) Triple A 托管专家系列奖项: - 最佳 QFII 托管行 (2013) - 最佳中国区托管专家 (2016)  财资杂志(The Asset) Triple A 个人领袖奖项:

	<p><b>Fanny Wong - 香港区年度托管银行家 (2014)</b></p> <p>财资杂志 (The Asset) Triple A 资产服务、机构投资者及保险机构系列奖项:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- 最佳 QDII 托管行 (2018); 及</li> <li>- 最佳 QDII 客户个案 (2018)</li> </ul>
	<p>获债券通有限公司颁发“债券通优秀托管机构”(2018)</p>

截至 2017 年末，中银香港(控股)的托管资产规模达 **11,623 亿港元**。

## 二、托管部门人员配备、安全保管资产条件的说明

### (一) 主要人员情况

托管业务是中银香港的核心产品之一，由管理委员会成员兼副总裁袁树先生直接领导。针对国内机构客户而设的专职托管业务团队现时有二十名骨干成员，职级均为经理或以上，分别主理结算、公司行动、账务(Billing)、对账(Reconciliation)、客户服务、产品开发、营销及网管理等方面。骨干人员均来自各大跨国银行，平均具备 15 年以上的专业托管工作经验(包括本地托管及全球托管)，并操流利普通话，可说是香港最资深的托管团队。

除配备专职的客户关系经理，中银香港更特设为内地及本地客户服务的专业托管业务团队，以提供同时区、同语言的高素质服务。

除上述托管服务外，若客户需要估值、会计、投资监督等增值性服务，则由中银香港的附属公司中银国际英国保诚信托有限公司(“中银保诚”)提供。作为「强制性公积金计划管理局」认可的信托公司，中银保诚多年来均提供国际水平的估值、会计、投资监督等服务，其专职基金会计与投资监督人员达 50 多名，人员平均具备 10 年以上相关经验。

---

中银香港的管理层对上述服务极为重视，有关方面的人员配置及系统提升正不断加强。另外，其它中/后台部门亦全力配合及支持托管服务的提供，力求以最高水平服务各机构性客户。

### 关键人员简历

黄晚仪女士

托管业务主管

黄女士于香港大学毕业，并取得英国 **Heriot-Watt University** 的工商管理硕士及英国特许银行公会的会士资格。黄女士从事银行业务超过二十年，大部分时间专职于托管业务，服务企业及机构性客户。效力的机构包括曾为全球最大之金融集团 - 花旗集团 - 及本地两大发钞银行 - 渣打及中银香港。参加中银香港前，黄女士为花旗集团之董事及香港区环球托管业务总监。目前黄女士专职于领导中银香港的全球托管及基金服务发展，并全力配合中国合格境内机构投资者之境外投资及理财业务之所需，且担任中银香港集团属下多家代理人公司及信托公司的企业董事。黄女士亦热心推动行业发展，包括代表中银香港继续担任「香港信托人公会」行政委员会之董事一职；自09年9月至2015年6月期间，获「香港交易所」委任作为其结算咨询小组成员；另外，黄女士目前亦是香港证监会产品咨询委员会的委员之一。

张海萍女士

托管运作主管

张女士拥有超过二十年金融行业的工作经验。加入中银香港前，张女士曾任职于所罗门美邦、纽约梅隆银行、摩根大通和道富银行。来香港工作之前，她曾在美国纽约和达拉斯工作。

阮美莲女士

财务主管

阮女士拥有超过二十年退休金及信托基金管理经验，管理工作包括投资估值、基金核算、投资合规监控及信托运作等。加入中银国际集团前，阮女士曾于百慕达银行任职

---

退休金部门经理一职，以及于汇丰人寿任职会计经理，负责退休金基金会计工作。阮女士是香港会计师公会及英国特许公认会计师公会资深会员，并持有英国列斯特大学硕士学位。

## （二）安全保管资产条件

在安全保管资产方面，为了清楚区分托管客户与银行拥有的资产，中银香港目前已以托管人身份在本港及海外存管或结算机构开设了独立的账户以持有及处理客户的股票、债券等资产交收。

除获得客户特别指令或法例要求外，所有实物证券均透过当地市场之次托管人以该次托管人或当地存管机构之名义登记过户，并存放于次托管人或存管机构内，以确保客户权益。

至于在异地市场进行证券交割所需之跨国汇款，除非市场/存托机构/次托管行等另有要求，否则中银香港会尽可能在交收日汇入所需款项，以减少现金停留于相关异地市场的风险。

先进的系统是安全保管资产的重要条件。

中银香港所采用的托管系统名为“Custody & Securities System”或简称 CSS，是中银香港聘用一支科技专家、并结合银行内部的专才，针对机构性客户的托管需求在原有的零售托管系统上重新组建而成的。CSS 整个系统构建在开放平台上，以 IBM P5 系列 AIX 运行。系统需使用两台服务器，主要用作数据存取及支持应用系统软件，另各自附有备用服务器配合。此外，一台窗口服务器已安装 NFS (Network File System, for Unix) 模块，负责与 AIX 服务器沟通。

新系统除了采用尖端科技开发，并融合机构性客户的需求与及零售层面的系统优势，不单符合 SWIFT-15022 之要求，兼容 file transfer 等不同的数据传输，亦拥有庞大的容量（原有的零售托管系统就曾多次证实其在市场买卖高峰期均运作如常，反观部分主要银行的系统则瘫痪超过 1.5 小时）。

---

至于基金估值、会计核算以及投资监督服务，则采用自行研发的 FAMEX 系统进行处理，系统可相容多种货币、多种成本定价法及多种会计算法，以满足不同机构客户及各类基金的需要。系统优势包括：多种货币；多种分类；实时更新；支持庞大数据量；简易操作,方便用户。系统所支持的核算方法包括：权重平均(Weighted Average)；后入先出(LIFO)；先入先出(FIFO)；其它方法可经与客户商讨后实施。系统所支持的估值方法有：以市场价格标明 (Marking to Market)；成本法；成本或市场价的较低者；入价与出价(Bid and offer)；分期偿还(Amortization)；含息或除息(Clean/dirty)；及其它根据证券类别的例外估值等。

## 六、托管业务的主要管理制度

作为一家本地持牌银行，中银香港的业务受香港金融管理局全面监管；另外，作为本地上市的金融机构，中银香港亦需严格遵守香港联合交易所的规定及要求。

中银香港实施严格的内部控制制度和风险管理流程，所有重要环节均采用双人复核，减少人工操作风险；并由独立风险管理部门就任何新产品/服务/措施等进行全面评核及监控，避免人为失误或道德风险。任何外判安排，除上述风险分析外，还需寻求监管机构之批准。

对于次托管行或服务商的委任，中银香港亦制定了有关选任、服务标准、及日常服务水平监控等制度及要求，以确保服务质量。对托管客户而言，中银香港亦承担其次托管行之服务疏失等风险，并在托管合约中清楚订明。

中银香港具备经审核之应变计划以应付各种各样特殊情况的发生。应变计划每年均会进行测试及演练，模拟在突发情形下之业务运作，并对测试结果进行检讨及评估，以确保在突发情形下仍能提供服务。系统方面，灾难应变措施中心亦已预留独立应用软件及数据库服务器，随时取代生产服务器运作。

托管业务之规章制度及工作手册乃根据与托管相关的监管条例或指引(如：员工守则，了解你的客户政策、防洗钱政策及个人私隐条例等)与中银香港本身制定的内控制度

---

(如：信息安全管理办法，包括托管系统用户之管理、权限之设定等)缮制，并因应有关条例、指引或政策之修订而适时调整，以确保合乎对外、对内的监控要求。

有关托管业务的重要规章制度包括《托管业务标准操作规程》(Custody - Standard Operating Procedure Overview)，主要内容包括：账户开立、客户账户管理、结算程序、公司行动程序、资产核对、资金报告、账单、投诉、应急计划等等。以及《托管系统进入控制规程》(Custody - System Access Control Procedure Overview)，内容涵盖系统范围、系统描述、用户概况、功能列表、职责定义、增加、删除、修改程序、请求格式、控制与备份安排等。

中银香港设有独立的稽核委员会，直接向董事会负责，对各部门进行定期及不定期之稽核。至于年度审计，则委任罗兵咸永道会计师事务所进行。

中银集团系内各企业法人或业务条线均严格分开，并设严密的防火墙，以确保客户资料高度保密。

## 七、重大处罚

中银香港托管业务自成立至今已十二年，从未受到监管机构的重大处罚，亦没有重大事项正在接受司法部门、监管机构的立案调查。

## 八、基金的募集及基金合同的生效

本基金根据中国证券监督管理委员会《关于核准上投摩根全球天然资源股票型证券投资基金募集的批复》(证监许可[2011]1599号文)，自2012年2月20日起向全社会公开募集，截至2012年3月21日募集工作顺利结束。

经普华永道中天会计师事务所有限公司验资，本次募集的有效净认购金额为413,075,067.63元人民币，折合基金份额413,075,067.63份；认购款项在基金验资确认日之前产生的银行利息共计119,604.54元人民币，折合基金份额119,604.54份。

