

富安达策略精选灵活配置混合型

证券投资基金

招募说明书（更新）

（二〇二一年第二号）

基金管理人：富安达基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

## 【重要提示】

本基金的募集申请经中国证监会2012年2月15日证监许可[2012]193号文核准。本基金的基金合同于2012年4月25日正式生效。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

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

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者根据所持有的基金份额享受基金收益，同时承担相应的投资风险。本基金投资中的风险包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券市场价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金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积极管理风险，某一基金的特定风险等。本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将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。

本基金为混合型基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金。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和基金合同，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策。

投资者应当认真阅读基金合同、招募说明书和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、资产状况等判断基金是否和投资者的风险承受能力相适应，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。投资者应当通过基金管理人或代销机构购买本基金，基金代销机构名单详见本基金份额发售公告。

基金管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。本基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来表现，基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在做

出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。

本招募说明书所载内容截止至2021年4月25日，基金投资组合报告截止至2021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 .....	22
第五部分相关服务机构 .....	27
第六部分基金的募集 .....	42
第七部分基金合同的生效 .....	43
第八部分基金份额的申购、赎回与转换 .....	44
第九部分基金的投资 .....	56
第十部分基金的业绩 .....	70
第十一部分基金的财产 .....	72
第十二部分基金资产的估值 .....	74
第十三部分基金的收益与分配 .....	81
第十四部分基金的费用与税收 .....	83
第十五部分基金的会计与审计 .....	85
第十六部分基金的信息披露 .....	86
第十七部分风险揭示 .....	92
第十八部分基金的终止与基金财产清算 .....	96
第十九部分基金合同的内容摘要 .....	98
第二十部分基金托管协议的内容摘要 .....	120
第二十一部分对基金份额持有人的服务 .....	139
第二十二部分招募说明书存放及查阅方式 .....	142
第二十三部分备查文件 .....	143

## 第一部分 绪言

《富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》（以下简称“招募说明书”或“本招募说明书”）依照《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“《运作管理办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售管理办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）和其他有关法律的规定，以及《富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”或“合同”）编写。

本招募说明书阐述了富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金的投资目标、投资理念、投资策略、风险、费率等与投资者投资决策有关的全部必要事项，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

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

富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“基金”或“本基金”）是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本招募说明书由本基金管理人解释。本基金管理人没有委托或授权任何其他人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，并经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资者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。基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

## 第二部分 释义

在本招募说明书中，除非文义另有所指，下列词语具有以下含义：

- 1、基金或本基金：指富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金
- 2、基金管理人或本基金管理人：指富安达基金管理有限公司
- 3、基金托管人或本基金托管人：指交通银行股份有限公司
- 4、基金合同：指《富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充
- 5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
- 6、招募说明书：指《富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》，及其更新
- 7、基金产品资料概要：指《富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要》及其更新
- 8、发售公告：指《富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金份额发售公告》
- 9、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、司法解释、部门规章、地方性法规、地方政府规章及其他对基金合同当事人有约束力的规范性文件及对该等法律法规不时作出的修订
- 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》及对其不时作出的修订
- 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作出的修订

13、《运作管理办法》：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、《流动性风险规定》：指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订

15、中国：指中华人民共和国，就本基金合同而言，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区

16、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

17、中国银保监会：指中国银行保险监督管理委员会

18、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

19、个人投资者：指依据中华人民共和国有关法律法规及其他有关规定可以投资于开放式证券投资基金的自然人

20、机构投资者：指在中国境内合法注册登记或经有权政府部门批准设立和有效存续并依法可以投资证券投资基金的企业法人、事业法人、社会团体或其它组织

21、合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》及相关法律法规规定，经中国证监会批准可以投资于中国证券市场，并取得国家外汇管理局额度批准的中国境外的机构投资者

22、投资人：指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者的合称

23、基金份额持有人：指依照法律法规、招募说明书或基金合同合法取得基金份额的基金投资者

24、基金销售业务：指本基金的认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务

25、销售机构：指直销机构和代销机构

26、直销机构：指富安达基金管理有限公司

27、代销机构：指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金代销业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议，代为办理本基金销售业务的机构

28、基金销售网点：指直销机构的直销中心及代销机构的代销网点

29、注册登记业务：指本基金登记、存管、过户、清算和交收业务，具体内容包 括基金投资者基金账户的建立和管理、基金份额注册登记、清算和交收、基金销售业务的确认、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等

30、注册登记人：指办理基金注册登记业务的机构。本基金的注册登记机构为富安达基金管理有限公司或接受富安达基金管理有限公司委托代为办理基金注册登记业务的机构

31、基金账户：指注册登记机构为基金投资者开立的、记录其持有的、由该注册登记机构办理注册登记的基金份额余额及其变动情况的账户

32、基金交易账户：指销售机构为基金投资人开立的记录其持有的由该销售机构办理认购、申购、赎回、转换及转托管等业务的基金份额余额及其变动情况的账户。

33、基金合同生效日：指基金募集期结束后达到法律法规规定及基金合同约定的备案条件，基金管理人聘请法定机构验资并向中国证监会办理基金备案手续完毕，收到其书面确认之日

34、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，按照基金合同规定的程序终止基金合同的日期

35、基金募集期限：指基金合同和招募说明书中载明，并经中国证监会核准的基金份额募集期限，自基金份额发售之日起最长不超过 3 个月

36、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

37、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所及其他相关交易场所的正常交易日

38、日：指公历日

39、月：指公历月

40、T 日：指销售机构在规定时间受理基金投资者申购、赎回、或其他业务申请的日期

41、T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日(不包含 T 日)

42、开放日：指基金管理人为基金投资者办理基金份额申购、赎回或其他业务的日期

43、交易时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

44、认购：指在基金募集期间，基金投资者按照基金合同的规定申请购买本



## 基金份额的行为

45、申购：指在基金存续期内，基金投资者申请购买本基金份额的行为

46、赎回：指在基金存续期内基金份额持有人按基金合同规定的条件要求基金管理人将其持有的本基金基金份额兑换为现金的行为

47、基金转换：指基金份额持有人按照本基金合同和基金管理人届时有效的业务规则进行的本基金份额与基金管理人管理的且由同一注册登记机构办理注册登记的其他基金份额间的转换行为

48、转托管：指基金份额持有人将其基金账户内的同一基金的基金份额从某一销售机构交易账户转移到另一销售机构交易账户的行为

49、巨额赎回：指在本基金单个开放日内，基金净赎回申请份额（基金赎回申请总份额扣除申购申请总份额之余额）与净转出申请份额（基金转出申请总份额扣除转入申请总份额之余额）之和超过上一开放日本基金总份额10%的情形

50、元：指人民币元

51、基金收益：指基金管理人运用基金资产投资所得股票红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息和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

52、基金资产总值：基金资产总值是指本基金购买各类证券及票据价值、银行存款本息、债券的应计利息、基金应收的申购基金款等款项、缴存的保证金以及其他投资所形成的价值总和

53、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

54、基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额余额总数后得出的基金份额的资产净值

55、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

56、业务规则：指《富安达基金管理有限公司开放式基金登记结算业务规则》，是规范基金管理人管理的开放式证券投资基金注册登记方面的业务规则，由基金管理人和投资者共同遵守

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

58、流动性受限资产：指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等

59、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

60、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

61、不可抗力：指无法预见、无法克服、无法避免的任何事件和因素，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用和没收、法律法规变化、突发停电、恐怖袭击、传染病传播、证券交易场所非正常暂停或停止交易以及其他突发事件

## 第三部分 基金管理人

### 一、概况

#### (一) 基金管理人概况

名称：富安达基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区世纪大道 1568 号中建大厦 29 层

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 1568 号中建大厦 29 层

法定代表人：张睿

成立时间：2011 年 4 月 27 日

电话：（021）61870999-6210

联系人：宋丽韵

注册资本：8.18 亿元人民币

存续期间：持续经营

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务。

股权结构：富安达基金管理有限公司（以下简称“公司”）经中国证监会证监许可[2011]544号文批准设立。目前公司股东为南京证券股份有限公司，持有股份49%；江苏交通控股有限公司，持有股份26%；南京市河西新城区国有资产经营控股（集团）有限责任公司，持有股份25%。注册资本为8.18亿元人民币。

公司设立了投资决策委员会。投资决策委员会负责指导基金资产的运作、确定基本的投资策略和投资组合的原则。

公司下设十三个一级部门，分别是：党建工作部、投资管理部、研究发展部、市场营销部、机构业务部、电子商务部、产品创新部、信息技术部、基金事务部、综合管理部、人力资源部、计划财务部和监察稽核部。党建工作部全面负责公司党务建设工作，贯彻执行有关政策，落实党员管理工作。投资管理部在公司投资决策委员会的领导和风险控制委员会的指导下，负责公司所管理基金的投资运作，实现基金资产的保值增值，确保投资管理目标和风险控制目标的实现。研究发展部根据公司发展战略和基金管理的实际需求，把握产品设计定位，开展策略研究、行业研究、上市公司研究和数量研究工作，为公司投资管理业务提供有效的研究支持平台。市场营销部负责公司公募基金、专户等产品代销渠道的开拓与维护，营销协议的制定和实施，产品的发行和持续销售工作；负责公司各种产品的营销策划及实施。机构业务部负责公司机构客户的开发与维护，完成相应的业务销售

任务，增进并维护公司与机构客户业务关系。电子商务部以互联网为依托推广公司品牌，推介并销售公司产品，进而扩大公司产品规模，提升公司知名度和美誉度。产品创新部根据公司发展战略，提供公司产品策略建议，把握产品设计定位，提出产品设计思路，建立并完善公司高效产品线，促进公司经营目标的实现。信息技术部根据公司整体发展策略，规划公司信息技术体系架构，构建完善的信息技术平台；负责公司信息技术系统的规划、建设、运营和维护，为公司各项业务的正常运行、信息的安全保密和企业信息化提供有效的保障。基金事务部根据国家相关法律法规和公司相关制度，负责基金的财务核算、资产估值、注册登记、资金清算等相关业务，维护基金交易的正常有序运作。综合管理部根据公司的发展战略，负责公司中长期发展战略、年度工作计划和绩效目标的拟定、推行、跟踪和执行效果评估工作；负责公司制度建设、文秘管理、外部联络、内部宣传、信息调研、行政后勤管理，为公司日常运作、领导战略决策提供支持和服务。人力资源部根据公司的发展战略、经营计划和人力资源管理现状参与制订人力资源战略规划；负责制定、执行和优化人力资源管理政策，运作和维护人力资源体系；建立和完善人才梯队的配置和储备；制定并组织员工培训和开发；组织、实施和监督各部门的员工绩效管理；宣传、贯彻公司价值理念，组织员工活动，提供员工帮助，增强组织凝聚力；维持公司在市场竞争中的人力资源优势。计划财务部负责公司全面预算的编制、会计核算、公司财务报告的编制；定期进行财务分析，为公司发展和管理层决策提供依据；同时建立健全公司的财务管理制度以及与财务有关的内控制度；定期或不定期进行公司资产清查，监督公司自有财产的管理，保证公司自有财产记录准确和安全；并接受并配合国家监管机构、社会审计机构和公司内部监察稽核部门的检查。监察稽核部根据相关法律法规，负责公司规章制度的审核，检查、监督各部门执行情况；对基金管理的各个环节进行全程风险管理；负责公司专项审计、信息披露内容的审核、对外文件的法律审核，保证公司内部控制、风险管理的有效实施。

截止到2021年4月25日，公司总人数81人，具有基金从业资格的人数为76人，其中69.1%以上的员工具有硕士以上学历。

公司已经建立健全投资管理制度、风险控制制度、内部监察制度、财务管理制度、人事管理制度、信息披露制度和员工行为准则等公司管理制度体系。

## **（二）主要人员情况**

## 1、基金管理人董事会成员

### 董事长：

张睿女士，1977年1月出生，中共党员，硕士研究生。历任闽发证券有限责任公司投资银行部副经理；南京证券有限责任公司投资银行管理总部副总经理，兼上海投资银行部总经理；南京证券股份有限公司业务总监，兼投资银行业务总部、业务二部总经理。现任富安达基金管理有限公司党委书记、董事长。

### 副董事长：

杜文毅先生，1963年2月出生，中共党员，大学学士，高级经济师。历任南京交通学校财会教研室工作，江苏交通规划设计院计划财务室副主任、主任，江苏交通控股有限公司财务审计处副处长，江苏交通产业集团有限公司财务审计处副处长、处长，江苏交通产业集团有限公司董事，江苏京沪高速公路有限公司副总经理，江苏交通控股有限公司董事、副总会计师、财务管理部部长，富安达基金管理有限公司监事。现任江苏交通控股有限公司总会计师、党委委员，江苏金融租赁股份有限公司董事、江苏省铁路集团有限公司监事会主席、江苏银行股份有限公司董事、南京跃进汽车有限公司董事。

### 董事：

胥海先生，1973年5月出生，中共党员，硕士研究生。历任南京证券公司电脑部、营业部、基建办职员；南京证券有限责任公司行政管理部职员兼团委副书记，公司团委副书记（主持工作），行政管理部副经理兼公司团委副书记；南京证券有限责任公司南京大厂营业部副总经理，南京证券有限责任公司南京云南北路营业部副总经理，南京证券有限责任公司宁夏凤凰北街营业部副总经理，南京证券有限责任公司北京惠新西街营业部副总经理，南京证券有限责任公司广州先烈中路营业部副总经理（主持工作），南京证券有限责任公司南京云南北路营业部副总经理（主持工作）、总经理，南京证券股份有限公司深圳分公司总经理；江苏省镇江市扬中市人民政府副市长(挂职)。现任富安达基金管理有限公司总经理兼富安达资产管理（上海）有限公司监事。

张敏先生，1968年11月出生，本科学历，高级经济师。历任南京市医药管理局科员，国泰证券公司南京营业部交易管理部副经理，南京市城市建设(控股)有限公司投资财务部，南京城建项目管理发展有限公司综合办公室计划考核岗，南京市城市建设投资控股(集团)有限责任公司投资发展部投融资岗，南京城建

项目管理发展有限公司企业发展部副经理，河西国资集团投资部投融资管理、合同管理主管、河西国资集团投资与资产管理部投资管理、资产管理主管，现任南京河西新城区开发建设管理委员会部门主管。

金领千先生，1976年12月出生，中共党员，硕士研究生。历任南京证券有限责任公司上海南车站路营业部财务部经理；南京证券有限责任公司结算存管中心主办会计、计划财务部高级经理；富安达基金管理有限公司计划财务部负责人、总监；富安达资产管理（上海）有限公司总经理助理、总经理。现任富安达资产管理（上海）有限公司执行董事兼总经理。

吴战峰先生，1968年8月出生，硕士研究生。历任中大投资公司投资部经理，平安证券资产管理部投资经理，招商证券研发中心高级分析师，国信证券研究所首席分析师，国投瑞银基金高级组合经理，国泰基金基金经理，天治基金基金经理、总经理助理兼研究总监。现任富安达基金管理有限公司研究发展部总监、富安达优势成长混合型证券投资基金的基金经理、富安达消费主题灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、富安达科技领航混合型证券投资基金的基金经理、富安达科技创新混合型发起式证券投资基金的基金经理、富安达长三角区域主题混合型发起式证券投资基金的基金经理。

**独立董事：**

赵顺龙先生，1965年12月出生，中共党员，管理学博士，教授。历任南京化工学院社科部教师，南京化工大学社科系教师，南京化工大学经济管理学院工商管理系副主任、副教授，南京工业大学（原南京化工大学）经济管理学院院长、教授。现任南京工业大学经济管理学院党委书记、教授。

刘健先生，1955年6月出生，中共党员，研究生学历，律师。历任南京绵织厂劳动干事、人事负责人，南京内燃机配件五厂党务、人事负责人，南京大量律师事务所律师，江苏金鼎英杰律师事务所合伙人，上海市建纬（南京）律师事务所副主任。现任上海市建纬（南京）律师事务所合伙人、主任。

江涛女士，1967年4月出生，中共党员，本科学历，中级经济师。历任深圳赛格集团市场部外贸业务员，深圳石化集团秘书科长、海外企业管理部副总，招商证券有限责任公司投行总部总助、北京代表处副主任，中投证券有限责任公司董办副主任（主持），中银国际证券有限责任公司董事会秘书兼董办主任、执委会委员。

## 2、基金管理人监事会成员

### 监事会主席：

刘宁女士，1967年11月出生，中共党员，硕士研究生，高级会计师、高级审计师。历任南京市审计局政财金融审计处科员，金融审计处科员、副主任科员、主任科员，南京证券有限责任公司计划财务部副总经理、计划财务部总经理。现任南京证券股份有限公司财务总监兼计划财务部总经理。

### 监事：

林海涛先生，1969年5月出生，中共党员，硕士研究生，高级工程师。历任安徽水利电力学校教师，安徽水利电力职业技术学院教师，金陵药业股份有限公司投资发展部经理，南京市河西新城区国有资产经营控股（集团）下属南京金帆酒店管理股份有限公司董事长。现任南京健康科技集团有限公司总经理。

孙玮先生，1982年8月出生，中共党员，硕士研究生，经济师。历任深圳市华林证券有限责任公司信息管理部职员，江苏交通控股有限公司投资发展部职员、副主管、主管。现任江苏交通控股有限公司投资发展部副部长、江苏交通文化传媒有限公司董事、江苏云杉清洁能源投资控股有限公司董事、江苏云杉资本管理有限公司监事、苏南硕放国际机场有限公司董事、南通天生港发电有限公司董事。

