

新疆前海联合科技先锋混合型证券投资基金
招募说明书（更新）
（2021 年第 2 号）

基金管理人：新疆前海联合基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

二〇二一年三月

【重要提示】

新疆前海联合科技先锋混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）募集的准予注册文件名称为：《关于准予新疆前海联合科技先锋混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可【2018】2023号），注册日期为：2018年12月5日，本基金的基金合同于2019年8月14日正式生效。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，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。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，但不保证投资本基金一定盈利，也不保证基金份额持有人的最低收益；因基金价格可升可跌，亦不保证基金份额持有人能全数取回其原本投资。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资者在投资本基金前，需全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对投资本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资者根据所持有份额享受基金的收益，但同时也需承担相应的投资风险。投资本基金可能遇到的风险包括：因政治、经济、社会等因素对证券价格波动产生影响而引发的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金份额持有人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特定风险等。

本基金可能投资于中小企业私募债券。本基金所投资的中小企业私募债券之债务人如出现违约，或在交易过程中发生交收违约，或由于中小企业私募债券信用质量降低导致价格下降，可能造成基金财产损失。此外，受市场规模及交易活跃程度的影响，中小企业私募债券可能无法在同一价格水平上进行较大数量的买入或卖出，存在一定的流动性风险，从而对基金收益造成影响。

本基金可能投资于流通受限证券，流通受限证券在一定的锁定期内不能卖出，可能面临无法及时变现的流动性风险、锁定期内市场价格波动风险。

本基金可投资存托凭证，如果投资，可能面临存托凭证价格大幅波动甚至出

现较大亏损的风险，以及与中国存托凭证发行机制相关的风险。

当本基金持有特定资产且存在潜在大额赎回申请时，基金管理人履行相应程序后，可以启动侧袋机制，具体详见基金合同和本招募说明书“侧袋机制”等有关章节。侧袋机制实施期间，基金管理人将对基金简称进行特殊标识，并不办理侧袋账户的申购赎回。请基金份额持有人仔细阅读相关内容并关注本基金启用侧袋机制时的风险。

本基金为混合型证券投资基金，长期平均风险与预期收益率高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。投资有风险，投资者在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的招募说明书、基金产品资料概要和基金合同等信息披露文件，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，自主判断基金的投资价值，自主、谨慎做出投资决策，自行承担投资风险。基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。

本招募说明书（更新）根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及本基金基金合同对本基金信息披露相关内容进行更新，除非另有说明。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。

本基金本次招募说明书（更新）主要根据基金合同对侧袋机制有关内容进行了更新，基金管理人的董事、办公地址等信息的更新截止日为 2020 年 12 月 31 日。除非另有说明，本招募说明书（更新）基金经理等相关信息更新截止日为 2020 年 6 月 8 日，其余所载内容截止日为 2020 年 6 月 3 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2020 年 3 月 31 日（财务数据未经审计）。

目 录

第一部分 绪言	4
第二部分 释义	5
第三部分 基金管理人	10
第四部分 基金托管人	21
第五部分 相关服务机构	29
第六部分 基金份额的募集	48
第七部分 基金合同的生效	49
第八部分 基金份额的申购和赎回	50
第九部分 基金的投资	63
第十部分 基金的业绩	75
第十一部分 基金的财产	76
第十二部分 基金资产估值	77
第十三部分 基金的收益与分配	83
第十四部分 基金的费用与税收	85
第十五部分 基金的会计与审计	88
第十六部分 基金的信息披露	89
第十七部分 侧袋机制	97
第十八部分 风险揭示	101
第十九部分 基金合同的变更、终止和基金财产的清算	108
第二十部分 基金合同的内容摘要	110
第二十一部分 基金托管协议的内容摘要	128
第二十二部分 对基金份额持有人的服务	143
第二十三部分 其他应披露事项	145
第二十四部分 招募说明书存放及其查阅方式	148
第二十五部分 备查文件	149

第一部分 绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《证券投资基金管理公司治理准则（试行）》、《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“《流动性规定》”）和其他有关法律法规的规定以及《新疆前海联合科技先锋混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）编写。

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

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

第二部分 释义

《招募说明书》中除非文意另有所指，下列词语具有如下含义：

- 1、基金或本基金：指新疆前海联合科技先锋混合型证券投资基金
- 2、基金管理人：指新疆前海联合基金管理有限公司
- 3、基金托管人：指上海浦东发展银行股份有限公司
- 4、基金合同或《基金合同》：指《新疆前海联合科技先锋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《新疆前海联合科技先锋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《新疆前海联合科技先锋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《新疆前海联合科技先锋混合型证券投资基金基金份额发售公告》
- 8、基金产品资料概要：指《新疆前海联合科技先锋混合型证券投资基金基金产品资料概要》及其更新
- 9、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
- 10、《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，2012 年 12 月 28 日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自 2013 年 6 月 1 日起实施，并经 2015 年 4 月 24 日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修改的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 11、《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
- 12、《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

13、《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

14、《流动性规定》：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

15、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

16、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

17、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

18、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

19、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

20、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

21、投资人、投资者：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

22、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

23、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、转托管及定期定额投资等业务

24、销售机构：指新疆前海联合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协议，办理基金销售业务的机构

25、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

26、**登记机构**：指办理登记业务的机构。基金的登记机构为新疆前海联合基金管理有限公司或接受其委托办理登记业务的机构

27、**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

28、**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、转托管及定期定额投资等业务导致基金份额变动及结余情况的账户

29、**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

30、**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

31、**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

32、**存续期**：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

33、**工作日**：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

34、**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

35、**T+n日**：指自T日起第n个工作日(不包含T日)，n为自然数

36、**开放日**：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

37、**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

38、**《业务规则》**：指《新疆前海联合基金管理有限公司开放式基金业务规则》及其修订，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 and 投资人共同遵守

39、**认购**：指在基金募集期内，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

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

41、**赎回**：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同和招募说明书规

定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为

42、基金转换：指基金份额持有人按照基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金基金份额的行为

43、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

44、定期定额投资计划：指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期申购日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及受理基金申购申请的一种投资方式

45、巨额赎回：指本基金单个开放日，基金净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过上一开放日基金总份额的 10%的情形

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、基金应收申购款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：指计算日各类基金份额的各自基金资产净值除以计算日各自类别的基金份额总数

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、基金份额类别：本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。收取认购费、申购费并根据持有期限收取赎回费，不收取销售服务费的，称为 A 类基金份额；收取销售服务费并根据持有期限收取赎回费，不收取认购费及申购费的，称为 C 类基金份额

53、销售服务费：指从基金资产中计提的，用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务的费用

54、A 类基金份额：指在投资人认购及申购时收取认购及申购费用，在赎回

时根据持有期限收取赎回费用，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额

55、C类基金份额：指在投资人认购及申购时不收取认购及申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，并从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额

56、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

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

58、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及指定互联网网站（包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介

59、不可抗力：指基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

60、侧袋机制：指将基金投资组合中的特定资产从原有账户分离至一个专门账户进行处置清算，目的在于有效隔离并化解风险，确保投资者得到公平对待，属于流动性风险管理工具。侧袋机制实施期间，原有账户称为主袋账户，专门账户称为侧袋账户

61、特定资产：包括：（一）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的资产；（二）按摊余成本计量且计提资产减值准备仍导致资产价值存在重大不确定性的资产；（三）其他资产价值存在重大不确定性的资产

第三部分 基金管理人

一、基金管理人概况

名称：新疆前海联合基金管理有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐经济技术开发区维泰南路1号维泰大厦1506室

成立日期：2015年8月7日

法定代表人：王晓耕

办公地址：深圳市宝安区兴业路1100号金利通大厦(前海人寿金融中心)T2栋33层

联系人：张绍东

联系电话：0755-23695990

传真：0755-82788000

基金管理人新疆前海联合基金管理有限公司是经中国证监会证监许可【2015】1842号文核准设立，注册资本为贰亿元人民币。目前的股权结构为：

序号	股东名称	持股比例
1	深圳市钜盛华股份有限公司	30%
2	深圳粤商物流有限公司	25%
3	深圳市深粤控股股份有限公司	25%
4	凯信恒有限公司	20%

二、主要人员情况

1、董事会成员基本情况

公司董事会共有7名成员，其中3名独立董事。

黄炜先生，董事长，硕士研究生。1997年7月至2002年5月在工商银行广东省分行工作，担任信贷部副经理；2002年5月至2013年11月在工商银行深圳分行工作，担任机构业务部总经理，现任新疆能源产业基金（管理）有限公司董事长、深圳市宝能投资集团有限公司高级副总裁。

乔宗利先生，副董事长，博士研究生。曾先后任职于深圳石化集团、深圳鹏

基龙电安防股份有限公司、深圳市凯欣达多媒体有限公司、宝能地产股份有限公司、深圳市宝能投资集团有限公司、前海人寿保险股份有限公司，现任深圳市宝能投资集团有限公司副总裁。

孙磊先生，董事，硕士研究生。曾先后任职于中国工商银行深圳红围支行、中国工商银行深圳市分行投资银行部、中信银行长沙分行投资银行部，现任杭州新天地集团有限公司董事、前海人寿保险股份有限公司资产管理中心副总监。

王晓耕女士，董事，硕士研究生。曾先后任职于深圳发展银行总行国际部、大鹏证券有限责任公司经纪业务总部、《新财富》杂志社，2009年1月起担任五矿证券有限责任公司副总经理。2015年1月任新疆前海联合基金管理有限公司筹备组负责人，公司成立至今任公司总经理、董事。

孙学致先生，独立董事，博士。历任吉林大学法学院教授、副院长，吉林省高级人民法院庭长助理，现任吉林大学法学院教授、吉林功承律师事务所独立管理人。

夏正林先生，独立董事，博士。曾先后任职于江苏省连云港职业大学、江苏省连云港职业技术学院；2006年7月至今任职于华南理工大学，历任华南理工大学法学院讲师、副教授等职务，现任华南理工大学法学院教授、副院长；兼任中国法学会宪法学研究会理事、中国法学会法学教育研究会理事、中国法学会董必武法学思想研究会常务理事、广东省法学会港澳基本法研究会副会长、广东省法学会党内法规研究会副会长、广东省法学会宪法学研究会秘书长。

张卫国先生，独立董事，博士。曾先后任职于宁夏师范学院、宁夏大学；2004年至今任职于华南理工大学，历任华南理工大学经济与贸易学院副院长，华南理工大学工商管理学院副院长、常务副院长，现任华南理工大学工商管理学院院长、教授、博士生导师。

2、监事基本情况

公司不设监事会，设监事 2 名。

宋粤霞女士，监事，大学本科。历任深圳市金鹏会计师事务所文员、中国平安保险股份有限公司会计、深圳市足球俱乐部财务主管，现任凯信恒有限公司总经理、执行董事。

赵伟先生，监事，硕士研究生。先后任职于厦门南鹏电子有限公司、深圳证券通信有限公司，担任软件工程师、项目经理等职，2015 年 1 月加入新疆前海联合基金管理有限公司筹备组，现任新疆前海联合基金管理有限公司信息技术部部门负责人。

3、公司高级管理人员

王晓耕女士，董事，总经理，简历参见董事会成员基本情况。

邱张斌先生，硕士研究生；历任安永会计师事务所审计经理，银华基金管理有限公司监察稽核部监察员，大成基金管理有限公司监察稽核部执行总监及大成创新资本管理有限公司副总经理兼监察稽核与风险管理部总监，现任新疆前海联合基金管理有限公司督察长。

周明先生，硕士研究生；先后任职于日本电信电话有限公司(日本)研发部，深圳市联想信息产品有限公司开发部，融通基金管理有限公司监察稽核部，乾坤期货有限公司合规部，2015 年 8 月加入新疆前海联合基金管理有限公司，历任风险管理部负责人、产品开发部负责人兼机构业务部、渠道业务部负责人，现任新疆前海联合基金管理有限公司总经理助理。

张永任先生，博士研究生，2015 年 6 月至 2019 年 4 月和 2012 年 7 月至 2014 年 7 月就职于前海人寿资产管理中心，历任投资经理助理、投资经理；2014 年 7 月至 2015 年 6 月就职于四川金融资产交易所，任互联网金融部总经理；2010 年 3 月至 2012 年 6 月就职于华西证券研究所，任行业研究员，现任新疆前海联合

基金管理有限公司总经理助理。

4、本基金基金经理

王静女士，CFA，硕士研究生，10年证券基金从业经验。2009年7月至2016年4月曾就职于民生加银基金管理有限公司，历任钢铁、化工、交运、纺织服装、农业等行业研究员，于2016年5月加入前海联合基金，现任前海联合科技先锋混合（2019年8月14日至今）兼前海联合新思路混合（2019年6月19日至今）的基金经理。曾任前海联合泳涛混合（管理时间：2017年6月7日至2020年2月3日）、前海联合沪深300（管理时间：2017年3月20日至2020年4月16日）、前海联合泳隆混合（管理时间：2017年8月29日至2020年4月16日）、前海联合研究优选混合（管理时间：2018年7月25日至2020年2月24日）、前海联合润丰混合（管理时间：2018年9月20日至2020年2月24日）、前海联合先进制造混合（管理时间：2018年12月26日至2020年2月24日）和前海联合泳隼混合（管理时间：2018年1月29日至2020年2月3日）的基金经理。

林材先生，硕士研究生，12年证券基金投资研究经验，2011年10月至2015年7月任金元顺安基金经理，2008年11月至2011年10月任民生加银基金医药行业研究员、基金经理助理，2000年7月至2003年9月曾任职于广州医药集团，于2015年9月加入前海联合基金，现任前海联合科技先锋混合（2020年2月18日至今）兼前海联合添利债券（2016年11月17日至今）、前海联合新思路混合（2016年11月11日至今）、前海联合沪深300（2016年11月30日至今）、前海联合国民健康混合（2016年12月29日至今）和前海联合泳隆混合（2020年2月18日至今）的基金经理。曾任前海联合泓鑫混合（管理时间：2016年11月30日至2019年9月17日）和前海联合研究优选混合（管理时间：2018年7月25日至2019年9月26日）的基金经理。

张磊先生，硕士研究生，6年证券基金投资研究经验，先后从事TMT、医药等行业研究。于2017年2月加入前海联合基金，现任职于权益投资部。2013年7月至2017年2月任华润元大基金管理有限公司投资管理部研究员。现任前海联合科技先锋混合（2020年6月8日至今）的基金经理。

5、基金管理人投资决策委员

公司投资决策委员会成员包括：总经理王晓耕女士，总经理助理、基金经理

张永任先生，权益投资部总经理、基金经理何杰先生，研究发展部总经理助理王静女士，固定收益部总经理、基金经理黄浩东先生，基金经理林材先生，基金经理敬夏玺先生。

上述人员之间不存在近亲属关系。

三、基金管理人的职责

1、依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构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条件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。

四、基金管理人关于遵守法律法规的承诺

- 1、基金管理人承诺不从事违反《中华人民共和国证券法》、《基金法》、《运

作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》等法律法规的活动，并承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违法行为的发生；

2、基金管理人的禁止行为：

- （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）不公平地对待管理的不同基金财产；
- （3）利用基金财产或者职务之便为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；
- （4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- （5）侵占、挪用基金财产；
- （6）泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
- （7）玩忽职守，不按照规定履行职责；
- （8）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。

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）故意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，不按照规定履行职责；
- （7）泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
- （8）协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易；
- （9）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；
- （10）贬损同行，以提高自己；
- （11）在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；

- (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) 其他法律、行政法规禁止的行为。

五、基金管理人关于禁止性行为的承诺

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

- (1) 承销证券；
- (2) 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) 买卖其他基金份额，但是法律法规或中国证监会另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- (6) 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；
- (7) 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的同意，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。

