

信达澳银新征程定期开放灵活配置混合型  
证券投资基金招募说明书（更新）

基金管理人：信达澳银基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

二〇二一年一月

## 重要提示

本基金经中国证监会 2017 年 8 月 9 日证监许可【2017】1462 号文注册。根据相关法律法规，本基金基金合同已于 2018 年 3 月 27 日生效，基金管理人于该日起正式开始对基金财产进行运作管理。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。投资者应当认真阅读基金招募说明书、基金合同等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。

证券投资基金（以下简称“基金”）是一种长期投资工具，其主要功能是分散投资，降低投资单一证券所带来的个别风险。基金不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具，投资者购买基金，既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益，也可能承担基金投资所带来的损失。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，获得基金投资收益，亦承担基金投资中出现的各类风险，包括：市场风险、流动性风险、信用风险、管理风险、本基金的特有风险、其他风险等。

本基金为混合型基金，属于证券投资基金中预期风险与预期收益中等的投资品种，其风险收益水平高于货币基金和债券型基金，低于股票型基金。

投资有风险，投资者认（申）购基金份额时应认真阅读本招募说明书及基金合同，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策。

投资者应当通过本基金管理人或代销机构购买和赎回基金。本基金在募集期内按 1.00 元面值发售并不改变基金的风险收益特征。投资者按 1.00 元面值购买基金份额以后，有可能面临基金份额净值跌破 1.00 元从而遭受损失的风险。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人承诺以恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不向投资者保证基金一定盈利，也不向投

投资者保证最低收益。

本基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。

本更新招募说明书关于基金经理及基金管理人信息的内容截止日为 2021 年 1 月 22 日，本基金本次招募说明书其余所载内容截止日为 2020 年 2 月 24 日，所载财务数据和净值表现截至 2019 年 12 月 31 日（财务数据未经审计）。

## 目 录

|                             |     |
|-----------------------------|-----|
| 一、绪言 .....                  | 2   |
| 二、释义 .....                  | 3   |
| 三、基金管理人 .....               | 8   |
| 四、基金托管人 .....               | 22  |
| 五、相关服务机构 .....              | 26  |
| 六、基金的募集 .....               | 35  |
| 七、基金备案与基金合同的生效 .....        | 36  |
| 九、基金份额的申购与赎回 .....          | 38  |
| 十、基金的投资 .....               | 49  |
| 十一、基金的业绩 .....              | 62  |
| 十二、基金的财产 .....              | 63  |
| 十三、基金资产的估值 .....            | 66  |
| 十四、基金收益与分配 .....            | 72  |
| 十五、基金的费用与税收 .....           | 74  |
| 十六、基金的会计与审计 .....           | 77  |
| 十七、基金的信息披露 .....            | 78  |
| 十八、风险揭示 .....               | 85  |
| 十九、基金合同的变更、终止与基金财产的清算 ..... | 89  |
| 二十、基金合同的内容摘要 .....          | 91  |
| 二十一、基金托管协议的内容摘要 .....       | 124 |
| 二十二、对基金份额持有人的服务 .....       | 144 |
| 二十三、其他应披露事项 .....           | 146 |
| 二十四、招募说明书的存放及查阅方式 .....     | 151 |
| 二十三、备查文件 .....              | 152 |

## 一、绪言

本招募说明书根据《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》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险规定》”）及其他有关规定以及《信达澳银新征程定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》编写。

本招募说明书阐述了新征程定期开放灵活配置混合型证券投资基金的投资目标、策略、风险、费率和基金交易等与投资者投资决策有关的必要事项，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

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

本基金根据本招募说明书所载资料申请募集。本招募说明书由信达澳银基金管理有限公司解释。本基金管理人没有委托或者授权委托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出任何解释或者说明。

本基金招募说明书依据本基金的基金合同编写，并经中国证监会注册。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件，其他与本基金相关的涉及基金合同当事人之间权利义务关系的任何文件或表述，均以基金合同为准。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。基金投资者取得依基金合同所发行的基金份额，即成为基金份额持有人和本基金基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受。基金份额持有人作为基金合同当事人并不以在基金合同上书面签章为必要条件。基金合同当事人按照《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《销售办法》、《流动性风险规定》基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务；基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅《信达澳银新征程定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。

## 二、释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

- 1、基金或本基金：指信达澳银新征程定期开放灵活配置混合型证券投资基金
- 2、基金管理人：指信达澳银基金管理有限公司
- 3、基金托管人：指交通银行股份有限公司
- 4、基金合同：指《信达澳银新征程定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充
- 5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《信达澳银新征程定期开放灵活配置混合型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
- 6、招募说明书或本招募说明书：指《信达澳银新征程定期开放灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》及其更新
- 7、基金份额发售公告：指《信达澳银新征程定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金份额发售公告》
- 8、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等
- 9、《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，并经 2012 年 12 月 28 日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自 2013 年 6 月 1 日起实施，并经 2015 年 4 月 24 日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修改的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 10、《销售办法》：指中国证监会 2013 年 3 月 15 日颁布、同年 6 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 11、《信息披露办法》：指中国证监会 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》及颁布机关对其不时做出的修订
- 12、《运作办法》：指中国证监会 2014 年 7 月 7 日颁布、同年 8 月 8 日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 13、《流动性风险规定》：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

14、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

15、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会

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

17、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

18、机构投资者：指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织

19、合格境外机构投资者：指符合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

20、投资人：指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称

21、基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人

22、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换及转托管等业务

23、销售机构：指信达澳银基金管理有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议，代为办理基金销售业务的机构

24、登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等

25、登记机构：指办理登记业务的机构。基金的登记机构为信达澳银基金管理有限公司或接受信达澳银基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构

26、基金账户：指登记机构为投资人开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户

27、基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构办理认购、申购、赎回、转换及转托管等业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户

28、基金合同生效日：指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，

基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期

29、基金合同终止日：指基金合同规定的基金合同终止事由出现后，基金财产清算完毕，清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期

30、基金募集期：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过3个月

31、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

32、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

33、T日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日

34、T+n日：指自T日起第n个工作日(不包含T日)

35、封闭期：本基金的封闭期为自基金合同生效之日（含）起或自每一开放期结束之日次日（含）起3个月的期间。本基金封闭期内不办理申购与赎回业务，也不上市交易

36、开放期：本基金自每个封闭期结束之后第一个工作日（含）起进入开放期，期间可以办理申购与赎回等业务

37、开放日：指开放期内，为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

38、开放时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

39、《业务规则》：指《信达澳银基金管理有限公司开放式基金业务规则》，是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金登记方面的业务规则，由基金管理人和投资人共同遵守

40、认购：指在基金募集期内，投资人根据基金合同及招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

41、申购：指基金合同生效后的开放期内，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

42、赎回：指基金合同生效后的开放期内，基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为

43、基金转换：指开放期内，基金份额持有人按照基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换



为基金管理人管理的、且由同一登记机构办理注册登记的其他基金基金份额的行为

44、转托管：指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基金份额销售机构的操作

45、巨额赎回：指本基金开放期内单个开放日，基金净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过上一工作日基金总份额的 20%

46、元：指人民币元

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

48、基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收款项及其他资产的价值总和

49、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

50、基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

51、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

52、基金产品资料概要：指《信达澳银新征程定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要》及其更新

53、摆动定价机制：指当遭遇大额申购或赎回时，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

54、基金份额的类别：本基金根据认/申购费、销售服务费收取方式不同，将基金份额分为不同的类别：A类基金份额和C类基金份额。各类基金份额分设不同的基金代码，并分别计算和公布各类基金份额净值和各类基金份额累计净值

55、A类基金份额：指在投资者认购/申购时收取认购/申购费用，而不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额

56、C类基金份额：指在投资者认购/申购时不收取认购/申购费用，但从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额

57、销售服务费：指本基金用于持续销售和服务基金份额持有人的费用，该笔费用从基金财产中计提，属于基金的营运费用

58、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

59、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（以下简称“指定报刊”）及指定互联网网站（以下简称“指定网站”，包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会电子披露网站）等媒介

60、不可抗力：指基金合同当事人无法预见、无法抗拒、无法避免且在基金合同由基金管理人、基金托管人签署之日后发生的，使基金合同当事人无法全部或部分履行基金合同的任何事件，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、恐怖袭击、传染病传播、法律法规变化、突发停电或其他突发事件、证券、期货交易所非正常暂停或停止交易，中国人民银行结算系统故障、计算机系统故障、网络故障、通讯故障、电力故障、计算机病毒攻击及其他非基金管理人、基金托管人故意造成的意外事故

### 三、基金管理人

#### (一) 基金管理人概况

##### 1、基金管理人概况

名称：信达澳银基金管理有限公司

住所：广东省深圳市南山区科苑南路（深圳湾段）3331 号阿里巴巴大厦 N1 座第 8 层和第 9 层

办公地址：广东省深圳市南山区科苑南路（深圳湾段）3331 号阿里巴巴大厦 T1 座第 8 层和第 9 层

邮政编码：518054

成立日期：2006 年 6 月 5 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监基金字【2006】071 号

法定代表人：祝瑞敏

电话：0755-83172666

传真：0755-83199091

联系人：韩宗惊

经营范围：基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务

组织形式：有限责任公司

注册资本：壹亿元人民币

股本结构：信达证券股份有限公司出资 5400 万元，占公司总股本的 54%；East Topco Limited 出资 4600 万元，占公司总股本的 46%

存续期间：持续经营

#### (二) 主要人员情况

##### 1、董事、监事、高级管理人员

董事：

祝瑞敏，董事长，中国人民大学管理学博士，高级会计师。2008 年 7 月至 2012 年 4 月历任东兴证券股份有限公司财务部总经理、公司助理总经理、公司副总经理，

2012年4月至2019年4月任中国银河证券股份有限公司首席财务官。2019年4月任信达证券股份有限公司党委副书记，2019年9月任信达证券股份有限公司党委副书记、董事、总经理，2020年11月6日起任信达证券股份有限公司法定代表人。2019年12月15日起兼任信达澳银基金管理有限公司董事长。

潘广建先生，副董事长，英国伯明翰大学工商管理硕士，加拿大注册会计师。曾任职于德勤会计师事务所稽核部、香港期货交易所监察部，1997年起历任山一证券分析员、香港证券及期货事务监察委员会助理经理、香港强制性公积金计划管理局经理、景顺亚洲业务发展经理、景顺长城基金管理公司财务总监、AXA国卫市场部助理总经理、银联信托有限公司市场及产品部主管。2007年5月起任首域投资（香港）有限公司中国业务开发董事并于同年兼任信达澳银基金管理有限公司监事至2016年5月13日。2016年5月14日起兼任信达澳银基金管理有限公司董事。2019年起任澳大利亚联邦银行信达澳银董事，2019年12月5日兼任信达澳银基金管理有限公司副董事长。

朱永强先生，董事，浙江大学工学硕士，长江商学院高级管理人员工商管理硕士。2004年12月至2010年1月历任华泰联合证券有限责任公司总裁助理、副总裁，2010年1月至2012年11月任中信证券股份有限公司经纪业务发展管理委员会董事总经理，2012年11月至2016年10月任中国银河证券股份有限公司经纪业务线业务总监，兼任经纪管理总部总经理。2016年10月至2019年10月任前海开源基金管理有限公司执行董事长兼首席执行官。2019年12月5日起任信达澳银基金管理有限公司董事，2019年12月31日起任信达澳银基金管理有限公司总经理，2020年8月19日起兼任信达澳银基金管理有限公司首席信息官。

刘治海先生，独立董事，全国律师协会公司法专业委员会委员，北京市人大立法咨询专家，中国政法大学法学硕士，历任江苏省盐城市政法干校教师，首都经贸大学经济系讲师，自1993年2月起担任北京金诚同达律师事务所高级合伙人。2015年5月8日起兼任信达澳银基金管理有限公司独立董事。

张宏先生，独立董事，北京大学光华管理学院工商管理硕士，高级经济师。1987年9月至1997年1月历任中国建设银行总行信托投资公司证券部副总经理、国际业务部副总经理，1997年1月至2009年5月任北京国利能源投资有限公司副总经理，2009年5月起历任华澳国际信托有限公司总裁、董事长、监事长。2019年4月9日起兼任信达澳银基金管理有限公司独立董事。

刘颂兴先生，独立董事，香港中文大学工商管理硕士。历任 W. I. Carr（远东）有限公司投资分析师，霸菱国际资产管理有限公司投资分析师、投资经理，纽约摩根担保信托公司 Intl 投资管理副经理，景顺亚洲有限公司投资董事，汇丰资产管理（香港）有限公司（2005 年 5 月起改组为汇丰卓誉投资管理公司）股票董事，中银保诚资产管理有限公司投资董事，新鸿基地产有限公司企业策划总经理，中国平安资产管理（香港）有限公司高级副总裁兼股票投资董事，中国国际金融（香港）有限公司资产管理部执行董事，Seekers Advisors（香港）有限公司执行董事兼投资总监。2012 年 6 月 19 日起担任广发资产管理（香港）有限公司董事总经理。2011 年 12 月起兼任信达澳银基金管理有限公司独立董事。

#### 执行监事：

韩冰女士，清华大学经济管理学院工商管理硕士，现任公司行政总监。19 年证券、基金从业经验。2001 年 4 月至 2014 年 9 月任职世纪证券有限责任公司，任职人力资源部负责人职务。2015 年 4 月加入信达澳银基金管理有限公司，任行政总监。自 2020 年 11 月 16 日起兼任信达澳银基金管理有限公司职工监事。

#### 高级管理人员：

朱永强先生，总经理，浙江大学工学硕士，长江商学院高级管理工商管理硕士，27 年证券、基金从业经验，具有证券与基金从业资格、基金业高级管理人员任职资格。2004 年 12 月至 2010 年 1 月历任华泰联合证券有限责任公司总裁助理、副总裁，2010 年 1 月至 2012 年 11 月任中信证券股份有限公司经纪业务发展管理委员会董事总经理，2012 年 11 月至 2016 年 10 月任中国银河证券股份有限公司经纪业务线业务总监，兼任经纪管理总部总经理。2016 年 10 月至 2019 年 10 月任前海开源基金管理有限公司执行董事长兼首席执行官。2019 年 12 月 5 日起任信达澳银基金管理有限公司董事，2019 年 12 月 31 日起任信达澳银基金管理有限公司总经理，2020 年 8 月 19 日起兼任信达澳银基金管理有限公司首席信息官。

黄晖女士，副总经理兼董事会秘书，中南财经大学经济学学士，加拿大 Concordia University 经济学硕士。23 年证券、基金从业经验，具有证券与基金从业资格、基金业高级管理人员任职资格。1999 年起历任大成基金管理有限公司研究部分析师、市场部副总监、规划发展部副总监、机构理财部总监等职务。2000-2001 年参与英国政府“中国金融人才培养计划”（FIST 项目），任职于东方汇理证券公司（伦敦）。2005 年 8 月加入信达澳银基金管理有限公司，任督察长兼董

事会秘书。2019年4月30日起任信达澳银基金管理有限公司副总经理。

于鹏先生，副总经理，中国人民大学经济学学士。26年证券、基金从业经验，具有证券与基金从业资格、基金业高级管理人员任职资格。历任中国建设银行总行信托投资公司证券总部驻武汉证券交易中心交易员、计划财务部会计、深圳证券营业部计划财务部副经理、经理；中国信达信托投资公司北京证券营业部总经理助理兼计财部经理；宏源证券股份有限公司北京营业部副总经理、机构管理总部业务监控部经理兼清算中心经理、资金财务总部副总经理、资金管理总部总经理兼客户资金存管中心总经理等职务。2005年10月加入信达澳银基金管理有限公司，历任财务总监、总经理助理兼财务总监、副总经理。

王咏辉先生，副总经理，英国牛津大学工程专业本科和牛津大学计算机专业硕士，22年证券、基金从业经验，具备基金从业资格、基金业高级管理人员任职资格、英国基金经理从业资格（IMC）、英国 IET 颁发的特许工程师（CEng）认证资格。曾任伦敦摩根大通（JPMorgan）投资基金管理公司分析员、高级分析师，汇丰投资基金管理公司（HSBC）高级分析师，伦敦巴克莱国际投资基金管理公司基金经理、部门负责人，巴克莱资本公司（Barclays Capital）部门负责人，泰达宏利基金管理公司（Manulife Teda）国际投资部负责人、量化投资与金融工程部负责人、基金经理，鹏华基金管理有限公司量化及衍生品投资部总经理、资产配置与基金投资部总监、基金经理兼投资决策委员会委员等职务。2017年10月加入信达澳银基金管理有限公司，任总经理助理、基金经理，分管智能量化与全球资产配置总部。2019年8月16日起任信达澳银基金管理有限公司副总经理。

徐伟文先生，督察长，湖南大学工业自动化专业学士，25年证券、基金从业经验，具有证券与基金从业资格、基金业高级管理人员任职资格。1990年7月至1993年7月任长沙二机床厂数控机床控制系统技术员；1993年7月至1995年8月任《证券时报》证券信息数据库工程师；1995年9月至1998年9月任湘财证券公司经纪业务总部交易监控组主管；1999年1月至2004年8月历任广发证券深圳营业部电脑部经理、总部稽核部业务主管、IT审计主管；2004年8月至2008年9月任景顺长城基金管理有限公司法律稽核部稽核经理；2008年9月加入信达澳银基金管理有限公司，历任交易部经理、运营总监、首席信息官。2020年8月19日起任信达澳银基金管理有限公司督察长。

冯明远先生，联席投资总监，浙江大学计算机科学与技术专业硕士。10年证券、基金从业经验，具有证券与基金从业资格。2010年9月至2013年12月，就职于平安证券综合研究所，任行业研究员，2014年1月加入信达澳银基金公司，历任行业研究员、基金经理助理、基金经理、权益投资总部副总监。2020年1月16日起任信达澳银基金管理有限公司联席投资总监，分管权益投资总部。

## 2、本基金拟任基金经理

### (1) 现任基金经理

| 姓名  | 职务   | 任本基金的基金经理（助理）期限 |      | 证券从业年限 | 说明  |
|-----|--|-----------------|------|--------|---|
|     |  | 任职日期            | 离任日期 |        |   |
| 王辉良 | 本基金的基金经理、信达澳银中证沪港深高股息精选指数基金基金经理（2018年11月2日起至今）<br>信达澳银新财富灵活配置混合基金（2021年1月22日至至今） | 2021-01-22      | -    | 13年    | 中国人民大学金融学硕士。2006年7月至2010年8月在招商基金管理有限公司，任策略研究员；2010年8月至2012年4月在华宝兴业基金管理有限公司，任高级分析师；2013年1月加入信达澳银基金公司，历任高级策略研究员、信达澳银中小盘混合基金基金经理助理、信达澳银红利回报混合基金基金经理助理、信达澳银红利回报混合基金基金经理（2016年1月8日起至2020年7月27日）、信达澳银中证沪港深高股息精选指数基金基金经理（2018年11月2日起至今）。 |

### (2) 曾任基金经理

| 姓名  | 任本基金的基金经理期限 |             |
|-----|-------------|-------------|
|     | 任职日期        | 离任日期        |
| 杨超  | 2019年10月24日 | 2021年01月22日 |
| 唐弋迅 | 2018年3月27日  | 2019年9月28日  |
| 李朝伟 | 2019年9月19日  | 2020年2月20日  |

### 3、公司公募基金投资审议委员会

公司公募基金投资审议委员会由 4 名成员组成，设主席 1 名，委员 3 名。名单如下：

主席：朱永强，总经理

委员：

冯明远，联席投资总监

王咏辉，副总经理、权益投资总部总监、智能量化与资产配置总部总监

李淑彦，研究咨询部负责人

上述人员之间不存在亲属关系。

### （三）基金管理人的职责

- 1、依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、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基金收益；
- 5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- 6、编制季度报告、中期报告和年度报告；
- 7、计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回及转换价格；
- 8、严格按照法律法规、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
- 9、依据法律法规、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；
- 10、按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料；
- 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）基金管理人关于遵守法律法规的承诺

- 1、基金管理人承诺严格遵守《证券法》，并建立健全的内部控制制度，采取有



效措施，防止违反《证券法》行为的发生；

2、基金管理人承诺严格遵守《基金法》、《运作办法》，建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止以下《基金法》、《运作办法》禁止的行为发生：

- (1) 将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
- (2) 不公平地对待其管理的不同基金财产；
- (3) 利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；
- (4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- (5) 法律法规和中国证监会禁止的其他行为。