黄懿稚女士，1974年4月出生，中共党员，硕士研究生，历任金新信托上海管理总部人力资源部薪酬福利主管，民安证券上海管理总部人力资源部副总经理，华富基金管理有限公司人力资源部经理，富安达基金筹备组人力资源负责人，富安达基金管理有限公司人力资源部历任部门经理，部门副总监（主持工作）。现任富安达基金管理有限公司人力资源部总监。

戚明龙先生，1976年2月出生，中共党员，硕士研究生，历任南京证券上海营业部场内交易员，南京证券上海南车站营业部市场部经理，南京云南北路营业部市场部经理，现任富安达基金管理有限公司综合管理部总监兼党建工作部负责人。

孙丽女士，1986年7月出生，大学本科，经济学学士。历任中国平安保险集团公司稽核监察部稽核监察岗，中国太平洋保险集团公司审计技术部审计师，国海富兰克林基金管理有限公司监察稽核部内审经理，富安达基金管理有限公司监察稽核部内审经理、合规管理部副经理（主持工作），南京证券股份有限公司资

产托管部（筹）投资监督岗（借调）。现任富安达基金管理有限公司监察稽核部总监助理（主持工作）。

### 3、基金管理人高级管理人员

总经理：

胥海先生（简历请参见上述董事会成员介绍）。

副总经理：

沈伟青先生，中共党员，本科学历。历任南京市证券公司上海长宁支路营业部、南京证券有限责任公司上海南车站路证券营业部员工，南京证券有限责任公司上海南车站路证券营业部交易部经理，西北证券托管组银川福州南街证券营业部托管小组成员，南京证券有限责任公司常熟吉祥商城证券营业部、南京证券有限责任公司上海南车站路证券营业部、南京证券有限责任公司上海西藏南路证券营业部、南京证券有限责任公司上海新华路证券营业部总经理助理，南京证券股份有限公司上海番禺路证券营业部、南京证券股份有限公司上海分公司副总经理。现任富安达基金管理有限公司副总经理。

督察长：

李理想先生，中共党员，硕士研究生。历任富安达基金管理有限公司监察稽核部法务，富安达资产管理（上海）有限公司合规风控部总监助理、副总监、总监，富安达资产管理（上海）有限公司总经理助理。现任富安达基金管理有限公司督察长兼富安达资产管理（上海）有限公司监事。

首席信息官：

孙爱民先生，中共党员，硕士。历任南京电声股份有限公司技术中心工程师、南京市国际信托投资公司 IT 工程师、南京证券有限责任公司上海新华路营业部 IT 工程师，富安达基金信息技术部总监助理、副总监、总监。现任富安达基金管理有限公司首席信息官兼信息技术部总监。

### 4、本基金基金经理

李守峰先生，中共党员，硕士研究生。历任万联证券研究所医药研究员。现任富安达基金管理有限公司行业研究部负责人，富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金、富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金、富安达医药创新混合型证券投资基金的基金经理。



朱义女士，硕士研究生。历任金元顺安基金管理有限公司风险管理专员，上投摩根基金管理有限公司高级风险管理经理，富安达基金管理有限公司监察稽核部副总监，研究发展部研究总监助理兼基金经理助理。现任富安达基金研究发展部总监助理，富安达长盈灵活配置混合型证券投资基金、富安达行业轮动灵活配置混合型证券投资基金、富安达新动力灵活配置混合型证券投资基金、富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

历任基金经理：黄强先生，2012年4月25日至2015年8月12日管理本基金。

毛矛先生，2015年5月12日至2020年8月10日管理本基金。

#### 5、投资决策委员会成员

投资决策委员会主席：

胥海先生（简历请参见上述董事会成员介绍）。

投资决策委员会成员：

吴战峰先生（简历请参见上述董事会成员介绍）。

李飞先生，博士研究生。历任上海应用技术学院财政经济系教师，聚源数据有限责任公司研究发展中心项目经理，国盛证券有限责任公司投资研究部高级宏观债券研究员，金元惠理基金管理有限公司投资部基金经理。现任公司投资管理部副总监（主持工作）、固定收益部副总监（主持工作），富安达增强收益债券型证券投资基金、富安达富利纯债债券型证券投资基金基金经理。

6、上述人员之间均不存在近亲关系。

### （三）基金管理人的职责

1、依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

2、办理基金备案手续；

3、自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；

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

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

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

7、依法接受基金托管人的监督；

8、计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回价格；

9、采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；

10、按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

11、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

12、编制季度报告、中期报告和年度报告；

13、严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

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

15、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

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

17、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；

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

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

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

21、基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

22、按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；

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

24、执行生效的基金份额持有人大会决议；

25、不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

26、依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利，不谋求对上市公司的控股和直接管理；

27、法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

#### **（四）基金管理人的承诺**

1、基金管理人承诺不从事违反《证券法》的行为，并承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反《证券法》行为的发生；

2、基金管理人承诺不从事违反《基金法》的行为，并承诺建立健全内部风险控制制度，采取有效措施，防止下列行为的发生：

（1）将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；

（2）不公平地对待管理的不同基金财产；

（3）利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；

（4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；

（5）依照法律、行政法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他行为。

3、基金管理人承诺严格遵守基金合同，并承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反基金合同行为的发生；

4、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；

5、基金管理人承诺不从事其他法规规定禁止从事的行为。

#### **（五）基金经理承诺**

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

2、不利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者谋取利益；

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；

4、不得以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

#### **(六) 基金管理人的内部控制制度**

##### **1、内部控制的目标**

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

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

(3) 确保基金、公司财务和其他信息真实、准确、完整、及时。

##### **2、内部控制的原则**

###### **(1) 健全性原则**

公司风险管理必须覆盖公司的所有部门、各项业务和各个岗位，渗透业务的决策、执行、监督、反馈等各个经营环节。

###### **(2) 独立性原则**

公司设立独立的督察长和监察稽核部保持高度的独立性和权威性，负责对公司各部门风险控制工作进行稽核和检查。

###### **(3) 相互制约原则**

公司及各部门在内部组织结构的设计上要形成一种相互制约的机制，建立不同岗位之间的制衡体系。

###### **(4) 有效性原则**

公司的内部风险控制工作必须从实际出发，主要通过对工作流程的控制，进而实现对各项经营风险的控制。

###### **(5) 成本效益原则**

运用科学化的经营管理方法降低运作成本，提高经济效益，以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

##### **3、内部控制的主要内容**

###### **(1) 控制环境**

良好的控制环境包括科学的公司治理、有效的监督管理、合理的组织结构和有力的控制文化。

①董事会下设资格审查和薪酬委员会、合规和风险控制委员会等专业委员会，其中合规和风险控制委员会负责评价与完善公司内部控制体系。

②公司管理层设立了投资决策委员会和风险管理委员会，投资决策委员会为公司投资管理的最高决策机构，负责指导基金资产的运作、确定基本的投资策略和投资组合的原则。风险管理委员会为公司风险管理的最高决策机构，负责全面评估公司经营管理过程中的各项风险，并提出防范化解措施。

③公司各部门之间有明确的授权分工，既互相合作，又互相核对和制衡，形成了合理的组织结构。

④公司设有督察长，负责组织指导公司的监察与稽核工作，对公司和基金运作的合法性、合规性及合理性进行全面检查与监督，参与公司风险控制工作，发生重大风险事件时向公司董事会和中国证监会报告。

⑤公司注重内控文化的建设，树立员工内控优先和风险管理的理念，定期对员工进行合法合规的相关培训。

## （2）风险评估

公司风险控制人员定期评估公司风险状况，范围包括所有能对经营目标产生负面影响的内部和外部因素，评估这些因素对公司总体经营目标产生影响的程度及可能性。对于不可控风险，风险评估的目的是决定是否承担该风险或减少相关业务；对于可控风险，风险评估的目的是分析如何通过制度安排来控制风险程度。风险评估还包括各业务部门对日常工作中新出现的风险进行再评估并完善相应的制度，以及新业务设计过程中评估相关风险并制定风险控制制度。

## （3）操作控制

公司内部组织结构的设计方面，体现部门之间职责有分工，但部门之间又相互合作与制衡的原则。基金投资管理、基金运作、市场等业务部门有明确的授权分工，各部门的操作相互独立，并且有独立的报告系统。各业务部门之间相互核对、相互牵制。

各业务部门内部工作岗位分工合理、职责明确，形成相互检查、相互制约的关系，以减少舞弊或差错发生的风险，各工作岗位均制定有相应的书面管理制度。

在明确的岗位责任制度基础上，设置科学、合理、标准化的业务操作流程，同时，规定完备的处理手续，保存完整的业务记录，制定严格的检查、复核标准。

## （4）信息与沟通

公司建立了内部办公自动化信息系统与业务汇报体系,通过建立有效的信息交流渠道,保证公司员工及各级管理人员可以充分了解与其职责相关的信息,保证信息及时送达适当的人员进行处理。

#### (5) 监督与内部稽核

本公司设立了独立于各业务部门的监察稽核部,其中监察稽核人员履行内部稽核职能,检查、评价公司内部控制制度合理性、完备性和有效性,监督公司内部控制制度的执行情况,揭示公司内部管理及基金运作中的风险,及时提出改进意见,促进公司内部管理制度有效地执行。监察稽核人员具有相对的独立性,定期出具监察稽核报告,报公司督察长、董事。

#### 4、基金管理人关于内部控制的声明

(1) 本公司确知建立、实施和维持内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任;

(2) 上述关于内部控制的披露真实、准确;

(3) 本公司承诺将根据市场环境的变化及公司的发展不断完善内部控制制度。

## 第四部分 基金托管人

### 一、基金托管人基本情况

#### (一) 基金托管人概况

公司法定中文名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）

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

法定代表人：任德奇

住 所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号

办公地址：上海市长宁区仙霞路18号

邮政编码：200336

注册时间：1987年3月30日

注册资本：742.63亿元

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]25号

联系人：陆志俊

电 话：95559

交通银行始建于1908年，是中国历史最悠久的银行之一，也是近代中国的发钞行之一。1987年重新组建后的交通银行正式对外营业，成为中国第一家全国性的国有股份制商业银行，总部设在上海。2005年6月交通银行在香港联合交易所挂牌上市，2007年5月在上海证券交易所挂牌上市。交通银行连续12年跻身《财富》(FORTUNE)世界500强，营业收入排名第162位；列《银行家》(The Banker)杂志全球千家大银行一级资本排名第11位。

截至2020年12月31日，交通银行资产总额为人民币10.70万亿元。2020年1-12月，交通银行实现净利润(归属于母公司股东)人民币782.74亿元。

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

#### (二) 主要人员情况

任德奇先生，董事长、执行董事，高级经济师。

任先生2020年1月起任本行董事长（其中：2019年12月至2020年7月代为履行

行长职责)、执行董事, 2018年8月至2020年1月任本行副董事长(其中: 2019年4月至2020年1月代为履行董事长职责)、执行董事, 2018年8月至2019年12月任本行行长; 2016年12月至2018年6月任中国银行执行董事、副行长, 其中: 2015年10月至2018年6月兼任中银香港(控股)有限公司非执行董事, 2016年9月至2018年6月兼任中国银行上海人民币交易业务总部总裁; 2014年7月至2016年11月任中国银行副行长, 2003年8月至2014年5月历任中国建设银行信贷审批部副总经理、风险监控部总经理、授信管理部总经理、湖北省分行行长、风险管理部总经理; 1988年7月至2003年8月先后在中国建设银行岳阳长岭支行、岳阳市中心支行、岳阳分行, 中国建设银行信贷管理委员会办公室、信贷风险管理部工作。任先生1988年于清华大学获工学硕士学位。

刘珺先生, 副董事长、执行董事、行长, 高级经济师。

刘先生2020年7月起担任本行行长; 2016年11月至2020年5月任中国投资有限责任公司副总经理; 2014年12月至2016年11月任中国光大集团股份公司副总经理; 2014年6月至2014年12月任中国光大(集团)总公司执行董事、副总经理(2014年6月至2016年11月期间先后兼任光大永明人寿保险有限公司董事长、中国光大集团有限公司副董事长、中国光大控股有限公司执行董事兼副主席、中国光大国际有限公司执行董事兼副主席、中国光大实业(集团)有限责任公司董事长); 2009年9月至2014年6月历任中国光大银行行长助理、副行长(期间先后兼任中国光大银行上海分行行长、中国光大银行金融市场中心总经理); 1993年7月至2009年9月先后在中国光大银行国际业务部、香港代表处、资金部、投行业务部工作。刘先生2003年于香港理工大学获工商管理博士学位。

袁庆伟女士, 资产托管部总经理, 高级经济师。

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

### (三) 基金托管业务经营情况

截至2020年12月31日, 交通银行共托管证券投资基金512只。此外, 交通银



行还托管了基金公司特定客户资产管理计划、证券公司客户资产管理计划、银行理财产品、信托计划、私募投资基金、保险资金、全国社保基金、养老保障管理基金、企业年金基金、职业年金基金、QFII证券投资资产、RQFII证券投资资产、QDII证券投资资产、RQDII证券投资资产、QDIE资金、QDLP资金和QFLP资金等产品。

## 二、基金托管人的内部控制制度

### （一）内部控制目标

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

### （二）内部控制原则

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

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

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

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

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

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

### （三）内部控制制度及措施

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

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

### 三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

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

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

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

### 四、其他事项

最近一年内交通银行及其负责资产托管业务的高级管理人员无重大违法违规行为，未受到中国人民银行、中国证监会、中国银保监会及其他有关机关的处

罚。负责基金托管业务的高级管理人员在基金管理公司无兼职的情况。

## 第五部分 相关服务机构

### 一、基金份额销售机构

#### 1、直销机构

富安达基金管理有限公司直销中心

名称：富安达基金管理有限公司直销中心

地址：上海市浦东新区世纪大道 1568 号中建大厦 29 层

电话：(021) 61870808

传真：(021) 61601555

联系人：宋丽韵

全国统一服务热线：400-630-6999

#### 2、其他销售机构

##### (1) 交通银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：任德奇

电话：021-58781234

传真：021-58408483

联系人：高天

客服电话：95559

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

##### (2) 南京证券股份有限公司

住所：江苏省南京市江东中路 389 号

办公地址：江苏省南京市江东中路 389 号

法定代表人：李剑锋

客户服务电话：95386

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

##### (3) 中信建投证券股份有限公司

住所：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：王常青

客户服务电话：400-8888-108

网址：www.csc108.com

（4）安信证券股份有限公司

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

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

深圳市福田区深南大道 2008 号中国凤凰大厦 1 栋 9 层

法定代表人：黄炎勋

客户服务电话：4008001001

网址：www.essence.com.cn

（5）广发证券股份有限公司

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

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

法定代表人：孙树明

客户服务电话：95575 或致电各地营业网点

网址：www.gf.com.cn

（6）国金证券股份有限公司

住所：成都市东城根上街 95 号

办公地址：成都市东城根上街 95 号

法定代表人：冉云

客户服务电话：4006600109

网址：www.gjzq.com.cn

（7）国泰君安证券股份有限公司

住所：上海市浦东新区商城路 618 号

办公地址：上海市静安区南京西路 768 号国泰君安大厦

法定代表人：贺青

客户服务电话：95521

网址：www.gtja.com

（8）中信证券股份有限公司

住所：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦

法定代表人：张佑君

客户服务电话：95548

网址：[www.cs.ecitic.com](http://www.cs.ecitic.com)

（9）兴业证券股份有限公司

住所：福州市湖东路268号

办公地址：浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼22层

法定代表人：杨华辉

客户服务电话：95562

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

（10）中泰证券股份有限公司

住所：济南市经七路86号

办公地址：济南市经七路86号23层

法定代表人：李峰

客户服务电话：95538

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

（11）招商证券股份有限公司

住所：深圳市福田区福田街道福华一路111号

办公地址：深圳市福田区福田街道福华一路111号

法定代表人：霍达

客户服务电话：95565、4008888111

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

（12）申万宏源证券有限公司

住所：上海市徐汇区长乐路989号世纪商贸广场45层

办公地址：上海市徐汇区长乐路989号世纪商贸广场40层

法定代表人：杨玉成

客户服务电话：95523 或 4008895523

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

（13）东吴证券股份有限公司

住所：江苏省苏州市苏州工业园区星阳街 5 号

办公地址：江苏省苏州市苏州工业园区星阳街 5 号

法定代表人：范力

客户服务电话：0512-33396288

网址：www.dwzq.com.cn

（14）国信证券股份有限公司

住所：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人：何如

客户服务电话：95536

网址：www.guosen.com.cn

（15）海通证券股份有限公司

住所：上海市淮海中路 98 号

办公地址：上海市广东路 689 号

法定代表人：周杰

客户服务电话：95553

网址：www.htsec.com

（16）华泰证券股份有限公司

住所：南京市建邺区江东中路 228 号

办公地址：南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场

法定代表人：张伟

客户服务电话：95597

网址：www.htsc.com.cn

（17）江苏银行股份有限公司

注册地址：南京市中华路 26 号

办公地址：南京市中华路 26 号

法定代表人：夏平

客服电话：400-86-96098

公司网址：www.jsbchina.cn

（18）中国工商银行股份有限公司

注册地址：中国北京复兴门内大街 55 号

办公地址：中国北京复兴门内大街 55 号

法定代表人：陈四清

客服电话：95588

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

(19) 南京银行股份有限公司

注册地址：江苏省南京市中山路 288 号

办公地址：江苏省南京市中山路 288 号

法定代表人：胡升荣

客服电话：40088-96400（全国）、96400（江苏）

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

(20) 东北证券股份有限公司

注册地址：长春市生态大街 6666 号

办公地址：长春市生态大街 6666 号

法定代表人：李福春

客服电话：95360

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

(21) 中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼 20 层

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层

(266061)