六、基金经理承诺

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

2、不能利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者牟取利益；

3、不泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

4、不得以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

七、基金管理人的内部控制制度

1、内部控制制度概述

为了保证公司规范运作，有效地防范和化解管理风险、经营风险以及操作风险，确保基金财务和公司财务以及其他信息真实、准确、完整，从而最大程度地保护基金份额持有人的利益，本基金管理人建立了科学合理、控制严密、运行高效的内部控制制度。

内部控制制度是指公司为实现内部控制目标而建立的一系列组织机制、管理方法、操作程序与控制措施的总称。内部控制制度由内部控制大纲、基本管理制度、部门业务规章等组成。

公司内部控制大纲是对公司章程规定的内控原则的细化和展开，是对各项基本管理制度的总揽和指导，内部控制大纲明确了内控目标、内控原则、控制环境、内控措施等内容。

基本管理制度包括内部会计控制制度、风险控制制度、投资管理制度、监察稽核制度、基金会计制度、信息披露制度、信息技术管理制度和危机处理制度等。

部门业务规章是在基本管理制度的基础上，对各部门的主要职责、岗位设置、岗位职责、操作守则等的具体说明。

2、内部控制原则

（1）全面性原则：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、反馈和监督等各个环节；

（2）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，公司基金资产、自有资产与其他类型资产的运作相互分离；

（3）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；

（4）相互制约原则：公司设置的各部门、各岗位权责分明、职责明确并相互制衡；

（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，合理地控制成本以达到最佳的内部控制效果。

3、主要内部控制制度

（1）内部会计控制制度

公司依据《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业务指引》、《企业财务通则》等国家有关法律、法规制订了基金会计制度、公司财务会计制度、会计工作操作流程和会计岗位职责，并针对各个风险控制点建立严密的会计系统控制。

内部会计控制制度包括凭证制度、复核制度、账务处理程序、基金估值制度和程序、基金财务清算制度和程序、成本控制制度、财务收支审批制度和费用报销管理办法、财产登记保管和实物资产盘点制度、会计档案保管和财务交接制度等。

（2）风险管理控制制度

风险控制制度由风险管理委员会组织各部门制定，风险控制制度由风险控制的目标和原则、风险控制的机构设置、风险控制的程序、风险类型的界定、风险控制的主要措施、风险控制的具体制度、风险控制制度的监督与评价等部分组成。

风险控制的具体制度主要包括投资风险管理、交易风险管理、财务风险控制以及岗位分离、防火墙、保密、员工行为准则等程序性风险管理制度。

（3）监察稽核制度

公司设立督察长，负责监察稽核工作，督察长由总经理提名，经董事会聘任，报中国证监会核准。

除应当回避的情况外，督察长可以列席公司任何会议，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。督察长应当定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况，董事会应当对督察长的报告进行审议。

公司设立监察稽核部门，具体执行监察稽核工作。公司配备了充足合格的监察稽核人员，明确规定了监察稽核部门及内部各岗位的职责和 workflows。

监察稽核制度包括内部监察稽核管理办法等。通过制度的建立，检查公司业务部门和人员遵守有关法律、法规和规章的有关情况；检查公司业务部门和人员执行公司内部控制制度、各项管理制度和业务规章的情况。

4、基金管理人关于内部控制制度的声明

（1）基金管理人承诺以上关于内部控制的披露真实、准确；

（2）基金管理人承诺根据市场变化和公司发展不断完善内部合规控制。

第四部分 基金托管人

一、基金托管人概况

1、基本情况

名称：上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市中山东一路 12 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：郑杨

成立时间：1992 年 10 月 19 日

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

组织形式：股份有限公司

注册资本：293.52 亿元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基金字[2003]105 号

联系人：胡波

联系电话：（021）61618888

上海浦东发展银行自 2003 年开展资产托管业务，是较早开展银行资产托管服务的股份制商业银行之一。经过二十年来的稳健经营和业务开拓，各项业务发展一直保持较快增长，各项经营指标在股份制商业银行中处于较好水平。

上海浦东发展银行总行于 2003 年设立基金托管部，2005 年更名为资产托管

部，2013年更名为资产托管与养老金业务部，2016年进行组织架构优化调整，并更名为资产托管部，目前下设证券托管处、客户资产托管处、内控管理处、业务保障处、总行资产托管运营中心（含合肥分中心）五个职能处室。

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

2、主要人员情况

郑杨，男，1966年出生，研究生学历，博士学位，高级经济师。曾任国家经贸委经济法规司调研处副处长；中国机电设备招标中心开发处处长、第七招标业务处处长；国家外汇管理局资本项目司副司长；中国人民银行上海分行党委委员、副行长、国家外汇管理局上海市分局副局长；中国人民银行上海总部党委委员、副主任兼外汇管理部主任；上海市金融工作党委副书记、市金融办主任；上海市金融工作党委书记、市金融办主任；上海市金融工作党委书记、市地方金融监管局（市金融工作局）局长。现任上海浦东发展银行党委书记、董事长。

潘卫东，男，1966年出生，硕士研究生，高级经济师。曾任宁波证券公司业务一部副经理；上海浦东发展银行宁波分行资财部总经理兼任北仑办事处主任、宁波分行副行长；上海浦东发展银行产品开发部总经理；上海浦东发展银行昆明分行行长、党组书记；上海市金融服务办公室挂职并任金融机构处处长；上海国际集团党委委员、总经理助理，上海国际集团党委委员、副总经理，上海国际信托有限公司党委书记、董事长；上海浦东发展银行党委委员、执行董事、副行长、财务总监。现任上海浦东发展银行党委副书记、副董事长、行长，上海国际信托有限公司董事长。

孔建，男，1968年出生，博士研究生。历任工商银行山东省分行资金营运处副处长，上海浦东发展银行济南分行信管处总经理，上海浦东发展银行济南分行行长助理、副行长、党委书记、行长。现任上海浦东发展银行总行金融市场业务工作党委委员，资产托管部总经理。

3、基金托管业务经营情况

截止 2020 年 6 月 30 日,上海浦东发展银行证券投资基金托管规模为 7475.95 亿元,比去年末增加 24.12%。托管证券投资基金共二百十六只,分别为国泰金龙行业精选基金、国泰金龙债券基金、天治财富增长基金、广发小盘成长基金、汇添富货币基金、长信金利趋势基金、嘉实优质企业基金、国联安货币基金、长信利众债券基金(LOF)、博时安丰 18 个月基金(LOF)、易方达裕丰回报基金、鹏华丰泰定期开放基金、汇添富双利增强债券基金、华富恒财定开债券基金、汇添富和聚宝货币基金、工银目标收益一年定开债券基金、北信瑞丰宜投宝货币基金、中海医药健康产业基金、华富国泰民安灵活配置混合基金、安信动态策略灵活配置基金、东方红稳健精选基金、国联安鑫享混合基金、长安鑫利优选混合基金、工银瑞信生态环境基金、天弘新价值混合基金、嘉实机构快线货币基金、鹏华 REITs 封闭式基金、华富健康文娱基金、金鹰改革红利基金、易方达裕祥回报债券基金、中银瑞利灵活配置混合基金、华夏新活力混合基金、鑫元汇利债券型基金、南方转型驱动灵活配置基金、银华远景债券基金、富安达长盈灵活配置混合型基金、中信建投睿溢混合型证券投资基金、工银瑞信恒享纯债基金、长信利发债券基金、博时景发纯债基金、鑫元得利债券型基金、东方红战略沪港深混合基金、博时富发纯债基金、博时利发纯债基金、银河君信混合基金、兴业启元一年定开债券基金、工银瑞信瑞盈 18 个月定开债券基金、中信建投稳裕定开债券基金、招商招怡纯债债券基金、中加丰享纯债债券基金、长安泓泽纯债债券基金、银河君耀灵活配置混合基金、广发汇瑞 3 个月定期开放债券发起式证券投资基金、汇安嘉汇纯债债券基金、南方宣利定开债券基金、招商兴福灵活配置混合基金、博时鑫润灵活配置混合基金、兴业裕华债券基金、易方达瑞通灵活配置混合基金、招商招祥纯债债券基金、易方达瑞程混合基金、中欧骏泰货币基金、招商招华纯债债券基金、汇安丰融灵活配置混合基金、汇安嘉源纯债债券基金、国泰普益混合基金、汇添富鑫瑞债券基金、鑫元合丰纯债债券基金、博时鑫惠混合基金、国泰润利纯债基金、华富天益货币基金、汇安丰华混合基金、汇安沪深 300 指数增强型证券投资基金、汇安丰恒混合基金、景顺长城中证 500 指数基金、鹏华丰康债券基金、兴业安润货币基金、兴业瑞丰 6 个月定开债券基金、兴业裕丰债券基金、易方达瑞弘混合基金、长安鑫富领先混合基金、万家现金增利货币基金、上银慧增利货币市场基金、易方达瑞富灵活配置证券投资基金、博时富腾纯

债债券型证券投资基金、安信工业 4.0 主题沪港深精选混合基金、万家天添宝货币基金、中欧瑾泰债券型证券投资基金、中银证券安弘债券基金、鑫元鑫趋势灵活配置混合基金、泰康年年红纯债一年定期开放债券基金、广发高端制造股票型发起式基金、永赢永益债券基金、南方安福混合基金、中银证券聚瑞混合基金、太平改革红利精选灵活配置混合基金、富荣富乾债券型证券投资基金、国联安安稳灵活配置混合型证券投资基金、前海开源景鑫灵活配置混合型证券投资基金、前海开源弘丰债券型发起式证券投资基金、中海沪港深多策略灵活配置混合型基金基金、中银证券祥瑞混合型证券投资基金、前海开源盛鑫灵活配置混合型证券投资基金、鑫元行业轮动灵活配置混合型证券投资基金、兴业 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、富国颐利纯债债券型证券投资基金、华安安浦债券型证券投资基金、南方泽元债券型证券投资基金、鹏扬淳利定期开放债券型证券投资基金、万家鑫悦纯债债券型基金、新疆前海联合泳祺纯债债券型证券投资基金、永赢盈益债券型证券投资基金、中加颐合纯债债券型证券投资基金、中信保诚稳达债券型证券投资基金、中银中债 3-5 年期农发行债券指数证券投资基金、东方红核心优选一年定期开放混合型证券投资基金、平安惠锦纯债债券型证券投资基金、华夏鼎通债券型证券投资基金、鑫元全利债券型发起式证券投资基金、中融恒裕纯债债券型证券投资基金、嘉实致盈债券型证券投资基金、永赢消费主题灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信瑞福纯债债券型证券投资基金、广发景智纯债债券型证券投资基金、东兴品牌精选灵活配置混合型证券投资基金、广发中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、融通通捷债券型证券投资基金、华富恒盛纯债债券型证券投资基金、建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金、汇安嘉鑫纯债债券型证券投资基金、国寿安保安丰纯债债券型证券投资基金、博时中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、银河家盈纯债债券型证券投资基金、博时富永纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、南方畅利定期开放债券型发起式证券投资基金、中加瑞利纯债债券型证券投资基金、华富中证 5 年恒定久期国开债指数型证券投资基金、永赢合益债券型证券投资基金、嘉实中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、广发港股通优质增长混合型证券投资基金、长安泓沅中短债债券型证券投资基金、中海信息产业精选混合型证券投资基金、民生加银恒裕债券型证券投资基金、国寿安保尊益信用纯债债券型证券投

资基金、平安惠泰纯债债券型证券投资基金、中信建投景和中短债债券型证券投资基金、工银瑞信添慧债券型证券投资基金、华富安鑫债券型证券投资基金、汇添富中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金、南方旭元债券型发起式证券投资基金、大成中债 3-5 年国开行债券指数基金、永赢众利债券型证券投资基金、华夏中债 3-5 年政策性金融债指数证券投资基金、中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金、新疆前海联合科技先锋混合型证券投资基金、银华尊尚稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、博时颐泽平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、农银养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)、汇添富汇鑫浮动净值货币市场基金、泰康安欣纯债债券型证券投资基金、恒生前海港股通精选混合型证券投资基金、鹏华丰鑫债券型证券投资基金、中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金、汇添富保鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富安兴 39 个月定期开放债券型证券投资基金、中融睿享 86 个月定期开放债券型基金、南方梦元短债债券型证券投资基金、鹏扬淳开债券型证券投资基金、华宝宝惠纯债 39 个月定期开放债券型证券投资基金、建信 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金、农银汇理金益债券型证券投资基金、博时稳欣 39 个月定期开放债券型证券投资基金、同泰慧择混合型证券投资基金、招商中证红利交易型开放式指数证券投资基金、嘉实致禄 3 个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、永赢久利债券型证券投资基金、嘉实安元 39 个月定期开放纯债债券型证券投资基金、交银施罗德裕泰两年定期开放债券型证券投资基金、长城嘉鑫两年定期开放债券型证券投资基金、建信荣禧一年定期开放债券型证券投资基金、鹏扬浦利中短债债券型证券投资基金、平安惠合纯债债券型证券投资基金、工银瑞信深证 100 交易型开放式指数证券投资基金、鹏华 0-5 年利率债债券型发起式证券投资基金、景顺长城弘利 39 个月定期开放债券型证券投资基金、工银瑞信泰颐三年定期开放债券型证券投资基金、华安鑫浦 87 个月定期开放债券型证券投资基金、汇安嘉盛纯债债券型证券投资基金、东方红安鑫甄选一年持有期混合型证券投资基金、西藏东财中证通信技术主题指数型发起式证券投资基金、财通裕惠 63 个月定期开放债券型证券投资基金、南方尊利一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰中证全指家用电器交易型开放式指数证券投资基金、鹏华尊裕一年定期

开放债券型发起式证券投资基金、鹏扬淳悦一年定期开放债券型发起式证券投资基金、兴业鼎泰一年定期开放债券型发起式证券投资基金、安信丰泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金基金、国泰中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金、广发恒隆一年持有期混合型证券投资基金、安信中证信用主体 50 债券指数证券投资基金基金、大成彭博巴克莱政策性银行债券 3-5 年指数证券投资基金、国泰中证全指家用电器交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、海富通富泽混合型证券投资基金、华富中债-0-5 年中高等级信用债收益平衡指数证券投资基金、汇添富稳健增益一年持有期混合型证券投资基金、南方誉慧一年持有期混合型证券投资基金、农银汇理永乐 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）、鹏扬景恒六个月持有期混合型证券投资基金、平安合兴 1 年定期开放债券型发起式证券投资基金、融通中债 1-3 年国开行债券指数基金基金、太平中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、天弘永裕稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、中欧真益稳健一年持有期混合型证券投资基金、南华中证杭州湾区交易型开放式指数证券投资基金联接基金、金信核心竞争力灵活配置混合型证券投资基金、华泰紫金中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金等。

二、基金托管人的内部控制制度

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

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

3、内部控制制度及措施：上海浦东发展银行已建立完善的内部控制制度。内控制度贯穿资产托管业务的决策、执行、监督全过程，渗透到各业务流程和各

操作环节，覆盖到从事资产托管各级组织结构、岗位及人员。内部控制以防范风险、合规经营为出发点，各项业务流程体现“内控优先”要求。

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

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

1、监督依据

托管人严格按照有关政策法规、以及基金合同、托管协议等进行监督。监督依据具体包括：

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

2、监督内容

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

3、监督方法

(1) 资产托管部设置核算监督岗位，配备相应的业务人员，在授权范围内独立行使对基金管理人投资交易行为的监督职责，规范基金运作，维护基金投资

人的合法权益，不受任何外界力量的干预；

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

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

4、监督结果的处理方式

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

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

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

第五部分 相关服务机构

一、基金销售机构

1、直销机构

（1）前海联合基金网上交易平台

交易网站：www.qlhfund.com

客服电话：400-640-0099

（2）前海联合基金直销交易平台

直销机构：新疆前海联合基金管理有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐经济技术开发区维泰南路1号维泰大厦1506室