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

- (1) 越权或违规经营；
- (2) 违反基金合同或托管协议；
- (3) 损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益；
- (4) 在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；
- (5) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
- (6) 玩忽职守、滥用职权；
- (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) 除按本公司制度进行基金投资外，直接或间接进行其他股票交易；
- (9) 协助、接受委托或以其它任何形式为其它组织或个人进行证券交易；
- (10) 违反证券交易场所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；
- (11) 故意损害基金投资者及其它同业机构、人员的合法权益；
- (12) 以不正当手段谋求业务发展；
- (13) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；
- (14) 信息披露不真实，有误导、欺诈成分；
- (15) 法律法规和中国证监会禁止的其他行为。

(五) 基金管理人关于禁止性行为的承诺

本基金财产不得用于下列投资或者活动：

- 1、承销证券；

- 2、违反规定向他人贷款或者提供担保；
- 3、从事承担无限责任的投资；
- 4、向其基金管理人、基金托管人出资；
- 5、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；
- 6、法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

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的，应当符合本基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按变更后的规定执行。

#### （六） 基金经理的承诺

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

#### （七） 基金管理人的内部控制制度

本基金管理人为加强内部控制，促进公司诚信、合法、有效经营，保障基金份额持有人利益，维护公司及公司股东的合法权益，依据《证券法》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》等法律法规，并结合公司实际情况，制定《信达澳银基金管理有限公司内部控制大纲》。

公司内部控制是指公司为防范和化解风险，保证经营运作符合公司的发展规划，在充分考虑内外部环境的基础上，通过建立组织机制、运用管理方法、实施操作程序与控制措施而形成的系统。公司建立科学合理、控制严密、运行高效的内部

控制体系，制定科学完善的内部控制制度。

公司内部控制制度由内部控制大纲、基本管理制度、部门业务规章等部分组成。

公司董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任，公司管理层对内部控制制度的有效执行承担责任。

#### 1、公司内部控制的总体目标

(1) 保证公司经营运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念。

(2) 防范和化解经营风险，提高经营管理效益，确保经营业务的稳健运行和受托资产的安全完整，实现公司的持续、稳定、健康发展。

(3) 确保基金、公司财务和其他信息真实、准确、完整、及时。

#### 2、公司内部控制遵循以下原则

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

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

(3) 独立性原则。公司各机构、部门和岗位职责的设置保持相对独立，公司基金财产、自有资产与其他资产的运作相互分离。

(4) 相互制约原则。公司设置的各部门、各岗位权责分明、相互制衡。

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

#### 3、公司制定内部控制制度遵循以下原则

(1) 合法合规性原则。公司内控制度符合国家法律、法规、规章和各项规定。

(2) 全面性原则。内部控制制度涵盖公司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。制定内部控制制度以审慎经营、防范和化解风险为出发点。

(4) 适时性原则。随着有关法律法规的调整和公司经营战略、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内部控制制度。

#### 4、内部控制的基本要素

内部控制的基本要素包括控制环境、风险评估、控制活动、信息沟通和内部监控。

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

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

(3) 健全公司法人治理结构，充分发挥独立董事和执行监事的监督职能，禁止不正当关联交易、利益输送和内部人控制现象的发生，保护投资者利益和公司合法权益。

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

(5) 依据公司自身经营特点设立顺序递进、权责统一、严密有效的内控防线：

①各岗位职责明确，有详细的岗位说明书和业务流程，各岗位人员在上岗前均应知悉并以书面方式承诺遵守，在授权范围内承担责任。

②建立重要业务处理凭据传递和信息沟通制度，相关部门和岗位之间相互监督制衡。

③公司督察长和内部监察稽核部门独立于其他部门，对内部控制制度的执行情况实行严格的检查和反馈。

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

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

(8) 建立严谨、有效的授权管理制度，授权控制贯穿于公司经营活动的始终。

①确保股东会、董事会、执行监事和管理层充分了解和履行各自的职权，建立健全公司授权标准和程序，保证授权制度的贯彻执行。

②公司各业务部门、分支机构和各级人员在规定授权范围内行使相应的职责。

③公司重大业务的授权采取书面形式，明确授权书的授权内容和时效。

④公司适当授权，建立授权评价和反馈机制，包括已获授权的部门和人员的反馈和评价，对已不适用的授权及时修改或取消授权。

(9) 建立完善的资产分离制度，公司资产与基金财产、不同基金的资产之间和其他委托资产，实行独立运作，分别核算。

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

(11) 制订切实有效的紧急应变措施，建立危机处理机制和程序。

(12) 维护信息沟通渠道的畅通，建立清晰的报告系统。

(13) 建立有效的内部监控制度，设置督察长和独立的监察稽核部门，对公司内部控制制度的执行情况进行持续的监督，保证内部控制制度落实。公司定期评价内部控制的有效性，并根据市场环境、新的金融工具、新的技术应用和新的法律法规等情况进行适时改进。

## 5、内部控制的主要内容

(1) 公司自觉遵守国家有关法律法规，按照投资管理业务的性质和特点严格制定管理规章、操作流程和岗位手册，明确揭示不同业务可能存在的风险点并采取控制措施。

(2) 研究业务控制主要包括：

①研究工作保持独立、客观。

②建立严密的研究工作业务流程，形成科学、有效的研究方法。

③建立投资对象备选库制度，根据基金合同要求，在充分研究的基础上建立和维护备选库。

④建立研究与投资的业务交流制度，保持通畅的交流渠道。

⑤建立研究报告质量评价体系。

(3) 投资决策业务控制主要包括：

①严格遵守法律法规的有关规定，符合基金合同所规定的投资目标、投资范围、投资策略、投资组合和投资限制等要求。

②健全投资决策授权制度，明确界定投资权限，严格遵守投资限制，防止越权决策。

③投资决策有充分的投资依据，重要投资有详细的研究报告和风险分析支持，并有决策记录。

④建立投资风险评估与管理制度，在设定的风险权限额度内进行投资决策。

⑤建立科学的投资管理业绩评价体系，包括投资组合情况、是否符合基金产品特征和决策程序、基金绩效归属分析等内容。

(4) 基金交易业务控制主要包括：

①基金交易实行集中交易制度，基金经理不得直接向交易员下达投资指令或者直接进行交易。

②建立交易监测系统、预警系统和交易反馈系统，完善相关的安全设施。

③交易管理部门审核投资指令，确认其合法、合规与完整后方可执行，如出现指令违法违规或者其他异常情况，应当及时报告相应部门与人员。

④公司执行公平的交易分配制度，确保不同投资者的利益能够得到公平对待。

⑤建立完善的交易记录制度，及时核对并存档保管每日投资组合列表等。

⑥建立科学的交易绩效评价体系。

根据内部控制的原则，制定场外交易、网下申购等特殊交易的流程和规则。

(5) 建立严格有效的制度，防止不正当关联交易损害基金份额持有人利益。基金投资涉及关联交易的，在相关投资研究报告中特别说明，并报公司投资审议委员会审议批准。

(6) 公司在审慎经营和合法规范的基础上力求金融创新。在充分论证的前提下周密考虑金融创新品种或业务的法律性质、操作程序、经济后果等，严格控制金融新品种、新业务的法律风险和运行风险。

(7) 建立和完善客户服务标准、销售渠道管理、广告宣传行为规范，建立广告宣传、销售行为法律审查制度，制定销售人员准则，严格奖惩措施。

(8) 制定详细的注册登记工作流程，建立注册登记电脑系统、数据定期核对、备份制度，建立客户资料的保密保管制度。

(9) 公司按照法律、法规和中国证监会有关规定，建立完善的信息披露制度，保证公开披露的信息真实、准确、完整、及时。

(10) 公司设置专门部门及高级管理人员负责信息披露工作，进行信息的组织、审核和发布。

(11) 加强对公司及基金信息披露的检查和评价，对存在的问题及时提出改进办法，对出现的失误提出处理意见，并追究相关人员的责任。

(12) 掌握内幕信息的人员在信息公开披露前不得泄露其内容。

(13) 根据国家法律法规的要求，遵循安全性、实用性、可操作性原则，严格

制定信息系统的管理制度。

信息技术系统的设计开发符合国家、金融行业软件工程标准的要求，编写完整的技术资料；在实现业务电子化时，设置保密系统和相应控制机制，并保证计算机系统的可稽性，信息技术系统投入运行前，经过业务、运营等部门的联合验收。

(14) 通过严格的授权制度、岗位责任制度、门禁制度、内外网分离制度等管理措施，确保系统安全运行。

(15) 计算机机房、设备、网络等硬件要求符合有关标准，设备运行和维护整个过程实施明确的责任管理，严格划分业务操作、技术维护等方面的职责。

(16) 公司软件的使用充分考虑到软件的安全性、可靠性、稳定性和可扩展性，具备身份验证、访问控制、故障恢复、安全保护、分权制约等功能。信息技术系统设计、软件开发等技术人员不得介入实际的业务操作。用户使用的密码口令定期更换，不得向他人透露。数据库和操作系统的密码口令分别由不同人员保管。

(17) 对信息数据实行严格的管理，保证信息数据的安全、真实和完整，并能及时、准确地传递到会计等各职能部门；严格计算机交易数据的授权修改程序，并坚持电子信息数据的定期查验制度。

建立电子信息数据的即时保存和备份制度，重要数据异地备份并且长期保存。

(18) 信息技术系统定期稽核检查，完善业务数据保管等安全措施，进行排除故障、灾难恢复的演习，确保系统可靠、稳定、安全地运行。

(19) 依据《中华人民共和国会计法》、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》、《企业财务通则》等国家有关法律、法规制订基金会计制度、公司财务制度、会计工作操作流程和会计岗位工作手册，并针对各个风险控制点建立严密的会计系统控制。

(20) 明确职责划分，在岗位分工的基础上明确各会计岗位职责，禁止需要相互监督的岗位由一人独自操作全过程。

(21) 以基金为会计核算主体，独立建账、独立核算，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账簿记录等方面相互独立。基金会计核算与公司会计核算相互独立。

(22) 采取适当的会计控制措施，以确保会计核算系统的正常运转。

①建立凭证制度，通过凭证设计、登录、传递、归档等一系列凭证管理制度，确保正确记载经济业务，明确经济责任。

②建立账务组织和账务处理体系,正确设置会计账簿,有效控制会计记账程序。

③建立复核制度,通过会计复核和业务复核防止会计差错的产生。

(23) 采取合理的估值方法和科学的估值程序,公允反映基金所投资的有价证券在估值时点的价值。

(24) 规范基金清算交割工作,在授权范围内,及时准确地完成基金清算,确保基金财产的安全。

(25) 建立严格的成本控制和业绩考核制度,强化会计的事前、事中和事后监督。

(26) 制订完善的会计档案保管和财务交接制度,财会部门妥善保管密押、业务用章、支票等重要凭据和会计档案,严格会计资料的调阅手续,防止会计数据的毁损、散失和泄密。

(27) 严格制定财务收支审批制度和费用报销运作管理办法,自觉遵守国家财税制度和财经纪律。

(28) 公司设立督察长,对董事会负责,经董事会聘任,报中国证监会核准。根据公司监察稽核工作的需要和董事会授权,督察长可以列席公司相关会议,调阅公司相关档案,就内部控制制度的执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能。督察长定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况,董事会对督察长的报告进行审议。

(29) 公司设立监察稽核部门,对公司管理层负责,开展监察稽核工作,公司保证监察稽核部门的独立性和权威性。

(30) 明确监察稽核部门及内部各岗位的具体职责,配备充足的监察稽核人员,严格监察稽核人员的专业任职条件,严格监察稽核的操作程序和组织纪律。

(31) 强化内部检查制度,通过定期或不定期检查内部控制制度的执行情况,确保公司各项经营管理活动的有效运行。

(32) 公司董事会和管理层重视和支持监察稽核工作,对违反法律、法规和公司内部控制制度的,追究有关部门和人员的责任。

## 6、基金管理人关于内部控制制度的声明

(1) 本公司承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确。

(2) 本公司承诺根据市场变化和公司业务发展不断完善内部控制制度。





## 四、基金托管人

### （一）基金托管人概况

公司法定中文名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）

公司法定英文名称：BANK OF COMMUNICATIONS CO., LTD

法定代表人/负责人：任德奇

住 所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号

办公地址：上海市长宁区仙霞路 18 号

邮政编码：200336

注册时间：1987 年 3 月 30 日

注册资本：742.63 亿元

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]25 号

联系人：陆志俊

电 话：95559

交通银行始建于 1908 年，是中国历史最悠久的银行之一，也是近代中国的发钞行之一。1987 年重新组建后的交通银行正式对外营业，成为中国第一家全国性的国有股份制商业银行，总部设在上海。2005 年 6 月交通银行在香港联合交易所挂牌上市，2007 年 5 月在上海证券交易所挂牌上市。根据 2019 年英国《银行家》杂志发布的全球千家大银行报告，交通银行一级资本位列第 11 位，连续五年跻身全球银行 20 强；根据 2019 年美国《财富》杂志发布的世界 500 强公司排行榜，交通银行营业收入位列第 150 位，较上年提升 18 位。

截至 2019 年 9 月 30 日，交通银行资产总额为人民币 99,328.79 亿元。2019 年 1-9 月，交通银行实现净利润(归属于母公司股东)人民币 601.47 亿元。

交通银行总行设资产托管业务中心（下文简称“托管中心”）。现有员工具有多年基金、证券和银行的从业经验，具备基金从业资格，以及经济师、会计师、工程师和律师等中高级专业技术职称，员工的学历层次较高，专业分布合理，职业技能优良，职业道德素质过硬，是一支诚实勤勉、积极进取、开拓创新、奋发向上的资产托管从业人员队伍。

### （二）主要人员情况

任德奇先生，副董事长、执行董事、行长，高级经济师。

任先生 2018 年 8 月起任本行副董事长、执行董事、行长；2016 年 12 月至 2018 年 6 月任中国银行执行董事、副行长，其中：2015 年 10 月至 2018 年 6 月兼任中银香港（控股）有限公司非执行董事，2016 年 9 月至 2018 年 6 月兼任中国银行上海人民币交易业务总部总裁；2014 年 7 月至 2016 年 11 月任中国银行副行长，2003 年 8 月至 2014 年 5 月历任中国建设银行信贷审批部副总经理、风险监控部总经理、授信管理部总经理、湖北省分行行长、风险管理部总经理；1988 年 7 月至 2003 年 8 月先后在中国建设银行岳阳长岭支行、岳阳市中心支行、岳阳分行，中国建设银行信贷管理委员会办公室、信贷风险管理部工作。任先生 1988 年于清华大学获工学硕士学位。

袁庆伟女士，资产托管业务中心总裁，高级经济师。

袁女士 2015 年 8 月起任本行资产托管业务中心总裁；2007 年 12 月至 2015 年 8 月，历任本行资产托管部总经理助理、副总经理，本行资产托管业务中心副总裁；1999 年 12 月至 2007 年 12 月，历任本行乌鲁木齐分行财务会计部副科长、科长、处长助理、副处长，会计结算部高级经理。袁女士 1992 年毕业于中国石油大学计算机科学系，获得学士学位，2005 年于新疆财经学院获硕士学位。

### （三）基金托管业务经营情况

截至 2019 年 9 月 30 日，交通银行托管证券投资基金 436 只。此外，交通银行还托管了基金公司特定客户资产管理计划、证券公司客户资产管理计划、银行理财产品、信托计划、私募投资基金、保险资金、QDIE 资金、全国社保基金、养老保障管理基金、企业年金基金、职业年金基金、QFII 证券投资资产、RQFII 证券投资资产、QDII 证券投资资产、RQDII 证券投资资产和 QDLP 资金等产品。

## 二、基金托管人的内部控制制度

### （一）内部控制目标

交通银行严格遵守国家法律法规、行业规章及行内相关管理规定，加强内部管理，托管中心业务制度健全并确保贯彻执行各项规章制度，通过对各种风险的识别、评估、控制及缓释，有效地实现对各项业务的风险管控，确保业务稳健运行，保护基金持有人的合法权益。

### （二）内部控制原则

1、合法性原则：托管中心制定的各项制度符合国家法律法规及监管机构的监管要求，并贯穿于托管业务经营管理活动始终。

2、全面性原则：托管中心建立各二级部自我监控和风险合规部风险管控的内部控制机制，覆盖各项业务、各个部门和各级人员，并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个经营环节，建立全面的风险管理监督机制。

3、独立性原则：托管中心独立负责受托基金资产的保管，保证基金资产与交通银行的自有资产相互独立，对不同的受托基金资产分别设置账户，独立核算，分账管理。

4、制衡性原则：托管中心贯彻适当授权、相互制约的原则，从组织架构的设置上确保各二级部和各岗位权责分明、相互制约，并通过有效的相互制衡措施消除内部控制中的盲点。

5、有效性原则：托管中心在岗位、业务二级部和风险合规部三级内控管理模式的基础上，形成科学合理的内部控制决策机制、执行机制和监督机制，通过行之有效的控制流程、控制措施，建立合理的内控程序，保障各项内控管理目标被有效执行。

6、效益性原则：托管中心内部控制与基金托管规模、业务范围和业务运作环节的风险控制要求相适应，尽量降低经营运作成本，以合理的控制成本实现最佳的内部控制目标。

### （三）内部控制制度及措施

根据《证券投资基金法》、《中华人民共和国商业银行法》、《商业银行资产托管业务指引》等法律法规，托管中心制定了一整套严密、完整的证券投资基金托管管理规章制度，确保基金托管业务运行的规范、安全、高效，包括《交通银行资产托管业务管理办法》、《交通银行资产托管业务风险管理办法》、《交通银行资产托管业务系统建设管理办法》、《交通银行资产托管部信息披露制度》、《交通银行资产托管业务商业秘密管理规定》、《交通银行资产托管业务从业人员行为规范》、《交通银行资产托管业务档案管理暂行办法》等，并根据市场变化和基金业务的发展不断加以完善。做到业务分工科学合理，技术系统管理规范，业务管理制度健全，核心作业区实行封闭管理，落实各项安全隔离措施，相关信息披露由专人负责。

托管中心通过对基金托管业务各环节的事前揭示、事中控制和事后检查措施实现全流程、全链条的风险管理，聘请国际著名会计师事务所对基金托管业务运行进行国际标准的内部控制评审。

### 三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

交通银行作为基金托管人，根据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和有关证券法规的规定，对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金的申购资金的到账与赎回资金的划付、基金收益分配等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

交通银行作为基金托管人，发现基金管理人违反《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关证券法规和《基金合同》的行为，及时通知基金管理人予以纠正，基金管理人收到通知后及时核对确认并进行调整。交通银行有权对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对于交通银行通知的违规事项未能及时纠正的，交通银行有权报告中国证监会。

交通银行作为基金托管人，发现基金管理人重大违规行为，有权立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

### 四、其他事项

最近一年内交通银行及其负责资产托管业务的高级管理人员无重大违法违规行为，未受到中国人民银行、中国证监会、中国银保监会及其他有关机关的处罚。负责基金托管业务的高级管理人员在基金管理公司无兼职的情况。