法定代表人：冯恩新

客服电话：95548

公司网址：<http://sd.citics.com>

(22) 上海长量基金销售有限公司

办公地址：上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层

法定代表人：张跃伟

客服电话：400-820-2899

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

(23) 上海好买基金销售有限公司



办公地址：上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 9 楼

法定代表人：杨文斌

客服热线：400-700-9665

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

(24) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

注册地址：杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 幢 202 室

法定代表人：祖国明

客服电话：4000-766-123

公司网址：<http://www.fund123.cn/>

(25) 上海天天基金销售有限公司

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号金座 26 楼

法定代表人：其实

客服电话：400-1818-188

公司网址：[www.1234567.com.cn](http://www.1234567.com.cn)

(26) 中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：陈共炎

客户服务电话：400-8888-888

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

(27) 诺亚正行基金销售有限公司

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴银城中路 68 号时代金融中心 8 楼 801

法定代表人：汪静波

客户服务电话：400-821-5399

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

(28) 和讯信息科技有限公司

办公地址：上海市浦东新区东方路 18 号保利广场 E 座 18F

法定代表人：王莉

客户电话：400-920-0022

公司网址: <http://www.licaike.com/>

(29) 浦领基金销售有限公司

注册地址: 北京市朝阳区望京东园四区 2 号楼 10 层 1001 号 04 室

法定代表人: 聂婉君

客服电话: 4000125899

公司网站: <http://www.zscffund.com/>

(30) 深圳众禄基金销售股份有限公司

注册地址: 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

客服电话: 4006-788-887

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

(31) 上海联泰基金销售有限公司

办公地址: 上海市长宁区金钟路 658 弄 2 号楼 B 座 6 楼

法定代表人: 尹彬彬

客服热线: 400-118-1188

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

(32) 北京增财基金销售有限公司

办公地址: 北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208 室

法定代表人: 罗细安

客服电话: 400-001-8811

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

(33) 申万宏源西部证券有限公司

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: 王献军

电话: 4008000562

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

(34) 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

法定代表人：李兴春

客服电话：95733

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

(35) 平安证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道益田路 5023 号平安金融中心 B 座第 22-25 层

办公地址：深圳市福田区福田街道益田路 5023 号平安金融中心 B 座第 22-25 层

法定代表人：何之江

电话：021-38631117

网址：<http://stock.pingan.com>

(36) 东海期货有限责任公司

办公地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦 8 楼

法定代表人：陈太康

电话：95531/400-8888588

网址：[www.qh168.com.cn](http://www.qh168.com.cn)

(37) 信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人：祝瑞敏

电话：95321

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

(38) 宁波银行股份有限公司

注册地址：浙江省宁波市鄞州区宁南南路 700 号

办公地址：浙江省宁波市鄞州区宁南南路 700 号

法定代表人：陆华裕

电话：95574

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

(39) 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

电话：95528

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

(40) 华龙证券股份有限公司

注册地址：兰州市城关区东岗西路 638 号财富大厦 21 楼

办公地址：兰州市城关区东岗西路 638 号财富大厦 21 楼

法定代表人：陈牧原

电话：95368

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

(41) 光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闸路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闸路 1508 号

法定代表人：刘秋明

电话：95525

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

(42) 上海凯石财富基金销售有限公司

办公地址：上海市黄浦区延安东路 1 号凯石大厦 4 楼

注册地址：上海市黄浦区西藏南路 765 号 602-115 室

法定代表人：陈继武

客服电话：400-643-3389

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

(43) 上海汇付基金销售有限公司

办公地址：上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼

法定代表人：金佶

电话：021-34013999

网址：<https://www.hotjijin.com/>

(44) 浙江同花顺基金销售有限公司

办公地址：浙江省杭州市西湖区翠柏路7号电子商务产业园2号楼2楼

法定代表人：吴强

电话：952555

网址：<http://www.ijijin.com.cn/>

(45) 上海陆金所基金销售有限公司

办公地址：上海市浦东新区源深路1088号平安财富大厦7楼

法定代表人：陈祎彬

客服电话：4008219031

网址：<https://www.lufunds.com>

(46) 中信期货有限公司

办公地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层  
1301-1305室、14层

法定代表人：张皓

电话：400-990-8826

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

(47) 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

电话：95177

网址：<https://www.snjijin.com/>

(48) 一路财富（北京）基金销售有限公司

办公地址：北京市海淀区宝盛南路奥北科技园20号楼国泰大厦9层

法定代表人：吴雪秀

电话：400-001-1566

网址：<https://www.yilucaifu.com/>

(49) 上海中正达广基金销售有限公司

注册地址：上海市龙兰路277号1号楼1203、1204室

办公地址：上海市龙兰路 277 号 1 号楼 1203、1204 室

法定代表人：黄欣

客服电话：400-6767-523

网址：<http://www.zzwealth.cn/>

(50) 华金证券股份有限公司

注册地址：中国(上海)自由贸易试验区杨高南路 759 号 30 层

办公地址：中国(上海)自由贸易试验区杨高南路 759 号 30 层

法定代表人：宋卫东

电话：4008211357

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

(51) 东海证券股份有限公司

注册地址：江苏省常州延陵西路 23 号投资广场 18 层

办公地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦

法定代表人：钱俊文

电话：95531

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

(52) 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 1201-1203

法定代表人：肖雯

客服电话：020-89629066

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

(53) 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

客服电话：400-820-5369

网址：<https://www.jiyufund.com.cn/>

(54) 中证金牛（北京）投资咨询有限公司

注册地址：北京市丰台区东管头 1 号 2 号楼 2 - 45 室

办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲 1 号环球财讯中心 A 座 5 层

法定代表人：钱昊旻

客服电话：4008-909-998

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

(55)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 A 座 1108

办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲 1 号环球财讯中心 D 座 401

法定代表人：王伟刚

客服电话：400-619-9059

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

(56)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 楼 04 室

法定代表人：吕柳霞

客服电话：021-50810673

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

(57)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

传真：010-85632773

客服热线：95510

公司网站：<http://fund.sinosig.com/>

(58)长江证券股份有限公司

注册地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

办公地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：李新华

电话：95579 或 4008888999

网址：[www.95579.com](http://www.95579.com)

(59)中国人寿保险股份有限公司

注册地址：中国北京市西城区金融大街 16 号

办公地址：中国北京市西城区金融大街 16 号

法定代表人：王滨

客服热线：95519

公司网站：[www.e-chinalife.com](http://www.e-chinalife.com)

(60) 中信证券华南股份有限公司

注册地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19、20 层

法定代表人：胡伏云

客服热线：95396

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

(61) 北京蛋卷基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区创远路 34 号院 6 号楼 15 层 1501 室

法定代表人：钟斐斐

客服电话：400-159-9288

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

(62) 东方财富证券股份有限公司

注册地址：西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城 10 栋楼

法定代表人：徐伟琴

客服电话：95537

网址：<http://www.xzsec.com/>

(63) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道民田路 178 号华融大厦 27 层 2704

法定代表人：洪弘

客服电话：400-166-1188

网址：<http://8.jrj.com.cn/>

(64) 北京植信基金销售有限公司

注册地址：北京市密云区兴盛南路 8 号院 2 号楼 106 室-67

法定代表人：王军辉

联系人：张鼎

客服电话：400-680-2123



网址：<https://www.zhixin-inv.com/>

(65) 和耕传承基金销售有限公司

注册地址：河南自贸试验区郑州片区（郑东）东风南路东康宁街北 6 号楼 5 楼 503

法定代表人：温丽燕

联系人：胡静华

客服电话：4000555671

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

(66) 财咨道信息技术有限公司

注册地址：辽宁省沈阳市浑南区白塔二南街 18-2 号 B 座 601

法定代表人：朱荣晖

联系人：庞文静

客服电话：400-003-5811

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

(67) 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

法定代表人：吴言林

客服电话：025-66046166

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

(68) 海银基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 8 号 402 室

法定代表人：巩巧丽

客服热线：400-808-1016

公司网站：<https://www.fundhaiyin.com/>

(69) 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：北京市朝阳区北苑路甲 1 号

法定代表人：王舰正

客服热线：4006997719

其他销售机构详见《基金份额发售公告》及基金管理人新增销售机构的公告。

## 二、注册登记机构

名称：富安达基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区世纪大道 1568 号中建大厦 29 层

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 1568 号中建大厦 29 层

法定代表人：张睿

电话：（021）61870999-3618

传真：（021）021-61065222

联系人：王雪

## 三、律师事务所和经办律师

名称：上海源泰律师事务所

注册地址：上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼

电话：（021）51150298

传真：（021）51150398

联系人：刘佳、张兰

经办律师：刘佳、张兰

## 四、会计师事务所和经办注册会计师

机构名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦  
6 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

联系电话：021-23238888

传真：021-23238800

联系人：陈熹

经办注册会计师：薛竞、陈熹

## 第六部分 基金的募集

本基金为契约型开放式基金，基金存续期限为不定期。基金管理人按照《基金法》、《运作管理办法》、《销售管理办法》、《信息披露办法》、基金合同及其他有关规定募集本基金，并于2012年2月15日经中国证监会证监许可[2012]193号文核准募集。

### 一、基金类型

混合型证券投资基金

### 二、基金存续期限

不定期

### 三、募集情况

经普华永道中天会计师事务所验资，本次募集的有效认购户数为4565户，净销售金额为人民币583,296,937.09元，折合基金份额583,296,937.09份；募集资金在基金合同生效前产生的利息共计人民币66,915.55元，折合66,915.55份基金份额归基金份额持有人所有。在基金募集期内，富安达基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）的基金从业人员认购本基金份额1,163,039.66份，占本基金份额总量的0.20%；富安达基金管理有限公司使用自有资金认购本基金份额为9,990,000.00份，占基金份额总量的1.71%。上述资金已于2012年4月25日全额划入本基金在基金托管人交通银行股份有限公司开立的基金托管专户。按照每份基金份额初始面值1.00元计算，本次募集期的有效认购份额583,296,937.09份，利息结转的基金份额66,915.55份，两项合计共583,363,852.64份基金份额。

## 第七部分 基金合同的生效

### 一、基金合同的生效

1、基金募集期限届满，在基金募集份额总额不少于 2 亿份，基金募集金额不少于 2 亿元人民币，并且基金份额持有人的人数不少于 200 人的条件下，基金管理人依据法律法规和招募说明书的规定可以决定停止基金发售。基金管理人应当自基金募集期届满之日或停止基金发售之日起 10 日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告之日起 10 日内，向中国证监会提交验资报告，办理基金备案手续。自中国证监会书面确认之日起，基金备案手续办理完毕，基金合同生效。基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日予以公告。

2、基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对基金合同生效事宜予以公告。

3、本基金募集期届满之日前，投资人的认购款项只能存入有证券投资基金托管业务资格的商业银行的基金募集专用账户，任何人不得动用。有效认购款项在基金募集期内产生的利息将折合成基金份额，归基金份额持有人所有。基金募集期产生的利息以注册登记人的记录为准。

### 二、基金募集失败的处理方式

基金募集期届满，未达到基金的备案条件，或因不可抗力使基金合同无法生效，则基金募集失败。基金管理人应当：

(1) 以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；

(2) 在基金募集期限届满后30日内退还投资者已缴纳的认购款项，并加计银行同期存款利息。

### 三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资金规模

基金合同生效后，基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元的，基金管理人应当及时报告中国证监会；连续 20 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会说明原因和报送解决方案。

法律法规另有规定的，按其规定办理。

### 四、基金合同生效

根据有关规定，本基金满足《基金合同》生效条件，《基金合同》于2012年4月25日正式生效。自《基金合同》生效日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

## 第八部分 基金份额的申购、赎回与转换

### 一、申购与赎回办理的场所

本基金的销售机构包括基金管理人的直销机构和基金管理人委托的其他销售机构。

#### 1、本基金管理人的直销中心

富安达基金管理有限公司直销中心

名称：富安达基金管理有限公司直销中心

地址：上海市浦东新区世纪大道 1568 号中建大厦 29 层

电话：(021) 61870808

传真：(021) 61601555

联系人：宋丽韵

全国统一服务热线：400-630-6999

投资人可以通过本公司网上交易系统办理本基金的开户、申购及赎回等业务，具体交易细则请参阅本公司网站公告。

#### 2、其他销售机构

目前其他销售机构为交通银行股份有限公司、南京证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、中泰证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、东吴证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、江苏银行股份有限公司、中国工商银行股份有限公司、南京银行股份有限公司、东北证券股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、中国银河证券股份有限公司、上海长量基金销售有限公司、上海好买基金销售有限公司、蚂蚁（杭州）基金销售有限公司、上海天天基金销售有限公司、诺亚正行基金销售有限公司、和讯信息科技有限公司、浦领基金销售有限公司、深圳众禄基金销售股份有限公司、上海联泰基金销售有限公司、北京增财基金销售有限公司、申万宏源西部证券有限公司、上海利得基金销售有限公司、平安证券股份有限公司、东海期货有限责任公司、信达证券股份有限公司、宁波银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、华龙证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、上海凯石财富基金销售有限公司、上海汇付基金销售有

限公司、浙江同花顺基金销售有限公司、上海陆金所基金销售有限公司、中信期货有限公司、南京苏宁基金销售有限公司、一路财富(北京)基金销售有限公司、上海中正达广基金销售有限公司、华金证券股份有限公司、东海证券股份有限公司、珠海盈米基金销售有限公司、上海基煜基金销售有限公司、中证金牛(北京)投资咨询有限公司、北京汇成基金销售有限公司、上海挖财基金销售有限公司、阳光人寿保险股份有限公司、长江证券股份有限公司、中国人寿保险股份有限公司、中信证券华南股份有限公司、北京蛋卷基金销售有限公司、东方财富证券股份有限公司、深圳市新兰德证券投资咨询有限公司、北京植信基金销售有限公司、和耕传承基金销售有限公司、财咨道信息技术有限公司、江苏汇林保大基金销售有限公司、海银基金销售有限公司、喜鹊财富基金销售有限公司。投资人可通过上述场所按照规定的方式进行申购或赎回。本基金管理人可根据情况变更或增减基金销售机构，并在管理人网站公示。

销售机构可以根据情况变化增加或者减少其销售城市(网点)，并另行公告。若基金管理人或其指定的销售机构开通电话、传真或网上等交易方式，投资人可以通过上述方式进行申购与赎回，具体办法由基金管理人另行公告。

## 二、申购、赎回办理的开放日及时间

### (1) 开放日及业务办理时间

本基金的开放日是指为投资人办理基金申购、赎回等业务的上海、深圳证券交易所交易日。开放日具体业务办理时间在招募说明书中载明或另行公告，但具体业务办理结束时间不得晚于证券交易所交易结束时间。

若出现新的证券交易市场或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及具体业务办理时间进行相应的调整并提前公告。

### (2) 申购与赎回的开始时间

本基金已于2012年6月25日开始办理日常申购、赎回等业务。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。投资者在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请的，其基金份额申购、赎回或转换价格为下次办理基金份额申购、赎回或转换时间所在开放日的价格。

## 三、申购与赎回的原则

### (1) “未知价”原则，即基金的申购与赎回价格以受理申请当日收市后计

算的基金份额净值为基准进行计算；

(2) “金额申购、份额赎回”的原则，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交易时间结束前撤销，在交易时间结束后不得撤销；

(4) 先进先出原则，即在基金份额持有人赎回基金份额、基金管理人对该基金份额持有人的基金份额进行赎回处理时，认购、申购确认日期在前的基金份额先赎回，认购、申购确认日期在后的基金份额后赎回，以确定所适用的赎回费率；

(5) 基金管理人在不影响基金份额持有人实质利益的情况下可更改上述原则，但最迟应在新的原则实施2日前在指定媒介予以公告。

#### 四、申购与赎回的程序

##### (1) 申购与赎回申请的提出

基金投资者须按销售机构规定的程序，在开放日的业务办理时间提出申购或赎回的申请。

投资者在提交申购申请时须按销售机构规定的方式备足申购资金，投资者在提交赎回申请时须持有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回申请无效。

##### (2) 申购与赎回申请的确认

本基金注册登记机构应以交易时间结束前收到申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T日)，并在T+1日内对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请，投资者可在T+2日起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。

##### (3) 申购与赎回申请的款项支付

申购时，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无效。若申购无效，基金管理人或基金管理人指定的代销机构将投资人已缴付的申购款项本金退还给投资人。

赎回时，当投资人赎回申请成功后，基金管理人将按有关规定在T+7日(包括该日)内支付赎回款项。在发生巨额赎回时，款项的支付办法按照本基金合同

有关条款处理。

## 五、申购与赎回的数额限制

1、代销机构每个基金账户单笔申购的最低金额为单笔 10 元（含申购费）；直销机构每个账户首次最低申购金额为 10,000 元（含申购费），已在直销机构有本基金申购记录的投资人不受首次申购最低金额的限制。代销机构的投资人欲转入直销机构进行交易要受直销机构最低金额的限制。投资人当期分配的基金收益转购基金份额时，不受最低申购金额的限制。通过本基金网上交易系统办理基金申购业务的不受直销机构单笔申购最低金额的限制，申购最低金额为单笔 10 元（含申购费）。

投资人可多次申购，对单个投资人的累计持有份额不设上限限制，但法律法规、监管机构另有要求或基金合同另有约定的，从其规定。

2、基金份额持有人在销售机构赎回/转换时，每次对本基金的赎回/转换申请不得低于 10 份基金份额。基金份额持有人赎回/转换时或赎回/转换后在销售机构（网点）保留的基金份额余额不足 10 份的，在赎回/转换时需一次全部赎回/转换。

3、基金管理人可根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整上述对申购金额、赎回份额和账户最低持有余额的数量限制，基金管理人必须在调整的 2 日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