法定代表人：王晓耕

办公地址：深圳市宝安区兴业路1100号金利通大厦(前海人寿金融中心)T2
栋33层

电话：0755-82785257

传真：0755-82788000

客服电话：440-640-0099

联系人：余伟维

2、其他基金销售机构

（1）兴业银行股份有限公司

注册地址：福州市湖东路154号中山大厦

办公地址：上海市浦东新区银城路167号

法定代表人：陶以平（代为履行法定代表人职权）

电话：021-52629999

传真：021-62159217

联系人：蔡宣铭

网址：<https://www.cib.com.cn>

（2）珠海盈米基金销售有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼 b1201-1203

法定代表人：肖雯

电话：020-89629099

传真：020-89629011

客服电话：020-89629066

联系人：王宇昕

网址：www.yingmi.cn

(3) 深圳众禄金融控股股份有限公司

住所：深圳市罗湖区笋岗街道笋西社区梨园路 8 号 HALO 广场一期四层 12-13 室

办公地址：深圳市罗湖区笋岗街道笋西社区梨园路 8 号 HALO 广场一期四层 12-13 室

法定代表人：薛峰

电话：0755-33227950

传真：0755-33227951

客服电话：4006-788-887

联系人：龚江江

网址：www.jjmmw.com

(4) 深圳前海凯恩斯基金销售有限公司

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

办公地址：深圳市福田区福华路 355 号岗厦皇庭中心 8 楼 DE（凯恩斯）

法定代表人：高锋

电话：0755-82880158

传真：0755-83655518

联系人：付燚杰

(5) 武汉市伯嘉基金销售有限公司

住所：武汉市江汉区台北一路 17-19 号环亚大厦 B 座 601 室

办公地址：武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际 SOHO 城（一期）第七

幢 23 层 1 号 4 号

法定代表人：陶捷

联系人：陈玲

电话：027-87006009-8015

传真：027-87006010

（6）奕丰基金销售有限公司

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

办公地址：深圳市南山区海德三道航天科技广场 A 座 17 楼 1704 室

法定代表人：TEO WEE HOWE

联系人：叶健

电话：0755-89460500

传真：0755-21674453

（7）嘉实财富管理有限公司

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

办公地址：北京市朝阳区建国路 91 号金地中心 A 座 6 层

法定代表人：赵学军

联系人：李雯

电话：010-60842306

传真：010-85712195

传真：021-52975270

（8）国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址：深圳市红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人：何如

电话：0755-82130833-701266

传真：0755-82133952

联系人：李颖

网址：<http://www.guosen.cm.cn>

（9）喜鹊财富基金销售有限公司

注册地址：西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦 1513 室

办公地址：西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦 1513 室

法定代表人：陈皓

电话：4006997719

传真：010-88371180

联系人：张萌

网址：www.xiquefund.com

（10）上海陆金所基金销售有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号西裙楼

法定代表人：王之光

电话：021-20665952

传真：021-22066653

客服电话：400-866-6618

联系人：程晨

网址：www.lu.com

（11）北京唐鼎耀华基金销售有限公司

注册地址：北京市延庆县延庆经济开发区百泉街 10 号 2 栋 236 室

办公地址：北京市朝阳区东三环北路 38 号院 1 号泰康金融中心 38 层

法定代表人：张冠宇

电话：010-85870662

传真：010-59200800

客服电话：400-819-9858

联系人：王国壮

网址：www.datangwealth.com

（12）北京虹点基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区工人体育场北路甲 2 号裙房 2 层 222 单元

办公地址：北京市朝阳区工人体育场北路甲 2 号裙房 2 层 222 单元

法定代表人：郑毓栋

电话：010-56580660

传真：010-56580666

客服电话：400-618-0707

联系人：王重阳

网址：www.hongdianfund.com

（13）一路财富（北京）信息科技有限公司

注册地址：北京市西城区阜成门大街 2 号万通新世界广场 A 座 2208

办公地址：北京市西城区阜成门大街 2 号万通新世界广场 A 座 2208

法定代表人：吴雪秀

电话：88312877

传真：88312877

客户服务电话：400-001-1566

联系人：董宣

网址：www.yilucaifu.com

（14）北京恒天明泽基金销售有限公司

注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 39 号第一上海中心 C 座 6 层

法定代表人：周斌

电话：010-58845312

传真：010-58845306

联系人：张敏

客户服务电话：400-898-0618

网址：www.chtfund.com

（15）深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006#

办公地址：北京市西城区宣武门外大街 28 号富卓大厦 A 座 7 层

法定代表人：洪弘

电话：010-83363101

传真：010-83363072

联系人：文雯

公司网站：www.new-rand.cn

（16）北京汇成基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村大街11号11层1108

办公地址：北京市海淀区中关村大街11号11层1108

法定代表人：王伟刚

电话：010-56282140

传真：010-62680827

联系人：王骁骁

网址：www.fundzone.cn

（17）和讯信息科技有限公司

注册地址：北京市朝阳区朝外大街22号1002室

办公地址：北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层

法定代表人：王莉

电话：010-85650628

传真：010-65884788

联系人：陈慧

网址：www.hexun.com

（18）北京晟视天下基金销售有限公司

住所：北京市怀柔区九渡河镇黄坎村735号03室

办公地址：北京市朝阳区朝外大街甲六号万通中心D座21层&28层

法定代表人：蒋煜

联系人：徐晓荣

电话：010-58170876

传真：010-58170800

（19）济安财富(北京)基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区太阳宫中路16号院1号楼3层307

办公地址：北京市朝阳区东三环中路7号北京财富中心A座46层

法定代表人：杨健

联系人：李海燕

电话：010-65309516

传真：010-65330699

(20) 天津万家财富资产管理有限公司

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

办公地址：北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦5层

法定代表人：张军

联系人：王茜蕊

电话：18511290872

传真：010-59013707

(21) 北京蛋卷基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507

办公地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院望京SOHO塔3A座19层

法定代表人：钟斐斐

联系人：袁永姣

电话：15011386983

(22) 北京植信基金销售有限公司

注册地址：北京市密云县兴盛南路8号院2号楼106室-67

办公地址：北京市朝阳区惠河南路盛世龙源10号

法定代表人：于龙

电话：010-56075718

传真：010-67767615

联系人：张喆

网址：<https://www.zhixin-inv.com>

(23) 阳光人寿保险股份有限公司

注册地址：海南省三亚市迎宾路360-1号三亚阳光金融广场16层

办公地址：北京市朝阳区朝阳门外大街乙 12 号院 1 号昆泰国际大厦 12 层

法定代表人：李科

联系人：王超

电话：010-59053660

传真：010-59053700

客服电话：010-59053660

网址：<http://fund.sinosig.com/>

（24）民商基金销售(上海)有限公司

注册地址：上海黄浦区北京东路 666 号 H 区（东座）6 楼 A31 室

办公地址：上海市浦东新区张杨路 707 号生命人寿大厦 32 楼

法定代表人：贲惠琴

联系人：林志枫

电话：021-50206002

传真：021-50206001

（25）蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路 969 号 3 幢 5 层 599 室

办公地址：浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路 969 号 3 幢 5 层 599 室

法定代表人：祖国明

联系人：韩爱彬

客服电话：4000-766-123

公司网址：www.fund123.cn

（26）北京新浪仓石基金销售有限公司

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

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

法定代表人：李昭琛

联系人：李唯

客服电话：86-010-62675369

公司网址：<http://www.xincai.com/>

(27) 北京肯特瑞基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区西三旗建材城中路 12 号 17 号平房 157

办公地址：北京市通州区亦庄经济技术开发区科创十一街 18 号院京东集团
总部 A 座 15 层

法定代表人：王苏宁

电话：95118

传真：010-89189566

客服热线：95118

公司网站：kenterui.jd.com

联系人：邢锦超

(28) 浙江同花顺基金销售有限公司

办公地址：杭州市余杭区五常街道同顺街 18 号同花顺大楼

邮政编码：310000

法定代表人：凌顺平

联系人：洪宏

电话：0571-88911818-8554

传真：0571-86800423

客服电话：952555

网址：<http://fund.10jqka.com.cn/>

(29) 上海天天基金销售有限公司

办公地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

法定代表人：其实

电话:021-54509998

传真:021-64385308

联系人：兰薇

网址：fund.eastmoney.com

(30) 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

办公地址：上海市杨浦区长阳路 1687 号 2 号楼

法定代表人：汪静波

电话：021-80359115

传真：021-80359611

客服电话：400-821-5399

联系人：李娟

网址：www.noah-fund.com

（31）上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号

办公地址：上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903~906 室

法定代表人：杨文斌

电话：021-20613999

传真：021-68596919

客服电话：4007-006-665

联系人：高媛

网址：www.ehowbuy.com

（32）上海万得基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

办公地址：上海市浦东新区福山路 33 号 8 楼

法定代表人：王廷富

电话：021-51327185

传真：021-50710161

联系人：徐亚丹

（33）中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市东城区朝内大街 188 号

法定代表人：王常青

电话：010-85156310

传真：010-65182261

联系人：刘芸

网址：<http://www.csc108.com>

（34）恒泰证券股份有限公司

注册地址：内蒙古呼和浩特赛罕区敕勒川大街东方君座 D 座

办公地址：内蒙古呼和浩特赛罕区敕勒川大街东方君座 D 座

法定代表人：庞介民

电话：0471-4972675

联系人：熊丽

网址：<http://www.cnht.com.cn/>

（35）上海利得基金销售有限公司

注册地址：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室

办公地址：上海市浦东新区峨山路 91 弄 61 号陆家嘴软件园 10 号楼 12 楼

法定代表人：李兴春

电话：021-61101685

传真：021-50583633

联系人：徐亮

网址：www.leadfound.com.cn

（36）上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市东方路 1267 号金融服务广场 2 期

法定代表人：张跃伟

联系人：党敏

电话：021-2069-1935

（37）招商证券股份有限公司

住所：深圳市益田路江苏大厦 38-46 层

办公地址：深圳市益田路江苏大厦 38-46 层

法定代表人：霍达

联系人：黄婵君

电话：0755-82960167

（38）中国银河证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

办公地址：深圳市益田路江苏大厦 38-46 层

法定代表人：陈共炎

联系人：辛国政

电话：010-83574507

传真：010-83574807

（39）平安证券股份有限公司

住所：深圳市福田区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

办公地址：深圳市福田区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

法定代表人：曹实凡

联系人：王超

电话：021-38631117

传真：021-58991896

（40）中泰证券股份有限公司

住所：济南市市中区经七路 86 号

办公地址：济南市市中区经七路 86 号

法定代表人：李玮

联系人：许曼华

电话：021-20315290

传真：0531-68889095

（41）上海联泰资产管理有限公司

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

办公地址：上海市长宁区福泉北路 518 号 8 号楼 3 层

法定代表人：燕斌

联系人：兰敏

电话：021-52822063

传真：021-52975270

（42）上海基煜基金销售有限公司

注册地址：上海市崇明县长兴镇潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室（上海泰和经济发展区）

办公地址：上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 1503 室

法定代表人：王翔

联系人：居晓菲

电话：021-6537-0077*249

传真：021-5508-5991

（43）安信证券股份有限公司

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

办公地址：深圳市福田区深南大道 2008 号中国凤凰大厦 1 号楼 9 层

法定代表人：王连志

电话：0755-82558323

传真：0755-82558166

联系人：刘志斌

网址：www.essence.com

（44）上海挖财基金销售有限公司

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

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

法定代表人：冷飞

联系人：曾芸

电话：021-50810687

传真：021-58300279

网址：www.wacai.com

（45）上海攀赢基金销售有限公司

注册地址：上海市闸北区广中西路 1207 号 306 室

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴银城中路 488 号太平金融大厦 603 室

法定代表人：田为奇

联系人：吴卫东

电话： 021-68889082

传真： 021-68889283

网址： www.pytz.cn

（46）上海有鱼基金销售有限公司

注册地址： 中国(上海)自由贸易试验区浦东大道 2123 号 3 层 3E-2655 室

办公地址： 上海市徐汇区桂平路 391 号 B 座 19 层

法定代表人： 林琼

电话： 021-60907378

传真： 021-60907397

联系人： 黄志鹏

网址： www.youyufund.com

（47）联储证券有限责任公司

住所：深圳市福田区福田街道岗厦社区深南大道南侧金地中心大厦 9 楼

办公地址：北京市朝阳区安定路 5 号院 3 号楼中建财富国际中心 27 层联储
证券

法定代表人：吕春卫

联系人：张婉婷

客服电话：400-620-6868

联系人电话：010-86499427

联系人邮箱：zhangwanting@lczq.com

传真：010-86499401

网址：www.lczq.com

（48）江苏汇林保大基金销售有限公司

注册地址：南京市高淳区经济开发区古檀大道 47 号

办公地址：江苏省南京市鼓楼区中山北路 105 号中环国际 1413 室

法定代表人：吴言林

电话：025-66046166 转 837

传真：025-56663409

联系人：孙平

客户服务热线：025-66046166

（49）东方财富证券股份有限公司

注册地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号金座东方财富大厦

法定代表人：陈宏

联系人：付佳

客服电话：9535

公司网址：<http://www.18.cn>

（50）大连网金基金销售有限公司

注册地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号诺德大厦 2 层 202 室

办公地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号诺德大厦 2 层 202 室

法定代表人：樊怀东

电话：0411-39027810

传真：0411-39027835

客户服务热线：4000-899-100

联系人：于秀

网址：<http://www.yibaijin.com/>

（51）华瑞保险销售有限公司

注册地址：上海市嘉定区南翔镇众仁路 399 号运通星财富广场 1 号楼 B 座

13、14 层

办公地址：上海市嘉定区南翔镇众仁路 399 号运通星财富广场 1 号楼 B 座

13、14 层

法定代表人：路昊

联系电话：021-68595717

联系人：杨雅风

网址：www.huaruisales.com

（52）南京苏宁基金销售有限公司

注册地址：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

办公地址：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

法定代表人：王锋

联系电话：025-66996699-887226

联系人：王锋

网址：jinrong.suning.com

（53）北京度小满基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区西北旺东路10号院西区4号楼1层103室

法定代表人：葛新

办公地址：北京市海淀区西北旺东路10号院西区4号楼

机构联系人：孙博超

联系人电话：010-59403028

联系人传真：010-59403027

客户服务电话：95055-4

公司网址：www.baiyingfund.com

（54）申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路989号45层

办公地址：上海市徐汇区长乐路989号40层

法定代表人：李梅

电话：021-3338825233388229

传真：021-33388224

联系人：胡馨文 李玉婷

网址：www.swhysc.com

（55）申万宏源西部证券有限公司

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

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

法定代表人：韩志谦

电话：021-33388252

传真：0991-2301927

联系人：胡馨文

网址：www.hysec.com

网址：<http://www.cnht.com.cn/>

（56）山西证券股份有限公司

住所：山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

办公地址：山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

法定代表人：侯巍

联系人：韩笑

电话：0351—8686659

传真：0351—8686619

（57）东北证券股份有限公司

注册地址：长春市自由大路 1138 号

办公地址：长春市自由大路 1138 号

法定代表人：李福春

电话：0431-85096517

传真：0431-85096795

联系人：安岩岩

客户服务电话:4006-000-686

网址：www.nesc.cn

（58）深圳富济财富管理有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路 3088 号中洲大厦 3203A
单元

办公地址：深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路 3088 号中洲大厦 3203A
单元

法定代表人：刘鹏宇

电话：0755-83999907

传真：0755-83999926

联系人：刘勇

客服电话：0755-83999913

（59）深圳前海财厚基金销售有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室

办公地址：深圳市南山区深圳湾科技生态园三区11栋A座3608室

法定代表人：杨艳平

电话：0755-22676026

传真：0755-26640652

联系人：叶见云

网址：www.caiho.cn

（60）深圳盈信基金销售有限公司

注册地址：深圳市福田区莲花街道商报东路英龙商务大厦8楼A-1(811-812)