---

经中国证券监督管理委员会核准，本基金的基金合同于 2012 年 3 月 26 日生效。本基金为契约型开放式股票型基金，存续期限为不定期。

本基金的基金名称自 2015 年 7 月 21 日起由上投摩根全球天然资源股票型证券投资基金变更为上投摩根全球天然资源混合型证券投资基金。该变更不涉及基金份额持有人权利义务关系的变化，亦不涉及投资目标、投资范围和投资策略的变更，对本基金的投资及基金份额持有人利益无实质性不利影响。

## 九、基金的申购与赎回

### （一）申购与赎回办理的场所

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，并在基金管理人网站公示。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

本基金申购和赎回的开放日为上海证券交易所、深圳证券交易所及本基金主要投资市场的同时正常交易的工作日，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回日除外。本基金主要投资市场包括加拿大多伦多证券交易所、英国伦敦证券交易所、澳大利亚证券交易所，若本基金投资的主要市场发生变更，将在招募说明书（更新）中进行列示。

自本次招募说明书发布之日起至次年同期，在本基金所投资的国家或地区中，由于境外当地市场假期原因，有可能在 4 月 6 日至 9 日、9 月 3 日、10 月 8 日、12 月 25 日、12 月 26 日无法对本基金资产进行正常的交易或估值，届时本基金将根据实际投资组合权重决定具体暂停申购或赎回日期，并按照法律法规要求提前公告。

---

每一开放日的开放时间截止到当日下午 3 点。对于投资者在非开放时间提出的申购、赎回申请，其基金份额申购、赎回价格为下一开放日的基金份额资产净值。若出现新的证券交易市场或交易所交易时间更改或实际情况需要，基金管理人可对申购、赎回时间进行调整，但此项调整应在实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

## 2、申购与赎回的开始时间

本基金的申购自基金合同生效后不超过三个月开始办理。具体业务办理时间由基金管理人另行公告。

本基金的赎回自基金合同生效后不超过三个月的时间开始办理。具体开放时间由基金管理人另行公告。

在确定申购开始时间与赎回开始时间后，由基金管理人于开始申购或赎回前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

### （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的基金份额净值（折算为人民币）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、基金份额持有人在赎回基金份额时，基金管理人按先进先出的原则，即对该基金份额持有人在销售机构托管的基金份额进行处理，申购确认日期在先的基金份额先赎回，申购确认日期在后的基金份额后赎回，以确定所适用的赎回费率；

4、当日的申购与赎回申请可以在当日业务办理时间结束前撤销，在当日业务办理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依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

#### **（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提出申购或赎回的申请。

投资者申购本基金，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**

T 日规定时间受理的申请，正常情况下，本基金注册登记人在 T+2 日内为投资者对该交易的有效性进行确认。投资者应在 T+3 日（包括该日）后及时到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。因投资者未及时进行该查询而造成的后果由其自行承担。

基金销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申购、赎回申请。申购、赎回申请的确认以注册登记机构或基金管理人的确认结果为准。

##### **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，申购不成功或无效，申购款项将退回投资者账户。

投资者赎回申请成交后，基金管理人应通过注册登记机构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十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基金合同有关规定处理。

#### **（五）申购与赎回的数额限制**

1. 申购的单笔最低金额为 10 元人民币(含申购费)，追加申购的单笔最低限额为人民币 10 元。基金投资者将当期分配的基金收益转购基金份额时，不受最低申购金额的限制。

基金投资者可多次申购，法律法规、中国证监会另有规定的除外。

2. 基金投资者可将其全部或部分基金份额赎回。本基金按照份额进行赎回，申请赎回份额精确到小数点后两位，每次赎回份额不得低于 10 份，基金账户余额在赎回后不得低于 10 份，如进行一次赎回后基金账户中基金份额余额将低于 10 份，应一次性赎回。如因非交易过户、转托管、巨额赎回等原因导致的账户余额少于 10 份之情况，不受此限，但再次赎回时必须一次性全部赎回。

3. 基金管理人可以规定单个投资人累计持有的基金份额上限，具体规定请参见更新的招募说明书。

4. 当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。具体规定请参见招募说明书或相关公告。

5. 基金管理人可以根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上刊登公告。

## （六）申购费用和赎回费用

1、本基金的申购费用由基金申购人承担，不列入基金资产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

2、投资者可将其持有的全部或部分基金份额赎回。赎回费用由基金赎回人承担。本基金的赎回费用在投资人赎回本基金份额时收取，扣除用于市场推广、注册登记费和其他手续费后的余额归基金资产，赎回费归入基金资产的比例不得低于法律法规或中国证监会规定的比例下限。

### 3、申购费率

本基金申购费率如下：

购买金额（M）	申购费率
---------	------

M<100 万	1.6%
100 万≤M<500 万	1.0%
M≥500 万	每笔 1000 元

#### 4、赎回费用

本基金赎回费用按持有人持有该部分基金份额的时间分段设定如下：

持有基金份额期限	赎回费率
小于 7 日	1.5%
大于等于 7 日小于一年	0.50%
大于等于一年小于两年	0.30%
大于等于两年	0%

本基金将对持续持有期少于 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，除此之外的本基金的赎回费用扣除注册登记费和其他手续费后的余额归基金资产，赎回费归入基金资产的部分为赎回费总额的 25%。

5、基金管理人可以在法律法规和基金合同规定范围内调整申购费率和赎回费率。费率如发生变更，基金管理人应在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上刊登公告。

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况下根据市场情况制定基金促销计划，经代销机构同意后，针对投资者定期和不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，基金管理人可以按中国证监会要求履行必要手续后，对投资者适当调整基金申购费率、赎回费率和转换费率。

### （七）申购份额与赎回金额的计算

#### 1、本基金申购份额的计算：

本基金的申购金额包括申购费用和净申购金额。其中，

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

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

---

申购份额 = 净申购金额 / T 日基金份额净值

2、本基金赎回金额的计算：

本基金的净赎回金额为赎回金额扣减赎回费用。其中，

赎回金额 = 赎回份数 × T 日基金单位净值

赎回费用 = 赎回金额 × 赎回费率

净赎回金额 = 赎回金额 - 赎回费用

3、本基金份额净值的计算：

T 日的基金份额净值在 T+1 日计算，并在 T+2 日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。本基金份额净值的计算，保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入。

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，以申请当日基金份额净值为基准计算，各计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金资产承担。

5、赎回金额的处理方式：

赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以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相应的费用的金额，各计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金资产承担。

## （八）申购与赎回的注册登记

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、投资者申购基金成功后，基金注册登记机构在 T+2 日为投资者增加权益并办理注册登记手续，投资者自 T+3 日起有权赎回该部分基金份额。

3、投资者赎回基金成功后，基金注册登记机构在 T+2 日为投资者扣除权益

---

并办理相应的注册登记手续。

4、基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，并依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

## （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申请总份额后的余额）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，确定该单个基金份额持有人当日办理的赎回份额；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，赎回价格为下一个开放日的价格。转入下一开放日的赎回申请不享有赎回优先权，以此类推，直到全部赎回为止。

（3）若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额的 20%，基金管理人有权先行对该单个基金份额持有人超出 20% 以上的部分赎回申请实施延期办理，而对该单个基金份额持有人 20% 以内（含

---

20%)的赎回申请与当日其他投资者的赎回申请按前述条款处理,具体见招募说明书或相关公告。

(4)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,在三个工作日内通知基金份额持有人,说明有关处理方法,并在2日内在指定媒介予以公告。

(5)暂停接受和延缓支付:本基金连续两个或两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二十个工作日,并应当在指定媒介公告。

#### **(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接受投资者的申购申请;
- (2)本基金进行交易的主要证券交易市场或外汇市场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)本基金投资的主要证券交易市场或外汇市场的公众节假日,并可能影响本基金正常估值时;
- (4)发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况;
- (5)基金资产规模过大,使基金管理人无法找到合适的投资品种;
- (6)本基金的资产组合中的重要部分发生暂停交易或其他重大事件,继续接受申购可能会影响或损害基金份额持有人利益时;
- (7)基金管理人、基金托管人、基金销售机构或注册登记机构因技术故障或异常情况导致基金销售系统或基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行;
- (8)基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金

---

份额持有人利益时；

(9) 本基金已经达到监管机构核定的本基金的募集规模；

(10) 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；

(11) 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；

(12) 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。发生上述（1）-（7）、（9）、（11）、（12）项情形且基金管理人决定暂停接受申购申请时，应当及时公告。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。

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不能支付赎回款项；

(2) 本基金进行交易的主要证券交易市场或外汇市场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) 本基金投资的主要证券交易市场或外汇市场的公众节假日，并可能影响本基金正常估值时；

(3) 发生连续巨额赎回，根据基金合同规定，可以暂停接受赎回申请的情况；

(4) 发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况；

(5) 基金管理人、基金托管人、基金销售机构或注册登记机构因技术故障或异常情况导致基金销售系统或基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运

---

行；

(6) 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；

(7) 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，已经确认的赎回申请，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。