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

## 六、申购与赎回的价格、费用及其用途

(1) 本基金的申购和赎回价格以申请当日的基金份额净值为基准进行计算；

(2) 投资人申购本基金需缴纳申购费，本基金的申购费率最高不超过申购金额（含申购费）的 5%。本基金实际执行的申购费率在招募说明书、基金产品资料概要中载明。



(3) 投资人赎回本基金份额需缴纳赎回费用，本基金的赎回费率最高不超过赎回总额（含赎回费用）的 5%。本基金实际执行的赎回费率在招募说明书、基金产品资料概要中载明。

(4) 基金管理人可以在法律法规和本基金合同规定范围内调低申购费率和赎回费率。费率如发生变更，基金管理人应在调整实施 2 日前在中国证监会指定媒介上刊登公告。

(5) 基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行相关手续后基金管理人可以对促销活动范围内的基金投资人调低基金申购费率和基金赎回费率。

基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情形下对以特定交易方式（如网上交易、电话交易等）等进行基金交易的投资者采用低于柜台费率的申购费率。

(6) 申购费用由申购基金份额的基金投资人承担，不列入基金财产，用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

(7) 赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，所收取的赎回费的归入基金财产的比例不得低于法律法规或中国证监会规定的比例下限，其余部分用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

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

## 七、申购费率、赎回费率

### 1、申购费率

投资人申购本基金需缴纳申购费，投资人在同一天多次申购的，根据单次申购金额确定每次申购所适用的费率。申购费用用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用，不列入基金财产。

表 2：基金的申购费率结构表

申购金额 (M)	申购费率 (%)
----------	----------

M<100 万	1.50%
100 万≤M<200 万	1.20%
200 万≤M<500 万	0.80%
M≥500 万	1000 元/笔

## 2、赎回费率

投资人赎回本基金份额需缴纳赎回费用，本基金的赎回费率按基金份额持有期限递减，其中，对持有持续有效期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5% 的赎回费，并全额计入基金财产。

表 3：本基金的赎回费率表

持有基金份额期限(Y)	赎回费率(%)
T<7 日	1.50%
7 日≤T<1 年	0.50%
1≤ T<2 年	0.25%
T≥ 2 年	0

3、基金管理人可以根据法律法规和《基金合同》的相关约定调低费率或收费方式，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前 2 日在中国证监会指定媒介上公告。

4、基金管理人可以在不违背法律法规规定及《基金合同》约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行相关手续后基金管理人可以对促销活动范围内的基金投资者调低基金申购费率和基金赎回费率。

基金管理人可以在不违背法律法规规定及《基金合同》约定的情形下对以特定交易方式（如网上交易、电话交易等）等进行基金交易的投资者采用低于柜台费率的申购费率。

## 八、申购份额与赎回金额的计算

### (1) 申购份额的计算

本基金的申购金额包括申购费用和净申购金额。申购份额以申请当日基金份

额净值为基准计算，计算公式如下：

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

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

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

$$\text{对于适用固定金额申购费的申购：净申购金额} = \text{申购金额} - \text{申购费用}$$

以上申购费用、申购份额均按四舍五入方法，保留到小数点后两位。由此误差产生的收益或损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

## (2) 赎回金额的计算

本基金的赎回金额为赎回总额扣减赎回费用，以申请当日基金份额净值为基准计算，计算公式如下：

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

$$\text{赎回费用} = \text{T 日基金份额净值} \times \text{赎回份额} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{赎回金额} = \text{T 日基金份额净值} \times \text{赎回份额} - \text{赎回费用}$$

以上赎回费用、赎回金额均按四舍五入方法，保留到小数点后两位。由此误差产生的收益或损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

(3) T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在次日公告。遇特殊情况，可以适当延迟计算或公告。

T 日的基金份额净值精确到 0.0001 元，小数点后第五位四舍五入，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

## 九、申购与赎回的注册登记

(1) 投资人申购基金成功后，基金注册登记人在 T+1 日为投资人增加权益并办理注册登记手续，投资人自 T+2 日起有权赎回该部分基金份额。

(2) 投资人赎回基金成功后，基金注册登记人在 T+1 日为投资人扣除权益并办理相应的注册登记手续。

(3) 基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，并最迟于开始实施 2 日前在中国证监会指定媒介上予以公告。

## 十、巨额赎回的认定及处理方式

### (1) 巨额赎回的认定

巨额赎回是指在单个开放日内，本基金中基金净赎回申请份额（基金赎回申

请总份额扣除申购申请总份额之余额)与净转出申请份额(基金转出申请总份额扣除转入申请总份额之余额)之和超过上一开放日基金总份额 10%的情形。

## (2) 巨额赎回的处理方式

出现巨额赎回时,基金管理人可以根据本基金当时的资产组合状况决定接受全额赎回或部分延期赎回。

1) 接受全额赎回:当基金管理人认为有能力兑付投资人的全部赎回申请和基金间转换时,按正常赎回程序执行。

2) 部分延期赎回:当基金管理人认为该基金兑付投资者的全部赎回及转出申请有困难,或认为为实现投资者的赎回、转出申请进行的资产变现可能使基金份额净值发生较大波动时,基金管理人在当日接受赎回及转出的比例不低于上一日该基金总份额 10%的前提下,对其余申请延期办理。若进行上述延期办理,对于单个基金份额持有人当日赎回申请超过上一开放日基金总份额 20%以上的部分,将自动进行延期办理。对于其余当日非自动延期办理的赎回申请,应当按单个账户非自动延期办理赎回申请量占非自动延期办理的赎回申请总量的比例,确定单个账户当日办理的赎回或转出份额;未受理赎回部分,除基金份额持有人在提交申请时选择将当日未获受理部分予以撤销者外,延迟至下一开放日办理,并且转入下一开放日的申请不享有优先权并将以该下一个开放日的基金份额净值为基准计算,以此类推,直到全部完成赎回申请为止;未受理转出部分,并不顺延至下一个开放日处理,全部确认失败。

当发生巨额赎回并延期办理时,基金管理人应当通过邮寄、传真等方式在 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 2 日内编制临时报告书予以公告。

(3) 暂停接受和延缓支付:本基金连续 2 个开放日以上发生巨额赎回,如基金管理人认为有必要,可暂停接受赎回申请;已经确认的赎回申请可以延缓支付赎回款项,但延缓期限不得超过 20 个工作日。连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请时,基金管理人应当在 2 日内编制临时报告书,予以公告。

## 十一、拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理

(1) 在如下情况下,基金管理人可以拒绝或暂停接受投资人的申购申请:

1) 因不可抗力导致基金无法正常运作或基金管理人无法接受投资人

的申购申请；

- 2) 证券交易场所在交易时间内非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；
- 3) 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接收投资人的申购申请。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；
- 4) 基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人的利益的情形；
- 5) 基金管理人无正当理由认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害其他基金份额持有人利益时；
- 6) 基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 50%（运作过程中，因基金份额赎回等情形导致被动超标、基金管理人使用固有资金、公司高级管理人员及基金经理等人员出资认购的基金份额超过基金总份额 50%的除外），或者变相规避 50%集中度的情形时；
- 7) 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述 1)、2)、3)、4)、7)项情形时，基金管理人应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。

(2) 在如下情况下，基金管理人可以暂停接受投资人的赎回申请：

- 1) 因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项；
- 2) 证券交易场所在交易时间内非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；
- 3) 连续 2 个开放日以上发生巨额赎回，根据本基金合同规定，基金管理人可以暂停接受赎回申请的情况；

4) 发生本基金合同规定的暂停基金财产估值情况时，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。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；

5) 法律、法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形时，基金管理人应当在当日立即向中国证监会备案并予以公告。

已经确认的赎回申请，基金管理人应当足额支付；如暂时不能足额支付，应当按单个赎回申请人已被接受的赎回申请量占已接受的赎回申请总量的比例分配给赎回申请人，其余部分在后续开放日由基金管理人按照发生的情况制定相应的处理办法予以支付。

在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理。

(3) 暂停期间结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应按规定公告并报中国证监会备案。

1) 如果发生暂停的时间为 1 天，基金管理人应于重新开放申购或赎回日在中国证监会指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并公告最近一个开放日的基金份额净值；

2) 如果发生暂停的时间超过 1 天但少于 2 周，基金管理人应于重新开放申购或赎回日的前 1 个工作日在中国证监会指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并于重新开放申购或赎回日公告最近一个开放日的基金份额净值；

3) 如果发生暂停的时间超过 2 周，基金管理人应在暂停期间每两周至少重复刊登暂停公告一次。暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应最迟提前 2 日在中国证监会指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近一个开放日的基金份额净值。

## **十二、基金转换**

基金转换是指基金份额持有人在本基金存续期间按照基金管理人的规定申请将其持有的本基金基金份额全部或部分转换为基金管理人管理的、由同一注册登记人办理注册登记的其它开放式基金份额的行为。基金管理人在本基金合同生效后的适当时候将为投资人办理基金间的转换业务，具体业务办理时间、业务规

则及转换费率届时在基金转换公告中列明。基金管理人最迟应于转换业务开始前2天在中国证监会指定媒介上刊登公告。

### **十三、定期定额投资计划**

定期定额投资计划，是指投资者通过有关销售机构提出申请，约定每期扣款日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资者指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式。

在各项条件成熟的情况下，本基金可为投资人提供定期定额投资计划服务，具体实施方法以招募说明书或基金管理人届时公布的业务规则为准。

### **十四、基金的非交易过户与转托管**

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

(1) “继承”是指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承。

(2) “捐赠”仅指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或其他具有社会公益性质的社会团体。

(3) “司法强制执行”是指司法机关依据生效的司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制执行划转给其他自然人、法人、社会团体或其他组织。

基金注册登记人可以办理的非交易过户情形，以其公告的业务规则为准。

2、办理非交易过户业务必须提供基金注册登记人要求提供的相关资料，直接向基金注册登记人或其指定的机构申请办理。

3、基金份额持有人在变更办理基金申购与赎回等业务的销售机构（网点）时，可根据各销售机构的实际情况办理已持有基金份额的转托管。基金销售机构可以按照其业务规则规定的标准收取转托管费。

### **十五、基金的销售**

本基金的销售业务指接受投资人申请为其办理的本基金的认购、申购、赎回、转换等业务。

本基金的销售业务由基金管理人及基金管理人委托的其他符合条件的机构办理。基金管理人委托代销机构办理本基金认购、申购、赎回等销售业务的，应与代销机构签订代销协议，以明确基金管理人和代销机构之间在基金份额认购、申购、赎回等销售事宜中的权利和义务，确保基金财产的安全，保护基金投资人和基金份额持有人的合法权益。

## **十六、基金份额的冻结、解冻及质押**

1、基金注册登记人只受理国家有权机关依法要求的基金账户或基金份额的冻结与解冻。基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益一并冻结。

2、在有关法律法规有明确规定的情况下，本基金将可以办理基金份额的质押业务或其他业务。



## 第九部分 基金的投资

### 一、投资目标

本基金紧跟中国经济发展趋势，在充分控制风险的前提下，通过投资具有持续增长潜力且具有合理估值的上市公司，实现基金资产的长期稳定增值。

### 二、投资范围

本基金投资对象是具有良好的流动性的金融工具，包括股票（包含中小板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、银行存款、资产支持证券、权证及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金股票投资占基金资产的比例为30-80%，债券投资占基金资产的比例为0-65%，权证投资占基金资产净值的比例为0-3%，现金及到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资于其它的产品，基金管理人在履行适当的程序后，可以将其纳入投资范围。

### 三、投资理念

本基金秉承“理性分析价值，深度挖掘成长”的投资理念，致力于精选价值与成长兼备的上市公司，通过积极主动的投资管理，实现基金资产的长期稳定增值。

### 四、投资策略

#### 1、资产配置策略

本基金采用自上而下的富安达多维经济模型，通过对全球经济发展形势，国内经济情况及经济政策、物价水平变动趋势、资金供求关系和市场估值的分析，结合 FED 模型，对未来一定时期各大类资产的收益风险变化趋势作出预测，并据此适时动态的调整本基金在股票、债券、现金等资产之间的配置比例。

FED 模型是指股票指数在公正的估值状况下，股票盈利率（即股票市盈率的倒数）应该等于长期（10 年期，国内由于 10 年期债券的历史较短，本基金采用 7 年期债券替代）的债券利率。也就是使用了无风险利率去衡量比较和决定另一种风险资产（如股票）的估值水平。当债券和股票被看做是相互竞争的大类资产配置时，他们的收益率理论上应该是 1：1 的比率，其中一方的收益率增长或下降的时候，这个简单的平衡状态理论上仍旧存在，并将实现偏离后的回归均衡。

### 1)、经济层面分析

经济层面分析包括宏观层面、国际市场等相关因素。

宏观层面相关因素包括宏观经济变量、宏观经济政策等。其中，宏观经济变量包括 GDP 增长率、CPI 和 PPI 走势、固定资产投资增长率、信贷投放规模、进出口增速、货币供应量 M1 增速、M2 增速等因素，宏观经济政策包括利率政策、财政政策、汇率政策、产业政策等因素。

国际市场相关因素包括全球宏观经济、国际金融市场等。全球宏观经济和国际金融市场覆盖美国、欧盟、日本等主要资本市场的经济变量和经济政策、石油等主要能源以及大宗商品的价格变动以及全球资金流动趋势等因素。

### 2)、市场层面分析

市场层面相关因素包括市场风险溢价水平、上市公司盈利预期和市场趋势等。其中，风险溢价水平分析覆盖与国内证券市场历史水平的纵向比较以及和同期国外市场的横向比较等因素，上市公司盈利预期覆盖对上市公司总体业绩预期的调整方向和调整幅度等因素；市场信心覆盖股票市场新开户数的变动情况、市场成交量、换手率、市场气氛、技术走势、基金持仓量等指标的变化等因素。

### 3)、定性及定量分析

本基金基于依据富安达多维经济模型，对相关因素进行定性评估和定量分析。

定性分析时，本基金将上述各因素定性为下述五种情景中的一种，分别是负面、偏负、中性、偏正和正面，再对各因素进行定量评估，上述五种情景的量化得分依次为-2、-1、0、1、2。

### 4)、资产配置比例

在确定证券市场整体环境基础上，本基金根据大类资产的收益和风险，将每类资产的预期收益和风险与目前市场情况进行对比。根据对比结果，得到股票、债券、现金三大类资产的配置比例或调整此前资产配置比例。并随着各类资产风险收益特征的相对变化，适时动态地调整股票、债券和货币市场工具的投资比例，以规避或控制市场风险，提高基金收益率水平。

## 2、股票投资策略

本基金主要采用自下而上的个股精选策略，通过 GARP 策略精选具有成长潜力和合理估值的上市公司，在此基础上结合研究团队的定性分析及实地调研，动态调整本基金的投资组合。

## 1)、定量分析

**GARP策略**（**Growth at a Reasonable Price**：合理价格成长策略）的核心思想是以相对较低的价格买入成长性较高的公司股票。**GARP策略**是成长策略与价值策略的有机结合，不将投资标的划分为成长型股票和价值型股票，强调成长性与合理估值的动态平衡，在追求成长性的同时避免投资标的估值过高的风险。

本基金通过初选股票池、优选股票池、核心股票池构建三个步骤完成个股的定量筛选。

### （1）初选股票池

本基金在公司股票池的基础上剔除最近一年内存在重大管理及经营问题的上市公司。在此基础上，进行流动性筛选，按流通市值从大到小排序，剔除排名后5%的上市公司，构成本基金初选股票池。

### （2）优选股票池

在初选股票池的基础上，通过成长矩阵和价值矩阵筛选具有持续成长潜力，且相对低估的上市公司。

#### ①成长矩阵

本基金通过成长矩阵筛选具有持续的业绩增长历史，且预期保持持续成长的上市公司。成长矩阵共包括6个成长指标：预期净利润增长率、预期净资产收益率、预期EPS增长率、历史净利润增长率、历史净资产收益率、历史主营业务收入增长率。成长矩阵指标按等权重处理，将各项指标分别乘以权重并相加汇总，计算成长矩阵综合得分。将计算出的成长矩阵综合得分按从大到小的顺序进行排列，选择前80%的股票作为优选股票池成长类备选池。

#### ②价值矩阵

本基金通过价值矩阵筛选具有估值优势的上市公司。价值矩阵共包括5个指标：预测PEG，预测PE，历史PB，历史PS，历史EV/EBITDA。价值矩阵指标同样按等权重处理，将各项指标分别乘以权重并相加汇总，计算价值矩阵综合得分。将计算出的价值矩阵综合得分按从小到大的顺序进行排列，选择前80%的股票进入优选股票池价值类备选池。

#### ③构建优选股票池

选取同时在成长类备选池和价值类备选池中的股票形成优选股票池。

### （3）核心股票池

为了克服纯量化策略的缺点，投研团队将对公司股票池（以优选股票池为重点）展开基本面分析和实地调研，通过对上市公司治理结构、行业发展环境、产业政策等方面的评估和分析来确定核心股票池。核心股票池中要保证80%来自于优选股票池。

对于公司基本面明显好转，但财务指标尚未反映出公司基本面改观，或由于某些因素导致基本面出现重大好转，未来业绩具有爆发性增长的公司，经过内部评估后可直接进入核心股票池，但此类股票配置总体不得超过 10%。