办公地址：辽宁省大连市中山区海军广场街道人民东路52号民生金融中心
22楼

法定代表人：苗宏升

电话：0411-62623081

传真：0411-62623236

联系人：王清臣

网址：www.fundying.com

基金管理人可根据有关法律法规的要求，变更、调整本基金的销售机构，并在基金管理人网站公示。

二、登记机构

机构名称：新疆前海联合基金管理有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐经济技术开发区维泰南路1号维泰大厦1506室

法定代表人：王晓耕

办公地址：深圳市宝安区兴业路1100号金利通大厦(前海人寿金融中心)T2
栋33层

电话：0755-25129526

传真：0755-82789277

客服电话：400-640-0099

联系人：陈艳

三、律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

注册地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：俞卫锋

联系人：陈颖华

经办律师：黎明、陈颖华

电话：021-31358666

传真：021-31358600

四、会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼

办公地址：上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼

执行事务合伙人：李丹

电话：021-23238888

传真：021-23238800

联系人：李隐煜

经办注册会计师：薛竞、李隐煜

第六部分 基金份额的募集

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》、《基金合同》及其它法律法规的有关规定募集，经 2018 年 12 月 5 日中国证监会证监许可【2018】2023 号文《关于准予新疆前海联合科技先锋混合型证券投资基金注册的批复》注册募集，经 2019 年 7 月 18 日中国证监会机构部函【2019】1806 号文《关于新疆前海联合科技先锋混合型证券投资基金延期募集备案的回函》延期募集。本基金自 2019 年 7 月 22 日起开始发售，每份基金份额的发售面值为 1.00 元人民币。截至 2019 年 8 月 9 日募集结束，共募集份额 255,785,197.33 份，有效认购户数为 3008 户。

第七部分 基金合同的生效

根据相关规定，本基金满足基金合同生效条件，基金合同已于 2019 年 8 月 14 日正式生效。本基金为契约型开放式基金，基金存续期间为不定期。自基金合同生效之日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

第八部分 基金份额的申购和赎回

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中列明或见基金管理人网站披露的基金销售机构名录。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。

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

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

2、申购、赎回开始日及业务办理时间

本基金于2019年9月12日开始办理日常申购、赎回业务。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资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，视为下一开放日的申购、赎回或转换申请。

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，基金销售机构另有规定的，以基金销售机构的规定为准；

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。

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，投资人交付申购款项，申购成立；登记机构确认基金份额时，申购生效。申购采用全额缴款方式，若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功，若申购不成功或无效，申购款项将退回投资者账户。

基金份额持有人在提交赎回申请时，赎回成立；登记机构确认赎回时，赎回生效。投资人赎回申请成功后，基金管理人将在 T+7 日（包括该日）内支付赎回款项。在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。如遇证券、期货交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行交换系统故障或其他非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响了业务流程，则赎回款项划付时间相应顺延。

3、申购和赎回申请的确认

基金管理人或基金管理人委托的登记机构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（包括该日）内对该交易的有效性进行确认。T 日提交的有效申请，投资人应在 T+2 日后（包括该日）及时到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功或无效，则申购款项本金退还给投资人。

销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表该申请一定生效，而仅代表销售机构已经接收到申购、赎回申请。申购与赎回的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资人应及时查询。因投资者怠于查询，致使其相关权益受损的，基金管理人、基金托管人、基金销售机构不承担由此造成的损失或不利

后果。

基金管理人可以在不违反法律法规的前提下，对上述业务办理时间进行调整，并依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

五、申购和赎回的数量限制

1、通过基金管理人网上交易平台（目前仅对个人投资者开通）或其他销售机构首次和追加申购本基金份额的，每个基金账户单笔最低申购金额为 1 元人民币（含申购费）；通过基金管理人直销柜台首次申购本基金份额的，每个基金账户单笔最低申购金额为 5 万元人民币（含申购费）。直销柜台追加申购本基金份额的单笔最低金额为 5 万元人民币（含申购费）。销售机构另有规定的，从其规定。投资者可将其全部或部分基金份额赎回。本基金对每个投资人每个基金交易账户的最低基金份额余额不设限制，对单个投资人累计持有的基金份额不设上限，但单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的 50%（在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过 50%的除外）。

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

基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。具体见基金管理人相关公告。

3、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额、赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

六、申购和赎回的价格、费用及其用途

1、申购费用

本基金 A 类基金份额的申购费用由 A 类基金份额的基金申购人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用。

本基金 A 类基金份额在申购时收取申购费用，C 类基金份额不收取申购费用。

本基金 A 类基金份额的申购费率如下：

申购金额（M）	申购费率
---------	------

M < 100 万元	1.50%
100 万元 ≤ M < 500 万元	1.00%
500 万元 ≤ M	按笔收取，每笔 1000 元

备注：M 为基金申购金额（含申购费）。

2、赎回费用

本基金的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。

（1）本基金 A 类基金份额的赎回费率如下：

持有期限（N）	赎回费率
N < 7 日	1.50%
7 日 ≤ N < 30 日	0.75%
30 日 ≤ N < 1 年	0.50%
N ≥ 1 年	0%

备注：N 为基金持有期限。

对于持续持有 A 类基金份额少于 30 日的投资人收取的赎回费，将全额计入基金财产；对持续持有 A 类基金份额长于或等于 30 日但少于 3 个月的投资人收取的赎回费的 75% 计入基金财产；对持续持有 A 类基金份额长于或等于 3 个月但少于 6 个月的投资人收取的赎回费的 50% 计入基金财产；对持续持有 A 类基金份额长于或等于 6 个月的投资人收取的赎回费的 25% 归入基金财产。未计入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。

备注：针对持有期限而言，3 个月指 90 日，6 个月指 180 日，1 年指 365 日。

（2）本基金 C 类基金份额的赎回费率如下：

持有期限（N）	赎回费率
N < 7 日	1.50%
7 日 ≤ N < 30 日	0.50%
30 日 ≤ N	0

备注：N 为基金持有期限。对于持续持有 C 类基金份额少于 30 日的投资人收取的赎回费，将全额计入基金财产。未计入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。

3、基金管理人可以在《基金合同》约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

4、当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规及监管部门、自律组织的规定。具体见基金管理人届时的相关公告。

5、在不损害投资者利益的前提下基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对基金投资者定期和不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，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赎回费率，并在指定媒介上进行公告。

七、申购份额和赎回金额的计算及处理方式

1、申购采用金额申购的方式。

1) 对于申购本基金 A 类基金份额的投资人，申购份额的计算公式为：

申购费用采用比例费率时：

净申购金额=申购金额/（1+申购费率）

申购费用=申购金额-净申购金额

申购份额=净申购金额/申购当日 A 类基金份额净值

申购费用采用固定金额时：

申购费用=固定金额

净申购金额=申购金额-申购费用

申购份额=净申购金额/申购当日 A 类基金份额净值

例：某投资者投资 10 万元申购本基金 A 类基金份额，对应费率为 1.50%，假设申购当日 A 类基金份额净值为 1.0150 元，则其可得到的申购份额为：

净申购金额=100,000.00/（1+1.50%）=98,522.17 元

申购费用=100,000.00-98,522.17=1,477.83 元

申购份额=98,522.17/1.0150=97,066.18 份

即投资者投资 10 万元申购本基金 A 类基金份额，假设申购当日 A 类基金份额净值为 1.0150 元，则可得到 97,066.18 份 A 类基金份额。

2) 对于申购本基金 C 类基金份额的投资人，申购份额的计算公式为：

申购份额=申购金额/申购当日 C 类基金份额净值

例：某投资者投资 50,000 元申购本基金的 C 类基金份额，假设申购当日 C 类基金份额净值为 1.0160 元，则可得到的申购份额为：

申购份额=50,000.00/1.0160=49,212.60 份

即投资者投资 50,000 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 1.0160 元，则可得到 49,212.60 份 C 类基金份额。

2、赎回金额的计算及余额处理方式

本基金采用“份额赎回”方式，赎回金额以赎回当日的该类基金份额净值为基准进行计算，计算公式：

赎回总金额=赎回份额×赎回当日该类基金份额净值

赎回费用=赎回总金额×赎回费率

净赎回金额=赎回总金额-赎回费用

1) 例：某投资人赎回本基金 10,000.00 份 A 类基金份额，持有时间为六个月，对应的赎回费率为 0.50%，假设赎回当日 A 类基金份额净值是 1.2500 元，则其可得到的赎回金额为：

赎回总金额=10,000.00×1.2500=12,500.00 元

赎回费用=12,500.00×0.50%=62.50 元

净赎回金额=12,500.00-62.50=12,437.50 元

即：投资者赎回本基金 10,000 份 A 类基金份额，持有期限为六个月，假设赎回当日 A 类基金份额净值是 1.2500 元，则其可得到的赎回金额为 12,437.50 元。

2) 例：某投资者赎回本基金 10,000.00 份 C 类基金份额，持有时间为 20 天，适用的赎回费率为 0.50%，假设赎回当日 C 类基金份额净值是 1.0500 元，则其可得到的赎回金额为：

赎回总金额=10,000.00×1.0500=10,500.00 元

赎回费用=10,500.00×0.50%=52.50 元

赎回金额=10,500.00-52.50=10,447.50 元

即：投资者赎回本基金 10,000.00 份 C 类基金份额，持有时间为 20 天，假设赎回当日 C 类基金份额净值是 1.0500 元，则其可得到的赎回金额为 10,447.50

元。

3、基金份额净值的计算

本基金各个基金份额类别单独设置基金代码，各类份额分别计算和公告基金份额净值。T日的基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日（包括该日）内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。本基金各类基金份额净值的计算，保留到小数点后4位，小数点后第5位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

4、申购份额、余额的处理方式

本基金申购采用金额申购的方式。申购A/C类基金份额的有效份额为净申购金额除以当日的A/C类基金份额净值，有效份额单位为份，申购份额按四舍五入方法，保留到小数点后2位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。本基金A类基金份额在申购时收取申购费用，C类基金份额不收取申购费用。A类基金份额申购费用由投资人承担，不列入基金财产。

5、赎回金额的处理方式

赎回金额为按实际确认的A/C类基金份额的有效赎回份额乘以当日A/C类基金份额净值为基准并扣除相应的费用，计算结果保留到小数点后2位，小数点后2位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

八、申购和赎回的登记

（一）投资人T日申购基金成功后，基金登记机构在T+1日为投资人增加权益并办理登记手续，投资人自T+2日（含该日）起有权赎回该部分基金份额。

（二）投资人赎回基金成功后，基金登记机构在T+1日为投资人扣除权益并办理相应的登记手续。

（三）基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述登记办理时间进行调整，但不得实质影响投资人的合法权益，并最迟于开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

九、拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

- 1、因不可抗力导致基金无法正常运作。
- 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，或发生其他损害现有基金份额持有人利益的情形。

6、接受单笔申购后，金额达到基金管理人所设定的本基金总规模、单日净申购比例的上限。

7、单一账户单日累计申购金额/净申购金额达到基金管理人所设定的上限。

8、单笔申购金额达到基金管理人所设定的上限。

9、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或基金登记系统或基金会计系统无法正常运行时。

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

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

12、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第 1、2、3、5、9、11、12 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全部或部分拒绝的，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

十、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受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、继续接受赎回申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益。

5、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

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

7、法律法规规定或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基金份额持有人的赎回申请或者延缓支付赎回款项时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停赎回公告。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，未兑付部分由基金管理人按照发生的情况制定相应的处理办法在后续开放日予以兑付，并以该类基金份额净值为依据计算赎回金额。若出现上述第 5 项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

十一、巨额赎回的情形及处理方式

1、巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过前一开放日的基金总份额的 10%，即认为是发生了巨额赎回。

2、巨额赎回的处理方式

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部分延期赎回。

(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) 部分延期赎回：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，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的 10%

的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日的赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日该类基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

（3）暂停赎回：连续 2 个开放日以上(含本数)发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒介上进行公告。

（4）本基金发生巨额赎回的，在单个基金份额持有人超过上一工作日基金总份额 30%以上的大额赎回申请情形下，如果基金管理人认为支付全部投资人的赎回申请有困难或认为因支付全部投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人可以延期办理赎回申请。对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。具体分为两种情况：

①如果基金管理人认为有能力支付其他投资人的全部赎回申请，为了保护其他赎回投资人的利益，对于其他投资人的赎回申请按正常程序进行。对于单个投资人超过上一工作日基金总份额 30%以上的大额赎回申请，基金管理人在剩余支付能力范围内对其按比例确认当日受理的赎回份额，未确认的赎回部分作自动延期处理。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的该类基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时选择取消赎回的，则当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。

②如果基金管理人认为仅支付其他投资人的赎回申请也有困难时，则对于所有投资人的赎回申请(包括单个投资人超过上一工作日基金总份额 30%以上的大额赎回申请和其他投资人的赎回申请)，基金管理人在当日接受赎回比例不低于

上一工作日基金总份额的 30%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的该类基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。

3、巨额赎回的公告

当发生上述延期赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个工作日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，并在两日内在指定媒介上刊登公告。

十二、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

1、发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人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 个开放日各类基金份额净值。

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，依照《信息披露办法》的有关规定，最迟于重新开放日在指定媒介上刊登重新开放申购或赎回的公告；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，届时不再另行发布重新开放的公告。暂停结束，基金管理人按上述规定公告最近 1 个开放日各类基金份额净值。

十三、基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理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。

十四、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。

十五、基金的转托管

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

十六、定期定额投资计划

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

十七、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。

十八、基金份额的转让

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

十九、实施侧袋机制期间本基金的申购与赎回

本基金实施侧袋机制的，本基金的申购和赎回安排详见本招募说明书“侧袋机制”章节或届时发布的相关公告。

二十、其他业务

在相关法律法规允许的条件下，基金登记机构可依据其业务规则，受理基金

份额质押等业务，并收取一定的手续费用。

第九部分 基金的投资

一、投资目标

通过精选投资于科技先锋主题相关证券，深入研究并积极投资与科技先锋主题相关的优质上市公司，分享其发展和成长的机会，在合理控制风险并保持基金资产良好流动性的前提下，力求获取超额收益与长期资本增值。

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、存托凭证）、权证、债券（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债、证券公司短期公司债、中小企业私募债券、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超级短期融资券等）、债券回购、银行存款、货币市场工具、资产支持证券、国债期货、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的比例为 60%-80%，投资于科技先锋主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。国债期货、股指期货、权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

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，其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。

三、投资策略

本基金将采取主动的类别资产配置策略，注重风险与收益的平衡。本基金将精选具有较高投资价值的股票和债券，力求实现基金资产的长期稳定增长。

1、资产配置策略

本基金通过定性与定量相结合的方法分析宏观经济和证券市场发展趋势，对证券市场当期的系统性风险以及可预见的未来时期内各大类资产的预期风险和

预期收益率进行分析评估，并据此制定本基金在股票、债券、现金等资产之间的配置比例、调整原则和调整范围，在保持总体风险水平相对稳定的基础上，力争投资组合的稳定增值。此外，本基金将持续地进行定期与不定期的资产配置风险监控，适时地做出相应的调整。

2、股票投资策略

本基金将精选有良好增值潜力的、与科技先锋主题相关的上市公司股票构建股票投资组合。股票投资策略将从定性和定量两方面入手，定性方面主要考察上市公司所属行业发展前景、行业地位、竞争优势、管理团队、创新能力等多种因素；定量方面主要考察公司估值、资产质量及财务状况，比较分析各优质上市公司的估值、成长及财务指标，优先选择具有相对比较优势的公司作为最终股票投资对象。

（1）科技先锋主题相关股票的界定

我国已将科技创新作为重要的国家战略，摆在了国家发展全局的重要核心位置。科技进步与创新成为经济社会发展的首要推动力量，因此掌握尖端技术、在产业链中占据优势地位的行业或企业将具备极强的价值增长潜力和社会影响力。