3、暂停基金的申购、赎回，基金管理人应按规定公告。

4、暂停期间结束，基金重新开放时，基金管理人应按规定公告。

(1) 如果发生暂停的时间为一个开放日，基金管理人将于重新开放日，在指定媒介刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并公告最近一个工作日的基金份额净值。

(2) 如果发生暂停的时间超过一个开放日但少于十个开放日，暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前在指定媒介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工作日的基金份额净值。

(3) 如果发生暂停的时间超过十个开放日，暂停期间，基金管理人应每十个开放日至少重复刊登暂停公告一次；当连续暂停时间超过 20 个开放日时，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，基金管理人应提前在指定媒介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工作日的基金份额净值。

## (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其他开放式基金之间的转换服务。基金转换可以收取一定的转换费。基金转换的程序及相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及基金合同的规定制定并公告。

## （十二）基金的非交易过户、转托管、冻结与质押

1、非交易过户是指不采用申购、赎回等基金交易方式，将一定数量的基金份额按照一定规则从某一投资者基金账户转移到另一投资者基金账户的行为，包括继承、捐赠、司法强制执行、国有资产无偿划转、机构合并或分立及基金注册登记机构认可的其他行为。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是合格的个人投资者或机构投资者。其中：

1) “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；

2) “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其他具有社会公益性质的社会团体；

3) “司法强制执行”是指国家有权机关依据生效的法律文书将基金份额持有人持有的基金份额强制执行划转给其他自然人、法人、社会团体或其他组织；

4) “国有资产无偿划转”指因管理体制改革、组织形式调整或资产重组等原因引起的作为国有资产的基金份额在不同国有产权主体之间的无偿转移；

5) “机构合并或分立”指因机构的合并或分立而导致的基金份额的划转。

2、办理非交易过户业务必须提供基金注册登记机构要求提供的相关资料，并向基金注册登记机构申请办理。

3、符合条件的非交易过户申请自申请受理日起二个月内办理；申请人按基金注册登记机构规定的标准缴纳过户费用。

4、基金份额持有人在变更办理基金申购与赎回等业务的销售机构（网点）

---

时，应办理已持有基金份额的转托管。基金份额转托管可分一步或两步完成，具体按各销售机构要求办理。对于有效的基金转托管申请，基金份额将在转托管业务确认成功后转入其指定的销售机构（网点）。

5、基金注册登记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（包括现金分红和红利再投资）一并冻结。

6、根据相关法律法规的规定，基金管理人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。

### （十三）定期定额投资计划

基金管理人可以为投资者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。

## 十、基金的费用与税收

### （一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费（其中包含投资顾问费）；
- 2、基金托管人的托管费（其中包含境外托管人托管费）；
- 3、因基金的开户、证券交易、证券清算交收、证券登记存管而产生的各项费用；
- 4、基金合同生效以后的信息披露费用，但法律法规、中国证监会另有规定的除外；
- 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和其他为基金利益而产生的中介

---

机构费用；

7、基金的资金汇划费用；

8、基金的证券交易费用及在境外市场的交易，清算，登记等各项费用；

9、基金依照有关法律法规应当缴纳的，购买或处置证券有关的任何税收、征费、关税、印花税、交易及其他税收及预扣提税（以及与前述各项有关的任何利息、罚金及费用）(简称“税收”）；

10、外汇兑换交易的相关费用；

11、按照国家有关规定可以列入的其他费用。

## （二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

### 1、基金管理人的管理费

基金管理人的基金管理费（如基金管理人委托投资顾问，包括投资顾问费）按基金资产净值的 1.8% 年费率计提。

在通常情况下，基金管理费自基金合同生效日（含合同生效日）按以下方法计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.8\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金于每个估值日计提自上一估值日（不含上一估值日）至当日（含当日）的管理费，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 个工作日内从基金资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（如基金托管人委托境外资产托管人，包括向其支付的相应服务费）按基金资产净值的[0.35%]年费率计提。

在通常情况下，基金托管费自基金合同生效日（含合同生效日）按以下方法计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.35\% \div \text{当年天数}$$

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

基金于每个估值日计提自上一估值日（不含上一估值日）至当日（含当日）的托管费，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 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。

3、本条第（一）款第 3 至第 10 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，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，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资产的损失，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。

### （四）基金费用调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费、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，依照国家法律法规和境外市场的规定履行纳税义务。

## 十一、基金的资产

### （一）基金资产总值

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

### （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）基金资产的账户

本基金根据相关法律法规、规范性文件在境内开立人民币和外币资金账户，在境外开立外币资金账户及证券账户，与基金管理人、基金托管人和境外资产托管人自有的财产账户以及其他基金资产账户独立。

### （四）基金资产的保管及处分

1、本基金资产独立于基金管理人、基金托管人和境外资产托管人的固有财产。基金管理人、境外资产托管人不得将基金资产归入其固有财产。

2、基金托管人和境外资产托管人应安全保管基金资产。

3、基金管理人、基金托管人、境外资产托管人因基金资产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益，归基金资产。

4、基金托管人或境外资产托管人按照规定或境外市场惯例开设基金资产的所有资金账户和证券账户。

---

5、基金托管人对所托管的不同基金资产分别设置账户，确保基金资产的完整与独立。

6、基金管理人、基金托管人以其自有的财产承担自身相应的法律责任，其债权人不得对基金资产行使请求冻结、扣押或其他权利。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，基金资产不属于其清算范围。

7、非因基金资产本身承担的债务，不得对基金资产强制执行。

## 十二、基金资产的估值

### （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，确定基金资产净值，并为基金份额的申购与赎回提供计价依据。

### （二）估值日

基金合同生效后，每个开放日对基金资产进行估值，估值时间点为 T+1 日。

### （三）估值对象

本基金所拥有的股票和银行存款本息、应收款项和其它投资等资产。

### （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；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。

（2）未上市股票，送股、转增股、配股和公开增发新股等方式发行的股票，

---

按估值日在交易所挂牌的同一股票的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。首次发行且未上市的股票，按成本价估值。首次发行且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收盘价估值。

## 2、债券估值方法

(1) 对于上市流通的债券，证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘净价估值，估值日没有交易的，按最近交易日的收盘净价估值。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得到的净价进行估值，估值日没有交易的，按最近交易日收盘价减去债券最近交易日收盘价中所含的债券应收利息所得到的净价估值。

(2) 对于非上市债券，参照主要做市商或其他权威价格提供机构的报价进行估值。

## 3、衍生工具估值方法

(1) 上市流通衍生工具按估值日当日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。

(2) 未上市衍生工具按成本价估值，如成本价不能反映公允价值，则采用估值技术确定公允价值。

## 4、存托凭证估值方法

公开挂牌的存托凭证按其所在证券交易所的最近交易日的收盘价估值。

## 5、基金估值方法

(1) 上市流通的基金按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。

(2) 其他基金按最近交易日的基金份额净值估值。

---

## 6、非流动性资产或暂停交易的证券估值方法

对于未上市流通、或流通受限、或暂停交易的证券，应参照上述估值原则进行估值。如果上述估值方法不能客观反映公允价值的，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。

7、在任何情况下，基金管理人如采用本项 1-6 小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项 1-6 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。

8、国家法律法规对此有新的规定的，按其新的规定进行估值。

## 9、估值中的汇率选取原则：

估值计算中涉及美元、港币、日元、欧元、英镑等五种主要货币对人民币汇率的，采用当日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价；涉及其他货币对人民币的汇率，采用指定数据服务商提供的估值日各种货币对美元折算率并采用套算的方法进行折算。

## （五）估值程序

基金日常估值由基金管理人和基金托管人一同进行。基金管理人将估值结果发送基金托管人，基金托管人按《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或以其他约定的方式返回给基金管理人。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。

在法律法规允许的情况下，基金管理人与基金托管人可以各自委托第三方机构进行基金资产估值，但不改变基金管理人与基金托管人对基金资产估值各自应承担的责任。

## （六）暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的主要证券市场遇法定节假日或因其他原因停市时；



---

2、因不可抗力或其它情形致使基金管理人、基金托管人、境外资产托管人、投资顾问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的，应当暂停估值；

4、法律法规、中国证监会认定的其它情形。

### **（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。基金管理人每个工作日将计算的前一工作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。

基金份额净值的计算精确到 0.001 人民币，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三位内发生差错时，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 0.5%时，基金管理人应当公告，并同时报中国证监会备案。

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（四）估值方法中的第 7 项进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

---

2、对于因税收规定调整或其他原因导致基金实际交纳税金与基金按照权责发生制进行估值的应交税金有差异的，相关估值调整不作为基金资产估值错误处理。3、由于交易机构或独立价格服务商发送的数据错误，或有关会计制度变化以及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。

### 十三、基金的收益分配

#### （一）基金利润的构成

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

#### （二）基金可供分配利润

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

#### （三）收益分配原则

基金收益分配是指按规定将基金的可分配收益按基金份额进行比例分配。

1、本基金的每份基金份额享有同等分配权；

2、基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式，基金份额持有人可自行选择收益分配方式；基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金红利；选择红利再投资的，现金红利则按除权日经除权后的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。

3、基金当期收益先弥补上期亏损后，方可进行当期收益分配；

---

4、基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值，基金收益分配基准日即期末可供分配利润计算截止日；