## 2)、股票投资组合

基金经理根据本基金的投资决策流程，权衡风险收益特征后，构建股票投资组合，并根据市场及公司情况变动，定期动态调整。

对于存托凭证投资，本基金将在深入研究的基础上，通过定性分析和定量分析相结合的方式，精选出具有比较优势的存托凭证。

## 3、债券投资策略

本基金在充分分析债券市场宏观情况及利率政策的基础上，采取自上而下的策略构造组合。

1)、以久期策略为债券投资组合的核心策略，通过对宏观经济各项因素的分析分析预测市场利率水平的趋势变化，据此确定债券组合的整体久期；

2)、结合收益率曲线的预测，采取期限结构配置策略，包括采用集中策略、两端策略和梯形策略等，在长期、中期和短期债券间进行动态调整，确定长、中、短期债券投资比例；

3)、充分利用现有行业与公司研究力量，根据发债主体的经营状况和现金流等情况对其信用风险进行评估，以此作为品种选择的基本依据。

## 4、权证投资策略

本基金通过对权证标的证券基本面的研究，结合权证定价模型寻求其合理估值水平，主要投资策略为价差策略，在充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征的前提下，决策买入、持有及卖出权证。

## 五、投资管理程序

### 1、投资决策依据

(1) 国家有关法律、法规、规章和基金合同的有关规定。

(2) 宏观经济发展环境、证券市场走势。

## **2、投资管理程序**

(1) 投资研究管理架构

(2) 投资决策机制

依照逐级授权的原则，本公司的投资决策机制分别由投资决策委员会、投资业务负责人和基金经理三个层面具体实施：

1) 投资决策委员会

投资决策委员会是全公司基金投资的最高决策机构，公司基金及受托资产投资行为必须经过投资决策委员会授权，投资相关人员必须严格按照该委员会制定的原则和决策从事投资活动。投资决策委员会由公司总经理、投资总监、投资部和研究部负责人、基金经理等人员组成（督察长列席会议），定期或不定期召开会议讨论和决定基金投资中的重大问题，包括制定总体投资方案、确定资产和行业配置原则、审定基金经理的投资提案、批准基金经理的超权限投资等。

2) 投资业务负责人

投资业务负责人由投资总监担任，其主要职责是参加投资决策委员会、制定投资研究业务规则并监督实行、负责投资研究等部门的日常管理、审批基金经理超权限投资等。

3) 基金经理

本公司实行授权制度下的基金经理负责制。公司制定制度对基金经理的职责和权限进行规定，投资决策委员会对基金经理的投资方案进行原则性决策，基金经理在遵循上述要求的前提下负责具体的证券投资事务，执行和优化组合配置方案，并对其投资业绩负责。基金经理可以在特殊情况下授权基金经理助理暂时代为履行投资职责，但必须遵守公司的规定，不得采用无条件和无时限的授权。

## **3、研究机制**

本公司设立研究发展部，具体负责公司的研究业务，具体包括研究投资策略，提供包括宏观经济、资本市场、产业配置等策略报告，为投资部门把握市场机会服务；开展对行业、公司、固定收益产品、衍生产品的研究，为投资部门、投资决策委员会提供投资建议；开展基金绩效考核，为投资决策委员会提供旗下基金的绩效分析报告等。

## **4、投资基本流程**

### 1) 投资决策委员会制定投资决策

投资决策委员会定期或不定期召开会议,对下一阶段基金投资的资产和行业配置进行讨论,明确股票库的构成和最新变化,并最终确定总体投资方案。

### 2) 研究部门进行研究分析

研究部门将广泛地参考和利用公司外部的研究成果,及时了解国家宏观经济走势和行业发展状况等,并采用实地调研、持续跟踪等方式对上市公司进行深入调查研究,并建立相关模型,最终形成对宏观经济、投资策略和公司基本面的深度研究报告,提交投资决策委员会和投资部门作为决策和投资的依据。研究部门的固定收益产品研究人员将在对宏观经济、财政货币政策和市场资金供求状况深入分析的基础上,利用数量化模型,合理预计收益率曲线,并形成债券投资策略提交投资部门。此外,研究部门和投资部门定期或不定期举行投资研究联席会议,讨论宏观经济、行业、上市公司、债券等问题,作为投资决策的重要依据之一。

### 3) 投资部门实施投资

基金经理及投资团队根据投资决策委员会确定的总体投资方案,依据研究部门提供的研究成果,对宏观经济、行业发展和个股走势做出判断,完善资产配置和行业配置方案,构建和优化投资组合,并具体实施下达交易指令。对于超出权限范围的投资,基金经理应按照公司权限审批流程,提交主管投资领导或投资决策委员会审议。

#### ①集中交易室执行交易

集中交易室接受基金经理下达的交易指令。集中交易室接到指令后,首先应对指令予以审核,然后再具体执行。基金经理下达的交易指令不明确、不规范或者不合规的,集中交易室可以暂不执行指令,并即时通知基金经理或相关人员。集中交易室应根据市场情况随时向基金经理通报交易指令的执行情况及对该项交易的判断和建议,以便基金经理及时调整交易策略。

#### ②投资绩效分析评估

公司研究部门和风险控制部门会对基金投资的业绩进行数量化分析,利用相关工具对基金投资的风险检验、风险评估、投资绩效的风险调整和业绩贡献等方面进行评估和测算,并提交投资部门和投资决策委员会作为对下期投资方案决策的依据。

#### ③风险控制和监察稽核

公司设置风险管理委员会定期召开会议讨论公司各项风险问题，并对投资风险进行识别和监控；公司督察长和监察稽核部门负责对投资研究环节的全面事前、事中和事后的合规监督检查，及时向公司管理层和董事会上报发现的合规性问题并持续督促相关部门予以解决。

## 六、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准： $\text{沪深300指数收益率} \times 55\% + \text{上证国债指数收益率} \times 45\%$ 。

本基金采用沪深300指数和上证国债指数作为业绩比较基准主要是由于：

本基金为混合型证券投资基金，股票投资比例为30%-80%，因此在业绩比较基准中股票投资部分权重为55%，其余为债券投资部分。沪深300指数是由中证指数有限公司编制，在上海和深圳证券交易所中选取300只A股作为样本编制而成的成份股指数。该指数样本覆盖了沪深市场六成左右的市值，具有良好的市场代表性，是目前中国证券市场中公允性较好的股票指数，适合作为本基金的业绩比较基准。上证国债指数样本涵盖了上海证券交易所所有的国债品种，能反映出市场利率的瞬息变化并且也能真实地标示出利率市场整体的收益风险度。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，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，本基金可以与基金托管人协商一致并报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

## 七、风险收益特征

本基金属于混合型证券投资基金，一般情况，其风险和收益高于债券型基金和货币市场基金。

## 八、投资禁止行为与限制

(1) 禁止用本基金财产从事以下行为

- 1) 承销证券；
- 2) 向他人贷款或者提供担保；
- 3) 从事承担无限责任的投资；

- 4) 买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
- 5) 向本基金的基金管理人、基金托管人出资或者买卖本基金的基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- 6) 买卖与本基金的基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与本基金的基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；
- 7) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- 8) 依照法律、行政法规有关规定，由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禁止性规定，本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

## (2) 基金投资组合比例限制

- 1) 本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%；
- 2) 本基金与基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券总和，不超过该证券的 10%；
- 3) 本基金股票投资比例范围为：股票投资占基金资产的比例为 30-80%，债券投资占基金资产的比例为 0-65%，权证投资占基金资产净值的比例为 0-3%，现金及到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%；
- 4) 本基金参与股票发行申购，所申报的金额不超过本基金总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；
- 5) 在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不展期；
- 6) 在银行间市场进行债券回购融入的资金余额不超过基金资产净值的 40%；
- 7) 基金的投资组合中保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；



- 8) 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%; 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%; 本公司管理的全部基金持有的同一权证, 不得超过该权证的 10%。其他权证的投资比例, 遵从法规或监管部门的相关规定;
- 9) 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例, 不得超过该资产支持证券规模的 10%; 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例, 不得超过基金资产净值的 10%; 本公司管理的全部证券投资基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券, 不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%; 本基金持有的全部资产支持证券, 其市值不得超过基金资产净值的 20%, 中国证监会规定的特殊品种除外;
- 10) 本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, 将在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出;
- 11) 流通受限证券投资遵照《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》(证监基金字[2006]141 号)及相关规定执行;
- 12) 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%;
- 13) 本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票, 不得超过该上市公司可流通股票的 30%;
- 14) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的 15%;  
因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前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;
- 15) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的, 可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致;

16) 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；

17) 法律、法规、基金合同及中国证监会规定的其他比例限制。

(3) 法律法规或监管部门修改或取消上述限制规定（第 3）项除外）时，本基金不受上述投资组合限制并相应修改限制规定。

## 九、投资组合比例调整

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。除上述 7)、10)、14)、15) 项外，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的，基金管理人应当在 10 个工作日内进行调整，法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。

## 十、基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

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

2、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；

3、有利于基金财产的安全与增值；

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

## 十一、基金的融资融券

本基金可以按照国家的有关规定进行融资、融券。

## 十二、基金投资组合报告

本投资组合报告所载数据截至 2021 年 3 月 31 日。

### 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	84,100,855.08	63.21
	其中：股票	84,100,855.08	63.21
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	17,500,000.00	13.15
	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	31,371,947.82	23.58
8	其他资产	77,858.51	0.06
9	合计	133,050,661.41	100.00

由于四舍五入的原因，各比例的分项与合计可能有尾差。

## 2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	2,644,710.00	2.27
C	制造业	55,576,289.08	47.80
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	67,750.68	0.06
E	建筑业	1,193,700.00	1.03
F	批发和零售业	6,428.75	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	2,165,460.00	1.86
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,242,361.58	1.07
J	金融业	12,022,922.00	10.34
K	房地产业	2,986,877.00	2.57
L	租赁和商务服务业	1,254,928.00	1.08
M	科学研究和技术服务业	960,046.30	0.83
N	水利、环境和公共设施管理业	7,170.29	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	3,972,211.40	3.42
S	综合	-	-
	合计	84,100,855.08	72.33

注：由于四舍五入的原因，各比例的分项与合计可能有尾差。

### 2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资的股票。

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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000651	格力电器	95,700	6,000,390.00	5.16
2	600519	贵州茅台	2,800	5,625,200.00	4.84
3	601012	隆基股份	60,900	5,359,200.00	4.61
4	300413	芒果超媒	68,345	3,972,211.40	3.42
5	600276	恒瑞医药	42,720	3,934,084.80	3.38
6	601166	兴业银行	155,900	3,755,631.00	3.23
7	601398	工商银行	676,500	3,747,810.00	3.22
8	300750	宁德时代	11,300	3,640,521.00	3.13
9	600887	伊利股份	75,000	3,002,250.00	2.58
10	600048	保利地产	209,900	2,986,877.00	2.57

### 4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

### 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

本基金本报告期末未持有债券。

### 6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排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

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 11 投资组合报告附注

11.1 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，除兴业银行（601166）外，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2020年8月31日，中国银保监会福建监管局作出闽银保监罚决字（2020）24号行政处罚决定书，没收兴业银行违法所得6,361,807.97元，并合计处以罚款15,961,807.97元。主要违法违规事实(案由)如下：同业投资用途不合规、授信管理不尽职、采用不正当手段吸收存款、理财资金间接投资本行信贷资产收益权、非洁净转让信贷资产、违规接受地方财政部门担保。

2020年9月4日，中国人民银行福州中心支行作出福银罚字（2020）35号行政处罚决定书，对兴业银行给予警告，没收违法所得10,875,088.15元，并处13,824,431.23元罚款。主要违法违规事实(案由)如下：1. 为无证机构提供转接清算服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性的规定；2. 为支付机构超范围（超业务、超地域）经营提供支付服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性；3. 违规连通上、下游支付机构，提供转接清算服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性；4. 违反银行卡收单外包管理规定；5. 未按规定履行客户身份识别义务。

在本基金对该证券的投资过程中，本基金管理人在遵守法律法规和公司管理制度的前提下，经公司审慎研究评估，将该股票纳入投资库进行投资。整个过程中严格履行了相关的投资决策程序。

11.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选库。

### 11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	60,303.81
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,026.08
5	应收申购款	11,528.62
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	77,858.51

11.4 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。

#### **11.5 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。

## 第十部分基金的业绩

本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资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。本基金合同生效日为2012年4月25日,基金业绩数据截至2021年3月31日。

### 一、基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2012年04月25日(合同生效日)-2012年12月31日	-2.01%	0.65%	-0.43%	0.66%	-1.58%	-0.01%
2013年1月1日-2013年12月31日	4.98%	1.47%	-2.54%	0.77%	7.52%	0.70%
2014年1月1日-2014年12月31日	26.48%	1.47%	28.79%	0.67%	-2.31%	0.80%
2015年1月1日-2015年12月31日	49.92%	3.06%	7.82%	1.37%	42.10%	1.69%
2016年1月1日-2016年12月31日	4.84%	1.24%	-4.38%	0.77%	9.22%	0.47%
2017年1月1日-2017年12月31日	27.55%	0.55%	11.92%	0.35%	15.63%	0.20%
2018年1月1日-2018年12月31日	-16.62%	1.12%	-12.22%	0.74%	-4.4%	0.38%
2019年1月1日-2019年12月31日	29.07%	0.98%	21.32%	0.69%	7.75%	0.29%
2020年1月1日-2020年12月31日	41.82%	1.42%	16.76%	0.78%	25.06%	0.64%
2012年04月25日(合同生效日)-2021年03月31日	268.74%	1.52%	77.16%	0.80%	191.58%	0.72%

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

富安达策略精选混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2012年04月25日-2021年03月31日)



注：根据《富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》规定，本基金建仓期为6个月，建仓截止日为2012年10月24日。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。



## 第十一部分 基金的财产

### 一、基金资产总值

基金资产总值是指本基金拥有的各类有价证券及票据价值、银行存款本息、债券的应计利息、基金应收的申购基金款、缴存的保证金以及其他投资所形成的价值总和。

其构成主要有：

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

### 二、基金资产净值

本基金基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### 三、基金财产的账户

基金托管人以本基金的名义在其营业机构开立本基金的银行存款托管账户；以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司开立基金结算备付金账户，以本基金的名义在基金托管人托管系统中开立二级结算备付金账户；以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司开立证券账户，以本基金的名义开立银行间债券托管账户并报中国人民银行备案。开立的上述基金财产账户与基金管理人、基金托管人、代销机构和注册登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

如国家相关法律法规调整，基金管理人和基金托管人有权依据新规定执行。

### 四、基金财产的保管及处分

1、本基金财产独立于基金管理人及基金托管人的固有财产，并由基金托管人保管。

2、基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得

的财产和收益，归基金财产。

3、基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算范围。

4、基金财产的债权不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债务相抵销；不同基金财产的债权债务，不得相互抵销。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

5、基金管理人、基金托管人、注册登记机构和代销机构以其自有的财产承担其自身的法律责任，其债权人不得对本基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。除法律法规和基金合同的规定处分外，基金财产不得被处分。

## 第十二部分 基金资产的估值

### 一、估值目的

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

### 二、估值日

本基金的估值日为基金合同生效后相关的证券交易场所的正常交易日，以及法律法规规定需要对外披露基金净值的非交易日。

### 三、估值对象

基金所拥有的股票、债券、权证和银行存款本息、应收款项和其他投资等资产。

### 四、估值方法

#### 1、股票估值方法

(1) 上市流通股股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，以最近交易日的收盘价估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。如有充足证据表明最近交易日收盘价不能真实地反映公允价值的，应对最近交易日的收盘价进行调整，确定公允价值进行估值。

(2) 未上市股票的估值：

A、首次发行的股票，采用估值技术确定公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

B、首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按估值日其所在证券交易所上市的同一股票以第(1)条确定的估值价格进行估值。

C、送股、转增股、配股和公开增发新股等方式发行的股票，按估值日该上市公司在证券交易所挂牌的同一流通股票以第(1)条确定的估值价格进行估值。

D、非公开发行有明确锁定期的股票按如下方法进行估值：

a、估值日在证券交易所上市交易的同一股票以第(1)条确定的估值价格低于非公开发行股票初始取得成本时，应采用在证券交易所上市交易的同一股票以第(1)条确定的估值价格作为估值日该非公开发行股票的价值；

b、估值日在证券交易所上市交易的同一股票以第(1)条确定的估值价格高

于非公开发行股票初始取得成本时，应按下列公式确定估值日该非公开发行股票的价值：

$$FV=C+(P-C) \times (D1-Dr) / D1$$
（FV 为估值日该非公开发行股票的价值；C 为该非公开发行股票初始取得成本（因权益业务导致市场价格除权时，应于除权日对其初始取得的成本作相应调整）；P 为估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价；D1 为该非公开发行股票锁定期所含的交易所的交易天数；Dr 为估值日剩余锁定期，即估值日至锁定期结束所含的交易所的交易天数，不含估值日当天。

E、长期停牌的股票，按监管机构及行业协会的规范进行估值。若未来市场环境发生重大变化，基金管理人与基金托管人协商一致后，可采用其他合理的估值方法进行估值。

(3) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

## 2、债券估值方法

(1) 在证券交易所市场挂牌交易的实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日无交易的，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，以最近交易日的收盘价估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。如有充足证据表明最近交易日收盘价不能真实地反映公允价值的，应对最近交易日的收盘价进行调整，确定公允价值进行估值。

(2) 在证券交易所市场挂牌交易的未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值，估值日无交易的，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按最近交易日债券收盘价减去所含的最近交易日债券应收利息后的净价进行估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价（净价）及重大变化因素，调整最近交易日收盘价（净价），确定公允价值进行估值。如有充足证据表明最近交易日收盘价（净价）不能真实地反映公允价值的，应对最近交易日的收盘价（净价）进行调整，确定公允价值进行估值。

(3) 首次发行未上市债券采用估值技术确定的公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(4) 在银行间债券市场交易的债券根据行业协会指导的处理标准或意见并综合考虑市场成交价、市场报价、流动性及收益率曲线等因素确定其公允价值进

行估值。

(5) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

### 3、权证估值方法

(1) 上市流通权证按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，以最近交易日的收盘价估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。如有充足证据表明最近交易日收盘价不能真实地反映公允价值的，应对最近交易日的收盘价进行调整，确定公允价值进行估值。