本基金所指的“科技先锋”为我国领先的核心科学和技术，本基金投资于处于核心科技前沿并对未来科技发展具有积极引领作用的科技先锋主题上市公司股票。主要分为两类：一类是处于科技前沿，掌握核心技术，以科技创新为成长动力且发展空间巨大的行业和公司；另一类是传统行业中通过信息技术、生物科技、高端制造等技术对原有业务进行升级优化、提供新服务的创新型优质企业。

根据本基金的投资目标与投资理念，与“科技先锋”相关的主题行业包括：信息技术、通讯技术、电子制造、机械制造、航天军工、国防军工、新能源、新材料、生物科技、海洋工程、节能环保、智能家居、汽车、核电、智能电网、高端制造、医疗保健等。

（2）个股投资策略

本基金在积极进行主题、行业配置的基础上，通过定量筛选和定性分析相结合的方式考察和筛选具有综合性比较优势的品种。

①定量筛选

针对本基金提及的两类科技先锋主题企业，分别有各自的定量筛选方法。

对于第一类，处于科技前沿，掌握核心技术，以科技创新为成长动力且发展

空间巨大的行业和公司；利用定量数据分析体系初步筛选出值得深入研究的个股。该数据分析体系针对各细分门类均有专门的财务数据对应和外部数据验证体系，并包含多维度验证与评价财务健康程度的方法，同时包含具有业务前瞻性的数量指标。

对于第二类，传统行业中通过信息技术、生物科技、高端制造等技术对原有业务进行升级优化、提供新服务的创新型优质企业。对于传统行业中的创新型的企业，由于其主体还是传统行业部分，首先利用分析传统行业所使用的定量数据分析体系选出财务健康的企业，其次选出在盈利指标、经营效率指标上和同行有比较优势的企业；综合判断是否是由科技创新带来的比较优势。对于处于传统行业的企业，若其开拓了创新业务，则采用针对第一类科技行业公司的研究方法。

②定性研究

在定量初选的基础上，定性方面主要考虑公司在资源、技术、品牌方面的核心竞争力，公司的发展布局和战略的合理性和可行性，公司企业文化、治理结构，公司管理层的领导能力和执行能力等。

最后，结合定量筛选结果、定性研究、实地调研，筛选出行业增长空间广阔、发展布局合理、基本面健康、最具比较优势的个股作为本基金的核心投资标的，进行重点投资。

3、债券投资策略

本基金在债券投资方面，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

本基金在进行权证投资时，将通过对权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型寻求其合理估值水平，主要考虑运用的策略包括：价值挖掘策略、杠杆策略、获利保护策略、价差策略、双向权证策略、买入保护性的认沽权证策略、卖空保护性的认购权证策略等。

基金管理人将充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征，通过资产配置、品种与类属选择，谨慎进行投资，追求较稳定的当期收益。

5、中小企业私募债券投资策略

本基金将通过对中小企业私募债券进行信用评级控制，通过对投资单只中小企业私募债券的比例限制，严格控制风险，对投资单只中小企业私募债券而引起组合整体的利率风险敞口和信用风险敞口变化进行风险评估，并充分考虑单只中小企业私募债券对基金资产流动性造成的影响，通过信用研究和流动性管理后，决定投资品种。

基金投资中小企业私募债券，基金管理人将根据审慎原则，制定严格的投资决策流程、风险控制制度和信用风险、流动性风险处置预案，以防范信用风险、流动性风险等各种风险。

6、股指期货投资策略

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，以回避市场风险。故股指期货空头的合约价值主要与股票组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理股指期货合约数量，以萃取相应股票组合的超额收益。

7、国债期货投资策略

本基金投资国债期货，将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征，在风险可控的前提下，适度参与国债期货投资。

8、资产支持证券投资策略

本基金将通过宏观经济、提前偿还率、资产池结构及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，预测资产池未来现金流变化；研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响，同时密切关注流动性对标的证券收益率的影响。综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后的收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

9、存托凭证投资策略

本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。

四、投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金投资股票等权益类资产占基金资产的比例为 60%–80%，投资于科技先锋主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的 80%；

（2）本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债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，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等；

（3）本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；

（4）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；

（5）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

（6）本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

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

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

（9）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

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

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

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

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

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

(15) 本基金参与股指期货交易，须遵循以下投资比例限制：

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

3) 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%；

4) 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约定；

(16) 本基金参与国债期货交易，须遵循以下投资比例限制：

1) 在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的 15%；

2) 在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%；

3) 所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定；

4) 在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债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 30%；

(17) 本基金参与股指期货或国债期货交易，在任何交易日日终，持有的买入股指期货和国债期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%。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；

(18) 本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

(19) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的 15%。因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之

外的因素致使基金不符合前述所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

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

（21）本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行；

（22）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。除第（2）、（12）、（19）、（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。法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

法律、行政法规或监管部门取消或调整上述投资组合比例限制，如适用于本基金，基金管理人可按照取消或调整后的规定修改基金合同，无需经基金份额持有人大会审议。

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）买卖其他基金份额，但是法律法规或中国证监会另有规定的除外；
- （5）向其基金管理人、基金托管人出资；
- （6）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；
- （7）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

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

3、关联交易原则

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的同意，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。

五、业绩比较基准

本基金业绩比较基准为：中证新兴产业指数收益率×70%+中债综合全价指数收益率×30%。

中证新兴产业指数是由沪深市场中规模大、流动性好的 100 家新兴产业公司组成，以综合反映沪深市场中新兴产业的整体表现。其行业分布契合本基金的投资范围且行业权重比较均衡。因此，中证新兴产业指数是衡量本基金股票投资业绩的理想标准。中债综合全价指数能够较好的反映债券市场变动的全貌，适合作为本基金债券投资的比较基准。

如果今后法律法规发生变化，或指数编制单位停止编制该指数、更改指数名称，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时，基金管理人经和基金托管人协商一致并履行相关程序后，可以变更本基金业绩比较基准，报中国证监会备案并及时公告。

六、风险收益特征

本基金为混合型证券投资基金，长期平均风险与预期收益率高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。

七、基金管理人代表基金行使相关权利的处理原则及方法

- 1、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；
- 2、有利于基金资产的安全与增值；
- 3、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东或债权人权利，保护基金份额持有人的利益；
- 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、侧袋机制的实施和投资运作安排

当基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，根据最大限度保护基金份额持有人利益的原则，基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制，无需召开基金份额持有人大会审议。

侧袋机制实施期间，本部分约定的投资组合比例、投资策略、组合限制、业绩比较基准、风险收益特征等约定仅适用于主袋账户。

侧袋账户的实施条件、实施程序、运作安排、投资安排、特定资产的处置变现和支付等对投资者权益有重大影响的事项详见本招募说明书“侧袋机制”章节的规定。

九、基金投资组合报告

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。基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。本投资组合报告所载数据截至 2020 年 3 月 31 日，本报告中所列财务数据未经审计。

1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	43,937,334.47	76.63
	其中：股票	43,937,334.47	76.63
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,424,441.60	5.97
	其中：债券	3,424,441.60	5.97
	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	8,564,919.65	14.94
8	其他资产	1,412,973.72	2.46
9	合计	57,339,669.44	100.00

2、报告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	-	-
C	制造业	25,972,521.51	46.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	19,147.31	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,481,863.00	27.92
J	金融业	1,375,424.68	2.48
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	32,133.97	0.06
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	1,056,244.00	1.90
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	43,937,334.47	79.24

(2) 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未通过港股通机制投资港股。

3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明

细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688111	金山办公	20,274	4,551,513.00	8.21
2	600588	用友网络	80,000	3,236,800.00	5.84
3	300567	精测电子	45,000	2,358,900.00	4.25
4	300760	迈瑞医疗	9,000	2,355,300.00	4.25
5	300601	康泰生物	20,000	2,292,000.00	4.13
6	000063	中兴通讯	50,000	2,140,000.00	3.86
7	300003	乐普医疗	59,078	2,139,805.16	3.86
8	300628	亿联网络	25,000	2,039,250.00	3.68
9	000977	浪潮信息	50,000	1,939,000.00	3.50

10	002410	广联达	45,000	1,920,150.00	3.46
----	--------	-----	--------	--------------	------

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	3,424,441.60	6.18
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,424,441.60	6.18

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明

细

序号	债券代码	债券名称	数量	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	128088	深南转债	14,000	2,080,960.00	3.75
2	123041	东财转 2	10,020	1,343,481.60	2.42

注：本基金本报告期末仅持有以上债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

（1）报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

（2）本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

（1）本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

（2）报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

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

本基金本报告期内未投资国债期货。

11、投资组合报告附注

（1）本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

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

（2）基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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	106,207.60
2	应收证券清算款	890,692.11
3	应收股利	-
4	应收利息	5,079.68
5	应收申购款	410,994.33
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,412,973.72

（4）报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

（5）报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

（6）投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

第十部分 基金的业绩

基金业绩截止日为 2020 年 3 月 31 日。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。下述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

前海联合科技先锋混合 A

阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
2019 年 8 月 14 日（基金 合同生效日） 至 2019 年 12 月 31 日	4.35%	0.36%	13.53%	0.74%	-9.18%	-0.38%
自基金合同 生效以来至 2020 年 3 月 31 日	13.53%	1.54%	12.30%	1.17%	1.23%	0.37%

前海联合科技先锋混合 C

阶段	净值增 长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
2019 年 8 月 14 日（基金 合同生效日） 至 2019 年 12 月 31 日	4.12%	0.36%	13.53%	0.74%	-9.41%	-0.38%
自基金合同 生效以来至 2020 年 3 月 31 日	13.16%	1.54%	12.30%	1.17%	0.86%	0.37%

第十一部分 基金的财产

一、基金资产总值

基金资产总值是指购买的各类证券及票据价值、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和。

二、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

三、基金财产的账户

基金托管人根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立资金账户、证券账户、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。

第十二部分 基金资产估值

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、存托凭证、权证、债券、股指期货合约、国债期货合约和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

三、估值方法

1、证券交易所上市的有价证券的估值

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

(2) 交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（基金合同另有规定的除外），在估值日采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

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

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

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

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

(3) 流通受限的股票，包括非公开发行股票、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。

3、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，在估值日采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。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债券，按成本估值。

4、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

5、中小企业私募债券，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。

6、股指期货合约的估值方法

(1) 股指期货合约一般以估值当日结算价格进行估值，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；

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

(3) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

7、国债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。

8、本基金投资存托凭证的估值核算，依照境内上市交易的股票执行。

9、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。

10、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。

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

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

根据有关法律法规，基金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信息的计算结果对外予以公布。

四、估值程序

1、各类基金份额净值是按照每个工作日闭市后，各类基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人于每个工作日计算基金资产净值、各类基金份额净值及各类基金份额累计净值，并按规定公告。如遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值，但基金管理人根据法律法规或基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将各类基金份额净值信息发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人依据基金合同和相关法律法规的规定对外公布。

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。当基金份额净值小数点后 4 位以内（含第 4 位）发生估值错误时，视为基金份额净值错误。

基金合同的当事人应按照以下约定处理：

1、估值错误类型

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

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

2、估值错误处理原则

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

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

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

（4）估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

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

4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

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

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

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

(4) 前述内容如法律法规或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、当特定资产占前一估值日基金资产净值 50% 以上的，经与基金托管人协商一致的，基金管理人应当暂停估值；

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、各类基金份额净值和各类基金份额累计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、各类基金份额净值和各类基金份额累计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，由基金管理人依据基金合同和相关法律法规的规定对基金净值信息予以公布。

八、实施侧袋机制期间的基金资产估值

本基金实施侧袋机制的，应根据本部分的约定对主袋账户资产进行估值并披露主袋账户的基金资产净值和份额净值，暂停披露侧袋账户的基金净值信息。

九、特殊情形的处理

1、基金管理人、基金托管人按估值方法的第9项、股指期货合约估值方法第（2）项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理；

2、由于证券、期货交易所、证券经纪机构、期货公司及登记结算公司发送的数据错误，或由于其他不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，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、基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

第十三部分 基金的收益与分配

一、基金利润的构成

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

二、基金可供分配利润

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

三、基金收益分配原则

1、由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同；

2、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对应类别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；

如投资者在不同销售机构选择的分红方式不同，基金登记机构将以投资者最后一次选择的分红方式为准；

3、基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；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；

4、同一类别每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规、基金合同的约定以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金管理人可调整基金收益的分配原则和支付方式，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。

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对应类别的基金份额。红利再投资的计算方法，依照登记机构相关业务规则执行。

七、实施侧袋机制期间的收益分配

本基金实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配，详见本招募说明书“侧袋机制”章节的规定。

第十四部分 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、C类基金份额的销售服务费；
- 4、《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、基金的证券、期货账户开户费用、银行账户维护费用；
- 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。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

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

二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

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。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划拨指令，基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。如遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划拨指令，基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。如遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

3、C 类基金份额的销售服务费

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 0.40%。本基金销售服务费将专门用于本基金份额销售与基金份额持有人服务。

销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.40% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为前一日 C 类基金份额的基金资产净值

C 类销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划拨指令，基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构。如遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

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（包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用）；

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、费用调整

根据相关法律法规及中国证监会的有关规定，基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金发展情况并履行适当程序后调整基金管理费率、基金托管费率、销售服务费等相关费率。

调整基金管理费率和基金托管费率或提高销售服务费，须召开基金份额持有人大会审议；调低销售服务费率等费率，无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前在中国证监会指定媒介公告。

五、实施侧袋机制期间的基金费用

本基金实施侧袋机制的，与侧袋账户有关的费用可以从侧袋账户中列支，但应待侧袋账户资产变现后方可列支，有关费用可酌情收取或减免，但不得收取管理费，详见本招募说明书“侧袋机制”章节或相关公告。

六、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。

第十五部分 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披露；
- 3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
- 4、会计制度执行国家有关会计制度；
- 5、本基金独立建账、独立核算；
- 6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；
- 7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

二、基金的年度审计

- 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的具有证券、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。

第十六部分 基金的信息披露

一、本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《基金合同》及其他有关规定。

二、信息披露义务人

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人及其日常机构（如有）等法律、行政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、准确性和完整性、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的全国性报刊（以下简称“指定报刊”）及指定互联网网站（以下简称“指定网站”）等媒介披露，并保证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：

（一）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，并登载在指定网站及基金销售机构网站或营业网点；基金产品资料概要其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金产品资料概要。

基金募集申请经中国证监会注册后，基金管理人应当在基金份额发售的三日前，将基金份额发售公告、基金招募说明书提示性公告和基金合同提示性公告登载在指定报刊上，将基金份额发售公告、基金招募说明书、基金产品资料概要、基金合同和基金托管协议登载在指定网站上，并将基金产品资料概要登载在基金销售机构网站或营业网点；基金托管人应当同时将基金合同、基金托管协议登载在指定网站上。

（二）基金份额发售公告

基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在基金份额发售的三日前登载在指定媒介上。

（三）《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报刊和指定网站上登载《基金合同》生效公告。

（四）基金净值信息

《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周在指定网站披露一次各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回后，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的基金份额净值和基金份额累计净值。

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

（五）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。

（六）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。

报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额 20% 的情形，为保障其他投资者利益，基金管理人应当至少在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告文件中“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者

的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本基金的特有风险。

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

（七）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、基金合并；
- 4、更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；
- 5、基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；
- 6、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- 7、基金管理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；
- 8、基金募集期延长或提前结束募集；
- 9、基金管理人的高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；
- 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、涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或者仲裁；
- 12、基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；

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

14、基金收益分配事项；

15、管理费、托管费、C类基金份额的销售服务费、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、基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；