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

6、在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至多 4 次；每次基金收益分配比例不低于符合上述基金分红条件的可分配收益的 25%。

7、法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

#### **（四）收益分配方案**

基金收益分配方案中载明基金收益的范围、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。

#### **（五）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公告。

#### **（六）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。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记机构可将基金份额持有人的现金红利按[除权日除权后]的基金份额净值自动转为基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。

## **十四、基金的会计与审计**

### **（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，以人民币为记账单位。
  - 3、会计制度按国家有关的会计制度执行。
  - 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）基金年度审计**

1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人、境外资产托管人相独立的、具有从事证券、期货相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师等机构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。基金管理人应在更换会计师事务所后按照《信息披露办法》的有关规定披露。

## **十五、基金的信息披露**

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”）及指定互联网网站（以下简称“指定网站”）等媒介披露，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、基金产品资料概要、基金合同、基金托管协议**

---

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。《基金合同》生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在指定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。

基金产品资料概要是基金招募说明书的摘要文件，用于向投资者提供简明的基金概要信息。《基金合同》生效后，基金产品资料概要的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金产品资料概要，并登载在指定网站及基金销售机构网站或营业网点；基金产品资料概要其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金产品资料概要。

## **（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媒介和网站上登载基金合同生效公告。

## **（四）基金净值信息**

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在指定网站披露一次基金份额净值和基金份额累计净值。

在开始办理基金份额申购或赎回之后，基金管理人应当在不晚于 T+2 日（T 日为开放日）通过指定网站、基金销售机构网站或者营业网点以及其他指定媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

---

基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一个市场交易日后2个工作日，在指定网站披露半年度和年度最后一日的基金份额净值和基金份额累计净值。

### （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单独编制，由基金托管人按照法律法规的规定对相关内容进行复核。

1、基金年度报告：基金管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载在指定网站上，并将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计。

2、基金中期报告：基金管理人应当在上半年结束之日起两个月内，编制完成基金中期报告，将中期报告登载在指定网站上，并将中期报告提示性公告登载在指定报刊上。

3、基金季度报告：基金管理人应当在每个季度结束之日起十五个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定网站上，并将季度报告提示性公告登载在指定报刊上。

基金合同生效不足两个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。

基金管理人应当在基金年度报告和中期报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。

报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情形，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。

---

## （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依照《信息披露办法》的有关规定编制临时报告书，并登载在指定报刊和指定网站上。

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及决定的事项；
- 2、基金合同终止、基金清算；
- 3、转换基金运作方式、基金合并；
- 4、更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；
- 5、基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；
- 6、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- 7、基金管理公司变更持有百分之五以上股权的股东、变更公司的实际控制人；
- 8、基金募集期延长；
- 9、基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十，基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十；
- 10、基金管理人的高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；
- 11、涉及基金管理业务、基金资产、基金托管业务的诉讼或者仲裁；

---

12、基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；

13、基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易事项，但中国证监会另有规定的除外；

14、基金收益分配事项；

15、管理费、托管费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；

16、基金份额净值计价错误达基金份额净值 0.5%；

17、基金开始办理申购、赎回；

18、基金发生巨额赎回并延期办理；

19、基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；

20、基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；

21、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；

22、更换投资顾问、境外资产托管人；

23、基金运作期间如遇投资顾问主要负责人员变动，基金管理人认为该事件有可能对基金投资产生重大影响；

24、基金信息披露义务人认为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其他事项或中国证监会规定的其他事项。

#### （七）公开澄清



---

在基金合同期限内，任何公共媒介中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动的，以及可能损害基金份额持有人权益的，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。

#### （八）清算报告

基金合同终止的，基金管理人应当依法组织基金财产清算小组对基金财产进行清算并制作清算报告。基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

#### （九）信息披露文件的存放与查阅

依法必须披露的信息发布后，基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于公司住所，供社会公众查阅、复制。

### 十六、基金合同的终止与基金资产的清算

#### （一）基金合同的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本合同的约定应经基金份额持有人大会决议通过事项的，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、但如因相应的法律法规发生变动并属于基金合同必须遵照进行修改的情形，以及基金合同约定的其他无需召开基金份额持有人大会决定的事项，或者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或对基金份额持有人利益无实质性不利影响的，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告，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，基金合同终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金管理人、基金托管人承接的；
- 3、法律法规和基金合同规定的其他情形。

## （三）基金资产的清算

1、基金合同终止，基金管理人应当按法律法规和基金合同的有关法律法规规定对基金资产进行清算。

### 2、基金资产清算组

（1）自基金合同终止事由之日起三十个工作日内由基金管理人组织成立基金资产清算组，在基金资产清算组接管基金资产之前，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资产安全的职责。

（2）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、期货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。基金资产清算组可以聘用必要的工作人员。

（3）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，由基金资产清算组统一接管基金资产；
- （2）基金资产清算组根据基金资产的情况确定清算期限；

---

(3) 基金资产清算组对基金资产进行清理和确认；

(4) 对基金资产进行评估和变现；

(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) 对基金资产进行分配。

#### 4、清算费用

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。

#### 5、基金剩余财产的分配

基金资产按下列顺序清偿：

(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。

基金资产未按前款（1）、（2）、（3）项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

#### 6、基金资产清算的公告

基金资产清算组做出的清算报告经具有证券、期货相关业务资格的会计师事

---

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。基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

7、基金资产清算账册及文件由基金托管人保存二十年以上。

## 十七、基金托管人

### （一）基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期：1983年10月31日

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

法定代表人：陈四清

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

托管部门信息披露联系人：王永民

传真：（010）66594942

中国银行客服电话：95566

### （二）基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于1998年，现有员工110余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内，中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。

### （三）证券投资基金托管情况

---

截至 2018 年 12 月 31 日，中国银行已托管 700 只证券投资基金，其中境内基金 662 只，QDII 基金 38 只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型、FOF 等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

#### **（四）托管业务的内部控制制度**

中国银行托管业务部风险管理与控制工作是中国银行全面风险控制工作的组成部分，秉承中国银行风险控制理念，坚持“规范运作、稳健经营”的原则。中国银行托管业务部风险控制工作贯穿业务各环节，通过风险识别与评估、风险控制措施设定及制度建设、内外部检查及审计等措施强化托管业务全员、全面、全程的风险管控。

2007 年起，中国银行连续聘请外部会计会计师事务所开展托管业务内部控制审阅工作。先后获得基于“SAS70”、“AAF01/06”“ISAE3402”和“SSAE16”等国际主流内控审阅准则的无保留意见的审阅报告。2017 年，中国银行继续获得了基于“ISAE3402”和“SSAE16”双准则的内部控制审计报告。中国银行托管业务内控制度完善，内控措施严密，能够有效保证托管资产的安全。

#### **（五）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序**

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。

## **十八、相关服务机构**

### **（一）基金销售机构：**

- 1、直销机构：上投摩根基金管理有限公司（同上）
- 2、代销机构：

---

(1) 中国建设银行股份有限公司  
住所：北京市西城区金融大街 25 号  
办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼  
法定代表人：田国立  
客户服务电话：95533  
网址：[www.ccb.com](http://www.ccb.com)

(2) 中国农业银行股份有限公司  
住所：北京市东城区建国门内大街 69 号  
办公地址：北京市东城区建国门内大街 69 号  
法定代表人：周慕冰  
客户服务电话：95599  
网址：[www.abchina.com](http://www.abchina.com)

(3) 中国银行股份有限公司  
地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号  
办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号客户服务电话：95566  
法定代表人：[陈四清](#)  
客服电话：95566  
网址：[www.boc.cn](http://www.boc.cn)

(4) 招商银行股份有限公司  
注册地址：广东省深圳市福田区深南大道 7088 号  
办公地址：广东省深圳市福田区深南大道 7088 号  
法人代表：李建红  
客户服务中心电话：95555  
网址：[www.cmbchina.com](http://www.cmbchina.com)

(5) 交通银行股份有限公司  
注册地址：上海市银城中路 188 号  
办公地址：上海市银城中路 188 号  
法定代表人：彭纯  
客户服务热线：95559  
网址：[www.bankcomm.com](http://www.bankcomm.com)

---

(6) 上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区浦东南路 500 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：郑杨

客户服务热线：95528

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

(7) 上海银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路168号

办公地址：上海市浦东新区银城中路168号

法定代表人：范一飞

客户服务热线：021-962888

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

(8) 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

法定代表人：董文标

24 小时客户服务热线：95568

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

(9) 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

法定代表人：孙建一

客户服务统一咨询电话：40066-99999

网址：[bank.pingan.com](http://bank.pingan.com)

(10) 上海农村商业银行股份有限公司

注册地址：中国上海市浦东新区浦东大道 981 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 8 号中融碧玉蓝天大厦 15-20 21-23 层

法定代表人：冀光恒

门户网站：[www.srcb.com](http://www.srcb.com)

客户服务电话：021-962999

(11) 南京银行股份有限公司

办公地址：南京市玄武区中山路 288 号

---

法定代表人： 胡升荣

客服电话： 95302

网站： [www.njcb.com.cn](http://www.njcb.com.cn)