## 五、相关服务机构

### (一) 销售机构及联系人

#### 1、直销机构

名称：信达澳银基金管理有限公司

住所：广东省深圳市南山区科苑南路（深圳湾段）3331 号阿里巴巴大厦 N1 座  
第 8 层和第 9 层

办公地址：广东省深圳市南山区科苑南路（深圳湾段）3331 号阿里巴巴大厦  
T1 座第 8 层和第 9 层

法定代表人：祝瑞敏

电话：0755-82858168/83077068

传真：0755-83077038

联系人：刘华

公司网址：www.fscinda.com

邮政编码：518054

#### 2、代销机构

| 序号 | 名称             | 注册地址                    | 法定代表人 | 办公地址                    | 客服电话             | 联系人    | 网站                            |
|----|----------------|-------------------------|-------|-------------------------|------------------|--------|-------------------------------|
| 1  | 交通银行股份有限公司     | 上海市浦东新区自由贸易试验区银城中路188号  | 任德奇   | 同“注册地址”                 | 95559            | 王菁     | www.bankcomm.com              |
| 2  | 平安银行股份有限公司     | 深圳市罗湖区深南东路5047号         | 谢永林   | 同“注册地址”                 | 95511-3          | 汤俊劼、赵杨 | www.bank.pingan.com           |
| 3  | 渤海银行股份有限公司     | 天津市河东区海河东路218号          | 李伏安   | 天津市河东区海河东路218号渤海银行大厦    | 95541/4008888811 | 王宏     | www.cbhb.com.cn               |
| 4  | 南洋商业银行（中国）有限公司 | 上海市浦东新区世纪大道800号三层、六层至九层 | 陈孝周   | 上海市浦东新区世纪大道800号南洋商业银行大厦 | 4008302066       | 繆佳莹    | www.ncbchina.cn/cn/index.html |
| 5  | 恒丰银行股份有限公司     | 山东省烟台市芝罘区南大街248号        | 蔡国华   | 同“注册地址”                 | 95395            | 顾于斌    | www.hfbank.com.cn             |

|    |                  |                                       |     |                                       |                  |        |                       |
|----|------------------|---------------------------------------|-----|---------------------------------------|------------------|--------|-----------------------|
| 6  | 江苏江南农村商业银行股份有限公司 | 江苏省常州市和平中路413号                        | 陆向阳 | 同“注册地址”                               | 0519-96005       | 李仙、蒋姣  | www.jnbank.com.cn     |
| 7  | 信达证券股份有限公司       | 北京市西城区闹市口大街9号院1号楼                     | 张志刚 | 同“注册地址”                               | 95321            | 付婷、任立秋 | www.cindasc.com       |
| 8  | 中国银河证券股份有限公司     | 北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座2-6层             | 陈共炎 | 同“注册地址”                               | 95551/4008888888 | 辛国政    | www.chinastock.com.cn |
| 9  | 中信建投证券股份有限公司     | 北京市朝阳区安立路66号4号楼                       | 王常青 | 北京市朝阳区内大街188号                         | 95587/4008888108 | 刘畅     | www.csc108.com        |
| 10 | 申万宏源证券有限公司       | 上海市徐汇区长乐路989号45层                      | 李梅  | 上海市徐汇区长乐路989号45层                      | 95523/4008895523 | 余敏     | www.swhysc.com        |
| 11 | 申万宏源西部证券有限公司     | 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 | 韩志谦 | 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 | 4008000562       | 黄莹     | www.hysec.com         |
| 12 | 华龙证券股份有限公司       | 甘肃省兰州市城关区东岗西路638号兰州财富中心21楼            | 李晓安 | 同“注册地址”                               | 95368/4006898888 | 范坤、杨力  | www.hlzqgs.com        |
| 13 | 中信证券股份有限公司       | 广东省深圳市福田区中心3路8号卓越时代广场（二期）北座           | 张佑君 | 北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦18层                | 95558            | 杜杰     | www.cs.ecitic.com     |
| 14 | 中信证券（山东）有限责任公司   | 青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融中心1号楼20层2001       | 姜晓林 | 同“注册地址”                               | 95548            | 孙秋月    | www.zxzqsd.com.cn     |
| 15 | 国泰君安证券股份有限公司     | 中国（上海）自由贸易试验区商城路618号                  | 杨德红 | 上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29层              | 95521            | 钟伟镇    | www.gtja.com          |
| 16 | 光大证券股份有限公司       | 上海市静安区新闻路1508号                        | 周健男 | 同“注册地址”                               | 95525            | 代小燕、姚崑 | www.ebscn.com         |
| 17 | 兴业证券股份有限公司       | 福建省福州市湖东路268号                         | 杨华辉 | 上海市浦东新区长柳路36号                         | 95562            | 乔琳雪    | www.xyzq.com.cn       |

|    |             |  |     |   |                      |             |                    |
|----|-------------|--|-----|---|----------------------|-------------|--------------------|
| 18 | 海通证券股份有限公司  | 上海市黄浦区<br>广东路 689 号  | 周杰  | 上海市广东路<br>689 号海通证券<br>大厦                     | 95553/40088<br>88001 | 王立群         | www.htsec.com      |
| 19 | 招商证券股份有限公司  | 深圳市福田区<br>益田路江苏大<br>厦 A 座 38-45<br>层                             | 霍达  | 同“注册地址”                                       | 95565                | 黄婵君         | www.newone.com.cn  |
| 20 | 国信证券股份有限公司  | 深圳市罗湖区<br>红岭中路 1012<br>号国信证券大<br>厦 16-26 层                       | 何如  | 深圳市罗湖区<br>红岭中路 1012<br>号国信证券大<br>厦 16 层至 26 层 | 95536                | 李颖          | www.guosen.com.cn  |
| 21 | 安信证券股份有限公司  | 深圳市福田区<br>金田路 4018<br>号安联大厦 35<br>层、28 层 A02<br>单元               | 王连志 | 同“注册地址”                                       | 95517                | 刘志斌         | www.essence.com.cn |
| 22 | 平安证券股份有限公司  | 深圳市福田区中<br>心区金田路<br>4036 号荣超大<br>厦 16-20 层                       | 刘世安 | 同“注册地址”                                       | 95511                | 王阳          | stock.pingan.com   |
| 23 | 东兴证券股份有限公司  | 北京市西城区<br>金融大街 5 号<br>新盛大厦 B 座<br>12-15 层                        | 魏庆华 | 同“注册地址”                                       | 95309/40088<br>88993 | 和志鹏         | www.dxzq.net       |
| 24 | 世纪证券有限责任公司  | 深圳市前海深<br>港合作区南山<br>街道桂湾五路<br>128 号前海深<br>港基金小镇对<br>冲基金中心<br>406 | 李强  | 深圳市福田区<br>深南大道 7088<br>号招商银行大<br>厦 40-42 层    | 4008323000           | 王雯、陈<br>玮   | www.csc.com.cn     |
| 25 | 华福证券有限责任公司  | 福州市鼓楼区<br>温泉街道五四<br>路 157 号新天<br>地大厦 7-9 层                       | 黄金琳 | 福州市五四路<br>157 号新天地<br>大厦 7 至 10 层             | 95547                | 王虹, 刘<br>蕴祺 | www.hfzq.com.cn    |
| 26 | 华泰证券股份有限公司  | 南京市江东中<br>路 228 号  | 周易  | 深圳市福田区<br>莲花街道益田<br>路 5999 号基金<br>大厦 10 楼     | 95597                | 庞晓芸         | www.htsc.com.cn    |
| 27 | 广州证券股份有限公司  | 广州市天河区<br>珠江西路 5 号<br>广州国际金融<br>中心主塔 19<br>层、20 层                | 邱三发 | 同“注册地址”                                       | 95396                | 梁微          | www.gzs.com.cn     |
| 28 | 新时代证券股份有限公司 | 北京市海淀区<br>北三环西路 99<br>号院 1 号楼 15<br>层 1501                       | 叶顺德 | 同“注册地址”                                       | 95399                | 田芳芳         | www.xsdzq.cn       |



|    |             |                                     |     |                           |                  |         |                   |
|----|-------------|-------------------------------------|-----|---------------------------|------------------|---------|-------------------|
| 29 | 长江证券股份有限公司  | 武汉市新华路特8号长江证券大厦                     | 尤习贵 | 同“注册地址”                   | 95579/4008888999 | 奚博宇     | www.95579.com     |
| 30 | 浙商证券股份有限公司  | 浙江省杭州市江干区五星路201号                    | 吴承根 | 同“注册地址”                   | 95345            | 高扬, 陈姗姗 | www.stocke.com.cn |
| 31 | 中泰证券股份有限公司  | 济南市市中区经七路86号                        | 李玮  | 同“注册地址”                   | 95538            | 朱琴      | www.zts.com.cn    |
| 32 | 粤开证券股份有限公司  | 惠州市江北东江三路55号广播电视新闻中心西面一层大堂和三、四层     | 严亦斌 | 深圳市福田区深南中路2002号中广核大厦北楼10层 | 95564            | 彭莲      | www.ykzq.com      |
| 33 | 长城证券有限责任公司  | 深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层      | 丁益  | 深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14层  | 4006666888       | 王涛      | www.cgws.com      |
| 34 | 恒泰证券股份有限公司  | 内蒙古呼和浩特市赛罕区敕勒川大街东方君座D座光大银行办公楼14-18楼 | 庞介民 | 同“注册地址”                   | 4001966188       | 熊丽      | www.cnht.com.cn   |
| 35 | 太平洋证券股份有限公司 | 云南省昆明市北京路926号同德广场写字楼31楼             | 李长伟 | 北京市西城区北展北街9号华远企业号D座3单元    | 95397            | 王婧      | www.tpyzq.com     |
| 36 | 国金证券股份有限公司  | 四川省成都市青羊区东城根上街95号                   | 冉云  | 同“注册地址”                   | 95310            | 杜晶、贾鹏   | www.gjzq.com.cn   |
| 37 | 华金证券股份有限公司  | 中国(上海)自由贸易试验区杨高南路759号30层            | 宋卫东 | 同“注册地址”                   | 4008211357       | 郑媛      | www.huajinsc.cn/  |
| 38 | 华西证券股份有限公司  | 四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦             | 杨炯洋 | 同“注册地址”                   | 95584            | 谢国梅     | www.hx168.com.cn  |
| 39 | 五矿证券有限公司    | 深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心办公楼47层01单元      | 赵立功 | 同“注册地址”                   | 4001840028       | 濮耘瑶     | www.wkzq.com.cn/  |
| 40 | 联储证券有限责任公司  | 广东省深圳市福田区华强北路圣廷苑酒店                  | 沙常明 | 北京市朝阳区安定路5号院3号楼中建财富       | 4006206868       | 丁倩云     | www.lczq.com      |

|    |                |                             |     |                        |                  |         |  |
|----|----------------|-----------------------------|-----|------------------------|------------------|---------|--|
|    |                | B座26楼                       |     | 国际中心27层<br>联储证券        |                  |         |  |
| 41 | 西藏东方财富证券股份有限公司 | 拉萨市北京中路101号                 | 陈宏  | 上海市徐汇区宛平南路88号金座东方财富大厦  | 95357            | 付佳      | <a href="http://www.18.cn">http://www.18.cn</a>  |
| 42 | 中银国际证券股份有限公司   | 上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层      | 宁敏  | 同“注册地址”                | 4006208888       | 初晓、王炜哲  | <a href="http://www.bocichina.com">www.bocichina.com</a>   |
| 43 | 诺亚正行基金销售有限公司   | 上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室        | 汪静波 | 同“注册地址”                | 4008215399       | 李娟      | <a href="http://www.noah-fund.com">www.noah-fund.com</a>   |
| 44 | 深圳众禄基金销售股份有限公司 | 深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼801      | 薛峰  | 深圳市罗湖区梨园路8号HALO广场4楼    | 4006788887       | 童彩平、徐丽平 | <a href="http://www.zlfund.cn">www.zlfund.cn</a> /<br><a href="http://www.jjmmw.com">www.jjmmw.com</a> |
| 45 | 上海天天基金销售有限公司   | 上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层          | 其实  | 上海市徐汇区龙田路195号3C座7楼     | 95021/4001818188 | 马茜玲     | <a href="http://www.1234567.com.cn">www.1234567.com.cn</a>   |
| 46 | 上海好买基金销售有限公司   | 上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号      | 杨文斌 | 同“注册地址”                | 4007009665       | 高源      | <a href="http://www.howbuy.com">www.howbuy.com</a>   |
| 47 | 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司 | 杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1幢202室   | 陈柏青 | 杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼 | 4000766123       | 徐丽玲、铄金  | <a href="http://www.fund123.cn">www.fund123.cn</a>   |
| 48 | 和讯信息科技有限公司     | 北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦1002室      | 王莉  | 同“注册地址”                | 4009200022       | 陈慧慧、陈艳琳 | <a href="http://licaike.hexun.com">licaike.hexun.com</a>   |
| 49 | 浙江同花顺基金销售有限公司  | 杭州市文二西路一号903室               | 凌顺平 | 同“注册地址”                | 4008773772       | 朱琮      | <a href="http://www.5ifund.com">www.5ifund.com</a>   |
| 50 | 上海联泰基金销售有限公司   | 中国（上海）自由贸易试验区富特北路277号3层310室 | 燕斌  | 上海市长宁区金钟路658弄2号楼B座6楼   | 4001181188       | 兰敏      | <a href="http://www.66zichan.com">www.66zichan.com</a>   |
| 51 | 北京展恒基金销售股份有限公司 | 北京市顺义区后沙峪镇安富街6号             | 闫振杰 | 山西省太原市迎泽区劲松北路31号哈伯大厦9层 | 4008188000       | 李晓芳     | <a href="http://www.myfund.com">www.myfund.com</a>   |
| 52 | 浦领基金销售有限公司     | 北京市朝阳区望京东园四区13号楼A座9层908室    | 聂婉君 | 北京市朝阳区望京浦项中心A座9层04-08  | 4008769988       | 徐微      | <a href="http://www.zscffund.com">www.zscffund.com</a>   |

|    |                  |   |     |   |            |         |                      |
|----|------------------|---|-----|---|------------|---------|----------------------|
| 53 | 中信期货有限公司         | 深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座13层1301-1305室、14层 | 张皓  | 深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座13层1301-1305室、14层 | 4009908826 | 刘宏莹     | www.citicsf.com      |
| 54 | 上海长量基金销售有限公司     | 上海市浦东新区高翔路526号2幢220室                      | 张跃伟 | 上海市浦东新区东方路1267号11层                        | 4008202899 | 詹慧萌     | www.erichfund.com    |
| 55 | 北京虹点基金销售有限公司     | 北京市朝阳区工人体育场北路甲2号盈科中心B座裙房2层                | 郑毓栋 | 北京市朝阳区工人体育馆北路甲2号盈科中心B座裙楼二层                | 4006180707 | 陈铭洲     | www.hongdianfund.com |
| 56 | 上海陆金所基金销售有限公司    | 上海市自由贸易试验区陆家嘴环路1333号14楼09单元               | 王之光 | 同“注册地址”                                   | 4008219031 | 程晨      | www.lufunds.com      |
| 57 | 上海利得基金销售有限公司     | 上海市宝山区蕴川路5475号1033室                       | 李兴春 | 上海虹口区东大名路1098号浦江国际金融广场53楼                 | 95733      | 陈洁      | www.leadfund.com.cn  |
| 58 | 深圳市金斧子基金销售有限公司   | 深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路15号科兴科学园B栋3单元11层1108    | 赖任军 | 同“注册地址”                                   | 4009300660 | 刘昕霞     | www.jfzinv.com       |
| 59 | 珠海盈米基金销售有限公司     | 珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491                     | 肖雯  | 广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼B1201-1203        | 89629066   | 梁文燕、邱湘湘 | www.yingmi.cn        |
| 60 | 北京创金启富基金销售有限公司   | 北京西城区白纸坊东街2号院6号楼712室                      | 梁蓉  | 同“注册地址”                                   | 4006262818 | 王瑶      | www.5irich.com       |
| 61 | 北京钱景基金销售有限公司     | 北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012                  | 赵荣春 | 同“注册地址”                                   | 4008936885 | 田伟静     | www.qianjing.com     |
| 62 | 中证金牛(北京)投资咨询有限公司 | 北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室                       | 钱昊旻 | 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                 | 4008909998 | 孙雯      | www.jnlc.com         |
| 63 | 上海万得基金销售         | 中国(上海)自由贸易试验                              | 王廷  | 上海市浦东新区福山路33号                             | 4008210203 | 徐亚丹     | www.520fund.com.cn   |

|    |                    |   |     |                                    |                  |     |                              |
|----|--------------------|---|-----|------------------------------------|------------------|-----|------------------------------|
|    | 有限公司               | 区福山路 33 号 11 楼 B 座                          | 富   | 8 楼                                |                  |     |                              |
| 64 | 北京富国大通资产管理有限公司     | 北京市东城区北三环东路 36 号 1 号楼 A2501 室               | 宋宝峰 | 同“注册地址”                            | 4000880088       | 方芳  | www.fuguowealth.com          |
| 65 | 上海基煜基金销售有限公司       | 上海市崇明县长兴镇潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室(上海泰和经济发展区) | 王翔  | 上海市杨浦区昆明路 518 号 A1002 室            | 4008205369       | 居晓菲 | www.jiyufund.com.cn          |
| 66 | 北京汇成基金销售有限公司       | 北京市海淀区中关村大街 11 号 E 世界财富中心 A 座 11 层 1108 号   | 王伟刚 | 北京市海淀区中关村大街 11 号 E 世界财富中心 A 座 11 层 | 4006199059       | 王骁骁 | www.hcjijin.com              |
| 67 | 中民财富基金销售(上海)有限公司   | 上海市黄浦区中山南路 100 号 7 层 05 单元                  | 弭洪军 | 上海市黄浦区中山南路 100 号 17 层              | 4008765716       | 黄鹏  | www.cmiwm.com                |
| 68 | 北京植信基金销售有限公司       | 北京市密云县兴盛南路 8 号院 2 号楼 106 室-67               | 王军辉 | 北京市朝阳区惠河南路盛世龙源 10 号                | 4006802123       | 吴鹏  | www.zhixin-inv.com           |
| 69 | 北京肯特瑞基金销售有限公司      | 北京市海淀区海淀东三街 2 号 4 层 401-15                  | 江卉  | 北京市大兴区亦庄经济开发区科创十一街十八号院京东集团总部       | 95118/4000988511 | 黄立影 | kenterui.jd.com/fund.jd.com/ |
| 70 | 喜鹊财富基金销售有限公司       | 西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦 1513 室                        | 陈皓  | 同“注册地址”                            | 4006997719       | 曹砚财 | www.xiquefund.com            |
| 71 | 一路财富(北京)基金销售股份有限公司 | 北京市西城区阜成门大街 2 号万通新世界广场 A 座 2208             | 吴雪秀 | 同“注册地址”                            | 4000011566       | 吕晓歌 | www.yilucaifu.com            |
| 72 | 南京苏宁基金销售有限公司       | 南京市玄武区苏宁大道 1 号                              | 王锋  | 同“注册地址”                            | 95177            | 张云飞 | www.snjijin.com              |
| 73 | 济安财富(北京)基金销售有限公司   | 北京市朝阳区太阳宫中路 16 号院 1 号楼 3 层 307              | 杨健  | 同“注册地址”                            | 4006737010       | 李海燕 | www.jianfortune.com          |
| 74 | 北京蛋卷基金销售有限公司       | 北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层             | 钟斐斐 | 北京市朝阳区创远路 34 号院融新科技中心 C 座 17 层     | 4005199288       | 王悦  | www.danjuanapp.com           |

|  |  |        |  |  |  |  |  |
|--|--|--------|--|--|--|--|--|
|  |  | 222507 |  |  |  |  |  |
|--|--|--------|--|--|--|--|--|

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或变更上述代销机构，并在基金管理人网站公示。

(二) 登记机构

名称：信达澳银基金管理有限公司

住所：广东省深圳市南山区科苑南路（深圳湾段）3331 号阿里巴巴大厦 N1 座第 8 层和第 9 层

办公地址：广东省深圳市南山区科苑南路（深圳湾段）3331 号阿里巴巴大厦 T1 座第 8 层和第 9 层

法定代表人：祝瑞敏

电话：0755-83172666

传真：0755-83196151

联系人：刘玉兰

(三) 律师事务所和经办律师

名称：上海源泰律师事务所

办公地址：上海市浦东南路 256 号华夏银行大厦 1405 室

负责人：廖海

电话：021-51150298

传真：021-51150398

联系人：刘佳

经办律师：刘佳、徐莘

(四) 会计师事务所和经办注册会计师

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

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

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

法定代表人（执行事务合伙人）：毛鞍宁

联系电话：010-58153000

传真：010-85188298

联系人：昌华

经办注册会计师：昌华、高鹤

## 六、基金的募集

（一）本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》、本基金的基金合同及其他有关规定募集。

（二）本基金于 2017 年 8 月 9 日中国证监会证监许可【2017】1462 号文准予注册。

（三）本基金为契约型定期开放式混合型证券投资基金，基金的存续期为不定期。

（四）本基金募集期间基金份额净值为人民币 1.00 元，按面值发售。

（五）本基金自 2018 年 2 月 2 日起向社会公开募集，截至 2018 年 3 月 23 日募集工作顺利结束。本次募集份额合计 232,561,227.02 份，有效认购户数为 2856 户。

## 七、基金备案与基金合同的生效

### 一、基金合同的生效

根据有关规定，本基金满足基金合同生效条件，基金合同于 2018 年 3 月 27 日起正式生效。自基金合同生效日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

### 二、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

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



## 八、基金的封闭期与开放期

### （一）基金的封闭期

本基金的封闭期为自基金合同生效之日（含）起或自每一开放期结束之日次日（含）起 3 个月的期间。本基金的第一个封闭期为自基金合同生效之日（含）起 3 个月的期间。下一个封闭期为首个开放期结束之日次日（含）起 3 个月的期间，以此类推。本基金封闭期内不办理申购与赎回业务，也不上市交易。

### （二）基金的开放期

一般情况下，本基金的每个开放期为自封闭期结束之日后第一个工作日（含）起不少于五个工作日、不超过二十个工作日的期间，具体期间由基金管理人在封闭期结束前公告说明。开放期内，本基金采取开放运作方式，投资人可办理基金份额的申购、赎回或其他业务，开放期末赎回或转换转出的基金份额将自动转入下一个封闭期。