17、本基金开始办理申购、赎回；

18、本基金发生巨额赎回并延期办理；

19、本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；

20、本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；

21、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；

22、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；

23、调整基金份额类别设置；

24、本基金推出新业务或服务；

25、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。

（八）澄清公告

在《基金合同》存续期限内，任何公共媒介中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动，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。

（九）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。

（十）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。

（十一）基金投资中小企业私募债券的信息披露

基金管理人应当在本基金投资中小企业私募债券后 2 日内,在中国证监会指定媒介披露所投资中小企业私募债券的名称、数量、期限、收益率等信息。

基金管理人应当在本基金季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露中小企业私募债券的投资情况。

（十二）基金投资股指期货的信息披露

基金管理人应当在基金季度报告、基金中期报告、基金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等。

（十三）基金投资国债期货的信息披露

基金管理人应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露国债期货交易情况,包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等,并充分揭示国债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。

（十四）基金投资资产支持证券信息披露

基金管理人在年度报告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。

（十五）投资流通受限证券的相关公告

基金管理公司应在基金投资非公开发行股票后两日内,在中国证监会指定媒介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。

（十六）实施侧袋机制期间的信息披露

本基金实施侧袋机制的,相关信息披露义务人应当根据法律法规、基金合同和招募说明书的规定进行信息披露,详见本招募说明书“侧袋机制”章节的规定。

（十七）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。

基金管理人、基金托管人应加强对未公开披露基金信息的管控，并建立基金敏感信息知情人登记制度。基金管理人、基金托管人及相关从业人员不得泄露未公开披露的基金信息。

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、各类基金份额的基金份额净值、各类基金份额的累计净值、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，并向基金管理人进行书面或电子确认。

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各自住所，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、不可抗力；
- 2、基金投资所涉及的证券、期货市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 3、发生基金合同约定的暂停估值的情形；
- 4、法律法规、基金合同或中国证监会规定的情况。

第十七部分 侧袋机制

一、侧袋机制的实施条件、实施程序

当基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，根据最大限度保护基金份额持有人利益的原则，基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制，无需召开基金份额持有人大会。

基金管理人应当在启用侧袋机制当日报中国证监会及公司所在地中国证监会派出机构备案。侧袋机制启用后，基金管理人应及时向基金销售机构提示侧袋机制启用的相关事宜。

启用侧袋机制当日，本基金登记机构以基金份额持有人的原有账户份额为基础，确认基金份额持有人的相应侧袋账户份额。

二、侧袋机制实施期间的基金运作安排

（一）基金份额的申购与赎回

1、对于启用侧袋机制当日收到的赎回申请，基金管理人仅办理主袋账户的赎回申请并支付赎回款项。在启用侧袋机制当日收到的申购申请，视为投资者对侧袋机制启用后的主袋账户提交的申购申请。基金管理人应依法向投资者进行充分披露。

2、实施侧袋机制期间，基金管理人不得办理侧袋账户份额的申购、赎回和转换；同时，基金管理人按照基金合同和招募说明书的约定办理主袋账户份额的赎回，并根据主袋账户运作情况确定是否暂停申购。

3、除基金管理人应按照主袋账户的份额净值办理主袋账户份额的申购和赎回外，本招募说明书“基金份额的申购与赎回”部分的申购、赎回规定适用于主袋账户份额。巨额赎回按照单个开放日内主袋账户份额净赎回申请超过前一开放日主袋账户总份额的10%认定。

（二）基金的投资

侧袋机制实施期间，招募说明书“基金的投资”部分约定的投资组合比例、投资策略、组合限制、业绩比较基准、风险收益特征等约定仅适用于主袋账户。

基金管理人计算各项投资运作指标和基金业绩指标应当以主袋账户资产为基准。

基金管理人原则上应当在侧袋机制启用后 20 个交易日内完成对主袋账户投资组合的调整，但因资产流动性受限等中国证监会规定的情形除外。

基金管理人不得在侧袋账户中进行除特定资产处置变现以外的其他投资操作。

（三）基金的费用

1、侧袋机制实施期间，侧袋账户资产不收取管理费。

2、与处置侧袋账户资产相关的费用可从侧袋账户中列支，但应待侧袋账户资产变现后方可列支。因启用侧袋机制产生的咨询、审计费用等由基金管理人承担。

（四）基金的收益分配

侧袋机制实施期间，在主袋账户份额满足基金合同收益分配条件的情形下，基金管理人可对主袋账户份额进行收益分配。侧袋账户不进行收益分配。

（五）基金的信息披露

1、基金净值信息

基金管理人应按照招募说明书“基金的信息披露”部分规定的基金净值信息披露方式和频率披露主袋账户的基金份额净值和基金份额累计净值。实施侧袋机制期间，本基金管理人暂停披露侧袋账户的基金份额净值和基金份额累计净值。

2、定期报告

侧袋机制实施期间，基金定期报告中的基金会计报表仅需针对主袋账户进行编制。侧袋账户相关信息在定期报告中单独进行披露，包括但不限于：

- （1）侧袋账户的基金代码、基金名称、侧袋账户成立日期等基本信息；
- （2）侧袋账户的初始资产、初始负债；
- （3）特定资产的名称、代码、发行人等基本信息；
- （4）报告期内的特定资产处置进展情况、与处置特定资产相关的费用情况及其他与特定资产状况相关的信息；
- （5）可根据特定资产处置进展情况披露特定资产的可变现净值或净值参考区间，并注明其不作为特定资产最终变现价格的承诺；
- （6）可能对投资者利益存在重大影响的其他情况及相关风险提示。

3、临时报告

基金管理人在启用侧袋机制、处置特定资产、终止侧袋机制以及发生其他可能对投资者利益产生重大影响的事项后应及时发布临时公告。其中，启用和终止侧袋机制后，还应披露会计师事务所出具的专项审计意见。

启用侧袋机制的临时公告内容应当包括启用原因及程序、特定资产流动性和估值情况、对投资者申购赎回的影响、风险提示等重要信息。

处置特定资产的临时公告内容应当包括特定资产处置价格和时间、向侧袋账户份额持有人支付款项的情况、相关费用发生情况等重要信息。

（六）特定资产的处置变现和支付

当侧袋账户资产恢复流动性后，基金管理人应当按照基金份额持有人利益最大化原则制定变现方案，将侧袋账户资产处置变现。无论侧袋账户资产是否全部完成变现，基金管理人都应及时向侧袋账户全部份额持有人支付已变现部分对应的款项。

侧袋账户资产完全清算后，基金管理人应注销侧袋账户。基金所有侧袋账户注销后，应取消主袋账户份额名称中的特殊标识。

（七）侧袋的审计

基金管理人应当在启用侧袋机制时，就特定资产认定的相关事宜取得符合《证券法》规定的会计师事务所的专业意见。

侧袋机制启用后五个工作日内，基金管理人应聘请于侧袋机制启用日发表意见的会计师事务所针对侧袋机制启用日该基金持有的特定资产情况出具专项审计意见，内容应包含侧袋账户的初始资产、份额、净资产等信息。会计师事务所对基金年度报告进行审计时，应对报告期间基金侧袋机制运行相关的会计核算和年报披露，执行适当程序并发表审计意见。

当侧袋账户资产全部完成变现后，基金管理人应参照基金清算报告的相关要求，聘请符合《证券法》规定的会计师事务所对侧袋账户进行审计并披露专项审计意见。

三、本部分关于侧袋机制的相关规定，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履行适当程序后，在对基金份额持有人利益无实质

性不利影响的前提下，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。

第十八部分 风险揭示

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。

基金分为股票基金、混合基金、债券基金、货币市场基金等不同类型，投资人投资不同类型的基金将获得不同的收益预期，也将承担不同程度的风险。本基金为混合型证券投资基金，长期平均风险与收益率高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。

投资人应当充分了解基金定期定额投资和零存整取等储蓄方式的区别。定期定额投资是引导投资人进行长期投资、平均投资成本的一种简单易行的投资方式。但是定期定额投资并不能规避基金投资所固有的风险，不能保证投资人获得收益，也不是替代储蓄的等效理财方式。

投资人应当认真阅读本基金《基金合同》、《招募说明书》、基金产品资料概要等基金法律文件，了解本基金的风险收益特征，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断本基金是否和投资人的风险承受能力相适应。

投资人应当通过本基金管理人或其他销售机构购买和赎回基金，基金销售机构名单详见本基金的招募说明书以及基金管理人网站揭示的基金销售机构名录。

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，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益；本基金管理人管理的其他基金的业绩不构成对本基金业绩表现的保证。

基金管理人提醒投资人在作出投资决策后，须了解并自行承担以下风险：

一、市场风险

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

1、政策风险。因国家宏观政策（如货币政策、财政政策、行业政策、地区发展政策等）发生变化，导致市场价格波动而产生风险。

2、经济周期风险。随经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化，从而引起债券价格波动，收益水平也会随之变化，从而产生风险。

3、利率风险。金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着债券的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。利率风险是债券投资所面临的主要风险。

4、信用风险。债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下降的风险，信用风险也包括证券交易对手因违约而产生的证券交割风险。

5、购买力风险。基金投资的收益可能因为通货膨胀的影响而导致购买力下降，从而使基金的实际收益下降。

6、再投资风险。再投资风险反映了利率下降对固定收益证券利息收入再投资时的收益率的影响。具体为当利率下降时，基金从投资的固定收益证券所得的利息收入进行再投资时，将获得较以前低的收益率。

二、流动性风险

（1）基金申购、赎回安排

本基金的申购、赎回安排详见本招募说明书“第八部分 基金份额的申购和赎回”章节。

（2）本基金拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券。且本基金投资于本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的 15%。本基金的基金资产流动性较好。

（3）巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过前一开放日的基金总份额的 10%，即认为是发生了巨额赎回。具体措施详见本招募说明书“第八部分基金份额的申购和赎回”中“十一、巨额赎回的情形及处理方式”。

（4）实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响
基金管理人经与基金托管人协商，在确保投资者得到公平对待的前提下，可

依照法律法规及基金合同的约定，综合运用各类流动性风险管理工具，作为特定情况下基金管理人流动性风险管理的辅助措施，包括但不限于延期办理巨额赎回申请、暂停接受赎回申请、延缓支付赎回款项、收取短期赎回费、暂停基金估值、摆动定价以及中国证监会认可的其他措施。同时基金管理人应时刻防范可能产生的流动性风险，对流动性风险进行日常监控，保护持有人的利益。当实施备用的流动性风险管理工具时，有可能无法按照合同约定的时限支付赎回款项。

在本基金的开放日，基金管理人有权接受投资者的申购和赎回。基金投资组合中的股票和债券会因各种原因面临较高的流动性风险，使证券交易的执行难度提高，买入成本或变现成本增加。此外，基金投资者的赎回需求可能造成基金仓位调整和资产变现困难，加剧流动性风险。基金管理人并不保证完全避免此类风险的发生但本基金将通过一系列风险控制指标加强对流动性风险的跟踪、防范和控制，努力去克服流动性风险。

（5）实施侧袋机制对投资者的影响

侧袋机制是一种流动性风险管理工具，是将特定资产分离至专门的侧袋账户进行处置清算，并以处置变现后的款项向基金份额持有人进行支付，目的在于有效隔离并化解风险。但基金启用侧袋机制后，侧袋账户份额将停止披露基金份额净值，并不得办理申购、赎回和转换，仅主袋账户份额正常开放赎回，因此启用侧袋机制时持有基金份额的持有人将在启用侧袋机制后同时持有主袋账户份额和侧袋账户份额，侧袋账户份额不能赎回，其对应特定资产的变现时间具有不确定性，最终变现价格也具有不确定性并且有可能大幅低于启用侧袋机制时的特定资产的估值，基金份额持有人可能因此面临损失。

实施侧袋机制期间，因本基金不披露侧袋账户份额的净值，即便基金管理人在基金定期报告中披露报告期末特定资产可变现净值或净值区间的，也不作为特定资产最终变现价格的承诺，因此对于特定资产的公允价值和最终变现价格，基金管理人不承担任何保证和承诺的责任。

基金管理人将根据主袋账户运作情况合理确定申购政策，因此实施侧袋机制后主袋账户份额存在暂停申购的可能。

启用侧袋机制后，基金管理人计算各项投资运作指标和基金业绩指标时仅需考虑主袋账户资产，基金业绩指标应当以主袋账户资产为基准，因此本基金披露

的业绩指标不能反映特定资产的真实价值及变化情况。

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和对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平。

2、基金管理人和基金托管人的管理水平、管理手段和管理技术等因素的变化也会影响基金收益水平。

四、操作和技术风险

基金的相关当事人在各业务环节的操作过程中，可能因内部控制不到位或者人为因素造成操作失误或违反操作规程而引致风险，如越权违规交易、内幕交易、交易错误和欺诈等。

此外，在基金的后台运作中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行甚至导致基金份额持有人利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理人、基金托管人、登记机构、销售机构、证券交易所和证券登记结算机构等。

五、合规性风险

指基金管理或运作过程中，违反国家法律、法规的规定，或者基金投资违反法规及《基金合同》有关规定的风险。

六、本基金特有风险

1、本基金为混合型基金，股票投资比例为60%-80%，相对较高的股票持仓比例容易造成收益波动率大幅提升的风险。

2、中小企业私募债风险

本基金投资中小企业私募债，中小企业私募债是根据相关法律法规由非上市中小企业采用非公开方式发行的债券。由于不能公开交易，一般情况下，交易不活跃，潜在较大流动性风险。当发债主体信用质量恶化时，受市场流动性所限，本基金可能无法卖出所持有的中小企业私募债，由此可能给基金净值带来更大的负面影响和损失。

3、投资资产支持证券的风险

本基金投资资产支持证券，资产支持证券是一种债券性质的金融工具。资产支持证券的风险主要包括资产风险及证券化风险。资产风险源于资产本身，包括

价格波动风险、流动性风险等。证券化风险主要表现为信用评级风险、法律风险等。

4、投资国债期货的风险

本基金可投资于国债期货，国债期货作为一种金融衍生品，具备一些特有的风险点。投资国债期货主要存在以下风险：

（1）市场风险：是指由于国债期货价格变动而给投资者带来的风险。

（2）流动性风险：是指由于国债期货合约无法及时变现所带来的风险。

（3）基差风险：是指国债期货合约价格和指数价格之间的价格差的波动所造成的风险，以及不同国债期货合约价格之间价格差的波动所造成的期现价差风险。

（4）保证金风险：是指由于无法及时筹措资金满足建立或者维持国债期货合约头寸所要求的保证金而带来的风险。

（5）信用风险：是指期货经纪公司违约而产生损失的风险。

（6）操作风险：是指由于内部流程的不完善，业务人员出现差错或者疏漏，或者系统出现故障等原因造成损失的风险。

5、投资股指期货的风险

本基金使用股指期货作为风险对冲工具，股指期货交易采用保证金交易制度，由于保证金交易具有杠杆性，存在潜在损失可能成倍放大的风险。

6、投资证券公司短期公司债券的风险

本基金的投资范围包括证券公司短期公司债券，由于证券公司短期公司债券非公开发行和交易，且限制投资者数量上限，潜在流动性风险相对较大。若发行主体信用质量恶化或投资者大量赎回需要变现资产时，受流动性所限，本基金可能无法卖出所持有的证券公司短期公司债券，由此可能给基金净值带来不利影响或损失。

7、投资流通受限证券的风险

（1）参与上市公司非公开发行股票可能面临最短 12 个月的锁定期，即在最短 12 个月的期限内，本基金持有的非公开发行股票不能转让变现。受证券市场不可控因素的影响，本基金投资的非公开发行股票在可流通后可能发生亏损的风险。

(2) 如果估值日非公开发行有明确锁定期的股票的初始成本低于在证券交易所上市交易的同一股票的市价，本基金基金份额净值可能由于估值方法的原因偏离所持有股票的收盘价所对应的净值。