(12) 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）

法定代表人： 李梅

客服电话： 95523 或 4008895523

国际互联网网址: [www.swhysc.com](http://www.swhysc.com)

(13) 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： 李琦

客户服务电话： 400-800-0562

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

(14) 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 号久事商务大厦 7 楼

办公地址： 上海市黄浦区四川中路 213 号久事商务大厦 7 楼

法定代表人： 李俊杰

客户服务电话： 021-962518

网址： [www.962518.com](http://www.962518.com)

(15) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址： 中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号

办公地址： 上海市银城中路 168 号上海银行大厦 29 层

法定代表人： 杨德红

客户服务咨询电话： 95521

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

(16) 招商证券股份有限公司



---

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 38-45 层

法定代表人：宫少林

客户服务电话：95565

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

(17) 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

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

(18) 中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：陈有安

客服电话：4008888888

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

(19) 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：北京市东城区朝内大街 188 号

法定代表人：王常青

客户服务咨询电话：400-8888-108；

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

(20) 兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 268 号

法定代表人：杨华辉

客户服务热线：95562

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

(21) 海通证券股份有限公司

注册地址：上海市淮海中路 98 号

法定代表人：王开国

客服电话：95553

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

---

(22) 国都证券股份有限公司

注册地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层

办公地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层

法定代表人：常喆

客户服务电话：4008188118

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

(23) 国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市红岭中路1012号国信证券大厦16-26层

法定代表人：何如

客户服务电话：95536

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

(24) 华泰证券股份有限公司

注册地址：江苏省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

客户咨询电话：95597

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

(25) 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：王东明

客户服务热线：010-95558

(26) 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-29层

法定代表人：潘鑫军

客户服务热线：95503

东方证券网站：[www.dfzq.com.cn](http://www.dfzq.com.cn)

(27) 中信证券（山东）有限责任公司

注册和办公地址：山东省青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001

法定代表人：杨宝林

客户服务电话：95548

---

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

(28) 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 至 10 层

法定代表人: 黄金琳

客户服务热线:0591-96326

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

(29) 中国国际金融有限公司

注册地址: 北京市建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

办公地址: 北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

法定代表人: 金立群

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

电话: 021-58881690

(30) 安信证券股份有限公司

注册地址: 深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

办公地址: 深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

法定代表人: 王连志

客服电话: 4008001001

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

(31) 长江证券股份有限公司

注册地址: 武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人: 尤习贵

客户服务热线: 95579 或 4008-888-999 长江证券客户服务网站: [www.95579.com](http://www.95579.com)

(32) 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: 詹露阳

客服电话: 95511-8

网址: <http://stock.pingan.com>

(33) 东海证券股份有限公司

---

注册地址：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18 层  
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  
客户服务电话：95531；4008888588  
公司网站：www.longone.com.cn

(34) 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 2 楼  
法定代表人：汪静波  
客服电话：400-821-5399  
公司网站：www.noah-fund.com

(35) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室  
办公地址：上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层  
法定代表人：张跃伟  
客服电话：400-820-2899  
公司网站：www.erichfund.com

(36) 北京展恒基金销售股份有限公司

注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号  
办公地址：北京市朝阳区安苑路 15-1 号邮电新闻大厦 6 层  
法定代表人：闫振杰  
客服电话：400-818-8000  
公司网站：www.myfund.com

(37) 上海华夏财富投资管理有限公司

住所：上海市虹口区东大名路 687 号 1 幢 2 楼 268 室  
办公地址：北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层  
法定代表人：李一梅  
客户服务电话：400-817-5666  
传真：010-88066552

(38) 上海万得基金销售有限公司

---

住所：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

办公地址：上海市浦东新区浦明路 1500 号万得大厦 11 楼

法定代表人：王廷富

客户服务电话：400-821-0203

网址：[www.520fund.com.cn](http://www.520fund.com.cn)

(39) 嘉实财富管理有限公司

住所：上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心办公楼二期 53 层 5312-15 单元

法定代表人：赵学军

客服电话：400-021-8850

网站：[www.harvestwm.cn](http://www.harvestwm.cn)

(40) 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室

办公地址：上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯大厦 903-906 室

法定代表人：杨文斌

客服电话：400-700-9665

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

(41) 深圳众禄基金销售股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

办公地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

法定代表人：薛峰

客服电话：4006-788-887

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

(42) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 幢 202 室

办公地址：杭州市西湖区万塘路 18 号黄龙时代广场 B 座 6 楼

法定代表人：陈柏青

客服电话：400-0766-123

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

(43) 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：上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 9 楼

法定代表人：其实

客服电话：400-1818-188

网站：[www.1234567.com.cn](http://www.1234567.com.cn)

(44) 浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903

办公地址：浙江省杭州市翠柏路 7 号杭州电子商务产业园 2 楼

法定代表人：凌顺平

客服电话：4008-773-772

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

(45) 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：上海市虹口区东大名路 1098 号浦江国际金融广场 18 层

法定代表人：李兴春

客服电话：400-921-7755

网站：[www.leadfund.com.cn](http://www.leadfund.com.cn)

(46) 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：胡学勤

客服电话：400-821-9031

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

(47) 北京虹点基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区工人体育场北路甲 2 号裙房 2 层 222 单元

办公地址：北京市朝阳区工人体育场北路甲 2 号裙房 2 层 222 单元

法定代表人：郑毓栋

客服电话：400-618-0707

网站：[www.hongdianfund.com](http://www.hongdianfund.com)

(48) 珠海盈米财富管理有限公司

---

注册地址：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼

法定代表人：肖雯

客服电话：020-89629066

网站：[www.yingmi.cn](http://www.yingmi.cn)

(49) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006#

办公地址：北京市西城区宣武门外大街 28 号富卓大厦 16 层

法定代表人：马勇

客服电话：400-166-1188

网站：<http://8.jrj.com.cn/>

(50) 北京新浪仓石基金销售有限公司

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

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

法定代表人：李昭琛

客服电话：010-62675369

网站：[www.xincai.com](http://www.xincai.com)

(51) 北京肯特瑞基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区海淀东三街 2 号 4 层 401-15

办公地址：北京市亦庄经济开发区科创十一街 18 号院京东集团总部

法定代表人：江卉

客服电话：4000988511/4000888816

网址：<http://fund.jd.com/>

(52) 中证金牛（北京）投资咨询有限公司

注册地址：北京市丰台区东管头 1 号 2 号楼 2-45 室

办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲 1 号环球财讯中心 A 座 5 层

法定代表人：钱昊旻

客服电话：4008-909-998

---

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

(53) 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（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市南山区海德三道航天科技广场A座17楼1704室

法定代表人：TEO WEE HOWE

客服电话：0755-89460500

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

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其它符合要求的机构代理销售本基金，并在基金管理人网站公示。

**（二）基金注册登记机构：**

上投摩根基金管理有限公司（同上）

**（三）律师事务所与经办律师：**

名称：国浩律师集团（上海）事务所

注册地址：上海市南京西路580号南证大厦45楼

负责人：倪俊骥

联系电话：021-5234 1668

传真：021-5234 1670

经办律师：宣伟华

**（四）审计基金资产的会计师事务所**

名称：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

注册地址：中国上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

办公地址：中国上海市黄浦区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼

执行事务合伙人：李丹

联系电话：(021) 23238888

传真：(021) 23238800

联系人：沈兆杰

经办注册会计师：薛竞、沈兆杰



---

## 十九、基金合同的内容摘要

### (一) 基金份额持有人的权利与义务

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) 分享基金资产收益；
- (2) 参与分配清算后的剩余基金资产；
- (3) 依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；
- (4) 按照规定要求召开或自行召集基金份额持有人大会；
- (5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会,对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- (6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- (7) 监督基金管理人的投资运作；
- (8) 法律法规、基金合同规定的其它权利。

#### 3、基金份额持有人的义务

- (1) 遵守法律法规、基金合同；
- (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获得的不当得利；
  - (7) 遵守基金管理人及其代理销售机构和注册登记机构的相关交易及业务规则；
  - (8) 法律法规及基金合同规定的其他义务。

## (二) 基金管理人的权利与义务

### 1、基金管理人的权利：

- (1) 依法申请并募集基金，办理基金备案手续；
- (2) 依照法律法规和基金合同运用基金资产；
- (3) 自基金合同生效之日起，基金管理人依照法律法规和基金合同独立管理基金资产；
- (4) 根据法律法规和基金合同的规定决定本基金的相关费率结构和收费方式，获得基金管理人报酬，收取认购费、申购费、基金赎回手续费及其它事先批准或公告的合理费用以及法律法规规定的其它费用；
- (5) 根据法律法规和基金合同之规定销售基金份额；
- (6) 在本合同的有效期限内，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资产、其它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，以及采取其它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对基金代销机构行为进行必要的监督和检查；

(8) 自行承担基金注册登记机构或选择、更换基金注册登记机构，办理基金注册登记业务，并按照基金合同规定对基金注册登记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，制订基金收益的分配方案；