如发生不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放或需依据基金合同暂停申购与赎回业务的，基金管理人有权合理调整申购或赎回业务的办理期间并予以公告。

### （三）封闭期与开放期示例

比如，若本基金的基金合同于 2017 年 9 月 6 日生效，则本基金的第一个封闭期为基金合同生效之日起 3 个月，即 2017 年 9 月 6 日至 2017 年 12 月 5 日。假设第一个开放期为十个工作日，则第一个开放期为 2017 年 12 月 6 日至 2017 年 12 月 19 日的十个工作日；第二个封闭期为第一个开放期结束之日次日起的 3 个月，即 2017 年 12 月 20 日至 2018 年 3 月 19 日。

## 九、基金份额的申购与赎回

### （一）申购和赎回场所

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。具体的销售机构将由基金管理人在招募说明书或基金管理人网站列明。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并在基金管理人网站公示。基金投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。若基金管理人或其指定的代销机构开通电话、传真或网上等交易方式，投资人可以通过上述方式进行申购与赎回。

### （二）申购和赎回的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，开放日为开放期内的每个工作日，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。在封闭期内，本基金不办理申购、赎回业务，也不上市交易。

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

#### 2、申购、赎回开始日及业务办理时间

本基金自基金合同生效后，每3个月开放一次申购和赎回。一般情况下，本基金办理申购与赎回业务的开放期为本基金每个封闭期结束之后第一个工作日（含）起不少于五个工作日、不超过二十个工作日的期间，具体期间由基金管理人在封闭期结束前公告说明。如发生不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放或需依据基金合同暂停申购与赎回业务的，基金管理人有权合理调整申购或赎回业务的办理期间并予以公告。

在确定申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告申购与赎回的开始时间。基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。

在开放期内，投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的，其基金份额申购、赎回价格为下一开放日基金份额申购、赎回的价格。但若投资者在开放期最后一日业务办理时间结束之后提出交易申请的，其交易申请将被拒绝。

### （三）申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算；

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；

4、赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人认购、申购的先后次序进行顺序赎回。

5、本基金份额分为 A、C 类别，适用不同的申购费率、赎回费率或销售服务费，投资者在申购时可自行选择基金份额类别；

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

### （四）申购与赎回的程序

#### 1、申购和赎回的申请方式

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

#### 2、申购和赎回的款项支付

投资人申购基金份额时，必须全额交付申购款项，否则所提交的申购申请无效。投资人提交申购申请，交付申购款项，申购成立；登记机构确认基金份额时，申购生效。

投资人在提交赎回申请时须持有足够的基金份额余额，否则所提交的赎回申请无效。基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；登记机构确认赎回时，赎回生效。

投资人赎回申请成功后，基金管理人将在 T+7 日(包括该日)内支付赎回款项。在发生巨额赎回或本基金合同载明的其他暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。

遇交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或

其它非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程，则赎回款顺延至上述情形消除后支付。

### 3、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T日)，在正常情况下，本基金登记机构在T+1日内对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请，投资人可在T+2日后(包括该日)到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。销售机构对申购和赎回申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购和赎回的确认以登记机构的确认结果为准。若申购不成立或无效，则申购款项本金退还给投资人。

#### (五) 申购和赎回的数量限制及余额的处理方式

1、投资者可多次申购，但单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的50%，也不得通过一致行动人等方式变相达到或超过基金份额总数的50%（在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过50%的除外）。

2、投资人在代销机构销售网点及直销机构网上交易首次申购的最低金额为人民币10元（含申购费），追加申购的最低金额为人民币10元（含申购费）；投资人在直销机构销售网点首次申购的最低金额为人民币5万元（含申购费），追加申购的最低金额为人民币1万元（含申购费）；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。具体申购金额限制以各基金销售机构的公告为准。

3、投资者赎回本基金时，可以申请将其持有的部分或全部基金份额赎回，单笔赎回的最低份额为10份基金份额，若某投资者在该销售网点托管的基金份额不足10份或某笔赎回导致该持有人在销售网点托管的基金份额少于10份，则全部基金份额必须一并赎回；如因红利再投资、非交易过户、转托管、巨额赎回、基金转换等原因导致的账户余额少于10份的情况，不受此限，但再次赎回时必须一次性全部赎回。

4、单个基金份额持有人持有本基金的最低限额为10份。

5、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。

6、基金管理人可根据市场情况，在不损害基金份额持有人权益的情况下，调整上述申购金额和赎回份额的数量限制，调整实施前基金管理人必须依照《信息披露办法》的有关规定在中国证监会指定媒介上刊登公告。

7、申购份额、余额的处理方式：申购的有效份额为净申购金额除以当日的基金份额净值，有效份额单位为份。上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后2位，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

8、赎回金额的处理方式：赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值，并扣除相应的赎回费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后2位，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

#### （六）申购和赎回费率

##### 1、申购费率

本基金 A 类基金份额采用前端收费模式收取申购费用，即在申购时支付申购费用，申购采用前端收费模式，费率按认购金额采用比例费率，投资人在一天之内如果有多笔认购，适用费率按单笔分别计算。投资人申购 C 类基金份额不收取申购费。费率表如下：

| 申购金额 (M)          | 申购费率    |    |
|-------------------|---------|----|
|                   | A类      | C类 |
| M < 50万元          | 1.5%    | 0  |
| 50万元 ≤ M < 200万元  | 1.0%    |    |
| 200万元 ≤ M < 500万元 | 0.6%    |    |
| M ≥ 500万元         | 每笔1000元 |    |

投资者选择红利自动再投资所转成的份额不收取申购费用。

本基金A类基金份额的申购费用由申购人承担，可用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用，不列入基金资产。

2、赎回费率投资者赎回 A 类和 C 类份额时须缴纳赎回费，投资者可将其持有的全部或部分基金份额赎回。赎回费用由赎回基金份额的基金持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取，

本基金的 A 类份额的赎回费率如下：

| 持有基金份额期限                            | A 类基金份额赎回费率 |
|-------------------------------------|-------------|
| $T < 7$ 日                           | 1.5%        |
| $7 \text{ 日} \leq T < 30 \text{ 日}$ | 0.75%       |
| $30 \text{ 日} \leq T < 1 \text{ 年}$ | 0.5%        |
| $1 \text{ 年} \leq T < 2 \text{ 年}$  | 0.25%       |
| $T \geq 2 \text{ 年}$                | 0           |

（注：1 个月以 30 日计，1 年以 365 日计）

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。

对持续持有期少于 30 天的投资人的赎回费全额计入基金财产；对持续持有期大于等于 30 天少于 3 个月的投资人的赎回费总额 75% 计入基金财产；对持续持有期大于等于 3 个月少于 6 个月的投资人的赎回费总额的 50% 计入基金财产；对持续持有期长于 6 个月的投资人的赎回费总额 25% 计入基金财产。

本基金 C 类基金份额的赎回费率如下：

| 持有基金份额期限        | C 类基金份额赎回费率 |
|-----------------|-------------|
| $T < 7$         | 1.50%       |
| $7 \leq T < 30$ | 0.5%        |
| $30 \leq T$     | 0           |

投资人可将其持有的全部或部分 C 类基金份额赎回。赎回费用由赎回 C 类基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回 C 类基金份额时收取。对持续持有期少于 30 日的投资人收取的赎回费将全额计入基金财产。

3、基金管理人可以根据法律法规规定及基金合同调整申购费率、赎回费率或收费方式，最新的申购费率、赎回费率或收费方式在招募说明书（更新）或相关公告中列示。费率或收费方式如发生变更，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式开始实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

4、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续

后，基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

5、当本基金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。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）申购份额与赎回金额的计算方式

##### 1、申购份额的计算

（1）若投资人选择 A 类基金份额，本基金的申购金额包括申购费用和净申购金额。其中：

申购份额的计算方式如下：

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

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

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

对于适用固定金额申购费的申购：净申购金额 = 申购金额 - 申购费用

例：某投资人投资 10,000 元申购本基金，假设申购当日基金份额净值为 1.0500 元，则可得到的申购份额为：

$$\text{净申购金额} = 10,000 / (1 + 1.5\%) = 9,852.22 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 10,000 - 9,852.22 = 147.78 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 9,852.22 / 1.0500 = 9,383.07 \text{ 份}$$

即：投资人投资 10,000 元申购本基金，其对应费率为 1.5%，假设申购当日基金份额净值为 1.0500 元，则其可得到 9,383.07 份基金份额。

（2）若投资人选择 C 类基金份额，则申购份额的计算公式如下：

$$\text{申购份额} = \text{申购金额} / \text{T 日 C 类基金份额净值}$$

例：某投资人投资 100,000 元申购本基金 C 类基金份额，假设申购当日 C 类基金份额净值为 1.040 元，则其可得到的申购份额为：

$$\text{申购份额} = 100,000 / 1.040 = 96,153.85 \text{ 份}$$

##### 2、赎回金额的计算

本基金的赎回金额为赎回总额扣减赎回费用。其中：

$$\text{赎回总额} = \text{赎回份数} \times \text{T 日基金份额净值}$$

$$\text{赎回费用} = \text{赎回总额} \times \text{赎回费率}$$

赎回金额=赎回总额-赎回费用

例：某投资人赎回本基金 10,000 份 A 类基金份额，持有时间为 6 个月，对应的赎回费率为 0.5%，假设赎回当日基金份额净值是 1.0500 元，则其可得到的赎回金额为：

赎回总额=10,000×1.0500=10,500 元

赎回费用=10,500×0.5%=52.50 元

赎回金额=10,500-52.50=10,447.50 元

即：投资人赎回本基金 1 万份基金份额，持有期限为 6 个月，假设赎回当日基金份额净值是 1.0500 元，则其可得到的赎回金额为 10447.50 元。

例：某投资人赎回本基金 10,000 份 C 类基金份额，假设该笔份额持有期限为 10 天，则对应的赎回费率为 0.50%，假设赎回当日 C 类基金份额基金份额净值是 1.016 元，则其可得到的赎回金额为：

赎回费用 = 10,000 × 1.016 × 0.50% = 50.80 元

赎回金额 = 10,000 × 1.016 - 50.80 = 10,109.20 元

即：投资人赎回本基金 10,000 份 C 类基金份额，假设赎回当日 C 类基金份额基金份额净值是 1.016 元，则其可得到的赎回金额为 10,109.20 元。

### 3、T 日基金份额净值的计算

T 日基金份额净值 = T 日基金资产净值 / T 日基金份额总数。

T 日的基金份额净值在当天收市后计算，精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

在封闭期内，基金管理人应当至少每周在指定网站披露一次各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。

在开放期内，基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过指定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日的各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。

基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在指定网站披露半年度和年度最后一日的各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。

#### （八）拒绝或暂停申购的情形

在开放期内发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申



请：

1、因不可抗力导致基金无法正常工作。

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。

3、证券、期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

4、接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。

5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人利益的情形。

6、基金管理人、基金托管人、基金销售机构或登记机构的异常情况导致基金销售系统、基金登记系统或基金会计系统无法正常工作。

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、当一笔新的申购申请被确认成功，使本基金总规模超过基金管理人规定的本基金总规模上限时；或使本基金单日申购金额或净申购比例超过基金管理人规定的当日申购金额或净申购比例上限时；或该投资人累计持有的份额超过单个投资人累计持有的份额上限时；或该投资人当日申购金额超过单个投资人单日或单笔申购金额上限时。

9、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。

10、法律法规、基金合同的规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第 1、2、3、5、6、9、10 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项本金将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理，且开放期间按暂停申购的时间相应延长。

#### （九）暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

在开放期内发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓

支付赎回款项：

1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。

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

3、证券、期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

4、继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时，可暂停接受投资人的赎回申请。

5、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当采取暂停接受基金赎回申请的措施。

6、法律法规、基金合同规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项时，基金管理人应按规定报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告，且开放期间按暂停赎回的时间相应延长。

#### （十）巨额赎回的情形及处理方式

##### 1、巨额赎回的认定

若本基金开放期内单个开放日内的基金份额净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过前一工作日的基金总份额的 20%，即认为是发生了巨额赎回。

##### 2、巨额赎回的处理方式

当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或延缓支付赎回款项。

（1）全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

(2) 延缓支付赎回款项：基金管理人符合法律法规及基金合同约定的赎回申请应于当日全部予以接受和确认。但对于已接受的赎回申请，当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付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，基金管理人应对当日全部赎回申请进行确认，当日按比例办理的赎回份额不得低于基金总份额的 20%，其余赎回申请可以延缓支付赎回款项，但延缓支付的期限最长不超过 20 个工作日。延缓支付的赎回申请以赎回申请当日的基金份额净值为基础计算赎回金额。

(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工作日基金总份额的 20%，基金管理人可以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，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，直至本开放期结束为止。如延期办理期限超过开放期的，开放期相应延长至份额全部赎回。延长的开放期内不办理申购，亦不接受新的赎回申请，即基金管理人仅为原开放期内因提交赎回申请超过基金总份额 20% 以上而被延期办理赎回的单个基金份额持有人办理赎回业务。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。

### 3、巨额赎回的公告

当发生上述巨额赎回并延缓支付赎回款项时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，并在 2 日内在指定媒介上刊登公告。

#### (十一) 暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

1、发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人应在规定期限内指定媒介上刊登暂停公告。

2、如发生暂停的时间为 1 日，基金管理人应于重新开放日，在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近 1 个工作日的基金份额净值。

3、如发生暂停的时间超过 1 日，基金管理人可以根据暂停申购或赎回的时间，依据《信息披露办法》的有关规定，最迟于重新开放申购或赎回日在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，也可以根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间，届时将不再另行发布重新开放的公告。

以上暂停及恢复基金申购与赎回的公告规定，不适用于基金合同约定的开放期与封闭期基金运作方式转换引起的暂停或恢复申购与赎回的情形。

#### （十二）基金转换

基金管理人可以在开放期内根据相关法律法规以及基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理、且由同一登记机构办理注册登记的其他基金之间的转换业务，基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及基金合同的规定制定并公告，并提前告知基金托管人与相关机构。

#### （十三）基金的非交易过户

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

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

#### （十四）基金的转托管

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

#### （十五）基金的冻结和解冻

基金登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻，以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。基金份额的冻结手续、冻结方式按照基金登记机构的相关规定办理。基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益按照我国法律法规、监管规章及国家有权机关的要求以及登记机构业务规定来处理。

## 十、基金的投资

### （一）投资目标

本基金在有效控制风险的前提下，运用多种投资策略，追求超越业绩比较基准的投资回报。

### （二）投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票等）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券或票据）、债券回购、现金、货币市场工具、权证、股指期货、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：

封闭期内，股票资产占基金资产的比例为 0%—100%；开放期内，股票资产占基金资产的比例为 0%—95%。开放期内，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；封闭期内，本基金不受上述 5%的限制，但每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

### （三）投资策略

本基金投资策略主要包括资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、权证投资策略、股指期货投资策略、资产支持证券投资策略。

#### 1、资产配置策略

本基金采取“自上而下”的方式进行大类资产配置，根据对宏观经济、市场面、政策面等因素进行定量与定性相结合的分析研究，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例。本基金主要考虑的因素为：

(1) 宏观经济指标：包括 GDP 增长率、工业增加值、居民消费价格指数(CPI)、生产者价格指数(PPI)、采购经理人指数 (PMI)、市场利率、货币供应量(M0, M1, M2)的增长率等指标。

(2) 市场因素：包括股票及债券市场的涨跌及预期收益率、市场整体估值水平及与国外市场的比较、市场资金供求关系及其变化。

(3) 政策因素：包括货币政策、财政政策、资本市场相关政策和行业政策扶持等。

通过对以上各种因素的分析，结合全球宏观经济形势，研判国内经济的发展趋势，并在严格控制投资组合风险的前提下，确定或调整投资组合中大类资产的比例。

## 2、股票投资策略

本基金通过积极主动的投资管理为投资人创造价值，秉承自下而上的投资分析方法，对企业及其发展环境的深入分析，寻求具有长期竞争力的成长型企业和他们被市场低估时产生的投资机会，通过投资具有持续盈利增长能力和长期投资价值的优质企业为投资人实现股票资产的持续增值。

运用“信达澳银公司价值分析体系 (QGV, Quality, Growth & Valuation)”，从公司素质、盈利增长和估值三个方面对公司进行严格的综合评估，以深度挖掘能够持续保持盈利增长的成长型公司。

运用“信达澳银行业优势分析体系(ITC, Industrial Trends & Competitiveness)”，从行业长期发展的维度对比分析行业内的公司，从行业层面对公司做出筛选，挑选行业内竞争力强、符合行业发展趋势的优秀公司。

运用“信达澳银宏观景气分析体系(MDE, Macro Drivers & Environment)”，考察宏观经济增长的行业驱动力，行业的景气变化、宏观景气变动对不同行业及相关公司的潜在影响，以及宏观经济政策对相关行业的影响，进而判断行业的发展趋势、景气周期、盈利能力、成长性、相对投资价值的变化，选择未来一段时间内持续增长能力突出的行业并调整对相关公司的价值判断，最终完成对行业配置的适度调控。

相关公司根据满足“信达澳银公司价值分析体系 (QGV)”和“信达澳银行业优势分析体系(ITC)”的不同程度，以及投资团队对该公司的研究深度，分别被确定为“核心品种”、“重点品种”和“观察性品种”3 个层级并不断循环论证，在此基础上基金经理根据自身判断，结合“信达澳银宏观景气分析体系(MDE)”提出的行业投资建议，构建基金的股票投资组合。

### 3、债券投资策略

本基金的债券投资将坚持价值投资理念，通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势以及不同类属的收益率水平、流动性和信用风险等因素，以久期控制和结构分布策略为主，以收益率曲线策略、利差策略等为辅，构造能够提供稳定收益的债券和货币市场工具组合。

### 4、权证投资策略

本基金将权证作为有效控制基金投资组合风险、提高投资组合收益的辅助工具。本基金在投资权证时，将根据权证对应公司基本面研究成果确定权证的合理估值，发现市场对股票权证的非理性定价，谨慎进行投资，追求较为稳健的当期收益。

### 5、股指期货投资策略

本基金在股指期货的投资中主要遵循避险和有效管理两项策略和原则。即在市场风险大幅累计时的避险操作，减小基金投资组合因市场下跌而遭受的市场风险；同时利用股指期货流动性好、交易成本低等特点，通过股指期货对投资组合的仓位进行及时调整，提高投资组合的运作效率。

### 6、资产支持证券投资策略

本基金将在宏观经济和基本面分析的基础上，对资产证券化产品的质量和构成、利率风险、信用风险、流动性风险和提前偿付风险等进行定性和定量的全方面分析，评估其相对投资价值并作出相应的投资决策，力求在控制投资风险的前提下尽可能的提高本基金的收益。

## （四）投资限制

### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）封闭期内，股票资产占基金资产的比例为 0%—100%；开放期内，股票资产占基金资产的比例为 0%—95%；

（2）开放期内，本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；封闭期内，本基金不受上述 5%的限制，但每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

- (3) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；
- (4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；
- (5) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；
- (6) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；
- (7) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；
- (8) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；
- (9) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；
- (10) 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；
- (11) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；
- (12) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；
- (13) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；
- (14) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%，在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不展期；
- (15) 开放期内，本基金与本基金管理人管理的其他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%；开放期内，本基金与本基金管理人管理的其他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%；
- (16) 开放期内，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%；



因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(17) 在封闭期内，本基金总资产不得超过基金净资产的 200%；在开放期内，本基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

(18) 本基金投资流通受限证券，基金管理人应事先根据中国证监会相关规定，与基金托管人在基金托管协议中明确基金投资流通受限证券的比例，根据比例进行投资。基金管理人应制定严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险；

(19) 本基金参与股指期货交易，则需遵守下列投资比例限制：

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

2) 开放期内的每个交易日日终，本基金持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；封闭期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

3) 本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；

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

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

(20) 开放期内，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本基金合同约定的投资范围保持一致；

(21) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

本基金在开始进行股指期货投资之前，应与基金托管人、期货公司三方一同就股指期货开户、清算、估值、交收等事宜另行签署协议。

除上述第（2）、（12）、（16）、（20）项外，因证券、期货市场波动、证券发行

人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 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，法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。期间，本基金的投资范围、投资策略应当符合本基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

如果法律法规或监管部门对上述投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。

法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

法律法规或监管部门对上述组合限制政策作出强制性调整的，本基金应当按照法律法规或监管部门的规定执行；如法律法规或监管部门对上述组合限制政策的调整或修改对本基金的效力并非强制性的，则基金管理人与基金托管人协商一致后，可按照法律法规或监管部门调整或修改后的组合限制政策执行，而无需基金份额持有人大会审议决定，但基金管理人在执行法律法规或监管部门调整或修改后的组合限制政策前，应向投资者履行信息披露义务并向监管机关报告或备案。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- (5) 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；
- (6) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