(3) 由于非公开发行股票缺乏流动性，当市场波动导致本基金被动超过合同规定的投资比例时，管理人只能在锁定期结束后进行相应调整。

8、投资存托凭证的风险

本基金可投资存托凭证，如果投资，可能面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与中国存托凭证发行机制相关的风险，包括存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险；存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险；存托协议自动约束存托凭证持有人的风险；因地上市造成存托凭证价格差异以及波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；存托凭证退市的风险；已在境外上市的基础证券发行人，在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险；境内外证券交易机制、法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险。

七、本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险

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

八、其他风险

- 1、在符合本基金投资理念的新型投资工具出现和发展后，如果投资于这些工具，基金可能会面临一些特殊的风险；
- 2、因技术因素而产生的风险，如计算机系统不可靠产生的风险；
- 3、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；

4、因人为因素而产生的风险，如内幕交易、欺诈行为等产生的风险；

5、对主要业务人员如基金经理的依赖可能产生的风险；

6、战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金资产的损失，影响基金收益水平，从而带来风险；

7、其他意外导致的风险。

第十九部分 基金合同的变更、终止和基金财产的清算

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表决通过生效后方可执行，并自生效之日起依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

二、《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接；
- 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 个工作日内成立基金财产清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券、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财产；
- (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，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。

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。

第二十部分 基金合同的内容摘要

一、基金合同当事人的权利、义务

（一）基金管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

（1）依法募集资金；

（2）自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；

（3）依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；

（4）销售基金份额；

（5）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、法规规定决定基金收益的分配方案；

（11）在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；

（12）依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

（13）在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；

（14）以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

（15）选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商、期货经纪机构

或其他为基金提供服务的外部机构；

（16）在符合有关法律法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换和非交易过户等业务规则；

（17）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

（1）依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构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条件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。

（二）基金托管人的权利与义务

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

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

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

（3）监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人违反《基金合同》及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

（4）根据相关市场规则，为基金开设资金账户、证券账户、期货账户及投资所需其他账户，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。

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

（1）以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

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

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

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

（5）保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

（6）按规定开设基金财产的资金账户、证券账户、期货账户和投资所需其他账户，按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

(7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；

(8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、各类基金份额净值、各类基金份额累计净值、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》的规定进行；如果基金管理人未执行《基金合同》规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

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

(12) 建立并保存基金份额持有人名册；

(13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

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

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

(16) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；

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

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

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

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

(21) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(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。

（三）基金份额持有人的权利与义务

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

除法律法规另有规定或基金合同另有约定外，同一类别内每份基金份额具有同等的合法权益。

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

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

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

- （1）认真阅读并遵守《基金合同》、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）遵守基金管理人、基金托管人、销售机构和登记机构的相关交易及业务规则；

（10）提供基金管理人和监管机构依法要求提供的信息，以及不时的更新和补充，并保证其真实性；

（11）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由全体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。除法律法规另有规定或基金合同另有约定外，基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

本基金份额持有人大会未设日常机构。在符合相关法律法规规定及基金合同的约定的前提下，履行相应程序后可增设日常机构。

（一）召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会，法律法规、中国证监会和基金合同另有规定的除外：

（1）修改《基金合同》的重要内容或终止《基金合同》；

（2）更换基金管理人；

（3）更换基金托管人；

（4）转换基金运作方式；

（5）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，但根据法律法规要求调整该等报酬标准或提高销售服务费的除外；

（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、基金合同的约定的情况下，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）对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，调低基金销售服务费；

（2）法律法规要求增加的基金费用的收取；

（3）对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，调整本基金的申购费率、调低赎回费率、变更收费方式、调整本基金的基金份额类别的设置；

（4）因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；

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

（6）对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人、销售机构、登记机构调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则；

（7）对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金推出新业务或服务；

（8）按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

（二）会议召集人及召集方式

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

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。

3、基金份额持有人大会未设立日常机构的，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、基金份额持有人大会未设立日常机构的，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、基金份额持有人大会设立日常机构的，基金管理人、基金托管人或者代表基金份额 10% 以上的基金份额持有人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向该日常机构提出书面提议。

该日常机构应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金管理人、基金托管人和提出提议的基金份额持有人代表。该日常机构决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；该日常机构决定不召集，基金管理人、基金托管人或者代表基金份额 10% 以上的基金份额持有人仍认为有必要召开的，按照未设立日常机构的相关规定执行。

6、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，而基金份额持有人大会的日常机构、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，基金份额持有人大会日常机构、基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

7、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。

（三）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）、授权方式（包括但不限于纸质授权、电话授权、短信授权及网络授权方式等）、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、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表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。

（四）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或通讯开会方式等法律法规或监管机构允许的其他方式召开，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。会议的召开方式由会议召集人确定。

1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托证明委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或基金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书符合法律法规、《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）。

参加基金份额持有人大会的基金份额持有人的基金份额低于上述规定比例的，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（含三分之一）基金份额的基金份额持有人参加，方可召开。

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会议通知载明的形式在表决截至日以前送达至召集人指定的地址或系统。

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表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取表决意见的，不影响表决效力；

（3）本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的，基金份额持有人所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）；

参加基金份额持有人大会的基金份额持有人的基金份额低于上述规定比例的，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（含三分之一）基金份额的基金份额持有人参加，方可召开；

(4) 上述第(3)项中直接出具表决意见的基金份额持有人或受托代表他人出具表决意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具表决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、在法律法规和监管机关允许的情况下，本基金的基金份额持有人亦可采用网络、电话、短信等其他非书面方式向其授权代表进行授权，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

4、在会议召开方式上，本基金亦可采用网络、电话、短信等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。表决方式上，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，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中载明。

(五) 议事内容与程序

1、议事内容及提案权

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

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

2、议事程序

(1) 现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第(七)条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的二分之一以上（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。

（六）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。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》、本基金与其他基金合并以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

基金份额持有人大会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。

（七）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和代理人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

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

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

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

2、通讯开会

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

(八) 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依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。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。

基金份额持有人大会日常机构、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

基金份额持有人大会日常机构、全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。

（九）实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定

若本基金实施侧袋机制，则相关基金份额或表决权的比例指主袋份额持有人和侧袋份额持有人分别持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例，但若相关基金份额持有人大会召集和审议事项不涉及侧袋账户的，则仅指主袋份额持有人持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例：

1、基金份额持有人行使提议权、召集权、提名权所需单独或合计代表相关基金份额 10%以上（含 10%）；

2、现场开会的到会者在权益登记日代表的基金份额不少于本基金在权益登记日相关基金份额的二分之一（含二分之一）；

3、通讯开会的直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日相关基金份额的二分之一（含二分之一）；

4、当参与基金份额持有人大会投票的基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日相关基金份额的二分之一，召集人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的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）相关基金份额的持有人参与或授权他人参与基金份额持有人大会投票；

5、现场开会由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人；

6、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；

7、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。

侧袋机制实施期间，基金份额持有人大会审议事项涉及主袋账户和侧袋账户的，应分别由主袋账户、侧袋账户的基金份额持有人进行表决，同一主侧袋账户内的每份基金份额具有平等的表决权。表决事项未涉及侧袋账户的，侧袋账户份

额无表决权。

侧袋机制实施期间，关于基金份额持有人大会的相关规定以本节特殊约定内容为准，本节没有规定的适用上文相关约定。

（十）本部分关于基金份额持有人大会的召开事由、召开条件、议事程序和表决条件等内容，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，基金管理人提前公告后，可直接对该部分内容进行修改或调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

三、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

（一）《基金合同》的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本基金合同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表决通过生效后方可执行，并自生效之日起依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

（二）《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接；
- 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 个工作日内成立基金财产清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券、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财产；
- (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，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。

(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。

四、争议解决方式

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争

议，如经友好协商未能解决的，应提交华南国际经济贸易仲裁委员会，根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为深圳市，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，仲裁费由败诉方承担。

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

《基金合同》受中国法律管辖。

五、基金合同存放地和投资者取得合同的方式

《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。

第二十一部分 基金托管协议的内容摘要

一、托管协议当事人

1、基金管理人

名称：新疆前海联合基金管理有限公司

住所：新疆乌鲁木齐经济技术开发区维泰南路1号维泰大厦1506室

法定代表人：王晓耕

成立时间：2015年8月7日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监许可【2015】1842号

注册资本：20000万元人民币

组织形式：其他有限责任公司

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

存续期间：持续经营

联系电话：0755-23695990

传真：0755-82788000

联系人：张绍东

2、基金托管人

名称：上海浦东发展银行股份有限公司

住所：上海市中山东一路12号

法定代表人：郑杨

成立时间：1992年10月19日

基金托管业务资格批准机关：中国证监会

基金托管业务资格文号：中国证监会证监基金字[2003]105号

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币293.52亿元人民币

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和《基金合同》的约定，对下述基金投资范围、投资对象进行监督。

本基金将投资于以下金融工具：

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、存托凭证）、权证、债券（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债、证券公司短期公司债、中小企业私募债券、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超级短期融资券等）、债券回购、银行存款、货币市场工具、资产支持证券、国债期货、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

（2）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投融资比例进行监督：

1）本基金股票投资占基金资产的比例为 60%-80%，其中投资于科技先锋主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。国债期货、股指期货、权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

因基金规模或市场变化等因素导致投资组合不符合上述规定的，基金管理人应在合理的期限内调整基金的投资组合，以符合上述比例限定。法律法规另有规定时，从其规定。

如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。

2）根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金投资组合遵循以下投资限制：

①本基金股票投资占基金资产的比例为 60%-80%，投资于科技先锋主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的 80%；

②本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债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，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等；

③本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；

④本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；

⑤本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

⑥本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

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

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

⑨本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

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

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

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

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

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

⑮本基金参与投资股指期货，须遵循以下投资比例限制：

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

3) 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%；

4) 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约定；

⑯本基金参与投资国债期货，须遵循以下投资比例限制：

a、在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的 15%；

b、在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%；

c、所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定；

d、在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债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 30%；

⑰本基金参与股指期货或国债期货，在任何交易日日终，持有的买入股指期货和国债期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%。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；

⑱本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%。

⑲本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的 15%。因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前述所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

⑳本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

⑲ 本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行；

⑳ 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除第②、⑫、⑰、⑱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。法律法规另有规定的，从其规定。

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

托管人对上述指标的监督义务，仅限于监督由基金管理人管理且由托管人托管的全部公募基金及基金专户产品是否符合上述比例限制。《基金法》及其他有关法律法规或监管部门取消上述限制的，履行适当程序后，基金不受上述限制。

除投资资产配置外，基金托管人对基金投资的监督和检查自本托管协议生效之日起开始。

（3）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投资禁止行为进行监督：

根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金禁止从事下列行为：

- 1) 承销证券；
- 2) 违反规定向他人贷款或提供担保；
- 3) 从事承担无限责任的投资；
- 4) 买卖其他基金份额，但法律法规或中国证监会另有规定的除外；
- 5) 向其基金管理人、基金托管人出资。

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

（4）基金托管人依据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定对于基金关联投资限制进行监督。

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其他重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当遵循基金份额持有人利益优先的原则，防范利益冲突，

符合国务院证券监督管理机构的规定，并履行信息披露义务。

如法律法规或《基金合同》有关于基金禁止从事关联交易的规定，基金管理人和基金托管人应相互提供与本机构有控股关系的股东或与本机构有其他重大利害关系的公司名单及其更新，并加盖业务章并书面提交，确保关联交易名单真实、完整、全面。基金管理人有责任保管关联交易名单，名单变更后基金管理人应及时发送基金托管人。如果基金托管人在运作中严格遵循了监督流程，基金管理人仍违规进行关联交易，并造成基金资产损失的，由基金管理人承担责任。

（5）基金托管人依据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。

① 基金托管人按以下方式对基金管理人参与银行间市场交易的交易对手的资信风险控制措施进行监督。

基金管理人向基金托管人提供其银行间债券市场交易的交易对手库，交易对手库由银行间交易会员中财务状况较好、实力雄厚、信用等级高的交易对手组成。基金管理人可以根据实际情况的变化，及时对交易对手库予以更新和调整，并及时书面通知基金托管人。基金托管人据以对基金银行间债券市场交易的交易对手是否符合上述名单进行监督。

② 基金托管人对银行间交易市场的交易方式的控制按如下约定进行监督。

基金管理人应按照审慎的风险控制原则，对银行间交易对手的资信状况进行评估，控制交易对手的资信风险，确定与各类交易对手所适用的交易结算方式，在具体的交易中，应尽力争取对基金有利的交易方式。由于交易对手资信风险引起的损失，基金托管人不承担赔偿责任。

（6）基金托管人对基金管理人选择存款银行进行监督。基金如投资银行存款，基金管理人应根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，事先确定符合条件的所有存款银行的名单，并及时提供给基金托管人，基金管理人可以根据实际情况的变化，及时对存款银行的名单予以更新和调整，并通知基金托管人。基金托管人据此对基金投资银行存款的交易对手是否符合上述名单进行监督。

基金管理人负责对存款银行的资信控制，并对投资银行存款的信用风险（包括但不限于存款银行的信用等级、存款银行的支付能力等）进行评估。

（7）基金托管人对基金投资流通受限证券的监督

如下所指“流通受限证券”与本协议以及基金合同所指“流动性受限资产”定义存在不同。流动性受限资产是指由于法律法规、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

基金管理人投资流通受限证券，应事先根据中国证监会相关规定，明确基金投资流通受限证券的比例，制订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。基金托管人对基金管理人是否遵守相关制度、流动性风险处置预案以及相关投资额度和比例等的情况进行监督。

1) 本基金投资的流通受限证券须为经中国证监会批准的非公开发行股票、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。本基金不投资有锁定期但锁定期不明确的证券。

2) 基金管理人投资非公开发行股票，应制订流动性风险处置预案并经其董事会批准。风险处置预案应包括但不限于因投资受限证券需要解决的基金投资比例限制失调、基金流动性困难以及相关损失等问题的应对解决措施，以及有关异常情况的处置。基金管理人应在首次投资流通受限证券前向基金托管人提供基金投资非公开发行股票的相关流动性风险处置预案。

3) 本基金投资非公开发行股票，基金管理人应至少于执行投资指令之前两个工作日将有关资料书面提交基金托管人，并保证向基金托管人提供的有关资料真实、准确、完整。有关资料如有调整，基金管理人应及时提供调整后的资料。上述书面资料包括但不限于：

- ① 中国证监会批准发行非公开发行股票的批准文件。
- ② 有关非公开发行股票的发行数量、发行价格、锁定期等发行资料。
- ③ 基金拟认购的数量、价格、总成本、账面价值。

④ 基金托管人应按照《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》规定，对基金管理人是否遵守法律法规进行监督，并审核基金管理人提供的有关书面信息。基金托管人认为上述资料可能导致基金出现风险的，有

权要求基金管理人在投资流通受限证券前就该风险的消除或防范措施进行补充书面说明，并保留查看基金管理人风险管理部门就基金投资流通受限证券出具的风险评估报告等资料的权利。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就上述问题达成一致，应及时上报中国证监会请求解决。基金托管人履行了本协议规定的监督职责后，不承担任何责任。

（8）基金托管人对基金投资中小企业私募债券、中期票据的监督责任仅限于依据本协议第二条第（一）款第2项对投资比例和投资限制进行事后监督；除此外，无其它监督责任。如发现异常情况，应及时以书面形式通知基金管理人。基金管理人应积极配合和协助基金托管人进行监督和核查。如因基金管理人原因导致基金出现损失的，基金托管人不承担任何责任。

基金管理人管理的基金在投资中小企业私募债、中期票据前，基金管理人须根据法律、法规、监管部门的规定，制定严格的关于投资中小企业私募债、中期票据的风险控制制度和流动性风险处置预案，管理人在此承诺将严格执行该风险控制制度和流动性风险处置预案。

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、各类基金份额净值和累计份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查。

3、当基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，根据最大限度保护基金份额持有人利益的原则，基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制，无需召开基金份额持有人大会。