(12) 按照法律法规，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它证券所产生的权利；

(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) 依照有关规定行使因基金资产投资于证券所产生的权利；

(16) 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；

(17) 根据法律法规和基金合同的规定，制订、修改并公布有关基金募集、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；

(18) 选择、更换基金投资顾问；

(19) 委托第三方机构办理本基金的交易、清算、估值、结算等业务；

(20) 法律法规、基金合同以及依据基金合同制订的其它法律文件所规定的

---

其它权利。

## 2、基金管理人的义务：

(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) 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资产；

(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资产；

(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，保证所管理的基金资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、分别记帐，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资产；

(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，并向基金托管人及时、全面提供有效的所投资市场相关法律法规等信息；

(10) 编制季度报告、中期报告和年度报告；

(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) 计算并公告基金净值信息，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) 保存基金资产管理业务活动的记录、帐册、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) 组织并参加基金资产清算组，参与基金资产的保管、清理、估价、变现和分配；
- (20) 因违反基金合同导致基金资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；基金托管人委托的第三方机构不包括相关司法管辖区域内的证券登记、清算机构、第三方数据和信息来源机构、根据当地市场惯例无法向该服务提供方追偿的其他机构。
- (21) 基金托管人违反基金合同造成基金资产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；
- (22) 基金管理人对其委托的投资顾问及其他第三方机构的行为承担责任。
- (23) 中国证监会规定的其他职责。

---

### （三）基金托管人的权利与义务

#### 1、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资产；
- （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）选择、更换境外资产托管人并为之签署有关协议；
- （7）法律法规、基金合同规定的其它权利。

#### 2、基金托管人的义务：

- （1）安全保管基金资产，准时将公司行为信息通知基金管理人，确保基金及时收取所有应得收入；
- （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，负责基金资产境内托管事宜；
- （3）按规定开设基金资产的资金帐户和证券帐户；
- （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；
- （5）对所托管的不同基金资产分别设置账户，确保基金资产的完整和独立；
- （6）保管（或委托境外资产托管人）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、帐册、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、季度报告、中期报告和年度报告出具意见, 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;

(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、基金份额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) 因过错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; 除法律法规和基金合同另有规定外, 基金托管人不承担连带责任;

(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) 对其委托第三方机构相关事项的法律后果承担责任。

(21) 国务院证券监督管理机构规定的其他职责。

#### **(四) 基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则**

1、有以下事由情形之一时，应召开基金份额持有人大会：

1) 终止基金合同，但基金合同另有约定的除外；

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，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；

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) 本基金与其它基金合并；

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它应当召开基金份额持有人大会的事项。

2、以下情况不需召开基金份额持有人大会：

1) 调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；

2) 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和收费方式、



---

调低赎回费率，在法律法规和基金合同规定的范围内且在不提高现有基金份额持有人适用的费率的前提下设立新的基金份额级别、增加新的收费方式；

3)因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改；

4)对基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化；

5)对基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；

6)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它情形。

### 3、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，应当自行召集。

3)代表基金份额百分之十以上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，代表基金份额百分之十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) 代表基金份额百分之十以上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，代表基金份额百分之十以上的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前三十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。

#### 4、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 天在指定媒介上公告。基金份额持有人大会不得就未经公告的事项进行表决。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；

3) 投票委托书送达时间和地点；

4) 会务常设联系人姓名、电话；

5) 权益登记日；

6) 如采用通讯表决方式，则载明具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见的提交和收取方式、投票表决的截止日以及表决票的送达地址等内容。

#### 5、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以及法律法规或监管机构允许的其他方式。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，基金管理人或基金托管人不派代表出席的，不影响表决效力；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，但决定基金管理人更换或基金托管人的更换、转换基金运作方式和提前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。

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

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、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，全部有效凭证所代表的基金份额不少于权益登记日基金总份额的 50%（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告会议通知后，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) 本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额不少于权益登记日基金总份额的 50%（含 50%）；

4) 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其它代表，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；

5) 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(至少应在 25 个工作日后)，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不变。

## 6、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：

a、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进行解释和说明。

b、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作出决定。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作出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

(4) 单独或合并持有权益登记日基金总份额 10%或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，未获得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。

(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由大会聘请的公证机关的公证员统计全部有效表决并形成决议，报经中国证监会核准或备案后生效。

## 7、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

对于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以上（含三分之二）通过。

### (2) 一般决议

对于一般决议应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的百分之五十以上（含百分之五十）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提前终止基金合同应当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，符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决。

---

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。

3) 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,但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

## 8、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中推举三名基金份额持有人担任监票人。

(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) 如果会议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者基金份额持有人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。

(4) 在基金管理人或基金托管人担任召集人的情形下,如果在计票过程中基金管理人或者基金托管人拒不配合的,则参加会议的基金份额持有人有权推举三名基金份额持有人代表共同担任监票人进行计票。

---

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。

## 2) 通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式可采取如下方式：

由大会召集人授权的两名监票人在监督人（如果基金管理人为召集人，基金托管人为监督人；如果基金托管人为召集人，基金管理人为监督人）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 名监票人进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

## （五）基金合同的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本合同的约定应经基金份额持有人大会决议通过事项的，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、但如因相应的法律法规发生变动并属于基金合同必须遵照进行修改的情形，以及基金合同约定的其他无需召开基金份额持有人大会决定的事项，或者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或对基金份额持有人利益无实质性不利影响的，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告，并报中国证监会备案。

## （六）基金合同的终止

有下列情形之一的，基金合同终止：

---

1、基金份额持有人大会决定终止；

2、基金管理人、基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金管理人、基金托管人承接的；

3、法律法规和基金合同规定的其他情形。

### **(七) 基金资产的清算**

1、基金合同终止，基金管理人应当按法律法规和基金合同的有关法律法规规定对基金资产进行清算。

#### **2、基金资产清算组**

(1) 自基金合同终止事由之日起三十个工作日内由基金管理人组织成立基金资产清算组，在基金资产清算组接管基金资产之前，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资产安全的职责。

(2) 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、期货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。基金资产清算组可以聘用必要的工作人员。

(3) 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，由基金资产清算组统一接管基金资产；

(2) 基金资产清算组根据基金资产的情况确定清算期限；

(3) 基金资产清算组对基金资产进行清理和确认；

(4) 对基金资产进行评估和变现；



---

(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) 对基金资产进行分配。

#### 4、清算费用

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。

#### 5、基金剩余财产的分配

基金资产按下列顺序清偿：

(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。

基金资产未按前款(1)、(2)、(3)项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

#### 6、基金资产清算的公告

基金资产清算组做出的清算报告经具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并公告。基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

---

7、基金资产清算账册及文件由基金托管人保存二十年以上。

### **（八）争议解决方式**

（一）基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

（二）基金合同的当事人之间因基金合同产生的或与基金合同有关的争议应首先通过友好协商解决。但若自一方书面要求协商解决争议发生之日起 60 日内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，根据当时有效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，基金合同的其他部分应当由基金合同当事人继续履行。

## **二十、基金托管协议的内容摘要**

### **（一）托管协议当事人**

#### **1、基金管理人**

名称：上投摩根基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区富城路 99 号震旦国际大楼 25 层

法定代表人：陈兵

成立日期：2004 年 5 月 12 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监基字「2004」56 号

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其它业务

---

组织形式：有限责任公司

注册资本：人民币 2.5 亿元

存续期间：持续经营

## 2、基金托管人

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所：北京市复兴门内大街 1 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号中国银行总行办公大楼

法定代表人：陈四清

成立时间：1983 年 10 月 31 日

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

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字【1998】24 号

联系人：王娟

联系电话：（010）66594909

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；经中国银行业监督管理机构等监管部门批准的其他业务。

---

## （二）基金托管人与基金管理人之间的业务监督、核查

一、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》中实际可以监控事项的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督。主要包括以下方面：

### 1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。

本基金主要投资于与中国证监会签署监管合作备忘录的国家和地区的证券市场上交易的证券。

本基金投资组合中股票及其它权益类证券市值占基金资产的 60%-95%，现金、债券及中国证监会允许投资的其它金融工具市值占基金资产的 5%-40%，并保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股票及其他权益类证券包括中国证监会允许投资的普通股、优先股、存托凭证、公募股票基金等。现金、债券及中国证监会允许投资的其它金融工具包括银行存款、可转让存单、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；政府债券、公司债券、可转换债券、债券基金、货币基金等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；中国证监会认可的境外交易所上市交易的金融衍生产品等。

本基金将投资于全球多元化的股票组合，本基金将不低于 80%的股票资产投资于全球天然资源领域内从事天然资源的勘探、开发、生产及销售，或是向天然资源行业提供服务的上市公司，主要包括三大行业：（1）能源，如石油和天然气的开采、加工、销售及运输等；能源设备及服务；（2）基本金属和矿石，如铜、铝等基本金属的采矿与加工生产；（3）贵金属，如黄金、铂等。所投资的股票在 GICS 行业分类标准中分类为：能源和原材料。

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。

基金管理人应将拟投资的股票库、全球天然资源风格库等各投资品种的具体范围提供给基金托管人。基金管理人可以根据实际情况的变化，对各投资品种的具体范围予以更新和调整，并通知基金托管人。基金托管人根据上述投资范围对基金的投资进行监督；