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的，应当符合本基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场

公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按变更后的规定执行。

#### （五）业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50%

1、沪深 300 指数是中证指数公司依据国际指数编制标准并结合中国市场的实际情况编制的沪深两市统一指数，科学地反映了我国证券市场的整体业绩表现，具有一定的权威性和市场代表性，业内也普遍采用。因此，沪深 300 指数是衡量本基金股票投资业绩的理想基准。

2、上证国债指数由上交所编制，具有较长的编制和发布历史，以及较高的知名度和市场影响力，适合作为本基金债券投资部分的基准。

如果业绩比较基准中所使用的指数停止发布或变更名称，或者今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，经与基金托管人协商一致，本基金可在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告，不需要召开基金份额持有人大会。

#### （六）风险收益特征

本基金为混合型基金，属于证券投资基金中预期风险与预期收益中等的投资品种，其风险收益水平高于货币基金和债券型基金，低于股票型基金。

#### （七）基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

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

2、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；

3、有利于基金财产的安全与增值；

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

#### （八）基金的投资组合报告

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

基金托管人交通银行股份有限公司复核了本次更新招募说明书中的投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本投资组合报告期截止至 2019 年 12 月 31 日。本报告中财务资料未经审计。以下金额单位均为人民币元。

一) 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额(元)          | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|----------------|---------------|
| 1  | 权益投资              | 75,868,437.18  | 55.71         |
|    | 其中：股票             | 75,868,437.18  | 55.71         |
| 2  | 基金投资              | -              | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 53,966,572.10  | 39.63         |
|    | 其中：债券             | 53,966,572.10  | 39.63         |
|    | 资产支持证券            | -              | -             |
| 4  | 贵金属投资             | -              | -             |
| 5  | 金融衍生品投资           | -              | -             |
| 6  | 买入返售金融资产          | -              | -             |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -              | -             |
| 7  | 银行存款和结算备付金合计      | 5,602,289.20   | 4.11          |
| 8  | 其他资产              | 755,507.24     | 0.55          |
| 9  | 合计                | 136,192,805.72 | 100.00        |

二) 期末按行业分类的股票投资组合

1、报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别     | 公允价值(元)       | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|----------|---------------|---------------|
| A  | 农、林、牧、渔业 | -             | -             |
| B  | 采矿业      | 3,180,261.00  | 2.34          |
| C  | 制造业      | 22,851,021.98 | 16.82         |

|   |                  |               |       |
|---|------------------|---------------|-------|
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 32,004.16     | 0.02  |
| E | 建筑业              | 3,086,703.86  | 2.27  |
| F | 批发和零售业           | -             | -     |
| G | 交通运输、仓储和邮政业      | 651,585.00    | 0.48  |
| H | 住宿和餐饮业           | -             | -     |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 1,183,662.90  | 0.87  |
| J | 金融业              | 41,368,558.44 | 30.44 |
| K | 房地产业             | 2,039,214.00  | 1.50  |
| L | 租赁和商务服务业         | 1,138,560.00  | 0.84  |
| M | 科学研究和技术服务业       | 336,865.84    | 0.25  |
| N | 水利、环境和公共设施管理业    | -             | -     |
| O | 居民服务、修理和其他服务业    | -             | -     |
| P | 教育               | -             | -     |
| Q | 卫生和社会工作          | -             | -     |
| R | 文化、体育和娱乐业        | -             | -     |
| S | 综合               | -             | -     |
|   | 合计               | 75,868,437.18 | 55.83 |

## 2、报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

## 三) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量(股)   | 公允价值(元)      | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------|--------------|--------------|
| 1  | 601318 | 中国平安 | 106,500 | 9,101,490.00 | 6.70         |
| 2  | 600519 | 贵州茅台 | 6,200   | 7,334,600.00 | 5.40         |

|    |        |      |         |                  |      |
|----|--------|------|---------|------------------|------|
|    |        | 台    |         | 0                |      |
| 3  | 600036 | 招商银行 | 123,200 | 4,629,856.0<br>0 | 3.41 |
| 4  | 601601 | 中国太保 | 116,600 | 4,412,144.0<br>0 | 3.25 |
| 5  | 600276 | 恒瑞医药 | 43,500  | 3,807,120.0<br>0 | 2.80 |
| 6  | 601166 | 兴业银行 | 176,753 | 3,499,709.4<br>0 | 2.58 |
| 7  | 600887 | 伊利股份 | 91,500  | 2,831,010.0<br>0 | 2.08 |
| 8  | 600030 | 中信证券 | 98,525  | 2,492,682.5<br>0 | 1.83 |
| 9  | 600016 | 民生银行 | 308,281 | 1,945,253.1<br>1 | 1.43 |
| 10 | 600000 | 浦发银行 | 151,694 | 1,876,454.7<br>8 | 1.38 |

四) 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种       | 公允价值(元)       | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------------|---------------|--------------|
| 1  | 国家债券       | -             | -            |
| 2  | 央行票据       | -             | -            |
| 3  | 金融债券       | 30,046,456.90 | 22.11        |
|    | 其中: 政策性金融债 | 30,046,456.90 | 22.11        |
| 4  | 企业债券       | 4,058,115.20  | 2.99         |
| 5  | 企业短期融资券    | -             | -            |
| 6  | 中期票据       | -             | -            |
| 7  | 可转债(可交换债)  | -             | -            |
| 8  | 同业存单       | 19,862,000.00 | 14.62        |
| 9  | 其他         | -             | -            |
| 10 | 合计         | 53,966,572.10 | 39.71        |

五) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码      | 债券名称          | 数量(张)   | 公允价值(元)       | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|---------------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 111909466 | 19 浦发银行 CD466 | 200,000 | 19,862,000.00 | 14.62        |
| 2  | 108602    | 国开 1704       | 149,430 | 15,029,669.40 | 11.06        |
| 3  | 018007    | 国开 1801       | 149,050 | 15,016,787.50 | 11.05        |
| 4  | 143103    | 17 云投 G1      | 10,000  | 1,000,600.00  | 0.74         |
| 5  | 136719    | 16 珠江 02      | 10,000  | 1,000,000.00  | 0.74         |

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

注: 本基金本报告期末未持有资产支持证券。

七) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注: 本基金本报告期末未持有贵金属。

八) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注: 本基金本报告期末未持有权证。

九) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

1、报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注: 本基金本报告期末未持有股指期货。

2、本基金投资股指期货的投资政策

注: 本基金未参与投资股指期货。

十) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

1、本期国债期货投资政策

注: 本基金未参与投资国债期货。

## 2、报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

## 3、本期国债期货投资评价

注：本基金未参与投资国债期货。

## 十一) 投资组合报告附注

1、本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形及相关投资决策程序说明。

### 中信证券（600030）

中信证券广州番禺万达广场证券营业部于2019年11月收到广东证监局“关于对中信证券股份有限公司广州番禺万达广场证券营业部采取责令改正措施的决定”，该公司违反了《证券公司分支机构监管规定》第十七条、《证券公司监督管理条例》第二十七条的规定。

该公司已经积极应对处理，并将加强内控，基金管理人经审慎分析，认为该事件对公司基本面不构成实质影响。

除中信证券（600030）外，其余的本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内没有被监管部门立案调查，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2、本基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库的情形。

### 3、其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额(元)      |
|----|---------|------------|
| 1  | 存出保证金   | 24,862.60  |
| 2  | 应收证券清算款 | -          |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | 730,644.64 |
| 5  | 应收申购款   | -          |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 其他      | -          |
| 8  | 合计      | 755,507.24 |

## 4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细



注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

#### 6、投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

## 十一、基金的业绩

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，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预示其未来表现。投资有风险，投资者在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的招募说明书及基金合同。

1、截至 2019 年 12 月 31 日，基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较：

信达澳银新征程定期开放灵活配置混合 A:

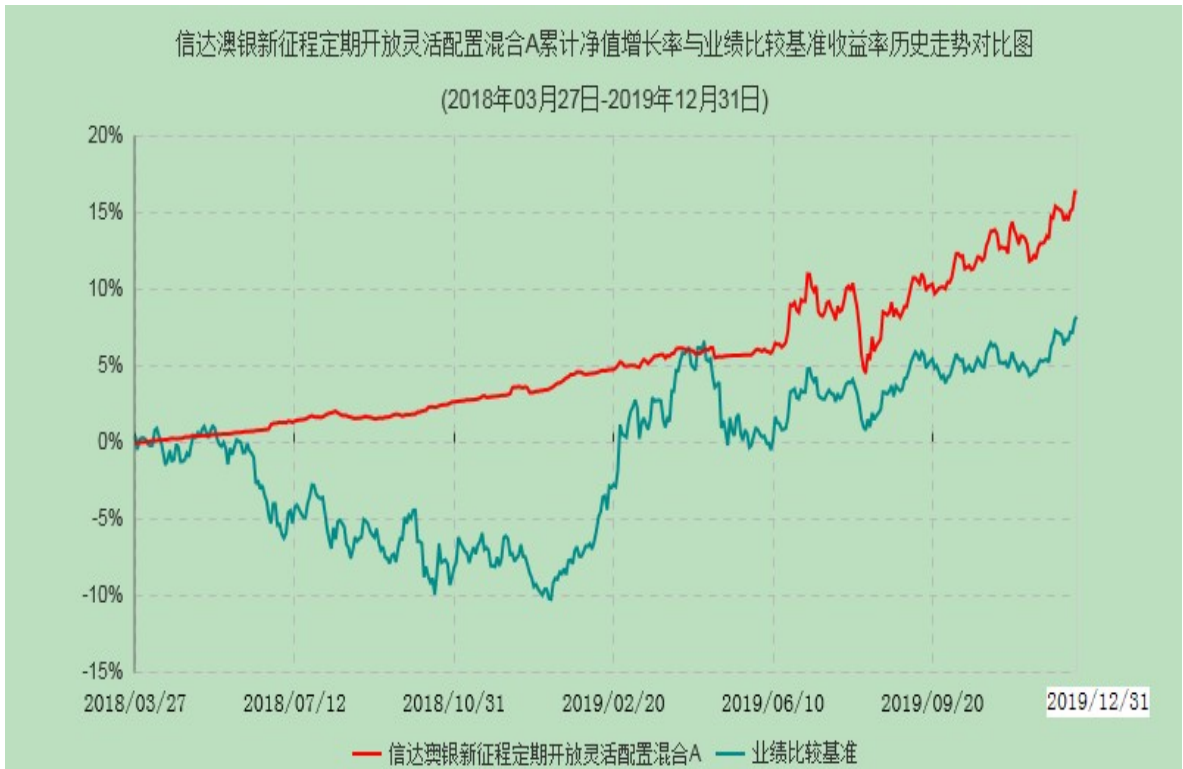
| 阶段   | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④    |
|--|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 2019 年<br>(2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日)   | 12.51%   | 0.42%       | 19.73%     | 0.62%         | -7.22% | -0.20% |
| 自基金合同生效起至今 (2018 年 3 月 27 日至 2019 年 12 月 31 日) | 16.39%   | 0.32%       | 8.23%      | 0.65%         | 8.16%  | -0.33% |

信达澳银新征程定期开放灵活配置混合 C:

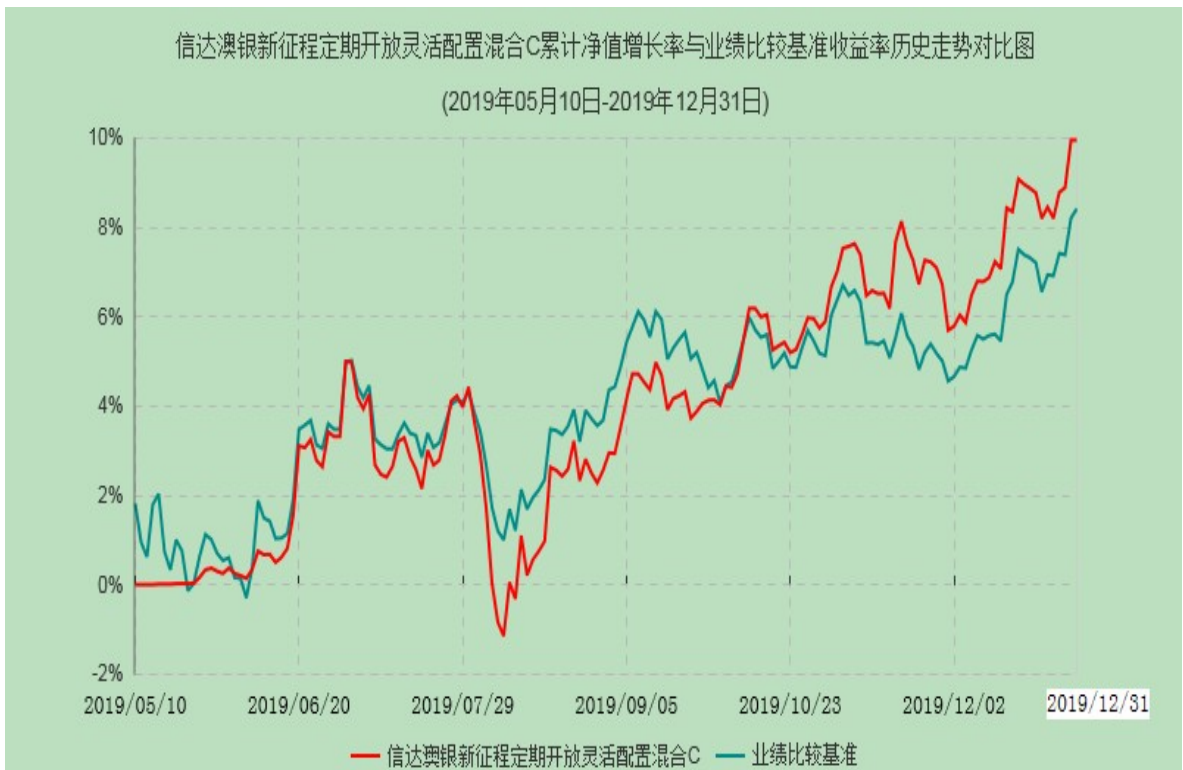
| 阶段   | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③   | ②-④   |
|--|----------|-------------|------------|---------------|-------|-------|
| 2019 年 (2019 年 5 月 10 日至 2019 年 12 月 31 日) | 9.97%    | 0.51%       | 8.43%      | 0.49%         | 1.54% | 0.02% |
| 自基金合同生效起至今                                 | 9.97%    | 0.51%       | 8.43%      | 0.49%         | 1.54% | 0.02% |

2、基金合同生效以来基金份额净值的变动情况，并与同期业绩比较基准的变动的比较

信达澳银新征程定期开放灵活配置混合 A:



信达澳银新征程定期开放灵活配置混合 C:



注:

注：1、本基金基金合同于 2018 年 3 月 27 日生效，2018 年 6 月 27 日开始办理申购、赎回业务。

2、本基金的投资组合比例为：封闭期内，股票资产占基金资产的比例为 0%—100%；开放期内，股票资产占基金资产的比例为 0%—95%。开放期内，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；封闭期内，本基金不受上述 5%的限制，但每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金按规定在合同生效后六个月内达到上述规定的投资比例。

3、本基金从 2018 年 10 月 8 日起新增 C 类份额，C 类份额自 2019 年 5 月 10 日起存续。此前存续的基金份额为 A 类基金份额。

## 十二、基金的财产

### （一）基金资产总值

基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息和基金应收款项以及其他资产的价值总和。

### （二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### （三）基金财产的账户

基金托管人根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立资金账户、证券账户、期货账户以及投资所需的其他专用账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

### （四）基金财产的保管和处分

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

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

## 十三、基金资产的估值

### （一）估值日

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

### （二）估值对象

基金所拥有的股票、权证、债券、衍生工具和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

### （三）估值方法

#### 1、证券交易所上市的权益类证券的估值

交易所上市的权益类证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

#### 2、交易所市场交易的固定收益品种的估值

（1）对在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（另有规定的除外），选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；

（2）对在交易所市场上市交易的可转换债券，按估值日收盘价减去可转换债券收盘价中所含债券应收利息后得到的净价进行估值；

（3）对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募债券，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，按成本估值；

（4）对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的固定收益品种，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

#### 3、银行间市场交易的固定收益品种的估值

（1）银行间市场交易的固定收益品种，选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；

（2）对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的固定收益品

种，按成本估值。

4、处于未上市期间的权益类证券应区分如下情况处理：

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

(2) 首次公开发行未上市的股票和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

(3) 在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

5、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

6、股指期货合约的估值：

本基金投资股指期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

7、其他资产的估值方法

其他资产按国家有关规定进行估值。

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

9、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

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。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反《基金合同》订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对于基金净值的计算结果对外予以公布，由此给基金份额持有人和基金造成的损

失以及因该交易日基金净值计算顺延错误而引起的损失，由基金管理人负责赔付，由此给基金份额持有人和基金造成的损失以及因该交易日基金净值计算顺延错误而引起的损失，基金托管人不负责赔付。

#### （四）估值程序

1、基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到 0.0001 元，小数点后第五位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

每个工作日计算基金资产净值及各类基金份额净值，并按规定公告。

2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或本基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将各类基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

#### （五）估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当任一类基金份额净值小数点后 4 位以内(含第 4 位)发生估值错误时，视为该类基金份额净值错误。基金合同的当事人应按照以下约定处理：

##### 1、估值错误类型

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

上述估值错误的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等。对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平不能预见、不能避免、不能克服，则属不可抗力。由于不可抗力原因造成投资人的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

##### 2、估值错误处理原则

（1）估值错误已发生，但尚未给当事人造成损失时，估值错误责任方应及时



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

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

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

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

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

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

(7) 按法律法规规定的其他原则处理差错。

### 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

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

#### 4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

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

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

(3) 因基金估值错误，给基金或基金份额持有人造成损失的，应由基金管理人先行赔付，基金管理人按差错情形，有权向其他当事人追偿。

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

(5) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

#### (六) 暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

3、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、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

#### (七) 基金净值的确认

基金资产净值和各类基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金资产净值和各类基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基

金管理人，由基金管理人 对基金净值予以公布。

（八）特殊情况的处理

1、基金管理人或基金托管人按估值方法第 8 项进行估值时，所造成的误差 不作为基金资产估值错误处理。

2、由于不可抗力原因，或由于证券、期货交易所及登记结算公司发送的数 据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等，基金管理人和基金托管人虽然已经 采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产 估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应 当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

## 十四、基金收益与分配

### （一）基金利润的构成

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

### （二）基金可供分配利润

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

### （三）基金收益分配原则

1、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

2、基金收益分配后各类基金份额净值均不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值。

3、本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权，由于本基金各类基金份额收取费用情况不同，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同；

4、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

### （四）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。由于不同基金份额类别对应的可分配收益不同，基金管理人可相应制定不同的收益分配方案。

### （五）收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，在 2 日内在指定媒介公告。

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

### （六）基金收益分配中发生的费用

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

## 十五、基金的费用与税收

### （一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、销售服务费；
- 4、除法律法规、中国证监会另有规定外，《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券、期货交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、基金的开户费用、账户维护费用；
- 10、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

### （二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.6% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

#### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.1% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

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。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

### 3、基金的销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.20%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务。

销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.20% 年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，按月支付。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。”

上述“一、基金费用的种类中第 4—10 项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人根据基金管理人指令并参照行业惯例从基金财产中支付。（三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

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

### （四）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

基金财产投资的相关税收，由基金份额持有人承担。



## 十六、基金的会计与审计

### （一）基金会计政策

- 1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；
- 2、基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日；基金首次募集的会计年度按如下原则：如果《基金合同》生效少于2个月，可以并入下一个会计年度；
- 3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
- 4、会计制度执行国家有关会计制度；
- 5、本基金独立建账、独立核算；
- 6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；
- 7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以托管协议约定的方式确认。

### （二）基金的年度审计

- 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意。
- 3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所需在2日内在指定媒介公告。

## 十七、基金的信息披露

(一) 本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《基金合同》及其他有关规定。相关法律法规关于信息披露的披露方式、登载媒介、报备方式等规定发生变化时，本基金从其最新规定。

### (二) 信息披露义务人

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和非法人组织。

本基金信息披露义务人以保护基金份额持有人利益为根本出发点，按照法律法规和中国证监会的规定披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性、完整性、及时性、简明性和易得性。

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会指定媒介披露，并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

(三) 本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

- 1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；
- 2、对证券投资业绩进行预测；
- 3、违规承诺收益或者承担损失；
- 4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构；
- 5、登载任何自然人、法人和非法人组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；
- 6、中国证监会禁止的其他行为。