侧袋机制实施期间，本部分约定的投资组合比例、投资策略、组合限制、业绩比较基准、风险收益特征等约定仅适用于主袋账户。

侧袋账户的实施条件、实施程序、运作安排、投资安排、特定资产的处置变现和支付等对投资者权益有重大影响的事项详见招募说明书的规定。

基金托管人应当依照法律法规和基金合同约定，加强对侧袋机制启用、特

定资产处置和信息披露等方面的复核和监督。不满足中国证监会规定和基金合同约定实施条件的，不得启用侧袋机制。

4、基金托管人发现基金管理人的投资运作及其他运作违反《基金法》、《基金合同》、基金托管协议有关规定时，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在下一个工作日及时核对，并以书面形式向基金托管人发出回函，进行解释或举证。

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。基金管理人收到基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

基金管理人应积极配合和协助基金托管人依照法律法规、《基金合同》和本托管协议对基金业务的监督和核查，对基金托管人发出的书面提示，必须在规定时间内答复基金托管人并改正，或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律法规、《基金合同》和本托管协议的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。

若基金托管人发现基金管理人发出但未执行的投资指令或依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反《基金合同》约定的，应当立即通知基金管理人，并报告中国证监会。基金管理人的上述违规失信行为给基金财产或基金份额持有人造成的损失，由基金管理人承担。

对于必须于估值完成后方可获知的监控指标或依据交易程序已经成交的投资指令，基金托管人发现该投资指令违反法律法规或者违反《基金合同》约定的，应当立即通知基金管理人，并报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠基金托管人根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍基金托管人进行有效监督，情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的，基金托管人应报告中国证监会。

三、基金管理人对于基金托管人的业务核查

基金管理人对于基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括但不限于基金托管人是否安全保管基金财产、是否分别开设基金财产的资金账户和证券、期货账户、是否复核基金管理人计算的基金资产净值、各类基金份额净值和

基金份额累计净值、是否根据管理人指令办理清算交收、进行相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、无故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》、本托管协议及其他有关规定时，基金管理人应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正，基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式向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。基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应立即报告中国证监会和银行业监督管理机构，同时通知基金托管人限期纠正。

基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复基金管理人并改正。

基金托管人无正当理由，拒绝、阻挠基金管理人根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍基金管理人进行有效监督，情节严重或经基金管理人提出警告仍不改正的，基金管理人应报告中国证监会。

四、基金财产保管

1、基金财产保管的原则

1) 基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。
2) 基金托管人应按本协议规定安全保管托管财产。未经基金管理人的指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何财产（托管人主动扣收的汇划费除外）。托管人不对处于自身实际控制之外的账户及财产承担责任。

3) 基金托管人按照规定为托管的基金财产开设资金账户和证券、期货账户。

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

5) 对于因基金认（申）购、基金投资过程中产生的应收财产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到

达基金托管人处的，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责任。

2、募集资金的验证

募集期内销售机构按销售与服务代理协议的约定，将认购资金划入基金管理人在具有托管资格的商业银行开设的“新疆前海联合基金管理有限公司基金认购专户”。该账户由基金管理人开立并管理。基金募集期满，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方为有效。验资完成，基金管理人应将募集的属于本基金财产的全部资金划入基金托管人为基金开立的资产托管专户中，并确保划入的资金与验资金额相一致。基金托管人收到有效认购资金当日以书面形式确认资金到账情况，并及时将资金到账凭证传真给基金管理人，双方进行账务处理。

若基金募集期限届满，未能达到《基金合同》生效的条件，由基金管理人按规定办理退款事宜。

3、基金资产托管专户的开立和管理

基金托管人以基金托管人的名义或以基金的名义在其营业机构开设资产托管专户，并根据基金管理人合法合规的有效指令办理资金收付。基金管理人应根据法律法规及托管行的相关要求，提供开户所需的资料并提供其他必要协助。本基金的资产托管专户的预留印鉴的印章由基金托管人、刻制、保管和使用。

本基金的一切货币收支活动，均需通过基金托管人或基金的资产托管专户进行。基金的资产托管专户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。除因本基金业务需要，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账户；亦不得使用以基金名义开立的银行账户进行本基金业务以外的活动。

资产托管专户的管理应符合《人民币银行结算账户管理办法》、《现金管理暂行条例》、《人民币利率管理规定》、《利率管理暂行规定》、《支付结算办法》以及银行业监督管理机构的其他有关规定。

4、基金证券账户与证券交易资金账户的开设和管理

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上海分公司/深圳分公司开立专门的证券账户。

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本基金的任何证券账户；亦不得使用本基金的任何证券账户进行本基金业务以外的活动。

基金证券账户的开立由基金托管人负责，管理和运用由基金管理人负责。

基金托管人保管证券账户卡原件。

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上海分公司/深圳分公司开立结算备付金账户，基金托管人代表所托管的基金完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级法人清算工作，基金管理人应予以积极协助。结算备付金、证券结算保证金等的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定和基金托管人为履行结算参与人的义务所制定的业务规则执行。

5、银行间市场债券托管和资金结算专户的开立和管理及市场准入备案《基金合同》生效后，在符合监管机构要求的情况下，基金管理人负责以基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表基金进行交易；基金托管人根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司、银行间市场清算所股份有限公司的有关规定，以本基金的名义分别在中央国债登记结算有限责任公司、银行间市场清算所股份有限公司开立债券托管账户和资金结算账户，并代表基金进行银行间市场债券交易的结算。基金管理人和基金托管人应共同负责完成银行间债券市场准入备案。

6、其他账户的开设和管理

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

2) 法律、法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

7、基金投资银行存款账户的开立和管理

基金投资银行定期存款，基金管理人与基金托管人应根据相关的规定，就本基金投资银行存款业务签订书面协议。

存款账户必须以基金名义开立，账户名称为基金名称，存款账户开户文件上加盖预留印鉴及基金管理人公章。

本基金投资银行存款时，基金管理人应当与存款银行签订具体存款协议，明确存款的类型、期限、利率、金额、账号、对账方式、支取方式、账户管理等细则。

为防范特殊情况下的流动性风险，定期存款协议中应当约定提前支取条款。

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

8、基金财产投资的有关实物证券、银行定期存款存单等有价凭证的保管

基金财产投资的有关实物证券由基金托管人存放于基金托管人的保管库；其中实物证券也可存入中央国债登记结算有限责任公司或中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司或票据营业中心的代保管库。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。属于基金托管人实际有效控制下的实物证券在基金托管人保管期间的损坏、灭失，由此产生的责任应由基金托管人承担。基金托管人对基金托管人以外机构实际有效控制或保管的实物证券、银行定期存款存单对应的财产不承担保管责任。

9、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应由基金托管人、基金管理人保管。除本协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时，应保证基金一方持有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人在合同签署后 5 个工作日内通过专人送达、挂号邮寄等安全方式将合同原件送达基金托管人处。合同原件应存放于基金管理人和基金托管人各自文件保管部门 15 年以上。

五、基金资产净值计算和会计核算

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。基金份额净值是指计算日基金资产净值除以该计算日基金份额总份额后的数值。基金份额净值的计算保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

每个工作日，基金管理人应对基金资产估值。估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算业务指引》及其他法律、法规的规定。基金资产净值、

各类基金份额的基金份额净值及各类基金份额累计净值，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份额净值信息并以双方认可的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以双方认可的方式发送给基金管理人，由基金管理人对外公布。

根据《基金法》，基金管理人计算并公告基金净值信息，基金托管人复核、审查基金管理人计算的基金净值信息。本基金的会计责任方是基金管理人，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，按照基金管理人对外公布的结果对外予以公布。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。

六、基金份额持有人名册的保管

基金管理人妥善保管的基金份额持有人名册，包括《基金合同》生效日、《基金合同》终止日、基金份额持有人大会权利登记日、每年6月30日、12月31日的基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容必须包括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由基金的基金登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，基金管理人应按照目前相关规则保管基金份额持有人名册。保管方式可以采用电子或文档的形式。保管期限为15年。

在基金托管人编制中期报告和年度报告前，基金管理人应将每年6月30日、12月31日的基金持有人名册送交基金托管人，文件方式可以采用电子或文档的形式并且保证其的真实、准确、完整。基金托管人应妥善保管，不得将持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途。

七、争议解决方式

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

2、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，除经友好协商可以解决的，应提交华南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，仲裁的地点为深圳市，仲裁裁决是终局性的并对相关各方均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

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》和本托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

八、基金托管协议的变更、终止

1、托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议的内容进行变更。变更后的托管协议，其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突，并需经基金管理人、基金托管人加盖公章或合同专用章以及双方法定代表人或授权代理人签字（或盖章）确认。基金托管协议的变更应报中国证监会备案。

2、基金托管协议终止的情形

发生以下情况，本托管协议终止：

- （1）《基金合同》终止；
- （2）基金托管人解散、依法被撤销、破产或有其他基金托管人接管基金资产；
- （3）基金管理人解散、依法被撤销、破产或有其他基金管理人接管基金管理权；
- （4）发生法律法规或《基金合同》规定的终止事项。

第二十二部分 对基金份额持有人的服务

基金管理人为基金份额持有人提供以下一系列的服务。基金管理人有权根据基金份额持有人的需要、市场状况以及基金管理人服务能力的变化，增加、修改以下服务项目或服务内容：

一、通知服务

基金管理人通过短信、电子邮件、邮寄信件或电话等方式按基金份额持有人意愿为基金份额持有人提供各项通知服务。通知服务内容包括账户交易确认通知、纸质账单寄送失败通知、与基金份额持有人相关的基金管理人公告及重要信息通知等服务。

二、查询与咨询服务

基金份额持有人可通过基金管理人客服热线和网站等完成查询与咨询服务。基金份额持有人可通过以上方式进行基金管理人信息查询和基金份额持有人账户信息查询。客服专员在工作时间还可为基金份额持有人提供人工查询、答疑服务。

具体查询内容：最新公告、各基金产品介绍、基金管理人介绍等基金管理人信息；基金交易信息、资产市值、基金份额净值、基金份额累计净值、基金收益分配等账户信息。

三、资料索取服务

为方便基金份额持有人办理各种直销交易手续，基金管理人网站上提供直销业务表单下载。基金份额持有人也可通过客户服务热线向客服专员索取业务表格。另外，基金管理人还可根据客户需求提供对账单、资产证明等资料。

四、互动活动

基金管理人可以为基金份额持有人定期或不定期地举办各种互动活动，以加强基金份额持有人与基金管理人之间的互动联系。

五、基金理财业务咨询

为更好地与基金份额持有人沟通，客服专员可以在工作时间内为基金份额持有人解答基金理财方面的疑问，提供关于基金理财的咨询服务。

六、投诉建议受理

如果基金份额持有人对基金管理人提供的各项服务有疑问，可通过语音留言、发送电子邮件、客服热线等方式随时向基金管理人提出。基金管理人将采用限期处理、分级管理的原则，及时处理基金份额持有人的投诉建议。

七、基金管理人客户服务中心联系方式

客户服务热线：400-640-0099；0755-88697000

人工坐席服务时间：周一至周五 8:35-11:30,13:00—17:00，法定节假日除外。

网址：www.qhlhfund.com

客服邮箱：service@qhlhfund.com

八、如本招募说明书存在任何您/贵机构无法理解的内容，请联系基金管理人客户服务热线。请确保投资前，您/贵机构已经全面理解了本招募说明书。

第二十三部分 其他应披露事项

- 1、2019年7月19日，前海联合科技先锋混合基金-托管协议
- 2、2019年7月19日，前海联合科技先锋混合基金-基金合同
- 3、2019年7月19日，前海联合科技先锋混合基金-招募说明书
- 4、2019年7月19日，前海联合科技先锋混合基金份额发售公告
- 5、2019年7月19日，前海联合科技先锋混合基金-基金合同内容摘要
- 6、2019年8月5日，关于旗下部分基金增加代理销售机构的公告
- 7、2019年8月15日，前海联合科技先锋混合基金-基金合同生效公告
- 8、2019年8月21日，关于旗下部分基金增加代理销售机构的公告
- 9、2019年8月27日，关于旗下部分基金增加代理销售机构的公告
- 10、2019年9月10日，前海联合科技先锋混合基金开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告
- 11、2019年9月20日，关于前海联合基金2019年9月20日服务器升级的提示
- 12、2019年9月21日，前海联合基金管理有限公司高级管理人员变更公告
- 13、2019年9月27日，关于前海联合科技先锋混合基金增加销售机构的公告
- 14、2019年10月18日，关于前海联合基金2019年10月18日服务器升级的提示
- 15、2019年10月28日，关于旗下部分基金新增代理销售机构的公告
- 16、2019年10月28日，关于旗下部分基金参与浙江同花顺基金销售有限公司费率优惠活动的公告
- 17、2019年10月29日，关于旗下部分基金新增代理销售机构的公告
- 18、2019年10月29日，关于旗下部分基金参与浙江同花顺基金销售有限公司费率优惠活动的公告
- 19、2019年10月29日，前海联合基金公司关于在电子直销平台对盈钱包货币基金转换非货币基金业务实施费率优惠的公告

20、2019年10月30日，关于前海联合基金网上交易平台暂停支付渠道服务的提示

21、2019年11月1日，关于前海联合基金2019年11月1日服务器升级的提示

22、2019年11月6日，前海联合科技先锋混合基金-招募说明书(更新)摘要(2019年第1号)

23、2019年11月6日，前海联合科技先锋混合基金-托管协议(信披新规修改)

24、2019年11月6日，前海联合科技先锋混合基金-招募说明书(更新)(2019年第1号)(信披新规修改)

25、2019年11月6日，前海联合科技先锋混合基金-基金合同(信披新规修改)

26、2019年11月6日，前海联合基金管理有限公司关于修订公司旗下23只基金基金合同有关条款的公告

27、2019年11月23日，前海联合基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告

28、2019年11月27日，关于前海联合基金2019年11月27日服务器升级的提示

29、2019年12月5日，关于旗下部分基金参与申万宏源证券有限公司及申万宏源西部证券有限公司费率优惠活动的公告

30、2019年12月16日，关于前海联合基金2019年12月17日服务器升级的提示

31、2020年1月13日，关于前海联合基金2020年1月14日服务器升级的提示

32、2020年1月18日，关于直销电子交易渠道替代交易方式的提示

33、2020年1月20日，前海联合科技先锋混合基金2019年第四季度报告

34、2020年1月23日，关于提醒直销网上交易系统投资者及时上传身份证件影印件并完善、更新身份信息的公告

35、2020年1月31日，前海联合基金关于在疫情防控期间可选择官网 APP 等进行线上基金业务办理的提示

36、2020年2月19日，前海联合科技先锋混合基金基金经理变更公告

37、2020年2月21日，前海联合科技先锋混合基金-招募说明书(更新)(2020年第1号)

38、2020年2月21日，前海联合科技先锋混合基金-招募说明书(更新)摘要(2020年第1号)

39、2020年3月17日，前海联合基金管理有限公司关于旗下基金所持停牌股票估值调整的公告

40、2020年3月24日，前海联合基金关于延迟披露旗下公募基金2019年年度报告的公告

41、2020年3月30日，关于前海联合基金网上交易平台暂停支付渠道服务的提示

42、2020年3月31日，关于前海联合基金暂停泰诚财富基金销售(大连)有限公司相关销售业务的公告

43、2020年4月22日，前海联合科技先锋混合基金2020年第1季度报告

44、2020年4月29日，前海联合科技先锋混合基金2019年年度报告

第二十四部分 招募说明书存放及其查阅方式

本招募说明书发布后，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各自住所，供社会公众查阅、复制。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

第二十五部分 备查文件

- 1、中国证监会准予本基金募集注册的文件；
- 2、《新疆前海联合科技先锋混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《新疆前海联合科技先锋混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、中国证监会要求的其他文件。