(2) 首次发行未上市的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(3) 停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值进行估值。

(4) 因持有股票而享有的配股权证，以配股除权日起到配股确认日止，若收盘价高于配股价，则按收盘价和配股价的差额进行估值，若收盘价低于配股价，则估值为零。

(5) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

### 4、资产支持证券的估值方法

(1) 交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，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) 全国银行间市场交易的资产支持证券，根据行业协会指导的处理标准或意见并综合考虑市场成交价、市场报价、流动性及收益率曲线等因素确定其公允价值进行估值。

(3) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

5、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。

### 6、其他资产的估值方法

其他资产按国家有关规定进行估值。

7、在任何情况下，基金管理人如采用上述估值方法对基金财产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如基金管理人认为上述估值方法对基金财产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人在综合考虑市场各因素的基础上，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。

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

基金管理人、基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序以及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，发现方应及时通知对方，以约定的方法、程序和相关法律法规的规定进行估值，以维护基金份额持有人的利益。

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

7、在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外）采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

## 五、估值程序

基金日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行。基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以双方约定形式报给基金托管人，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金托管人复核无误后将结果反馈给基金管理人，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行

## 六、暂停估值的情形

（1）基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

（2）因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

（3）当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商一致的，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、基金份额净值的计算

$T$  日基金份额净值 =  $T$  日基金资产净值 /  $T$  日基金总份额

基金份额净值的计算，精确到 0.0001 元，小数点第五位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

## 八、估值错误的处理

1、当基金财产的估值导致基金份额净值小数点后四位内（含第四位）发生差错时，视为基金份额净值估值错误。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财产估值的准确性、及时性。当估值或基金份额净值计价出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当计价错误达到或超过基金份额净值的 0.25% 时，基金管理人应通报基金托管人，并报告中国证监会；计价错误达到基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应通报基金托管人，按本基金合同的规定进行公告，并报中国证监会备案。

### 2、差错类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人、基金托管人、注册登记人、代理销售机构或投资人自身的原因造成差错，导致其他当事人遭受损失的，责任人应当对由于该差错遭受损失的当事人（“受损方”）按下述“差错处理原则”给予赔偿。

上述差错的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等；对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术无法预见、无法避免、无法抗拒，则属不可抗力。

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

### 3、差错处理原则

因基金估值错误给投资人造成损失的应由基金管理人或基金托管人或者基金先行支付赔偿金。基金管理人对其不应由其承担的责任，有权向责任人追偿。本基金合同的当事人应将按照以下约定的原则处理基金估值差错：

(1) 差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各

方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已产生的差错，给当事人造成损失的由差错责任方承担；若差错责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，由此造成或扩大的损失由差错责任方和未更正方依法分别各自承担相应的赔偿责任。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正；

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

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

(4) 差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式；

(5) 如果因基金管理人原因造成基金财产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人原因造成基金财产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。除基金管理人和托管人之外的第三方造成基金财产的损失，由基金管理人负责向差错方追偿；

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

(7) 按法律法规规定的其他原则处理差错。

#### 4、差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

(2) 根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；

(3) 根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔



偿损失；

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

(5) 基金管理人及基金托管人计价错误达到或超过基金份额净值的 0.25% 时，基金管理人应通报基金托管人，并报告中国证监会；计价错误达到基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应通报基金托管人，按本基金合同的规定进行公告，并报中国证监会备案。

### **九、特殊情形的处理**

1、基金管理人按本条第四项第 7 条款进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

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

## 第十三部分 基金的收益与分配

### 一、基金收益的构成

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

(2) 因运用基金财产带来的成本或费用的节约应计入收益。

(3) 基金净收益为基金收益扣除按照有关规定可以在基金收益中扣除的费用等项目后的余额。

### 二、收益分配原则

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 4 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 30%。基金收益分配比例应当以期末可供分配利润为基准计算。期末可供分配利润指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(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；

(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 每一基金份额享有同等分配权；

(5) 基金当期收益先弥补上期亏损后，方可进行当期收益分配；

(6) 分红权益登记日申请申购的基金份额不享受当次分红，分红权益登记日申请赎回的基金份额享受当次分红；

(7) 基金红利发放日距离收益分配基准日的时间不得超过 15 个工作日；

(8) 法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

### 三、收益分配方案

基金收益分配方案中载明基金收益的范围、基金收益分配对象、基金期末可供分配利润、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式、支付方式及有关手续费等内容。

### 四、收益分配方案的确定与公告

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，依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

## **五、收益分配中发生的费用**

收益分配时发生的银行转账等手续费用由基金份额持有人自行承担。当基金份额持有人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记机构可将基金份额持有人的现金红利按权益登记日除权后的基金份额净值自动转为基金份额。

## 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、基金合同生效后的与基金相关的信息披露费用；
- 4、基金份额持有人大会费用；
- 5、基金合同生效后与基金有关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 6、基金的证券交易费用；
- 7、基金银行汇划费用；
- 8、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。

上述基金费用从基金财产中支付。

### 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

本基金的管理费率为年费率 1.5%。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日或不可抗力无法支付的，支付日期顺延。

#### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费率为年费率 0.25%。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日或不可抗力无法支付的，支付日期顺延。

3、本条第（一）款第 3 至第 8 项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入或摊入当期基金费用。

### **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）以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用；
- （3）基金合同生效之前的律师费、会计师费和信息披露费用等不得从基金财产中列支；
- （4）其他根据法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

### **四、基金管理费和基金托管费的调整**

在符合相关法律法规和履行了必备的程序的条件下，基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前 2 日在中国证监会指定媒介上刊登公告。

### **五、其他费用**

按照国家有关规定和基金合同约定，基金管理人可以在基金财产中列支其他的费用，并按照相关的法律法规的规定进行公告或备案。

### **六、税收**

本基金运作过程中涉及的各纳税主体根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

## 第十五部分 基金的会计与审计

### 一、基金的会计政策

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

### 二、基金的审计

- 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相独立的、具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对基金年度财务报表及其他规定事项进行审计；
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人和基金托管人同意；
- 3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通知基金托管人。更换会计师事务所需按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

## 第十六部分 基金的信息披露

### 一、披露原则

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。

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、完整性、及时性、简明性和易得性。

基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内,将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的全国性报刊(以下简称“指定报刊”)及指定互联网网站(以下简称“指定网站”)等媒介披露,并保证投资人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。

本基金信息披露义务人承诺在公开披露基金信息的过程中不得有下列行为:

- (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。

本基金公开披露的信息应采用中文文本。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。

### 二、基金募集信息披露

- (1) 基金募集申请经中国证监会核准后,基金管理人应当在基金份额发售

的3日前，将招募说明书、基金合同摘要登载在指定媒体上；基金管理人、基金托管人应当将基金合同、基金托管协议登载在各自公司网站上。

(2) 基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于指定媒体上。

(3) 基金管理人应当在基金合同生效的次日在指定媒体上登载基金合同生效公告。

(4) 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。

(5) 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。

### 三、定期报告

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

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

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

(3) 基金季度报告：基金管理人应当在季度结束之日起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。

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

基金运作期间，如报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额 20% 的情形，为保障其他投资者的权益，基金管理人至少应当在基金定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本基金的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

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

#### **四、基金净值信息**

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

在开始办理基金份额申购或者赎回后，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、临时报告与公告**

基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，并登载在指定报刊和指定网站上。

前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件：

- (1) 基金份额持有人大会的召开及决定的事项；
- (2) 基金合同终止、基金清算；

- (3) 转换基金运作方式、基金合并；
- (4) 更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；
- (5) 基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；
- (6) 基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- (7) 基金管理公司变更持有百分之五以上股权的股东、变更公司的实际控制人；
- (8) 基金募集期延长或提前结束募集；
- (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仲裁；
- (12) 基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；
- (13) 基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易事项，中国证监会另有规定的除外；
- (14) 基金收益分配事项；
- (15) 管理费、托管费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- (16) 基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；
- (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) 基金信息披露义务人认为可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的其他事项或中国证监会规定的其他事项。

## 七、澄清公告

在基金合同期限内，任何公共媒体中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动，以及可能损害基金份额持有人权益的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会。

八、中国证监会规定的其他信息：无。

## 九、信息披露事务管理

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

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

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

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。

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。

#### **十、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。

#### **十一、本基金信息披露事项以法律法规规定及本章节约定的内容为准。**

## 第十七部分 风险揭示

### 一、投资于本基金的主要风险

风险揭示，即识别市场变化和交易过程中的各种潜在风险因素，并量化成各种风险指标。本基金面临的风险主要包括：市场风险、管理风险、流动性风险、信用风险以及其它风险等。

#### 1、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。基金投资于债券，收益水平也会随之变化，从而产生风险。

(3) 利率风险。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。基金投资于债券，其收益水平会受到利率变化的影响。在利率上升时，基金持有的债券价格下降，如基金组合久期较长，则将造成基金资产的损失。

(4) 债券市场流动性风险。由于银行间债券市场深度和宽度相对较低，交易相对较不活跃，可能增大银行间债券变现难度，从而影响基金资产变现能力的风险。

(5) 新股价格波动风险。本基金可投资于新股申购，本基金所投资新股价格波动将对基金收益率产生影响。

#### 2、管理风险

在基金管理运作过程中，基金管理人的研究水平、投资管理水平直接影响基金收益水平，如果基金管理人经济形势和证券市场判断不准确、获取的信息不全、投资操作出现失误，都会影响基金的收益水平。基金托管人的管理水平对基金收益水平也存在影响。

#### 3、流动性风险

流动性风险主要包括两层含义，一是开放式基金要随时应对投资者的赎回，如果基金资产不能迅速转变成现金，或者变现为现金时使资金净值产生不利的影响，都会影响基金运作和收益水平。尤其是在发生巨额赎回时，如果基金资产变现能力差，可能会产生基金仓位调整的困难，导致流动性风险，从而可能影响基

金份额净值。二是基金管理人难以在合理的时间内以公允价格将其投资组合变现而引起资产损失或交易成本的不确定性。

(1) 本基金的申购、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、赎回与转换”章节。

(2) 本基金拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

1) 本基金合同约定：“本基金投资对象是具有良好流动性的金融工具”，其中“股票投资占基金资产的比例为 30-80%”，从投资范围和所处的行业上看，基金资产及该类股票的流动性良好；

2) 从投资限制上看，本基金合同约定：“基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的 15%”，本基金流动性受限资产的比例设置符合《流动性风险管理规定》。

综上所述，本基金拟投资市场、行业及资产的流动性良好，流动性风险相对可控。

(3) 巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

当本基金出现巨额赎回情形时，本基金管理人经内部决策，并与基金托管人协商一致后，将运用多种流动性风险管理工具对赎回申请进行适度调整，以应对流动性风险，保护基金份额持有人的利益，包括但不限于：

- 1) 延缓办理巨额赎回申请；
- 2) 暂停接受赎回申请；
- 3) 延缓支付赎回款项；
- 4) 中国证监会认可的其他措施。

具体措施，详见招募说明书“第八部分基金份额的申购、赎回与转换”中“十、巨额赎回的认定及处理方式”的相关内容。

(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，对赎回申请等进行适度调整，作为特定情形下基金管理人流动性风险管理的辅助措施，包括但不限于：

- 1) 延期办理巨额赎回申请

具体措施,详见招募说明书“第八部分基金份额的申购、赎回与转换”中“十、巨额赎回的认定及处理方式”的相关内容。

#### 2) 暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项

上述具体措施,详见招募说明书“第八部分基金份额的申购、赎回与转换”中“十一、拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理”的相关内容。

#### 3) 收取短期赎回费

对持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5%的赎回费,并将上述赎回费全额计入基金财产。

#### 4) 暂停基金估值

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

#### 5) 摆动定价

当基金发生大额申购或赎回情形时,基金管理人可采用摆动定价机制,以确保基金估值的公平性,具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则规定。

当本基金出现上述情形时,本基金可能无法及时满足所有投资者的赎回申请,投资者收到赎回款项的时间也可能晚于预期或可能增加投资者赎回的成本。

#### 4、信用风险

本基金所遭遇的信用风险主要包括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,造成基金财产损失,以及基金所投资股票的上市公司因造假或者信息披露不真实等导致股票价格下降,造成基金财产损失。

#### 5、特定风险揭示

本基金为混合型基金,本基金股票投资比例为基金资产的 30%-80%,投资者面临的特定风险主要为股票投资风险。股票的投资收益会受到宏观经济、市场偏好、行业波动和公司自身经营状况等因素的影响。因此,本基金所投资的股票可能在一定时期内表现与其他未投资的股票不同,造成本基金的收益低于其他基金。此外,由于本基金还可以投资其它品种,这些品种的价格也可能因市场中的各类

变化而出现一定幅度的波动，产生特定的风险，并影响到整体基金的投资收益。

本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将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。6、其他风险

包括操作或技术风险、波动度风险、再投资风险、通货膨胀风险、政治或法律风险、行业风险、突发事件风险等。

## 二、声明

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

2、除基金管理人直接办理本基金的销售外，本基金还通过基金代销机构代理销售，但是，基金资产并不是代销机构的存款或负债，也没有经基金代销机构担保收益，代销机构并不能保证其收益或本金安全。



## 第十八部分 基金的终止与基金财产清算

### 一、基金合同的变更

(1) 基金合同变更涉及本基金合同第八节第(二)项规定的对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的, 应经基金份额持有人大会决议同意。变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准, 并自中国证监会核准之日起生效。

(2) 除上述第(1)项规定的情形外, 经基金管理人和基金托管人同意可对基金合同的内容进行变更, 该等变更应当在2日内由基金管理人进行公告。

### 二、基金合同的终止

有下列情形之一的, 本基金合同终止:

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

### 三、基金财产的清算

(1) 基金合同终止, 应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。

#### (2) 基金财产清算组

- 1) 自基金合同终止之日起30个工作日内由基金管理人组织成立基金财产清算组, 在基金财产清算组接管基金财产之前, 基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。
- 2) 基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、基金注册登记人、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。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。
- 3) 基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算组可以依法进行必要的民事活动。

### (3) 清算程序

- 1) 基金合同终止后，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- 2) 基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；
- 3) 基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；
- 4) 对基金财产进行评估和变现；
- 5) 基金清算组做出清算报告；
- 6) 会计师事务所对清算报告进行审计；
- 7) 律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- 8) 将基金清算结果报告中国证监会；
- 9) 公布基金清算公告；
- 10) 对基金剩余财产进行分配。

### (4) 清算费用

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

### (5) 基金剩余财产的分配

基金财产按如下顺序进行清偿：

- 1) 支付基金财产清算费用；
- 2) 缴纳基金所欠税款；
- 3) 清偿基金债务；
- 4) 清算后如有余额，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

### (6) 基金财产清算的公告

清算小组成立后 2 日内应就清算小组的成立进行公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算组做出的清算报告经具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并公告。基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

### (7) 基金财产清算账册及文件由基金托管人保存期限不少于 15 年。

## 第十九部分 基金合同的内容摘要

### 一、 基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

#### 1、基金份额持有人的权利、义务

(1) 基金投资人持有本基金基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，基金投资人自依据招募说明书、基金合同取得本基金的基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为当事人并不以在基金合同上书面签章为必要条件。每份基金份额具有同等的合法权益。

#### (2) 基金份额持有人的权利

- 1) 分享基金财产收益；
- 2) 参与分配清算后的剩余基金财产；
- 3) 依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；
- 4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会；
- 5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- 6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- 7) 监督基金管理人的投资运作；
- 8) 对基金管理人、基金托管人、注册登记人、基金销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；
- 9) 法律法规、基金合同规定的其它权利。

#### (3) 基金份额持有人的义务

- 1) 遵守基金合同；
- 2) 交纳基金认购、申购款项及基金合同规定的费用；
- 3) 在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；
- 4) 不从事任何有损基金及其他基金合同当事人合法利益的活动；
- 5) 执行生效的基金份额持有人大会决议；
- 6) 返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人、基金托管人及代销机构处获得的不当得利；

7) 法律法规及基金合同规定的其他义务。

## 2、基金管理人的权利、义务

### (1) 基金管理人的权利

- 1) 依法募集基金，办理基金备案手续；
- 2) 自基金合同生效之日起，依照法律法规和基金合同独立管理基金财产；
- 3) 根据法律法规和基金合同的规定，制订、修改并公布有关基金募集、认购、申购、赎回、转托管、基金转换、非交易过户、冻结、收益分配等方面的业务规则；
- 4) 根据法律法规和基金合同的规定获得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；
- 5) 在符合有关法律法规和基金合同的前提下，决定本基金的相关费率结构和收费方式；
- 6) 根据法律法规和基金合同之规定销售基金份额；
- 7) 依据法律法规和基金合同的规定监督基金托管人；
- 8) 根据基金合同的规定选择适当的基金代销机构并有权依照代销协议对基金代销机构行为进行必要的监督和检查；
- 9) 自行承担基金注册登记人或选择、更换基金注册登记代理机构，办理基金注册登记业务，并按照基金合同规定对基金注册登记代理机构进行必要的监督和检查；
- 10) 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回的申请；
- 11) 在法律法规允许的前提下，为基金份额持有人的利益依法为基金进行融资融券；
- 12) 依据法律法规和基金合同的规定，制订基金收益的分配方案；
- 13) 按照法律法规，代表基金对被投资企业行使股东权利，代表基金行使因投资于其它证券所产生的权利；
- 14) 在基金托管人职责终止时，提名新的基金托管人；
- 15) 依据法律法规和基金合同的规定，召集基金份额持有人大会；
- 16) 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

- 17) 选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构并确定有关费率;
- 18) 法律法规、基金合同以及依据基金合同制订的其它法律文件所规定的其它权利。