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

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

### (五) 公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

- 1、基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议、基金产品资料概要

(1) 《基金合同》是界定《基金合同》当事人的各项权利、义务关系，明确基

基金份额持有人大会召开的规则及具体程序，说明基金产品的特性等涉及基金投资者重大利益的事项的法律文件。

(2) 基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金认购、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。

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

(4) 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，并刊登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。

基金募集申请经中国证监会注册后，基金管理人在基金份额发售的3日前，将基金招募说明书、《基金合同》摘要登载在指定媒介上；基金管理人、基金托管人应当将《基金合同》、基金托管协议登载在网站上。

## 2、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媒介上。

## 3、《基金合同》生效公告

基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日在指定媒介上登载《基金合同》生效公告。

## 4、基金净值信息

在封闭期内，基金管理人应当至少每周在指定网站披露一次各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。

在开放期内，基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过指定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日的各类基金份额净值和各类基金份额累

计净值。

基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在指定网站披露半年度和年度最后一日的各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。

#### 5、基金份额申购、赎回价格

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

#### 6、基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告

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。

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，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 2 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。

基金持续运作过程中，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。

基金运作期间，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。

#### 7、临时报告

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，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（不包括本基金开放期与封闭期运作方式的转换）、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、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- (6) 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；
- (7) 基金募集期延长；
- (8) 基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、变更基金管理人的实际控制人；
- (9) 基金管理人高级管理人员、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；
- (10) 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；
- (11) 涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼或仲裁；
- (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，中国证监会另有规定的情形除外；
- (14) 基金收益分配事项；
- (15) 管理费、托管费、销售服务费、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) 任一类基金份额净值估值错误达该类基金份额净值百分之零点五；
- (17) 本基金进入开放期；

- (18) 本基金发生巨额赎回并延缓支付赎回款项；
- (19) 本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；
- (20) 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时；
- (21) 基金管理人采用摆动定价机制进行估值时；
- (22) 新增或调整基金类别份额；
- (23) 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。

#### 8、澄清公告

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，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。

#### 9、基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

#### 10、投资于股指期货的信息

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

#### 11、投资于资产支持证券的信息

本基金投资资产支持证券，基金管理人应在基金年报及中期报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细。基金管理人应在基金季度报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期末按市值占基金净资产比例大小排序的前 10 名资产支持证券明细。

#### 12、投资于流通受限证券

本基金投资流通受限证券，基金管理公司应在基金投资非公开发行股票后两个交易日内，在中国证监会指定媒体披露所投资非公开发行股票的名称、数量、总成

本、账面价值，以及总成本和账面价值占基金资产净值的比例、锁定期等信息。

### 13、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作出清算报告。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。

### 14、中国证监会规定的其他信息。

#### （六）信息披露事务管理

基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度，指定专门部门及高级管理人员负责管理信息披露事务。

基金信息披露义务人公开披露基金信息，应当符合中国证监会相关基金信息披露内容与格式准则等法规的规定。

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告、更新的招募说明书、基金产品资料概要、基金清算报告等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人出具书面文件或者盖章或者以 XBRL 电子方式复核审查并确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定报刊中选择一家报刊披露本基金信息。基金管理人、基金托管人应当向中国证监会基金电子披露网站报送拟披露的基金信息，并保证相关报送信息的真实、准确、完整、及时。

基金管理人、基金托管人除依法在指定媒介上披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒介披露信息，但是其他公共媒介不得早于指定媒介披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

基金管理人、基金托管人除按法律法规要求披露信息外，也可着眼于为投资者决策提供有用信息的角度，在保证公平对待投资者、不误导投资者、不影响基金正常投资操作的前提下，自主提升信息披露服务的质量。具体要求应当符合中国证监会及自律规则的相关规定。前述自主披露如产生信息披露费用，该费用不得从基金财产中列支。

为基金信息披露义务人公开披露的基金信息出具审计报告、法律意见书的专业机构，应当制作工作底稿，并将相关档案至少保存到《基金合同》终止后 10 年。

(七) 信息披露文件的存放与查阅

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。

(八) 当出现下述情况时，基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金相关信息：

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

2、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

3、法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的情况。



## 十八、风险揭示

### （一）市场风险

本基金主要投资于证券市场，而证券市场价格受政治、经济、投资心理和交易制度等各种因素的影响会产生波动，从而对本基金投资产生潜在风险，导致基金收益水平发生波动。

#### 1、政策风险

货币政策、财政政策、产业政策等国家宏观经济政策的变化对货币市场产生一定影响，从而导致投资对象价格波动，影响基金收益而产生的风险。

#### 2、经济周期风险

证券市场是国民经济的晴雨表，而经济运行则具有周期性的特点。随宏观经济运行的周期性变化，基金所投资于证券的收益水平也会随之变化，从而产生风险。

#### 3、利率风险

金融市场利率的变化直接影响着债券的价格和收益率，也会影响企业的融资成本和利润，进而影响基金持仓证券的收益水平。

#### 4、收益率曲线风险

不同信用水平货币市场投资品种应具有不同短期收益率曲线结构，若收益率曲线没有如预期变化导致基金投资决策出现偏差将影响基金的收益水平。

#### 5、购买力风险

基金收益的一部分将通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀的影响而使购买力下降，从而使基金的实际投资收益下降。

#### 6、国际竞争风险

随着中国市场开放程度的提高，上市公司的发展必然要受到国际市场同类技术或同类产品公司的强有力竞争，部分上市公司有可能不能适用新的行业形势而业绩下滑,存在不确定性。

#### 7、上市公司经营风险

上市公司的经营状况受多种因素的影响，如管理能力、行业竞争、市场前景、技术更新、财务状况、新产品研究开发等都会导致公司盈利发生变化。如果基金所投资的上市公司经营不善，其股票价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，

使基金投资收益下降。上市公司还可能出现难以预见的变化。虽然基金可以通过投资多样化来分散这种非系统风险，但不能完全避免。

## （二）信用风险

基金交易对手方发生交易违约或者基金持仓债券的发行人拒绝支付债券本息，导致基金财产损失。

## （三）管理风险

1、在基金管理运作过程中，基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等会影响其对信息的占有以及对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平。

2、基金管理人的管理手段和管理技术等因素的变化也会影响基金收益水平。

## （四）流动性风险

本基金运作方式为契约型开放式，基金规模将随着基金投资者对基金份额的申购和赎回而不断波动，若由于基金投资者的连续大量赎回，导致基金管理人的现金支付出现困难，或被迫在不适当的价格大量抛售证券，使基金资产净值受到不利影响，从而产生流动性风险。

本基金主要的流动性风险管理方法说明：

### 1、本基金的申购、赎回安排

本基金的申购、赎回安排详见招募说明书“第八部分 基金份额的封闭期与开放期”和“第九部分 基金份额的申购与赎回”。

### 2、拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

债券市场流动性风险是指通过该市场来出售与购买债券方面存在的困难而对投资者所形成的风险。因银行间债券市场具有交易频繁、交易金额较大、交易链条较长的特点、若个别机构因流动性不足、则有可能造成后续交易链条中的其他机构收到牵连，将会对市场的稳定性造成影响。

### 3、巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

在本基金出现巨额赎回情形下，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或延缓支付赎回款项。同时，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工作日基金总份额的 10%，基金管理人应当先行对该单个基金份额持有人超出 10%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 10%以内（含 10%）的赎回申请与当日其他投资者的赎回申请按全额赎回或延缓支付赎回款项条款处理。

#### 4、实施备用流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响

本基金可能实施备用的流动性风险管理工具，以更好地应对流动性风险。基金管理人经与基金托管人协商，在确保投资者得到公平对待的前提下，可依照法律法规及基金合同的约定，综合运用各类流动性风险管理工具，对赎回申请等进行适度调整，作为特定情形下基金管理人流动性风险管理的辅助措施，包括但不限于：（1）延期办理巨额赎回申请；（2）暂停接受赎回申请；（3）延缓支付赎回款项；（4）收取短期赎回费，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；（5）暂停基金估值，当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商一致，本基金将暂停基金估值；（6）摆动定价。

当基金管理人实施流动性风险管理工具时，可能对投资者产生一定的潜在影响，包括但不限于不能申购本基金、赎回申请不能确认或者赎回款项延迟到账、如持有期限少于 7 日会产生较高的赎回费造成收益损失等。提示投资者了解自身的流动性偏好、合理做好投资安排。

### （五）本基金特有风险

#### 1、资产配置风险

本基金为灵活配置的混合型基金，投资方面侧重大类资产的配置。由于市场环境、公司治理、制度建设、投资能力等因素的不同影响，可能导致本基金资产配置比例偏离最优水平，给基金投资组合绩效带来风险。

#### 2、股指期货等金融衍生品的投资风险

金融衍生品是一种金融合约，其价值取决于一种或多种基础资产或指数，其评价主要源自对挂钩资产的价格与价格波动的预期。投资于衍生品需承受市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险和法律风险等。由于衍生品通常具有杠杆效应，价格波动比标的工具更为剧烈，有时候要承担比投资标的资产更高的风险。并且由于衍生品定价相当复杂，不适当的估值有可能使基金资产面临损失风险。

股指期货采用保证金交易制度，由于保证金交易具有杠杆性，当出现不利行情时，股价指数微小的变动就可能会使投资者权益遭受较大损失。同时，股指期货采

用每日无负债结算制度，如果没有在规定的时间内补足保证金，按规定将被强制平仓，从而增加本基金总体风险水平。

### 3、投资于流通受限证券的风险

本基金投资范围包括流通受限证券，由于流通受限证券具有锁定期，存在潜在的流动性风险。因此可能在本基金需要变现资产时，受流动性所限，本基金无法卖出所持有的流通受限证券，由此可能给基金净值带来不利影响或损失。

### 4、定期开放方式运作的风险

在本基金的封闭运作期间，基金份额持有人不能赎回基金份额，因此，若基金份额持有人错过某一开放期而未能赎回，其份额将转入下一封闭期，至少至下一开放期方可赎回。

本基金开放期内单个开放日出现巨额赎回的，基金管理人对符合法律法规及《基金合同》约定的赎回申请应于当日全部予以办理和确认。基金经理会对可能出现的巨额赎回情况进行充分准备并做好流动性管理，但当基金在单个开放日出现巨额赎回被全部确认时，赎回的基金份额持有人仍有可能存在延缓支付赎回款项的风险，未赎回的基金份额持有人仍有可能承担短期内变现而带来的冲击成本对基金净资产产生的负面影响。

## （六）其他风险

- 1、因技术因素而产生的风险，如电脑系统不可靠产生的风险；
- 2、因基金业务快速发展而在制度建设、人员配备、内控制度建立等方面不完善而产生的风险；
- 3、因人为因素而产生的风险，如内幕交易、欺诈等行为产生的风险；
- 4、对主要业务人员如基金经理的依赖而可能产生的风险；
- 5、因业务竞争压力可能产生的风险；
- 6、其他风险。

## 十九、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### （一）《基金合同》的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，并自决议生效后两日内在指定媒介公告。

### （二）《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，在履行相关程序后，《基金合同》应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- 3、《基金合同》约定的其他情形；
- 4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### （三）基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有证券、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。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

#### 4、基金财产清算程序：

- （1）《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；
- （2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- （3）对基金财产进行估值和变现；

(4) 制作清算报告；

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

(6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；

(7) 对基金剩余财产进行分配。

5、基金财产清算的期限为 6 个月。

(四) 清算费用

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

(五) 基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

(六) 基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

(七) 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 二十、基金合同的内容摘要

### （一）基金合同当事人及权利义务

#### 1、基金管理人

##### （1）基金管理人简况

名称：信达澳银基金管理有限公司

住所：广东省深圳市南山区科苑南路（深圳湾段）3331号阿里巴巴大厦N1座第8层和第9层

法定代表人：于建伟

设立日期：2006年6月5日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2006]071号

组织形式：有限责任公司

注册资本：壹亿元人民币

存续期限：持续经营

联系电话：0755-83172666

##### （2）基金管理人的权利与义务

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

- 1) 依法募集资金；
- 2) 自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
- 3) 依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- 4) 销售基金份额；
- 5) 按照规定召集基金份额持有人大会；
- 6) 依据《基金合同》及有关法律法规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律法规规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- 7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

- 8) 选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；
- 9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；
- 10) 依据《基金合同》及有关法律的规定决定基金收益的分配方案；
- 11) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；
- 12) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- 13) 以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- 14) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商、期货经纪机构或其他为基金提供服务的外部机构；
- 15) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、转托管和非交易过户等业务规则；
- 16) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

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



基金份额申购、赎回的价格；

9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

10) 编制季度报告、中期报告和年度报告；

11) 严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

12) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；

13) 按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；

14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

15) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上；

17) 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件；

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

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

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

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

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

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

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

25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议;

26) 建立并保存基金份额持有人名册;

27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## 2、基金托管人

### (1) 基金托管人简况

名称: 交通银行股份有限公司(简称: 交通银行)

住所: 上海市浦东新区银城中路 188 号(邮政编码: 200120)

法定代表人: 牛锡明

成立时间: 1987 年 03 月 30 日

批准设立机关和批准设立文号: 国务院国发(1986)字第 81 号文和中国人民银行银发[1987] 40 号文

组织形式: 股份有限公司

注册资本: 柒佰肆拾贰亿陆仟贰佰万元人民币

存续期间: 持续经营

基金托管资格批文及文号: 中国证监会证监基字[1998]25 号

### (2) 基金托管人的权利与义务

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

1) 自《基金合同》生效之日起, 依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产;

2) 依《基金合同》约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用;

3) 监督基金管理人对本基金的投资运作, 如发现基金管理人违反《基金合同》及国家法律法规行为, 对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形,

应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

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

5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：

1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

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

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

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

5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户等投资所需账户，按照《基金合同》及《托管协议》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》、《托管协议》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露，因向审计、法律等外部专业顾问提供的情况除外；

8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购、赎回价格；

9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

10) 对基金财务会计报告、季度报告、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》及《托管协议》的规定

进行；如果基金管理人未执行《基金合同》及《托管协议》规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；

12) 从基金管理人或其委托的登记机构处接收并保存基金份额持有人名册；

13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

14) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；

15) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

16) 按照法律法规和《基金合同》及《托管协议》的规定监督基金管理人的投资运作；

17) 参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

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

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

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

21) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

### 3、基金份额持有人

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

同一类别每份基金份额具有同等的合法权益。

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但

不限于：

- (1) 分享基金财产收益；
- (2) 参与分配清算后的剩余基金财产；
- (3) 在开放期内根据基金合同的约定，依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；
- (4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会或者按规定召集基金份额持有人大会；
- (5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- (6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- (7) 监督基金管理人的投资运作；
- (8) 对基金管理人、基金托管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

- (1) 认真阅读并遵守《基金合同》、《招募说明书》等信息披露文件；
- (2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；
- (3) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；
- (4) 缴纳基金认购、申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；
- (5) 在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；
- (6) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；
- (7) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- (8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

4、本基金合同当事各方的权利义务以本基金合同为依据，不因基金账户名称而有所改变。

## （二）基金份额持有人大会

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的同一类别每一基金份额拥有平等的投票权。。

本基金份额持有人大会不设日常机构。

### 1、召开事由

（1）除法律法规、中国证监会另有规定外，当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

- 1) 终止《基金合同》；
- 2) 更换基金管理人；
- 3) 更换基金托管人；
- 4) 转换基金运作方式（不包括本基金开放期与封闭期运作方式的转换）；
- 5) 调整基金管理人、基金托管人的报酬标准或提高销售服务费；
- 6) 变更基金类别；
- 7) 本基金与其他基金的合并；
- 8) 变更基金投资目标、范围或策略；
- 9) 变更基金份额持有人大会程序；
- 10) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；

11) 单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；

12) 对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

13) 法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

（2）在不违反法律法规和基金合同约定且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

1) 法律法规要求增加的基金费用的收取；

2) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率、调低销售服务费、变更收费方式、或增加、减少、调整基金份额类别设置、

基金份额分类办法及规则；

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》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生重大变化；

5) 在不违反法律法规和基金合同约定且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人、登记机构、基金销售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；

6) 按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

## 2、会议召集人及召集方式

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

(2) 基金管理人未按规定召集或不能召开时，由基金托管人召集。

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

(4) 代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

(5) 代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项要求召

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

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

### 3、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

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

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

（3）如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。

### 4、基金份额持有人出席会议的方式

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



金管理人、基金托管人须为基金份额持有人行使投票权提供便利。

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

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

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

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

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

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

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

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

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

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

(4) 在会议召开方式上，本基金亦可采用其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开基金份额持有人大会，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。

## 5、议事内容与程序

### (1) 议事内容及提案权

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

2) 基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日本基金总份额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就召开事由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：

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。

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) 单独或合并持有权益登记日基金总份额 10%以上（含 10%）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，基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于 6 个月。法律法规另有规定的除外。

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

6) 基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

## (2) 议事程序

### 1) 现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第 7 条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

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

### 2) 通讯开会

在通讯开会的情况下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截

止日期后 2 个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

## 6、表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

(1) 一般决议，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过方为有效；除下列第（2）项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

(2) 特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。除法律法规、监管部门另有规定、基金合同另有约定外，转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》、与其他基金合并以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

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

## 7、计票

### (1) 现场开会

1) 如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

若监督员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。

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

3) 如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有怀疑，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

4) 计票过程应由公证机关予以公证,基金管理人或基金托管人拒不出席大会的，不影响计票的效力。

## (2) 通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

若监督员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。

## 8、生效与公告

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

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 日内在指定媒介上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决议。生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。

9、本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人经与基金托管人协商一致并提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

### （三）基金的收益与分配

#### 1、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。

#### 2、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。

#### 3、基金收益分配原则

（1）本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

（2）基金收益分配后各类基金份额净值均不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值。

（3）本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权，由于本基金各类基金份额收取费用情况不同，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同；

（4）法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

#### 4、收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。由于不同基金份额类别对应的可分配收益不同，基金管理人可相应制定不同的收益分配方案。

#### 5、收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，在 2 日内在指定媒介公告。

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、基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资

者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为相应类别的基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。

#### （四）基金的费用与税收

##### 1、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）除法律法规、中国证监会另有规定外，《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；

（4）《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；

（5）基金份额持有人大会费用；

（6）基金的证券、期货交易费用；

（7）基金的银行汇划费用；

（8）基金的开户费用、账户维护费用；

（9）按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

##### 2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

###### （1）基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.6% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

###### （2）基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.1% 的年费率计提。托管费的计算方

法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

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。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

### （3）基金的销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.20%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务。

销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.20% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，按月支付。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

上述“上述“一、基金费用的种类中第 4—10 项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人根据基金管理人指令并参照行业惯例从基金财产中支付。

### 3、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

（1）基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；

（2）基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

（3）《基金合同》生效前的相关费用；

（4）其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

### 4、基金税收



本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。基金财产投资的相关税收，由基金份额持有人承担。

## （五）基金的投资

### 1、投资目标

本基金在有效控制风险的前提下，运用多种投资策略，追求超越业绩比较基准的投资回报。

### 2、投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票等）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券或票据）、债券回购、现金、货币市场工具、权证、股指期货、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：

封闭期内，股票资产占基金资产的比例为 0%—100%；开放期内，股票资产占基金资产的比例为 0%—95%。开放期内，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；封闭期内，本基金不受上述 5%的限制，但每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

### 3、投资策略

本基金投资策略主要包括资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、权证投资策略、股指期货投资策略、资产支持证券投资策略。

#### （1）资产配置策略

本基金采取“自上而下”的方式进行大类资产配置，根据对宏观经济、市场面、政策面等因素进行定量与定性相结合的分析研究，确定组合中股票、债券、货币市

场工具及其他金融工具的比例。本基金主要考虑的因素为：

1) 宏观经济指标：包括 GDP 增长率、工业增加值、居民消费价格指数(CPI)、生产者价格指数(PPI)、采购经理人指数 (PMI)、市场利率、货币供应量(M0, M1, M2)的增长率等指标。

2) 市场因素：包括股票及债券市场的涨跌及预期收益率、市场整体估值水平及与国外市场的比较、市场资金供求关系及其变化。

3) 政策因素：包括货币政策、财政政策、资本市场相关政策和行业政策扶持等。

通过对以上各种因素的分析，结合全球宏观经济形势，研判国内经济的发展趋势，并在严格控制投资组合风险的前提下，确定或调整投资组合中大类资产的比例。

## (2) 股票投资策略

本基金通过积极主动的投资管理为投资人创造价值，秉承自下而上的投资分析方法，对企业及其发展环境的深入分析，寻求具有长期竞争力的成长型企业和他们被市场低估时产生的投资机会，通过投资具有持续盈利增长能力和长期投资价值的优质企业为投资人实现股票资产的持续增值。