---

2、对基金投融资比例进行监督；

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) 本基金持有同一家银行的存款不得超过基金净值的 20%，银行应当是中资商业银行在境外设立的分行或在最近一个会计年度达到中国证监会认可的信用评级机构评级的境外银行，但在基金托管账户的存款不受此限制；

(2) 本基金持有同一机构（政府、国际金融组织除外）发行的证券市值不得超过基金净值的 10%；

(3) 本基金持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产市值不得超过基金资产净值的 10%，其中持有任一国家或地区市场的证券资产市值不得超过基金资产净值的 3%；

(4) 本基金不得购买证券用于控制或影响发行该证券的机构或其管理层。同一境内机构投资者管理的全部基金不得持有同一机构 10%以上具有投票权的证券发行总量；

前项投资比例限制应当合并计算同一机构境内外上市的总股本，同时应当一并计算全球存托凭证和美国存托凭证所代表的基础证券，并假设对持有的股本权证行使转换；

(5) 本基金持有非流动性资产市值不得超过基金净值的 10%；

前项非流动性资产是指法律或基金合同规定的流通受限证券以及中国证监会认定的其他资产；

(6) 同一境内机构投资者管理的全部基金持有任何一只境外基金，不得超过该境外基金总份额的 20%；

(7) 本基金持有境外基金的市值合计不得超过本基金净值的 10%，持有货币市场基金不受上述限制。

(8) 本基金投资组合中股票及其它权益类证券市值占基金资产的 60%-95%，现金、债券及中国证监会允许投资的其它金融工具市值占基金资产的 5%-40%；

(9) 保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

(10) 本基金的金融衍生品全部敞口不得高于本基金资产净值的 100%；

(11) 本基金投资期货支付的初始保证金、投资期权支付或收取的期权费、投

---

资柜台交易衍生品支付的初始费用的总额不得高于基金资产净值的 10%；

(12) 本基金投资于远期合约、互换等柜台交易金融衍生品，应当符合以下要求：

(a) 所有参与交易对手方（中资商业银行除外）应当具有不低于中国证监会认可的信用评级机构评级。

(b) 交易对手方应当至少每个工作日对交易进行估值，并且基金可在任何时候以公允价值终止交易。

(c) 任一交易对手方的市值计价敞口不得超过基金资产净值的 20%。

(13) 本基金管理人管理且由本托管人托管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%；本基金管理人管理且由本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%；

(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；

(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；本基金管理人承诺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与基金合同约定的投资范围保持一致，并承担由于不一致所导致的风险或损失；

(16) 相关法律法规、基金合同及中国证监会的其他规定。

为有效管理投资组合和规避风险，本基金可适当投资于远期合约、期货合约、期权、掉期等衍生金融工具。金融衍生品投资应当符合法律法规及中国证监会有关规定。

法律法规或中国有关监管部门取消上述限制，本基金不受上述限制。《基金法》及其他有关法律法规或监管部门调整上述限制的，履行适当程序后，基金可依据届时有效的法律法规适时合理地调整上述限制。

因证券市场波动、上市公司合并分拆、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定的投资比例的，除上述第（9）、（14）、（15）

---

条所述情况外，基金管理人应当在 30 个工作日内进行调整。但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

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 个工作日内增加 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 30 个工作日延长到 3 个月。

3、对法律法规规定、《基金合同》和本协议约定的基金投资禁止行为进行监督。为对基金禁止从事的关联交易进行监督，基金管理人和基金托管人应相互提供与本机构有控股关系的股东或与本机构有其他重大利害关系的公司名单；

4、基金管理人向基金托管人提供其回购交易及监督所需的其他投资品种的交易对手库，交易对手库由信用等级符合《通知》要求的交易对手组成。基金托管人只对进行金融衍生品、证券借贷、回购交易之交易对手作出监督。监督范围并不包括一般证券买卖之券商。基金管理人可以根据实际情况的变化，及时对交易对手库予以更新和调整，并通知基金托管人。基金管理人进行金融衍生品、证券借贷、回购交易时，交易对手应符合交易对手库的范围。基金托管人对交易对手是否符合交易对手库进行监督；

5、基金如投资银行存款，基金管理人应根据法律法规的规定及基金合同的约定，事先确定符合条件的所有存款银行的名单，并及时提供给基金托管人，基金托管人据以对基金投资银行存款的交易对手是否符合上述名单进行监督；

6、对法律法规规定及《基金合同》中实际可以监控事项约定的基金投资的其他方面进行监督。

二、基金托管人应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

---

行业务复核。

三、基金托管人发现基金管理人或其投资顾问的违规行为，应及时通知基金管理人，由基金管理人或由基金管理人责成投资顾问限期纠正；基金管理人收到通知后应及时进行核对确认并回函；在限期内，基金托管人有权对通知事项进行复查，如基金管理人未予纠正或基金管理人未责成投资顾问纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

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

五、基金托管人对投资管理人对基金资产的投资运作于估值日结束且相关数据齐备后，进行交易后的投资监控和报告。

六、基金托管人的投资监督报告的准确性和完整性受限于基金管理人或其投资顾问及其他中介机构提供的数据和信息，基金托管人对这些机构的信息的准确性和完整性不作任何担保、暗示或表示，并对这些机构的信息的准确性和完整性所引起的损失不负任何责任。

七、基金托管人对基金管理人或其投资顾问的投资行为(包括但不限于其投资策略及决定)及其投资回报不承担任何责任。

### **(三) 基金管理人**对**基金托管人**的**业务监督和核查**

1、在本协议的有效期内，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协议的情况进行必要的核查，核查事项包括但不限于基金托管人安全保管基金资产、开设基金资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资产、未对基金资产实行分账管理、无正当理由未执行或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法律法规、《基金合同》及本协议有关规定时，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正，基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金管理人发出回函。在限期内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应报告中国证监会。

3、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。

#### **（四）基金资产的保管**

##### **1、基金资产保管的原则**

1) 基金资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资产，除本协议第八点(一)1、2 及 3 之情况外，未经基金管理人的合法合规指令或法律法规、《基金合同》及本协议另有规定，不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。

3) 基金托管人按照规定开设基金资产的所有资金账户和证券账户。

4) 基金托管人对所托管的不同基金资产分别设置账户，确保基金资产的完整与独立。

5) 基金托管人可将基金资产安全保管和办理与基金资产过户有关的手续等职责委托给第三方机构履行。

6) 现金账户中的现金由基金托管人或其境外托管人以银行身份持有。

7) 托管人或其境外托管人按照有关市场的适用法律、法规和市场惯例，支付现金、办理证券登记等托管业务。

---

## 2、基金募集期间及募集资金的验资

1) 基金募集期间的资金应存于基金管理人开立的“基金募集专户”。该账户由基金管理人以基金管理人的名义开立并管理。

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合同及其他有关规定后，基金管理人应在规定时间内，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。验资完成后，基金管理人应将属于基金资产的全部资金划入基金托管人开立并指定的基金托管银行账户中，并确保划入的资金与验资确认金额相一致。

3) 若基金募集期限届满，未能达到基金合同及其他有关规定的生效条件，由基金管理人按规定办理退款等事宜。

## 3、基金银行账户的开立和管理

1) 基金托管人应负责本基金的银行账户的开设和管理。

2) 基金托管人以本基金的名义开设本基金的托管账户。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，均需通过本基金的托管账户进行。

3) 本基金托管账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人、基金管理人不得假借本基金的名义开立其他任何银行账户；亦不得使用本基金的银行账户进行本基金业务以外的活动。

4) 基金资金结算账户的开立和管理应符合账户所在国或地区监管机构的有关规定。

## 4、基金证券账户的开立和管理

1) 基金托管人在基金所投资市场的交易所或登记结算机构或境外资产托管人处，按照该交易所或登记结算机构的业务规则开立证券账户。

---

2) 基金证券账户的开立和使用, 仅限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人以及各自委托代理人均不得出借擅自转让基金的任何证券账户, 亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

3) 基金证券账户的开立和证券账户相关证明文件的保管由基金托管人负责, 账户资产的管理和运用由基金管理人负责。

4) 除非基金托管人及其境外托管人存在过失、疏忽、欺诈或故意不当行为, 基金托管人将不保证其或其境外托管人所接收基金资产中的证券的所有权、合法性或真实性 (包括是否以良好形式转让)。

5) 基金证券账户的开立和管理应符合账户所在国或地区有关法律的规定。

#### 5、其他账户的开立和管理

1) 因业务发展需要而开立的其他账户, 可以根据投资市场所在国家或地区法律法规和基金合同的规定, 由基金托管人或境外资产托管人负责开立。新账户按有关规则使用并管理。

2) 投资市场所在国家或地区法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的, 从其规定办理。

#### 6、基金资产投资的有关有价凭证等的保管

基金资产投资的有价凭证等的保管按照实物证券相关规定办理。基金托管人对其以外机构实际有效控制的有价凭证不承担责任。

#### 7、与基金资产有关的重大合同的保管

基金托管人按照法律法规保管由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同及有关凭证。基金管理人代表基金签署有关重大合同后应在收到合同正本后 30 日内将一份正本的原件提交给基金托管人。除另有规定外, 基金管理人或其委托的第三方机构在代表基金签署与基金资产有关的重大合同时一般应保证有两份以上的正本, 以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本原件。