(2) 基金管理人的义务

- 1) 依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜;
- 2) 办理基金备案手续;
- 3) 自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产;
- 4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产;
- 5) 配备足够的专业人员办理基金份额的认购、申购和赎回业务;
- 6) 配备足够的专业人员和相应的技术设施进行基金的注册登记或委托其他机构代理该项业务;
- 7) 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资产相互独立，对所管理的不同基金和受托资产分别管理、分别记账，进行证券投资;
- 8) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得以基金财产为自己及任何第三人谋取非法利益，不得委托第三人运作基金财产;
- 9) 接受基金托管人依法进行的监督;
- 10) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回价格的方法符合基金合同等法律文件的规定，按照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;
- 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，应予以保密，不得向他人泄露;

- 13) 按基金合同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) 按照法律法规和本基金合同的规定受理申购和赎回等申请，及时、足额支付赎回和分红款项；
- 15) 不谋求对上市公司的控股和直接管理；
- 16) 依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会，或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
- 17) 按规定保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料不少于 15 年；
- 18) 进行基金会计核算并编制基金的财务会计报告；
- 19) 编制季度报告、中期报告和年度报告；
- 20) 确保需要向基金份额持有人提供的各项文件或资料，能在规定时间内发出；保证投资人能够按照基金合同约定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件；
- 21) 组织并参加基金财产清算组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- 22) 面临解散、依法被撤销、被依法宣告破产或者由接管人接管其资产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；
- 23) 因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人的合法权益，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- 24) 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，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；
- 25) 不从事任何有损基金财产及本基金其他当事人利益的活动；
- 26) 公平对待所管理的不同基金和受托资产，防止在不同基金和受托资产间进行有损本基金基金份额持有人的利益的资源分配；
- 27) 以基金管理人的名义，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；

28) 法律法规及基金合同规定的其他义务。

### 3、基金托管人的权利和义务

#### (1) 基金托管人的权利

- 1) 依据法律法规和基金合同的规定保管基金财产；
- 2) 依照基金合同的约定获得基金托管费；
- 3) 监督基金管理人对本基金的投资运作，如托管人发现基金管理人的投资指令违反基金合同或有关法律法规的规定的，不予执行并向中国证监会报告；
- 4) 在基金管理人职责终止时，提名新的基金管理人；
- 5) 依据法律法规和基金合同的规定召集基金份额持有人大会；
- 6) 依据法律法规和基金合同的规定监督基金管理人，如认为基金管理人违反了法律法规或基金合同规定对基金财产、其它基金合同当事人的利益造成重大损失的，应及时呈报中国证监会，以及采取其它必要措施以保护本基金及相关基金合同当事人的利益；
- 7) 法律法规、基金合同规定的其它权利。

#### (2) 基金托管人的义务

- 1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则安全保管基金财产；
- 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资产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金和受托资产分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金、受托资产之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；
- 4) 除依据《基金法》、本基金合同及其他有关规定外，不以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) 按规定保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
- 6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；
- 7) 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；

- 8) 保守基金商业秘密。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予以保密，不得向他人泄露；
- 9) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购、赎回价格；
- 10) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
- 11) 对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人未执行基金合同规定的行为，还应说明基金托管人是否采取了适当的措施；
- 12) 按规定保存有关基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料，保存基金的会计账册、报表和记录等不少于 15 年；
- 13) 根据有关法律法规，建立并保存基金份额持有人名册；
- 14) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
- 15) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；
- 16) 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；
- 17) 按照规定监督基金管理人的投资运作；
- 18) 参加基金财产清算组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- 19) 面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告中国证监会和中国银保监会，并通知基金管理人；
- 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，基金托管人应为基金向基金管理人追偿；
- 21) 因违反基金合同导致基金财产的损失，应承担赔偿责任，其责任不因其退任而免除；
- 22) 不从事任何有损基金及基金合同其他当事人利益的活动；
- 23) 法律、法规、本基金合同所规定的其他义务。



## 二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

1、本基金的基金份额持有人大会，由本基金的基金份额持有人共同组成。本基金的基金份额持有人享有平等的表决权，每一基金份额具有一票表决权。

2、有以下事由情形之一时，应召开基金份额持有人大会：

- (1) 终止基金合同；
- (2) 转换基金运作方式；
- (3) 更换基金托管人；
- (4) 更换基金管理人；
- (5) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；
- (6) 本基金与其它基金的合并；
- (7) 变更基金类别；
- (8) 变更基金投资目标、范围或策略（法律法规和中国证监会另有规定的除外）；
- (9) 变更基金份额持有人大会程序；
- (10) 对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；
- (11) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其它应当召开基金份额持有人大会的事项。

3、以下情况不需召开基金份额持有人大会：

- (1) 调低基金管理费、基金托管费；
- (2) 法律法规要求增加的基金费用的收取；
- (3) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率；
- (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变化；
- (6) 按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

4、召集人和召集方式

(1) 除法律法规或本基金合同另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。基金管理人未按规定召集或者不能召集时，由基金托管人召集。

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

(3) 代表基金份额 10%以上（含 10%，以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）的基金份额持有人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开。

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

(5) 基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

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

## **5、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，召集人必须于会议召开日前 40 天在指定媒介上公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容：

- 1) 会议召开的时间、地点和方式；
- 2) 会议拟审议的主要事项；

- 3) 会议形式;
- 4) 议事程序;
- 5) 有权出席基金份额持有人大会的权益登记日;
- 6) 授权委托书的内容要求(包括但不限于代理人身份、代理权限和代理有效期限等)、送达时间和地点;
- 7) 表决方式;
- 8) 会务常设联系人姓名、电话;
- 9) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续;
- 10) 召集人需要通知的其他事项。

(2) 采用通讯方式开会并进行表决的情况下, 由召集人决定通讯方式和书面表决方式, 并在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表达意见的寄交和收取方式及截止时间。

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

## **6、 基金份额持有人出席会议的方式**

### **(1) 会议方式**

基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会。

现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席, 现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席。

通讯方式开会指按照本基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。

会议的召开方式由召集人确定, 但决定更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式和终止基金合同事宜必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

### **(2) 召开基金份额持有人大会的条件**

### 1) 现场开会方式

在同时符合以下条件时，现场会议方可举行：

① 对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示，有效的基金份额应占权益登记日基金总份额的 50%以上（含 50%）；

② 到会的基金份额持有人身份证明及持有基金份额的凭证、代理人身份证明、委托人持有基金份额的凭证及授权委托代理手续完备，到会者出具的相关文件符合有关法律法规和基金合同及会议通知的规定，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。

未能满足上述条件的情况下，则召集人可另行确定并公告重新开会的时间和地点，但确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不变。

### 2) 通讯开会方式

在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

① 召集人按本基金合同规定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告；

② 召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的书面表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取书面表决意见的，不影响表决效力；

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

④ 直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的其他代表，同时提交的持有基金份额的凭证符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与登记注册机构记录相符。

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

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

## 7、议事内容与程序

### (1) 议事内容及提案权

- 1) 议事内容为本基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容。
- 2) 基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日本基金总份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前就召开事由向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案；也可以在会议通知发出后向大会召集人提交临时提案。临时提案应当在大会召开日前 35 天提交召集人。召集人对于临时提案应当在大会召开日前 30 天公布。
- 3) 对于基金份额持有人提交的提案(包括临时提案)，大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

①关联性。大会召集人对于基金份额持有人提案涉及事项与基金有直接关系，并且不超出法律法规和基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的，应提交大会审议；对于不符合上述要求的，不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会上解释和说明。

②程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题做出决定。如将其提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会做出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

- 4) 单独或合并持有权利登记日基金总份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案、基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于 6 个月。法律法规另有规定除外。
- 5) 基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后，如果需要对原有提案进行修改或增加新的提案，应当最迟在基金份额持有人大会召开日前 30 日公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证

至少与公告日期有 30 日的间隔期。

## (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规定程序宣布会议议事程序及注意事项，确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后在公证机关监督下进行表决，经合法执业的律师见证后形成大会决议。

大会由基金管理人授权代表主持。在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权代表主持；如果基金管理人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以所代表的基金份额 50% 以上多数选举产生一名代表作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会做出的决议的效力。

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)、身份证号码、住所地址、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名(或单位名称)等事项。

### 2) 通讯方式开会

在通讯表决开会的方式下，首先由召集人至少提前 30 天公布提案，在所通知的表决截止日期第 2 天在公证机构监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。

(3) 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。

## 8、决议形成的条件、表决方式、程序

(1) 基金份额持有人所持每一基金份额享有平等的表决权。

(2) 基金份额持有人大会决议分为特别决议和一般决议：

### 1) 特别决议

特别决议须经出席会议的基金份额持有人及其代理人所持表决权的三分之二以上通过方为有效；更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式、终止基金合同的重大事项必须以特别决议方式通过；

### 2) 一般决议

一般决议须经出席会议的基金份额持有人及其代理人所持表决权的 50% 以

上（含 50%）通过方为有效，除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。

（3）基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会核准，或者备案，并予以公告。

（4）基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

（5）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。

（6）基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人和基金托管人均有约束力。

## 9、计票

### （1）现场开会

1) 如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，则基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举 3 名基金份额持有人担任监票人。

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

3) 如会议主持人对于提交的表决结果有怀疑，可以对投票数进行重新清点；如会议主持人未进行重新清点，而出席会议的基金份额持有人或代理人对会议主持人宣布的表决结果有异议，其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点，会议主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

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参加基金份额持有人大会或拒不配合计票的，不影响计票的效力。

### （2）通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在

基金托管人授权代表(如果基金托管人为召集人,则为基金管理人授权代表)的监督下进行计票,由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的,不影响计票和表决结果。

## 10、基金份额持有人大会决议的生效与公告

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

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

(3) 基金份额持有人大会决议应自生效之日起 2 日内由相关信息披露义务人在指定媒介公告。

## 三、基金收益分配原则、执行方式

### 1、基金收益分配原则

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为 4 次,每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 30%。基金收益分配比例应当以期末可供分配利润为基准计算。期末可供分配利润指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配;

(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;

(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值;即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;

(4) 每一基金份额享有同等分配权;

(5) 基金当期收益先弥补上期亏损后,方可进行当期收益分配;

(6) 分红权益登记日申请申购的基金份额不享受当次分红,分红权益登记日申请赎回的基金份额享受当次分红;

(7) 基金红利发放日距离收益分配基准日的时间不得超过 15 个工作日;

(8) 法律法规或监管机构另有规定的,从其规定。



## 2、收益分配方案

基金收益分配方案中载明基金收益的范围、基金收益分配对象、基金期末可供分配利润、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式、支付方式及有关手续费等内容。

## 3、收益分配方案的确定与公告

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，依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

## 4、收益分配中发生的费用

收益分配时发生的银行转账等手续费用由基金份额持有人自行承担。当基金份额持有人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记机构可将基金份额持有人的现金红利按权益登记日除权后的基金份额净值自动转为基金份额。

## 四、与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例

### 1、基金费用的种类

- (1) 基金管理人的管理费；
- (2) 基金托管人的托管费；
- (3) 基金的证券交易费用；
- (4) 基金合同生效以后的与基金相关的信息披露费用；
- (5) 基金份额持有人大会费用；
- (6) 基金合同生效以后的与基金相关的会计师费和律师费；
- (7) 基金银行汇划费用；
- (8) 按照国家有关规定可以列入的其他费用。

上述费用从基金财产中支付。

### 2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

- (1) 基金管理人的管理费

本基金的管理费率为年费率 1.5%。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。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。

#### (2) 基金托管人的基金托管费

本基金的托管费率为年费率 0.25%。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

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

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。于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。

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

### 3、不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效之前的律师费、会计师费和信息披露费用等不得从基金财产中列支。

### 4、基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前 2 日在中国证监会指定媒介上刊登公告。

### 5、其他费用

按照国家有关规定和基金合同约定，基金管理人可以在基金财产中列支其他的费用，并按照相关的法律法规的规定进行公告或备案。

### 五、基金财产的投资方向和投资限制

## 1、投资目标

本基金紧跟中国经济发展趋势，在充分控制风险的前提下，通过投资具有持续增长潜力且具有合理估值的上市公司，实现基金资产的长期稳定增值。

## 2、投资范围

本基金投资对象是具有良好流动性的金融工具，包括股票（包含中小板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、银行存款、资产支持证券、权证及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金股票投资占基金资产的比例为30-80%，债券投资占基金资产的比例为0-65%，权证投资占基金资产净值的比例为0-3%，现金及到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资于其它的产品，基金管理人在履行适当的程序后，可以将其纳入投资范围。

## 3、投资禁止行为与限制

### (1) 禁止用本基金财产从事以下行为

- 1) 承销证券；
- 2) 向他人贷款或者提供担保；
- 3) 从事承担无限责任的投资；
- 4) 买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
- 5) 向本基金的基金管理人、基金托管人出资或者买卖本基金的基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- 6) 买卖与本基金的基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与本基金的基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；
- 7) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- 8) 依照法律、行政法规有关规定，由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禁止性规定，本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

(2) 基金投资组合比例限制

- 1) 本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%；
- 2) 本基金与基金管理人管理的其他基金持有一家发行的证券总和，不超过该证券的 10%；
- 3) 本基金股票投资比例范围：股票投资占基金资产的比例为 30-80%，债券投资占基金资产的比例为 0-65%，权证投资占基金资产净值的比例为 0-3%，现金及到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%；
- 4) 本基金参与股票发行申购，所申报的金额不超过本基金总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；
- 5) 在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不展期；
- 6) 在银行间市场进行债券回购融入的资金余额不超过基金资产净值的 40%；
- 7) 基金的投资组合中保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；
- 8) 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%；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%；本公司管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%。其他权证的投资比例，遵从法规或监管部门的相关规定；
- 9) 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；本公司管理的全部证券投资基金投资于同一原始权益人的各类资产支

持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%，中国证监会规定的特殊品种除外；

- 10) 本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，将在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；
- 11) 流通受限证券投资遵照《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》（证监基金字[2006]141 号）及相关规定执行；
- 12) 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股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 15%；
- 13) 本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 30%；
- 14) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的 15%；  
因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前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；
- 15) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；
- 16) 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；
- 17) 法律、法规、基金合同及中国证监会规定的其他比例限制。

（3）法律法规或监管部门修改或取消上述限制规定（第 3）项除外）时，本基金不受上述投资组合限制并相应修改限制规定。

#### **4、投资组合比例调整**

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。除上述 7)、10)、14)、15) 项外，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合

同约定的投资比例规定的，基金管理人应当在 10 个工作日内进行调整，法律法规另有规定的，从其规定。

## 六、基金净值的计算方法和公告方式

1、基金资产净值指基金资产总值减去基金负债后的价值；

$T$  日基金份额净值= $T$  日基金资产净值/ $T$  日基金总份额余额

基金份额净值的计算，精确到 0.0001 元，小数点第五位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

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

在开始办理基金份额申购或者赎回后，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基金份额净值和基金份额累计净值。

## 七、基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

### 1、基金合同的变更

(1) 基金合同变更涉及本基金合同第八节第（二）项规定的对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的，应经基金份额持有人大会决议同意。变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准，并自中国证监会核准之日起生效。

(2) 除上述第（1）项规定的情形外，经基金管理人和基金托管人同意可对基金合同的内容进行变更，该等变更应当在 2 日内由基金管理人进行公告。

### 2、基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同终止：

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

### 3、基金财产的清算

(1) 基金合同终止，应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。

#### (2) 基金财产清算组

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

2) 基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、基金注册登记人、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。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

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

#### (3) 清算程序

1) 基金合同终止后，由基金财产清算组统一接管基金财产；

2) 基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；

3) 基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；

4) 对基金财产进行评估和变现；

5) 基金清算组做出清算报告；

6) 会计师事务所对清算报告进行审计；

7) 律师事务所对清算报告出具法律意见书；

8) 将基金清算结果报告中国证监会；

9) 公布基金清算公告；

10) 对基金剩余财产进行分配。

#### (4) 清算费用

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

#### (5) 基金剩余财产的分配

基金财产按如下顺序进行清偿：

- 1) 支付基金财产清算费用；
- 2) 缴纳基金所欠税款；
- 3) 清偿基金债务；
- 4) 清算后如有余额，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

#### (6) 基金财产清算的公告

清算小组成立后 2 日内应就清算小组的成立进行公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算组做出的清算报告经具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并公告。基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

(7) 基金财产清算账册及文件由基金托管人保存 15 年以上。

### 八、争议解决方式

1、本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

2、本基金合同的当事人之间因本基金合同产生的或与本基金合同有关的争议可首先通过友好协商或调解解决。自一方书面要求协商解决争议之日起六十日内如果争议未能以协商或调解方式解决，则任何一方有权将争议提交设在上海的中国国际经济贸易仲裁委员会上海分会，根据提交仲裁时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。

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

### 九、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

基金合同可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、基金代销机构和注册登记机构的办公场所和营业场所查阅；投资者也可按工本费购买基金合同复印件或复印件，但内容应以基金合同正本为准。

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。



## 第二十部分基金托管协议的内容摘要

### 一、基金托管协议当事人

#### 1、基金管理人

名称：富安达基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区世纪大道 1568 号中建大厦 29 层

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 1568 号中建大厦 29 层

法定代表人：张华东

成立时间：2011 年 4 月 27 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监许可[2011]544 号

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务。

注册资本：1.6 亿元人民币

组织形式：有限责任公司

存续期间：持续经营

#### 2、基金托管人

名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）

住所：上海市浦东新区银城中路 188 号（邮政编码：200120）

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号（邮政编码：200120）

法定代表人：胡怀邦

成立时间：1987 年 3 月 30 日

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

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字 [1998] 25 号

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项业务；提供保管箱服务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务；经营结汇、售汇业务。