运用“信达澳银公司价值分析体系 (QGV, Quality, Growth & Valuation)”，从公司素质、盈利增长和估值三个方面对公司进行严格的综合评估，以深度挖掘能够持续保持盈利增长的成长型公司。

运用“信达澳银行业优势分析体系(ITC, Industrial Trends & Competitiveness)”，从行业长期发展的维度对比分析行业内的公司，从行业层面对公司做出筛选，挑选行业内竞争力强、符合行业发展趋势的优秀公司。

运用“信达澳银宏观景气分析体系(MDE, Macro Drivers & Environment)”，考察宏观经济增长的行业驱动力，行业的景气变化、宏观景气变动对不同行业及相关公司的潜在影响，以及宏观经济政策对相关行业的影响，进而判断行业的发展趋势、景气周期、盈利能力、成长性、相对投资价值的变化，选择未来一段时间内持续增长能力突出的行业并调整对相关公司的价值判断，最终完成对行业配置的适度调控。

相关公司根据满足“信达澳银公司价值分析体系 (QGV)”和“信达澳银行业优势分析体系(ITC)”的不同程度，以及投资团队对该公司的研究深度，分别被确定为“核心品种”、“重点品种”和“观察性品种”3个层级并不断循环论证，在此基础上基金经理根据自身判断，结合“信达澳银宏观景气分析体系(MDE)”提出的

行业投资建议，构建基金的股票投资组合。

### （3）债券投资策略

本基金的债券投资将坚持价值投资理念，通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势以及不同类属的收益率水平、流动性和信用风险等因素，以久期控制和结构分布策略为主，以收益率曲线策略、利差策略等为辅，构造能够提供稳定收益的债券和货币市场工具组合。

### （4）权证投资策略

本基金将权证作为有效控制基金投资组合风险、提高投资组合收益的辅助工具。本基金在投资权证时，将根据权证对应公司基本面研究成果确定权证的合理估值，发现市场对股票权证的非理性定价，谨慎进行投资，追求较为稳健的当期收益。

### （5）股指期货投资策略

本基金在股指期货的投资中主要遵循避险和有效管理两项策略和原则。即在市场风险大幅累计时的避险操作，减小基金投资组合因市场下跌而遭受的市场风险；同时利用股指期货流动性好、交易成本低等特点，通过股指期货对投资组合的仓位进行及时调整，提高投资组合的运作效率。

### （6）资产支持证券投资策略

本基金将在宏观经济和基本面分析的基础上，对资产证券化产品的质量和构成、利率风险、信用风险、流动性风险和提前偿付风险等进行定性和定量的全方面分析，评估其相对投资价值并作出相应的投资决策，力求在控制投资风险的前提下尽可能的提高本基金的收益。

## 4、投资限制

### （1）组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

1) 封闭期内，股票资产占基金资产的比例为 0%—100%；开放期内，股票资产占基金资产的比例为 0%—95%；

2) 开放期内，本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；封闭期内，本基金不受上述 5%的限制，但每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；其中现金不包括结

算备付金、存出保证金、应收申购款等；

3) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；

4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；

5) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

6) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

7) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；

8) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；

9) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

10) 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；

11) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

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

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

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

(15) 开放期内，本基金与本基金管理人管理的其他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%；开放期内，本基金与本基金管理人管理的其他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%；

(16) 开放期内，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%；

因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

17) 在封闭期内，本基金总资产不得超过基金净资产的 200%；在开放期内，本基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

18) 本基金投资流通受限证券，基金管理人应事先根据中国证监会相关规定，与基金托管人在基金托管协议中明确基金投资流通受限证券的比例，根据比例进行投资。基金管理人应制定严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险；

19) 本基金参与股指期货交易，则需遵守下列投资比例限制：

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

b、开放期内的每个交易日日终，本基金持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；封闭期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

c、本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；

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

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

20) 开放期内，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本基金合同约定的投资范围保持一致；

21) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

本基金在开始进行股指期货投资之前，应与基金托管人、期货公司三方一同就股指期货开户、清算、估值、交收等事宜另行签署协议。

除上述第 2)、12)、16)、21) 项外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、

基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 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，法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。期间，本基金的投资范围、投资策略应当符合本基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

如果法律法规或监管部门对上述投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。

法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

法律法规或监管部门对上述组合限制政策作出强制性调整的，本基金应当按照法律法规或监管部门的规定执行；如法律法规或监管部门对上述组合限制政策的调整或修改对本基金的效力并非强制性的，则基金管理人与基金托管人协商一致后，可按照法律法规或监管部门调整或修改后的组合限制政策执行，而无需基金份额持有人大会审议决定，但基金管理人在执行法律法规或监管部门调整或修改后的组合限制政策前，应向投资者履行信息披露义务并向监管机关报告或备案。

## （2）禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- 1) 承销证券；
- 2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- 3) 从事承担无限责任的投资；
- 4) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- 5) 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；
- 6) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

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的，应当符合本基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事

通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按变更后的规定执行。

## 5、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50%

(1) 沪深 300 指数是中证指数公司依据国际指数编制标准并结合中国市场的实际情况编制的沪深两市统一指数，科学地反映了我国证券市场的整体业绩表现，具有一定的权威性和市场代表性，业内也普遍采用。因此，沪深 300 指数是衡量本基金股票投资业绩的理想基准。

(2) 上证国债指数由上交所编制，具有较长的编制和发布历史，以及较高的知名度和市场影响力，适合作为本基金债券投资部分的基准。

如果业绩比较基准中所使用的指数停止发布或变更名称，或者今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，经与基金托管人协商一致，本基金可在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告，不需要召开基金份额持有人大会。

## 6、风险收益特征

本基金为混合型基金，属于证券投资基金中预期风险与预期收益中等的投资品种，其风险收益水平高于货币基金和债券型基金，低于股票型基金。

## 7、基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

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

(2) 不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；

(3) 有利于基金财产的安全与增值；

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

## (六) 基金资产净值的计算方法和公告方式

### 1、估值日

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

### 2、估值对象

基金所拥有的股票、权证、债券、衍生工具和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

### 3、估值方法

#### (1) 证券交易所上市的权益类证券的估值

交易所上市的权益类证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

#### (2) 交易所市场交易的固定收益品种的估值

1) 对在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（另有规定的除外），选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；

2) 对在交易所市场上市交易的可转换债券，按估值日收盘价减去可转换债券收盘价中所含债券应收利息后得到的净价进行估值；

3) 对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募债券，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，按成本估值；

4) 对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的固定收益品种，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

#### (3) 银行间市场交易的固定收益品种的估值

1) 银行间市场交易的固定收益品种，选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；

2) 对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的固定收益品种，按成本估值。

#### (4) 处于未上市期间的权益类证券应区分如下情况处理：

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

2) 首次公开发行未上市的股票和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；



3) 在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

(5) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

(6) 股指期货合约的估值：

本基金投资股指期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

(7) 其他资产的估值方法

其他资产按国家有关规定进行估值。

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

(9) 相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

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。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反《基金合同》订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对于基金净值的计算结果对外予以公布，由此给基金份额持有人和基金造成的损失以及因该交易日基金净值计算顺延错误而引起的损失，由基金管理人负责赔付，由此给基金份额持有人和基金造成的损失以及因该交易日基金净值计算顺延错误而引起的损失，基金托管人不负责赔付。

#### 4、估值程序

(1) 基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份

额的余额数量计算，精确到 0.0001 元，小数点后第五位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

每个工作日计算基金资产净值及各类基金份额净值，并按规定公告。

(2) 基金管理人应每个工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或本基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将各类基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

## 5、估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当任一类基金份额净值小数点后 4 位以内(含第 4 位)发生估值错误时，视为该类基金份额净值错误。本基金合同的当事人应按照以下约定处理：

### (1) 估值错误类型

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

上述估值错误的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等。对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平不能预见、不能避免、不能克服，则属不可抗力。由于不可抗力原因造成投资人的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

### (2) 估值错误处理原则

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

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

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

4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

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

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

7) 按法律法规规定的其他原则处理差错。

### (3) 估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

4) 根据估值错误处理的方法，需要修改基金登记机构交易数据的，由基金登

记机构进行更正，并就估值错误的更正向有关当事人进行确认。

(4) 基金份额净值估值错误处理的方法如下：

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

2) 错误偏差达到该类基金份额净值的 0.25%时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到该类基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告。3) 因基金估值错误，给基金或基金份额持有人造成损失的，应由基金管理人先行赔付，基金管理人按差错情形，有权向其他当事人追偿。

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

5) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

#### 6、暂停估值的情形

(1) 基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

(2) 因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

(3) 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) 中国证监会和基金合同认定的其它情形。

#### 7、基金净值的确认

基金资产净值和各类基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金资产净值和各类基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金净值予以公布。

#### 8、特殊情况的处理

(1) 基金管理人或基金托管人按估值方法第(8)项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

(2) 由于不可抗力原因，或由于证券、期货交易所及登记结算公司发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等，基金管理人和基金托管人虽然已

经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

#### （七）《基金合同》的变更、终止与基金财产的清算

##### 1、《基金合同》的变更

（1）变更基金合同涉及法律法规规定或本合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

（2）关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，并自决议生效后两日内在指定媒介公告。

##### 2、《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，在履行相关程序后，《基金合同》应当终止：

（1）基金份额持有人大会决定终止的；

（2）基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；

（3）《基金合同》约定的其他情形；

（4）相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

##### 3、基金财产的清算

（1）基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

（2）基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有证券、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。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

（4）基金财产清算程序：

1）《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；

- 2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认;
- 3) 对基金财产进行估值和变现;
- 4) 制作清算报告;
- 5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计, 聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书;
- 6) 将清算报告报中国证监会备案并公告;
- 7) 对基金剩余财产进行分配。

(5) 基金财产清算的期限为 6 个月。

#### 4、清算费用

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

#### 5、基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案, 将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后, 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

#### 6、基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告; 基金财产清算报告经具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

#### 7、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

#### (八) 争议的处理和适用的法律

各方当事人同意, 因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议, 如经友好协商未能解决的, 任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会, 按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为上海市。仲裁裁决是终局的, 对各方当事人均有约束力, 仲裁费用和律师费均由败诉方承担。

争议处理期间, 《基金合同》各方当事人应恪守职责, 继续忠实、勤勉、尽责

地履行《基金合同》规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

《基金合同》受中国法律管辖。

(九)《基金合同》存放地和投资者取得《基金合同》的方式

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

## 二十一、基金托管协议的内容摘要

### （一）基金托管协议当事人

#### 1、基金管理人

名称：信达澳银基金管理有限公司

住所：广东省深圳市南山区科苑南路（深圳湾段）3331号阿里巴巴大厦N1座第8层和第9层

办公地址：广东省深圳市南山区科苑南路（深圳湾段）3331号阿里巴巴大厦T1座第8层和第9层

邮政编码：518054

法定代表人：于建伟

成立时间：2006年6月5日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：证监基金字[2006]071号

经营范围：基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务

注册资本：壹亿元人民币

组织形式：有限责任公司

存续期间：持续经营

#### 2、基金托管人

名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）

住所：上海市浦东新区银城中路188号（邮政编码：200120）

办公地址：上海市浦东新区银城中路188号（邮政编码：200120）

法定代表人：牛锡明

成立时间：1987年3月30日

批准设立机关及批准设立文号：国务院国发(1986)字第81号文和中国人民银



行银发〔1987〕40号文

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字〔1998〕25号

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；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；代理收付款项业务；提供保管箱服务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务；经营结汇、售汇业务。

注册资本：柒佰肆拾贰亿陆仟贰佰万元人民币

组织形式：股份有限公司

存续期间：持续经营

## （二）基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

### 1、基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权

（1）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》和本协议的约定，对基金的投资范围、投资对象进行监督。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票等）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券或票据）、债券回购、现金、货币市场工具、权证、股指期货、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：

封闭期内，股票资产占基金资产的比例为0%—100%；开放期内，股票资产占基金资产的比例为0%—95%。开放期内，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%；封闭期内，本基金不受上述5%的限制，但每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；

其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

基金托管人对基金管理人业务进行监督和核查的义务自基金合同生效日起开始履行。

(2) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》和本协议的约定，对基金投资比例进行监督。

根据《基金合同》的约定，本基金投资组合比例应符合以下规定：

1) 封闭期内，股票资产占基金资产的比例为 0%—100%；开放期内，股票资产占基金资产的比例为 0%—95%；

2) 开放期内，本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；封闭期内，本基金不受上述 5%的限制，但每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

3) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；

4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；

5) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

6) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

7) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；

8) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；

9) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

10) 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；

11) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证

券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

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

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

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

15) 开放期内，本基金与本基金管理人管理的其他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%；开放期内，本基金与本基金管理人管理的其他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%；

16) 开放期内，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%；

因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

17) 在封闭期内，本基金总资产不得超过基金净资产的 200%；在开放期内，本基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

18) 本基金持有的所有流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的 15%；本基金持有的同一流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的 5%；

19) 本基金参与股指期货交易，则需遵守下列投资比例限制：

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

② 开放期内的每个交易日日终，本基金持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；封闭期内的每个交易日日终，持有的买入

期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

③本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；

④本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；

⑤本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关规定；

20) 开放期内，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本基金合同约定的投资范围保持一致；

21) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

本基金在进行股指期货投资之前，应与基金托管人、期货公司三方一同就股指期货开户、清算、估值、交收等事宜另行签署协议。

法律法规或监管部门对上述组合限制政策作出强制性调整的，本基金应当按照法律法规或监管部门的规定执行；如法律法规或监管部门对上述组合限制政策的调整或修改对本基金的效力并非强制性的，则基金管理人与基金托管人协商一致后，可按照法律法规或监管部门调整或修改后的组合限制政策执行，而无需基金份额持有人大会审议决定，但基金管理人在执行法律法规或监管部门调整或修改后的组合限制政策前，应向投资者履行信息披露义务并向监管机关报告或备案。

如果法律法规或监管部门对上述投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制规定时，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

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，法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。期间，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

除上述第 2)、12)、16)、20) 项外, 因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例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, 但中国证监会规定的特殊情形除外。基金托管人依照上述规定对本基金的投资组合限制及调整期限进行监督。

(3) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同和本协议的约定, 对基金投资禁止行为进行监督。基金财产不得用于下列投资或者活动。

- 1) 承销证券;
- 2) 违反规定向他人贷款或者提供担保;
- 3) 从事承担无限责任的投资;
- 4) 向本基金的基金管理人、基金托管人出资;
- 5) 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;
- 6) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

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的, 应当符合本基金的投资目标和投资策略, 遵循基金份额持有人利益优先原则, 防范利益冲突, 建立健全内部审批机制和评估机制, 按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人同意, 并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议, 并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

如法律法规或监管部门取消或变更上述禁止性规定, 如适用于本基金, 基金管理人在履行适当程序后, 则本基金可不受上述规定的限制或按变更后的规定执行。

(4) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同和本协议的约定, 对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。

1) 基金托管人依据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定对于基金管理人参与银行间市场交易时面临的交易对手资信风险进行监督。

基金管理人向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的银行间市场交易对手的名单。基金托管人在收到名单后 2 个工作日内电话或回函确认收到该名单。基

金管理人应定期和不定期对银行间市场现券及回购交易对手的名单进行更新。基金托管人在收到名单后2个工作日内电话或书面回函确认，新名单自基金托管人确认当日生效。新名单生效前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。

2) 基金管理人参与银行间市场交易时，有责任控制交易对手的资信风险，由于交易对手资信风险引起的损失，基金管理人应当负责向相关责任人追偿。

(5) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同和本协议的约定，对基金管理人选择存款银行进行监督。

基金投资银行定期存款的，基金管理人应根据法律法规的规定及基金合同的约定，确定符合条件的所有存款银行的名单，并及时提供给基金托管人，基金托管人应据以对基金投资银行存款的交易对手是否符合有关规定进行监督。

本基金投资银行存款应符合如下规定：

1) 基金管理人、基金托管人应当与存款银行建立定期对账机制，确保基金银行存款业务账目及核算的真实、准确。

2) 基金管理人与基金托管人应根据相关规定，就本基金银行存款业务另行签订书面协议，明确双方在相关协议签署、账户开设与管理、投资指令传达与执行、资金划拨、账目核对、到期兑付、文件保管以及存款证实书的开立、传递、保管等流程中的权利、义务和职责，以确保基金财产的安全，保护基金份额持有人的合法权益。

3) 基金托管人应加强对基金银行存款业务的监督与核查，严格审查、复核相关协议、账户资料、投资指令、存款证实书等有关文件，切实履行托管职责。

4) 基金管理人与基金托管人在开展基金存款业务时，应严格遵守《基金法》、《运作办法》等有关法律法规，以及国家有关账户管理、利率管理、支付结算等的各项规定。

(6) 基金托管人对基金投资流通受限证券的监督

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

2) 流通受限证券，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行

股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。

3) 基金管理人应在基金首次投资流通受限证券前，向基金托管人提供经基金管理人董事会批准的有关基金投资流通受限证券的投资决策流程、风险控制制度。基金投资非公开发行股票，基金管理人还应提供基金管理人董事会批准的流动性风险处置预案。上述资料应包括但不限于基金投资流通受限证券的投资额度和投资比例控制情况。基金管理人应至少于首次执行投资指令之前两个工作日将上述资料书面发至基金托管人，保证基金托管人有足够的时间进行审核。基金托管人应在收到上述资料后两个工作日内，以书面或其他双方认可的方式确认收到上述资料。

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

5) 基金托管人应对基金管理人提供的有关书面信息进行审核，基金托管人认为上述资料可能导致基金投资出现风险的，有权要求基金管理人在投资流通受限证券前就该风险的消除或防范措施进行补充书面说明，并保留查看基金管理人风险管理部门就基金投资流通受限证券出具的风险评估报告等备查资料的权利。否则，基金托管人有权拒绝执行有关指令。因拒绝执行该指令造成基金财产损失的，基金托管人不承担任何责任，并有权报告中国证监会。

如基金管理人和基金托管人无法达成一致，应及时上报中国证监会请求解决。如果基金托管人切实履行监督职责，则不承担任何责任。

(7) 基金托管人根据法律法规的规定及《基金合同》和本协议的约定，对基金投资其他方面进行监督。

2、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认、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核

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

3、基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查，在规定时间内答复并改正，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。

基金托管人发现基金管理人的投资指令或实际投资运作违反《基金法》及其他有关法规、《基金合同》和本协议规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对，并以电话或书面形式向基金托管人反馈，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人有权报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人在限期内纠正。

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

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

### （三）基金管理人对于基金托管人的业务核查

根据《基金法》及其他有关法规、《基金合同》和本协议规定，基金管理人对于基金托管人履行托管职责的情况进行核查，核查事项包括但不限于基金托管人是否安全保管基金财产、开立基金财产的资金账户、期货账户和证券账户及债券托管账户等投资所需账户，是否及时、准确复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值，是否根据基金管理人指令办理清算交收，是否按照法规规定和《基金合同》规定进行相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

基金管理人定期和不定期地对基金托管人保管的基金资产进行核查。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，在规定时间内答复并改正。

基金管理人发现基金托管人未对基金资产实行分账管理、擅自挪用基金资产、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、《基金合同》、本协议及其他有关规定的，应及时以书面形式通知基金托管人在限期内纠正，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。对基金管理人按照法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的，基金托管人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金托管人在限期内纠正。

#### （四）基金财产的保管

##### 1、基金财产保管的原则

（1）基金托管人应安全保管基金财产，未经基金管理人的指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何资产。

（2）基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。

（3）基金托管人按照规定开立基金财产的资金账户、证券账户、期货账户和债券托管等投资所需账户。

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

（5）对于因为基金投资产生的应收资产和基金申购过程中产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金资产没有到达基金银行存款账户的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失。基金托管人对此不承担任何责任。

##### 2、基金募集资产的验证

基金募集期满或基金提前结束募集之日起 10 日内，募集的基金份额总额、基

金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，由基金管理人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，出具的验资报告应由参加验资的 2 名以上（含 2 名）中国注册会计师签字有效。验资完成，基金管理人应将募集到的全部资金存入基金托管人为基金开立的基金银行存款账户中，基金托管人在收到资金当日出具相关证明文件。

### 3、基金的银行存款账户的开立和管理

(1) 基金托管人应负责本基金银行存款账户的开立和管理。

(2) 基金托管人以本基金的名义在其营业机构开立基金的银行存款账户，并根据中国人民银行规定计息。本基金的银行预留印鉴由基金托管人制作、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，均需通过本基金的银行存款账户进行。