---

重大合同由基金管理人与基金托管人按规定各自保管至少 20 年。

## （五）基金资产净值计算与会计核算

基金资产的净值计算和会计核算按照相关的法律法规进行。

### 一、基金资产定价

基金托管人、境外托管人负责按基金管理人和基金托管人约定的定价原则对基金资产进行定价。在进行资产定价时，基金托管人、境外托管人有权本着诚意原则，依赖本协议所约定的经纪人、定价服务机构或其他机构的定价信息，但在不存在过错的前提下，基金托管人、境外托管人对上述机构提供的信息的准确性和完整性不作任何担保，并对这些机构的信息的准确性和完整性所引起的基金管理人或基金资产损失不负任何责任。

### 二、基金资产净值的计算和复核

#### 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价值。基金份额净值是指基金资产净值除以基金份额总数后的价值。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。

#### 2、复核程序

基金管理人每个开放日对基金进行估值，估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算业务指引》及其他法律法规的规定。每个工作日下午 15:00 之前，基金管理人将前一日的基金估值结果以双方确认的形式报送基金托管人。基金托管人应在收到上述估值结果后进行复核，并在当日 18:00 之前以双方确认的方式将复核结果传送给基金管理人，由基金管理人定期对外公布。基金月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

3、当相关法律法规或《基金合同》规定的估值方法不能客观反映基金资产公允价值时，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、基金管理人、基金托管人发现基金估值违反《基金合同》订明的估值方法、程序以及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，双方应及时进行协商和纠正。

5、当基金资产的估值导致基金份额净值小数点后三位内发生差错时，视为基金份额净值估值错误。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。如法律法规或监管机构对前述内容另有规定的，按其规定处理。

6、如果基金托管人的复核结果与基金管理人的计算结果存在偏差并且偏差在合理的范围内，基金份额净值以基金管理人的计算结果为准，基金管理费和基金托管费也应以基金管理人的净值计算结果计提。

7、由于基金管理人对外公布的任何基金净值数据错误，导致该基金资产或基金份额持有人的实际损失，基金管理人应对此承担责任。若基金托管人计算的净值数据正确，则基金托管人对该损失不承担责任；若基金托管人计算的净值数据也不正确，则基金托管人也应承担部分未正确履行复核义务的责任。如果上述错误造成了基金资产或基金份额持有人的不当得利，且基金管理人及基金托管人已各自承担了赔偿责任，则基金管理人应负责向不当得利之主体主张返还不当得利。如果返还金额不足以弥补基金管理人 and 基金托管人已承担的赔偿金额，则双方按照各自赔偿金额的比例对返还金额进行分配。

8、由于证券交易所及其登记结算公司及其他中介机构发送的数据错误，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。但基金管理人和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。

9、如果基金托管人的复核结果与基金管理人的计算结果存在差异，且双方

---

经协商未能达成一致，基金管理人可以按照其对基金份额净值的计算结果对外予以公布，基金托管人可以将相关情况报中国证监会备案。

### 三、基金会计核算

#### 1、基金账册的建立

基金管理人和基金托管人在《基金合同》生效后，应按照双方约定的同一记账方法和会计处理原则，分别独立地设置、登记和保管基金的全套账册，对双方各自的账册定期进行核对，互相监督，以保证基金资产的安全。若双方对会计处理方法存在分歧，应以基金管理人的处理方法为准。

#### 2、会计数据和财务指标的核对

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

#### 3、基金财务报表和定期报告的编制和复核

基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。月度报表的编制，应于每月终了后 5 个工作日内完成；《基金合同》生效后，招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新招募说明书并登载在指定网站上。招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次；基金产品资料概要的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金产品资料概要并登载在指定网站及基金销售机构网站或营业网点。基金产品资料概要其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新招募说明书和基金产品资料概要。基金管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载在指定网站上，并将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。基金管理人应当在上半年结束之日起两个月内，编制完成基金中期报告，将中期报告登载在指定网站上，并将中期报告提示性公告登载在指定报刊上。基金管理人应当在季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，将季度报告登载在指定网站上，并将季度报告提示性公告登载在指定报刊上。基金合同生效不足两个月的，基金管理人可以不

---

编制当期季度报告，中期报告或者年度报告。

基金管理人在月度报表完成当日，将报表盖章后提供给基金托管人复核；基金托管人在收到后应立即进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人机构在季度报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后 5 个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在中期报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后 15 日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在年度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人应在收到后 25 日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人和基金托管人之间的上述文件往来均以传真的方式或双方商定的其他方式进行。

基金托管人在复核过程中，发现双方的报表存在不符时，基金管理人和基金托管人应共同查明原因，进行调整，调整以双方认可的账务处理方式为准；若双方无法达成一致以基金管理人的账务处理为准。核对无误后，基金托管人在基金管理人提供的月度报告上加盖业务章，在季报、中期报告和年报上加盖托管业务部门公章或者出具加盖托管业务部门公章的复核意见书或进行电子确认，双方各自留存一份。如果基金管理人与基金托管人不能于应当发布公告之日之前就相关报表达成一致，基金管理人有权按照其编制的报表对外发布公告，基金托管人有权就相关情况报证监会备案。

## （六）基金份额持有人名册的保管

### 一、基金份额持有人名册的内容

基金份额持有人名册的内容包括但不限于基金份额持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册包括以下几类：

- 1、基金募集期结束时的基金份额持有人名册；
- 2、基金权益登记日的基金份额持有人名册；

---

3、基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册；

4、每半年度最后一个交易日的基金份额持有人名册。

## 二、基金份额持有人名册的提供

对于每半年度最后一个交易日的基金份额持有人名册，基金管理人应在每半年度结束后 5 个工作日内定期向基金托管人提供。对于基金募集期结束时的基金份额持有人名册、基金权益登记日的基金份额持有人名册以及基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册，基金管理人应在相关的名册生成后 5 个工作日内向基金托管人提供。

## 三、基金份额持有人名册的保管

基金托管人应妥善保管基金份额持有人名册。如基金托管人无法妥善保存持有人名册，基金管理人应及时向中国证监会报告，并代为履行保管基金份额持有人名册的职责。基金托管人应对基金管理人由此产生的保管费给予补偿。

基金托管人对基金份额持有人名册负有保密义务。除法律法规、基金合同和本协议另有规定外，基金托管人不得将基金份额持有人名册及其中的任何信息以任何方式向任何第三方披露，基金托管人应将基金份额持有人名册及其中的信息限制在为履行基金合同和本协议之目的而需要了解该等信息的人员范围之内。

## （七）争议解决方式

因本协议产生或与之相关的争议，双方当事人应通过协商解决，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现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，双方当事人应各自继续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。

## **（八）托管协议的变更、终止与基金资产的清算**

### **一、托管协议的修改程序**

本协议经双方当事人经协商一致，可以书面形式对协议进行修改。修改后的新协议，其内容不得与基金合同的规定有任何冲突。基金托管协议的变更报中国证监会核准后生效。

### **二、基金托管协议终止出现的情形**

发生以下情况，本托管协议终止：

- 1、《基金合同》终止；
- 2、本基金更换基金托管人；
- 3、本基金更换基金管理人；
- 4、发生《基金法》、《运作办法》或其他法律法规规定的终止事项。

### **三、基金资产的清算**

基金管理人和基金托管人应按照《基金合同》及有关法律法规的规定对本基金的财产进行清算。

## **二十一、对基金份额持有人的服务**

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务。基金管理人将根据基金份额持有人的需要和市场的变化，增加或变更服务项目。主要服务内容如下：

### **（一）资料寄送**

1. 基金投资者对账单：

---

基金管理人将向发生交易的基金份额持有人以书面或电子文件形式定期或不定期寄送对账单。

2. 其他相关的信息资料。

### **(二) 多种收费方式选择**

基金管理人在合适时机将为基金投资者提供多种收费方式购买本基金，满足基金投资者多样化的投资需求，具体实施办法见有关公告。

### **(三) 基金电子交易服务**

基金管理人为基金投资者提供基金电子交易服务。投资人可登录基金管理人的网站([www.cifm.com](http://www.cifm.com))查询详情。

### **(四) 联系方式**

上投摩根基金管理有限公司

咨询电话：400 889 4888

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

## **二十二、招募说明书的存放及查阅方式**

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

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

## **二十三、其他应披露事项**

1. 2018年12月20日，上投摩根全球天然资源混合型证券投资基金暂停申购、赎回、定期定额投资及转换转入业务的公告

---

上述公告均依法通过中国证监会指定的媒介进行披露。

## 二十四、备查文件

本基金备查文件包括下列文件：

- 1、中国证监会核准上投摩根全球天然资源混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《上投摩根全球天然资源混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《上投摩根全球天然资源混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、关于申请募集上投摩根全球天然资源混合型证券投资基金法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、中国证监会要求的其他文件。