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

(4) 基金托管人可以通过申请开通本基金银行账户的企业网上银行业务进行资金支付，并使用交通银行企业网上银行（简称“交通银行网银”）办理托管资产的资金结算汇划业务。

(5) 基金银行存款账户的管理应符合《中华人民共和国票据法》、《人民币银行结算账户管理办法》、《现金管理暂行条例实施细则》、《人民币利率管理规定》、《支付结算办法》以及银行业监督管理机构的其他规定。

### 3、基金证券交收账户、资金交收账户和期货账户的开立和管理

基金托管人以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司开立证券账户。

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

基金管理人不得对基金证券交收账户、资金交收账户进行证券的超卖或超买。

基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算

备付金账户即资金交收账户，用于证券交易资金的结算。基金托管人以本基金的名义在基金托管人处开立基金的证券交易资金结算的二级结算备付金账户。

基金托管人与基金管理人应依据相关期货交易所或期货公司的相关规定开立和管理期货账户。

#### 4、债券托管账户的开立和管理

(1) 基金合同生效后，基金托管人负责向中国人民银行进行报备，并在备案通过后在中央国债登记结算有限责任公司和银行间市场清算所股份有限公司以本基金的名义开立债券托管账户，并由基金托管人负责基金的债券及资金的清算。基金管理人负责申请基金进入全国银行间同业拆借市场进行交易，由基金管理人在中国外汇交易中心开设同业拆借市场交易账户。

(2) 基金管理人代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议，协议正本由基金管理人保存。

#### 6、其他账户的开立和管理

若中国证监会或其他监管机构在本托管协议订立日之后允许基金从事其他投资品种的投资业务，涉及相关账户的开立、使用的，由基金管理人协助基金托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定，开立有关账户。该账户按有关规则使用并管理。

#### 7、基金财产投资的有关实物证券、银行存款定期存单等有价凭证的保管

实物证券由基金托管人存放于基金托管人的保管库。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。基金托管人对由基金托管人以外机构实际有效控制的本基金资产不承担保管责任。

银行存款定期存单等有价凭证由基金托管人负责保管。

#### 8、与基金财产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同的原件分别由基金托管人、基金管理人保管，相关业务程序另有限制除外。除本协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时应尽可能保证持有二份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件，基金管理人应及时将正本送达基金托管人处。合同的保管期限按照国家有关规定执行。

对于无法取得二份以上的正本的，基金管理人应向基金托管人提供加盖公章的合同传真件或复印件，未经双方协商或未在合同约定范围内，合同原件不得转移。

#### （五）基金资产净值计算和会计核算

##### 1、基金资产净值及基金份额净值的计算与复核

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

基金管理人应每工作日对基金资产估值，但基金管理人根据法律法规或基金合同的规定暂停估值时除外。估值原则应符合《基金合同》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》及其他法律、法规的规定。基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金资产净值和基金份额净值，以约定方式发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核后，将复核结果反馈给基金管理人，由基金管理人对外公布。

本基金按以下方法估值：

##### （1）证券交易所上市的权益类证券的估值

交易所上市的权益类证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

##### （2）交易所市场交易的固定收益品种的估值

1) 对在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（另有规定的除外），选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；

2) 对在交易所市场上市交易的可转换债券，按估值日收盘价减去可转换债券收盘价中所含债券应收利息后得到的净价进行估值；

（3）对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募债券，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，按成本估值；

4) 对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的固定收益品种, 采用估值技术确定公允价值, 在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下, 按成本估值;

(3) 银行间市场交易的固定收益品种的估值

1) 银行间市场交易的固定收益品种, 选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值;

2) 对银行间市场未上市, 且第三方估值机构未提供估值价格的固定收益品种, 按成本估值。

(4) 处于未上市期间的权益类证券应区分如下情况处理:

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

2) 首次公开发行未上市的股票和权证, 采用估值技术确定公允价值, 在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下, 按成本估值;

3) 在发行时明确一定期限限售期的股票, 包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等, 不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票, 按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

(5) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的, 按债券所处的市场分别估值。

(6) 股指期货合约的估值:

本基金投资股指期货合约, 一般以估值当日结算价进行估值, 估值当日无结算价的, 且最近交易日后经济环境未发生重大变化的, 采用最近交易日结算价估值。

(7) 其他资产的估值方法

其他资产按国家有关规定进行估值。

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

(9) 相关法律法规以及监管部门有强制规定的, 从其规定。如有新增事项, 按国家最新规定估值。

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。

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，发现方应及时通知对方，以约定的方法、程序和相关法律法规的规定进行估值，以维护基金份额持有人的利益。

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。因此，就与本基金有关的会计问题，本基金的会计责任方是基金管理人。如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，基金管理人有权按照其对基金净值的计算结果对外予以公布。

## 2、净值差错处理

当发生净值计算错误时，由基金管理人负责处理，由此给基金份额持有人和基金造成损失的，由基金管理人就基金先行支付赔偿金。基金管理人和基金托管人应根据实际情况界定双方承担的责任，经确认后按以下条款进行赔偿。

(1)如采用本协议第八章第1条“基金资产净值及基金份额净值的计算与复核”中估值方法的第(1)－(7)、(9)进行处理时，若基金管理人净值计算出错，基金托管人在复核过程中没有发现，且造成基金份额持有人损失的，应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金，就实际向投资者或基金支付的赔偿金额，由基金管理人与基金托管人按照管理费率 and 托管费率的比例各自承担相应的责任；

(2)如基金管理人和基金托管人对基金份额净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对，尚不能达成一致时，为避免不能按时公布基金份额净值的情形，以基金管理人的计算结果对外公布，由此给基金份额持有人和基金造成的损失以及因该交易日基金净值计算顺延错误而引起的损失，由基金管理人负责赔付，基金托管人不负赔偿责任；

(3)基金管理人、基金托管人按估值方法的第(8)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。

由于不可抗力原因，或由于证券、期货交易所及登记结算公司发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必

要、适当、合理的措施进行检查，但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或降低由此造成的影响。

针对净值差错处理，如果法律法规或证监会有新的规定，则按新的规定执行；如果行业有通行做法，在不违背法律法规且不损害投资者利益的前提下，双方应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则重新协商确定处理原则。

### 3、基金会计制度

按国家有关部门制定的会计制度执行。

### 4、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、登录和保管本基金的全套账册，对双方各自的账册定期进行核对，互相监督，以保证基金财产的安全。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。

### 5、会计数据和财务指标的核对

双方应每个交易日核对账目，如发现双方的账目存在不符的，基金管理人和基金托管人必须及时查明原因并纠正，确保核对一致。若当日核对不符，暂时无法查找到错账的原因而影响到基金净值的计算和公告的，以基金管理人的账册为准。

### 6、基金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。定期报告文件应按中国证监会的要求公告。季度报表的编制，应于每季度终了后 15 个工作日内完成；中期报告在基金会计年度前 6 个月结束后的两个月内公告；年度报告在会计年度结束后三个月内公告。

基金管理人在月初 3 个工作日内完成上月度报表的编制，经盖章后，以传真方式将有关报表提供基金托管人；基金托管人收到后在 2 个工作日内进行复核，并将复核结果及时书面通知基金管理人。对于季度报告、中期报告、年度报告等定期报告，基金管理人和基金托管人应在上述监管部门规定的时间内完成编制、复核及公告。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。如果基金管理人与基金托管人不能于应当发布公

告之日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。

基金托管人在对财务报表、季度报告、中期报告或年度报告复核完毕后，可以出具复核确认书（盖章）或以其他双方约定的方式确认，以备有权机构对相关文件审核检查。

#### （六）基金份额持有人名册的保管

基金管理人可委托基金登记机构登记和保管基金份额持有人名册。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、基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册、每年最后一个交易日的基金份额持有人名册，由基金登记机构负责编制和保管，并对基金份额持有人名册的真实性、完整性和准确性负责。

基金管理人应根据基金托管人的要求定期和不定期向基金托管人提供基金份额持有人名册。

1、基金管理人于《基金合同》生效日及《基金合同》终止日后 15 个工作日内向基金托管人提供由登记机构编制的基金份额持有人名册；

2、基金管理人于基金份额持有人大会权益登记日后 5 个工作日内向基金托管人提供由登记机构编制的基金份额持有人名册；

3、基金管理人于每年最后一个交易日后 15 个工作日内向基金托管人提供由登记机构编制的基金份额持有人名册；

4、除上述约定时间外，如果确因业务需要，基金托管人与基金管理人商议一致后，由基金管理人向基金托管人提供由登记机构编制的基金份额持有人名册。

基金托管人以电子版形式妥善保管基金份额持有人名册，并定期刻成光盘备份，保存期限为 15 年，法律法规或监管部门另有规定除外。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。若基金管理人或基金托管人由于自身原因无法妥善保管基金份额持有人名册，应按有关法规规定各自承担相应的责任。

#### （七）争议解决方式



相关各方当事人同意，因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议，应通过友好协商或者调解解决。托管协议当事人不愿通过协商、调解解决或者协商、调解不成的，任何一方当事人均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，根据该会届时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点在上海市，仲裁裁决是终局的，并对相关各方当事人均有约束力。仲裁费用和律师费用由败诉方承担。

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

本协议受中华人民共和国法律管辖。

#### （八）托管协议的变更、终止与基金财产的清算

##### 1、基金托管协议的变更

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行修改。修改后的新协议，其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突。修改后的新协议，应报中国证监会备案。

##### 2、基金托管协议的终止

（1）《基金合同》终止；

（2）基金托管人解散、依法被撤销、破产，被依法取消基金托管资格或因其他事由造成其他基金托管人接管基金财产；

（3）基金管理人解散、依法被撤销、破产，被依法取消基金管理资格或因其他事由造成其他基金管理人接管基金管理权；

（4）发生《基金法》、《销售办法》、《运作办法》或其他法律法规规定的终止事项。

##### 3、基金财产的清算

（1）基金财产清算小组

在基金财产清算小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》和本协议的规定继续履行保护基金资产安全的职责。

1) 基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有证券、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。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

2) 基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

#### (2) 基金财产清算程序

- 1) 《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金财产；
- 2) 基金财产清算小组根据基金财产的情况确定清算期限；
- 3) 基金财产清算小组对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- 4) 对基金财产进行评估和变现；
- 5) 基金财产清算小组做出清算报告；
- 6) 会计师事务所对清算报告进行审计；
- 7) 律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- 8) 将基金清算报告报中国证监会；
- 9) 公布基金清算公告；
- 10) 对基金剩余财产进行分配。

#### (3) 清算费用

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

#### (4) 基金剩余财产的分配

基金财产按如下顺序进行清偿

- 1) 支付基金财产清算费用；
- 2) 缴纳基金所欠税款；
- 3) 清偿基金债务；
- 4) 清算后如有余额，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

#### (5) 基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告。基金财产清算小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。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

(6) 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存期限不少于 15 年。

## 二十二、对基金份额持有人的服务

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

### （一）服务内容

#### 1、基金份额持有人注册登记服务

基金管理人委托登记机构为基金份额持有人提供注册登记服务。基金登记机构配备安全、完善的电脑系统及通讯系统，准确、及时地为基金投资者办理基金账户、基金份额的登记、管理、托管与转托管，股东名册的管理，权益分配时红利的登记、派发，基金交易份额的清算过户和基金交易资金的交收等服务。

#### 2、红利再投资服务

本基金收益分配时，基金份额持有人可以选择将所获红利再投资于本基金，且不收取任何申购费用。

#### 3、定期定额投资计划

基金管理人在合适时机将为基金投资者提供定期定额投资的服务。通过定期定额投资计划，投资者可以通过固定的渠道，定期定额申购基金份额，该定期申购计划不受最低申购金额的限制，以另行公告为准。

#### 4、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。

#### 5、基金网上交易服务

基金管理人已经开通网上交易服务。在未来市场和技术条件成熟时，基金管理人将提供更多类型的基金电子交易服务。

#### 6、理财服务

基金份额持有人可通过公司网站、在线客服、客服电话等方式向本基金管理人定制电子对账单。基金管理人将对留有联系方式的客户按照约定的方式向客户主动提供电子邮件和短信服务。但由于基金份额持有人未详实填写或未及时更新相关信息（包括手机号码、电子邮箱等）导致基金管理人无法送达的除外。如无联系方式

的客户您可以通过以下渠道进行查询或者订阅电子、短信账单。

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

客服电话：400-8888-118

基金管理人提供多样化服务模式，包括客服热线、网站查询、网站在线客服，实行工作日人工服务、7×24 小时自助服务方式，基金份额持有人可与基金管理人及时沟通，参与基金管理人举办的各种互动活动。基金管理人也将妥善处理基金份额持有人提出的建议或投诉。

## （二） 联系方式

- 1、信达澳银公司客服电话：400-8888-118/0755-83160160/83077038（传真）
- 2、信达澳银公司网址：[www.fscinda.com](http://www.fscinda.com)
- 3、信达澳银直销中心电话：0755-82858168/83077068/83077038（传真）

### 二十三、其他应披露事项

| 序号 | 公告事项  | 日期          |
|----|---|-------------|
| 1  | 信达澳银新征程定期开放灵活配置混合招募说明书摘要更新                          | 2020年2月22日  |
| 2  | 信达澳银新征程定期开放灵活配置混合招募说明书更新                            | 2020年2月22日  |
| 3  | 信达澳银新征程定期开放灵活配置混合基金经理变更公告                           | 2020年2月20日  |
| 4  | 信达澳银基金管理有限公司关于直销账户信息的提示性公告                          | 2020年2月4日   |
| 5  | 信达澳银基金管理有限公司关于调整旗下基金2020年春节假期清算交收安排及申购赎回等交易业务的提示性公告 | 2020年1月30日  |
| 6  | 信达澳银新征程定期开放灵活配置混合2019年第四季度报告                        | 2020年1月18日  |
| 7  | 信达澳银新征程定期开放灵活配置混合招募说明书更新                            | 2020年1月6日   |
| 8  | 信达澳银新征程定期开放灵活配置混合招募说明书摘要更新                          | 2020年1月6日   |
| 9  | 信达澳银基金行业高级管理人员变更公告                                  | 2020年1月2日   |
| 10 | 信达澳银基金管理有限公司旗下基金年度净值公告                              | 2020年1月1日   |
| 11 | 信达澳银基金管理有限公司关于网站系统切换对外业务暂停服务的公告                     | 2019年12月27日 |
| 12 | 信达澳银基金管理人董事变更公告                                     | 2019年12月16日 |

|    |   |             |
|----|---|-------------|
| 13 | 信达澳银基金行业高级管理人员变更公告                          | 2019年12月16日 |
| 14 | 信达澳银新征程定期开放灵活配置混合型证券投资基金延长开放期的公告            | 2019年11月28日 |
| 15 | 信达澳银新征程定期开放灵活配置混合基金开放日常申购（赎回、转换、定期定额投资）业务公告 | 2019年11月22日 |
| 16 | 信达澳银新征程定期开放灵活配置混合招募说明书更新                    | 2019年10月26日 |
| 17 | 信达澳银新征程定期开放灵活配置混合招募说明书摘要更新                  | 2019年10月26日 |
| 18 | 005168_信达澳银新征程定期开放灵活配置混合型证券投资基金2019年经理变更公告  | 2019年10月24日 |
| 19 | 信达澳银修改基金合同的公告                               | 2019年10月24日 |
| 20 | 信达澳银新征程定期开放灵活配置混合基金合同更新                     | 2019年10月24日 |
| 21 | 信达澳银新征程定期开放灵活配置混合托管协议更新                     | 2019年10月24日 |
| 22 | 2019年三季度报告                                  | 2019年10月24日 |
| 23 | 信达澳银新征程定期开放灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）           | 2019年10月8日  |
| 24 | 信达澳银新征程定期开放灵活配置混合型证券投资基金招募说明书摘要（更新）         | 2019年10月8日  |
| 25 | 信达澳银新征程定期开放灵活配置混合基金经理变更公告                   | 2019年9月28日  |
| 26 | 信达澳银新征程定期开放灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新             | 2019年9月23日  |

|    |   |            |
|----|---|------------|
| 27 | 信达澳银新征程定期开放灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新（摘要）             | 2019年9月23日 |
| 28 | 信达澳银新征程定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告                | 2019年9月19日 |
| 29 | 信达澳银基金管理有限公司关于终止信达慧理财APP运营及维护服务的公告              | 2019年9月10日 |
| 30 | 信达澳银基金管理有限公司关于系统升级对外业务暂停服务的公告                   | 2019年9月5日  |
| 31 | 关于嘉实财富管理有限公司终止代销信达澳银基金管理有限公司旗下基金的公告             | 2019年8月31日 |
| 32 | 2019年半年度报告                                      | 2019年8月24日 |
| 33 | 2019年半年度报告摘要                                    | 2019年8月24日 |
| 34 | 信达澳银基金管理有限公司关于参加国泰君安证券股份有限公司基金申购费率优惠活动的公告       | 2019年8月19日 |
| 35 | 信达澳银基金管理有限公司关于增加国泰君安证券股份有限公司为信达澳银新征程混合基金代销机构的公告 | 2019年8月19日 |
| 36 | 信达澳银新征程定期开放灵活配置混合型证券投资基金开放申购、赎回业务的公告(第五次)       | 2019年8月16日 |
| 37 | 信达澳银基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告                       | 2019年8月16日 |
| 38 | 信达澳银基金关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告                   | 2019年8月7日  |
| 39 | 信达澳银基金管理有限公司关于参加安信证券基金申购费率优惠活动的公告               | 2019年7月29日 |
| 40 | 信达澳银基金管理有限公司关于系统升级改造对外业务暂停服务的公告                 | 2019年7月25日 |



|    |  |            |
|----|--|------------|
| 41 | 信达澳银基金管理有限公司关于增加江苏江南农村商业银行股份有限公司为旗下部分基金的代销机构                   | 2019年7月22日 |
| 42 | 2019年二季度报告   | 2019年7月19日 |
| 43 | 信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金开通中信证券、中信证券（山东）、中信期货的转换和定投业务、参加基金申购费率优惠活动的公告 | 2019年7月2日  |
| 44 | 信达澳银基金管理有限公司旗下基金半年度净值公告  | 2019年7月1日  |
| 45 | 信达澳银基金管理有限公司关于直销系统升级改造对外业务暂停服务的公告                              | 2019年6月28日 |
| 46 | 信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金所持“中科曙光”及“曙光转债”估值调整的公告                       | 2019年6月26日 |
| 47 | 信达澳银基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票的公告                                | 2019年6月22日 |
| 48 | 关于参加华金证券基金申购费率优惠活动的公告<br>20190618                              | 2019年6月18日 |
| 49 | 关于北京晟视天下基金销售有限公司终止代销信达澳银旗下基金的公告 20190617                       | 2019年6月17日 |
| 50 | 信达澳银基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告                                      | 2019年5月17日 |
| 51 | 信达澳银新征程定期开放灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新 2019年第1期                       | 2019年4月30日 |
| 52 | 信达澳银新征程定期开放灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新 2019年第1期（摘要）                   | 2019年4月30日 |
| 53 | 信达澳银基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告                                      | 2019年4月30日 |
| 54 | 关于高级管理人员变更的公告  | 2019年4月30日 |

|    |   |            |
|----|---|------------|
| 55 | 20190426-关于天相投资顾问有限公司终止代销信达澳银旗下基金的公告      | 2019年4月26日 |
| 56 | 2019年一季度报告                                | 2019年4月18日 |
| 57 | 信达澳银新征程定期开放灵活配置混合型证券投资基金开放申购、赎回业务的公告(第四次) | 2019年4月16日 |
| 58 | 信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金所持股票估值调整的公告 20190416    | 2019年4月16日 |

## 二十四、招募说明书的存放及查阅方式

### （一）招募说明书的存放地点

本招募说明书存放在基金管理人、销售机构和登记机构的办公场所，并刊登在基金管理人的网站上。

### （二）招募说明书的查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅本基金的招募说明书，也可按工本费购买本招募说明书的复印件，但应以本基金招募说明书的正本为准。

## 二十三、备查文件

备查文件等文本存放在基金管理人和销售机构的办公场所和营业场所，在办公时间内可供免费查阅。

- （一）中国证监会注册信达澳银新征程定期开放灵活配置混合型基金的文件
- （二）《信达澳银新征程定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- （三）《信达澳银新征程定期开放灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- （四）《信达澳银基金管理有限公司开放式基金业务规则》
- （五）法律意见书
- （六）基金管理人业务资格批件和营业执照
- （七）基金托管人业务资格批件和营业执照
- （八）中国证监会要求的其他文件

信达澳银基金管理有限公司

二〇二一年一月二十六日