注册资本：618.85 亿元人民币

组织形式：股份有限公司

## 二、基金托管协议的依据、目的和原则

本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险规定》”）、《富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》（以下简称《基金合同》）及其他有关规定订立。

本协议的目的是明确基金管理人和基金托管人之间在基金财产的保管、投资运作、净值计算、收益分配、信息披露及相互监督等有关事宜中的权利、义务及职责，以确保基金财产的安全，保护基金份额持有人的合法权益。

基金管理人和基金托管人遵循平等自愿、诚实信用、充分保护投资者合法利益的原则，经协商一致，签订本协议。

## 三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

### 1、基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权。

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

本基金投资对象是具有良好流动性的金融工具，包括股票（包含中小板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、银行存款、资产支持证券、权证及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金股票投资占基金资产的比例为30-80%，债券投资占基金资产的比例为0-65%，权证投资占基金资产净值的比例为0-3%，现金及到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资于其它的产品，基金管理人在履行适当的程序后，可以将其纳入投资范围。

基金托管人对基金管理人业务进行监督和核查的义务自基金合同生效日起开始履行。

**(2) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金**

## 投资、融资比例进行监督。

根据《基金合同》的约定，本基金投资组合比例应符合以下规定：

(1) 本基金的投资比例为：股票投资占基金资产的比例为 30-80%，债券投资占基金资产的比例为 0-65%，权证投资占基金资产净值的比例为 0-3%，现金及到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%；

(2) 持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%；

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

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

(5) 在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不展期；

(6) 在全国银行间市场进行债券回购融入的资金余额不超过基金资产净值的 40%；

(7) 基金的投资组合中保留的现金及到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；

(8) 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%；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%；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%。其他权证投资比例，遵从法规或监管部门的相关规定；

(9) 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；本公司管理的全部证券投资基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%，中国证监会规定的特殊品种除外；

(10) 本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，将在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

(11) 流通受限证券投资遵照《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》（证监基金字[2006]141号）及相关规定执行；

（12）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%；

（13）本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%；

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

因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前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；

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

（16）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

（17）法律、法规、基金合同及中国证监会规定的其他比例限制。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。除上述（7）、（10）、（14）、（15）项外，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的，基金管理人应当在10个工作日内进行调整。法律法规或监管部门修改或取消上述限制规定时，本基金不受上述投资组合限制并相应修改其投资组合限制规定。

基金托管人依照上述规定对本基金的投资组合限制及调整期限进行监督。

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

- 1) 承销证券；
- 2) 向他人贷款或者提供担保；
- 3) 从事承担无限责任的投资；
- 4) 买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
- 5) 向本基金的基金管理人、基金托管人出资或者买卖本基金的基金管理人、

基金托管人发行的股票或者债券；

6) 买卖与本基金的基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与本基金的基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；

7) 依照法律、行政法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。根据法律法规有关基金禁止从事的关联交易的规定，基金合同生效后2个工作日内，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者与本机构有其他重大利害关系的公司名单，以上名单发生变化的，应及时予以更新并通知对方。

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

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

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

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

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

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

本基金投资银行存款应符合如下规定：

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

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

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

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

#### **(6) 基金托管人对基金投资流通受限证券的监督**

1) 基金投资流通受限证券, 应遵守《关于规范基金投资非公开发行证券行为的紧急通知》、《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。

2) 此处流通受限证券的释义与上文中流动性受限资产并不相同, 包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券, 不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。

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

4) 基金投资流通受限证券前, 基金管理人应向基金托管人提供符合法律法规要求的有关书面信息, 包括但不限于拟发行证券主体的中国证监会批准文件、

发行证券数量、发行价格、锁定期,基金拟认购的数量、价格、总成本、总成本占基金资产净值的比例、已持有流通受限证券市值占资产净值的比例、资金划付时间等。基金管理人应保证上述信息的真实、完整,并应至少于拟执行投资指令前两个工作日将上述信息书面发至基金托管人,保证基金托管人有足够的时间进行审核。

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

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

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

2、基金托管人应根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确认、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查。如果基金管理人未经基金托管人的审核擅自将不实的业绩表现数据印制在宣传推介材料上,则基金托管人对此不承担任何责任,并有权在发现后报告中国证监会。

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

基金托管人发现基金管理人的投资指令或实际投资运作违反《基金法》及其他有关法规、《基金合同》和本协议规定的行为,应及时以书面形式通知基金管理人在限期内纠正,并通知基金管理人收到通知后应及时核对,并以电话或书面形式向基金托管人反馈,说明违规原因及纠正期限,并保证在规定期限内及时改

正。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人有权报告中国证监会。

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

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

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

#### **四、基金财产的保管**

##### **1、基金财产保管的原则**

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

(2) 基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。

(3) 基金托管人按照规定开立基金财产的资金账户、证券账户和债券托管账户。

(4) 基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整和独立。

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

(6) 除依据《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关法律法规规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金资产。

##### **2、基金合同生效时募集资产的验证**

(1) 基金募集期间的资金应存于基金管理人在基金托管人的营业机构开立的“基金募集专户”。该账户由基金管理人开立并管理。



(2) 基金募集期满之日起 10 日内，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，由基金管理人聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的 2 名以上（含 2 名）中国注册会计师签字有效。验资完成，基金管理人应将募集到的全部资金存入基金托管人为基金开立的基金银行存款账户中，基金托管人在收到资金当日出具相关证明文件。

(3) 若基金募集期限届满，未能达到基金合同生效的条件，由基金管理人按照规定办理退款等事宜。

### **3、基金的银行存款账户的开立和管理**

(1) 基金托管人应负责本基金银行存款账户的开立和管理。

(2) 基金托管人以本基金的名义在其营业机构开立基金的银行存款账户，并根据中国人民银行规定计息。本基金的银行预留印鉴由基金托管人制作、保管和使用。本基金的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益，均需通过本基金的银行存款账户进行。

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

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

(5) 基金银行存款账户的管理应符合《中华人民共和国票据法》、《人民币银行账户结算管理办法》、《现金管理条例》、《中国人民银行利率管理的有关规定》、《关于大额现金支付管理的通知》、《支付结算办法》以及银行业监督管理机构的其他规定。

(6) 基金托管人应严格管理基金在基金托管人处开立的银行存款账户，及时核查基金银行存款账户余额。

### **4、基金证券交收账户、资金交收账户的开立和管理**

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

基金证券账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人

和基金管理人不得出借和未经对方同意擅自转让基金的任何证券账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。基金证券账户的开立和证券账户卡的保管由基金托管人负责，管理和运用由基金管理人负责。

基金管理人不得对基金证券交收账户、资金交收账户进行证券的超卖或超买。

基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户即资金交收账户，用于证券交易资金的结算。基金托管人以本基金的名义在托管人处开立基金的证券交易资金结算的二级结算备付金账户。

#### **5、债券托管账户的开立和管理**

(1) 基金合同生效后，基金托管人负责在中央国债登记结算有限责任公司以本基金的名义开立债券托管账户，并由基金托管人负责基金的债券及资金的清算。在上述手续办理完毕后，由基金托管人向人民银行进行报备。基金管理人负责申请基金进入全国银行间同业拆借市场进行交易，由基金管理人在中国外汇交易中心开设同业拆借市场交易账户。

(2) 基金管理人和基金托管人共同代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议，协议正本由基金托管人保管，协议副本由基金管理人保存。

#### **6、其他账户的开立和管理**

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

#### **7、基金财产投资的有关实物证券、银行存款定期存单等有价凭证的保管**

基金财产投资的有关实物证券、银行存款定期存单等有价凭证由基金托管人存放于托管银行的保管库。实物证券、银行定期存单等有价凭证的购买和转让，由基金托管人和基金管理人共同办理。属于基金托管人实际有效控制下的有价凭证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。基金托管人对由基金托管人以外机构实际有效控制的本基金资产不承担保管责任。

#### **8、与基金财产有关的重大合同的保管**

由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同的原件分别由基金托管人、基金管理人保管，相关业务程序另有限制除外。除本协议另有规定外，基

基金管理人在代基金签署与基金有关的重大合同时应尽可能保证持有二份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件，基金管理人应及时将正本送达基金托管人处。合同的保管期限按照国家有关规定执行。

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

## 五、基金资产净值计算和会计核算

### 1、基金资产净值及基金份额净值的计算与复核

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

基金管理人应每工作日对基金资产估值。估值原则应符合《基金合同》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》及其他法律、法规的规定。用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金资产净值，以约定方式发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核后，将复核结果反馈给基金管理人，由基金管理人就基金份额净值予以公布。

本基金按以下方法估值：

#### (1) 股票估值方法

1) 上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，以最近交易日的收盘价估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。如有充足证据表明最近交易日收盘价不能真实地反映公允价值的，应对最近交易日的收盘价进行调整，确定公允价值进行估值。

2) 未上市股票的估值：

①首次发行的股票，采用估值技术确定公允价值进行估值，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首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按估值日其所在证券交易所上市的同一股票以第1)条确定的估值价格进行估值。

③送股、转增股、配股和公开增发新股等方式发行的股票，按估值日该上市公司在证券交易所挂牌的同一流通股票以第 1) 条确定的估值价格进行估值。

④非公开发行有明确锁定期的股票按如下方法进行估值：

A、估值日在证券交易所上市交易的同一股票以第 1) 条确定的估值价格低于非公开发行股票初始取得成本时，应采用在证券交易所上市交易的同一股票以第 1) 条确定的估值价格作为估值日该非公开发行股票的价值；

B、估值日在证券交易所上市交易的同一股票以第 1) 条确定的估值价格高于非公开发行股票初始取得成本时，应按下列公式确定估值日该非公开发行股票的价值：

$$FV=C+(P-C) \times (D1-Dr)/D1$$

FV 为估值日该非公开发行股票的价值；C 为该非公开发行股票初始取得成本（因权益业务导致市场价格除权时，应于除权日对其初始取得的成本作相应调整）；P 为估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价；D1 为该非公开发行股票锁定期所含的交易所的交易天数；Dr 为估值日剩余锁定期，即估值日至锁定期结束所含的交易所的交易天数，不含估值日当天。

⑤长期停牌的股票，按监管机构及行业协会的规范进行估值。若未来市场环境发生重大变化，基金管理人与基金托管人协商一致后，可采用其他合理的估值方法进行估值。

3) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

## (2) 债券估值方法

- 1) 在证券交易所市场挂牌交易的实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日无交易的，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，以最近交易日的收盘价估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。如有充足证据表明最近交易日收盘价不能真实地反映公允价值的，应对最近交易日的收盘价进行调整，确定公允价值进行估值。

- 2) 在证券交易所市场挂牌交易的未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值，估值日无交易的，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按最近交易日债券收盘价减去所含的最近交易日债券应收利息后的净价进行估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价（净价）及重大变化因素，调整最近交易日收盘价（净价），确定公允价值进行估值。如有充足证据表明最近交易日收盘价（净价）不能真实地反映公允价值的，应对最近交易日的收盘价（净价）进行调整，确定公允价值进行估值。
- 3) 首次发行未上市债券采用估值技术确定的公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。
- 4) 在银行间债券市场交易的债券根据行业协会指导的处理标准或意见并综合考虑市场成交价、市场报价、流动性及收益率曲线等因素确定其公允价值进行估值。
- 5) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

### (3) 权证估值方法

- 1) 上市流通权证按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，以最近交易日的收盘价估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。如有充足证据表明最近交易日收盘价不能真实地反映公允价值的，应对最近交易日的收盘价进行调整，确定公允价值进行估值。
- 2) 首次发行未上市的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。
- 3) 停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值进行估值。
- 4) 因持有股票而享有的配股权证，以配股除权日起到配股确认日止，若收盘价高于配股价，则按收盘价和配股价的差额进行估值，若收

盘价低于配股价，则估值为零。

5) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

(4) 资产支持证券的估值方法

1) 交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，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) 全国银行间市场交易的资产支持证券，根据行业协会指导的处理标准或意见并综合考虑市场成交价、市场报价、流动性及收益率曲线等因素确定其公允价值进行估值。

3) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

(5) 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

(6) 其他资产的估值方法

其他资产按国家有关规定进行估值。

(7)在任何情况下，基金管理人如采用上述估值方法对基金财产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如基金管理人认为上述估值方法对基金财产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人在综合考虑市场各因素的基础上，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。

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

基金管理人、基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序以及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，发现方应及时通知对方，以约定的方法、程序和相关法律法规的规定进行估值，以维护基金份额持有人的利益。

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

## 2、净值差错处理

当发生净值计算错误时，由基金管理人负责处理，由此给基金份额持有人和

基金造成损失的，由基金管理人对基金份额持有人或者基金先行支付赔偿金。基金管理人和基金托管人应根据实际情况界定双方承担的责任，经确认后按以下条款进行赔偿。

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

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

(3) 基金管理人、基金托管人按上述估值方法的第(7)项进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

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

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

### **3、暂停估值与公告基金份额净值的情形**

(1) 基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

(2) 因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

(3) 当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商

一致的，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。

#### **4、基金会计制度**

按国家有关部门规定的会计制度执行。

#### **5、基金账册的建立**

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

#### **6、会计数据和财务指标的核对**

双方应定期核对会计数据和财务指标，如发现双方的账目存在不符的，基金管理人和基金托管人必须及时查明原因并纠正，确保核对一致。若当日核对不符，暂时无法查找到错账的原因而影响到基金资产净值的计算和公告的，以基金管理人的账册为准。

#### **7、基金定期报告的编制和复核**

基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。月度报表的编制，应于每月终了后 5 个工作日内完成。定期报告文件应按中国证监会的要求公告。季度报表的编制，应于每季度终了后 15 个工作日内完成；基金合同生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在指定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。基金合同生效后，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。中期报告在上半年结束之日起两个月内公告；年度报告在会计年度结束后三个月内公告。

基金管理人在月度报表完成当日，对报表加盖公章后，以加密传真方式将有关报表提供基金托管人；基金托管人在 2 个工作日内进行复核，并将复核结果及时书面通知基金管理人。基金管理人在季度报表完成当日，以约定方式将有关报



表提供基金托管人；基金托管人在 5 个工作日内进行复核，并将复核结果反馈给基金管理人。基金管理人在更新招募说明书、产品资料概要完成当日，将有关报告提供基金托管人，基金托管人在收到 15 日内进行复核，并将复核结果反馈给基金管理人。基金管理人在中期报告完成当日，将有关报告提供基金托管人，基金托管人在收到后 20 日内进行复核，并将复核结果反馈给基金管理人。基金管理人在年度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人，基金托管人在收到后 30 日内复核，并将复核结果反馈给基金管理人。基金托管人在复核过程中，发现双方的报表存在不符时，基金管理人和基金托管人应共同查明原因，进行调整，调整以双方认可的账务处理方式为准。如果基金管理人与基金托管人不能于应当发布公告之日前就相关报表达成一致，基金管理人有权按照其编制的报表对外发布公告，基金托管人有权就相关情况报证监会备案。

基金托管人在对财务报表、季度报告、中期报告、年度报告、更新的招募说明书、基金产品资料概要复核完毕后，并向基金管理人进行书面或电子确认，以备有权机构对相关文件审核检查。

## **六、基金份额持有人名册的保管**

基金管理人可委托基金注册登记人登记和保管基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容包括但不限于基金份额持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册，包括基金募集期结束时的基金份额持有人名册、基金权益登记日的基金份额持有人名册、基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册、每年最后一个交易日的基金份额持有人名册，由基金注册登记人负责编制和保管，并对基金份额持有人名册的真实性、完整性和准确性负责。

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

1、基金管理人于《基金合同》生效日及《基金合同》终止日后 10 个工作日内向基金托管人提供由注册登记人编制的基金份额持有人名册；

2、基金管理人于基金份额持有人大会权利登记日后 5 个工作日内向基金托管人提供由注册登记人编制的基金份额持有人名册；

3、基金管理人于每年最后一个交易日后 10 个工作日内向基金托管人提供由注册登记人编制的基金份额持有人名册；

4、除上述约定时间外，如果确因业务需要，基金托管人与基金管理人商议

一致后，由基金管理人向基金托管人提供由注册登记人编制的基金份额持有人名册。

基金托管人以电子版形式妥善保管基金份额持有人名册，并定期刻成光盘备份，保存期限为 15 年。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。若基金管理人或基金托管人由于自身原因无法妥善保管基金份额持有人名册，应按有关法规规定各自承担相应的责任。

## **七、争议解决方式**

相关各方当事人同意，因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议，应通过友好协商或者调解解决。托管协议当事人不愿通过协商、调解解决或者协商、调解不成的，任何一方当事人均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会上海分会，根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点在上海，仲裁裁决是终局的，并对相关各方当事人均有约束力。仲裁费用由败诉方承担。

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

本协议受中华人民共和国法律管辖。

## **八、托管协议的变更、终止与基金财产的清算**

### **1、基金托管协议的变更**

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行修改。修改后的新协议，其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突。

### **2、基金托管协议的终止**

(1) 《基金合同》终止；

(2) 基金托管人解散、依法被撤销、破产，被依法取消基金托管资格或因其他事由造成其他基金托管人接管基金财产；

(3) 基金管理人解散、依法被撤销、破产，被依法取消基金管理资格或因其他事由造成其他基金管理人接管基金管理权。

(4) 发生《基金法》、《销售办法》、《运作办法》或其他法律法规规定的终止事项。

### **3、基金财产的清算**

### (1) 基金财产清算组

在基金财产清算组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照《基金合同》和本协议的规定继续履行保护基金资产安全的职责。

- 1) 基金财产清算组组成：基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、基金注册登记人、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。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。
- 2) 基金财产清算组职责：基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算组可以依法进行必要的民事活动。

### (2) 基金财产清算程序

- 1) 《基金合同》终止后，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- 2) 基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；
- 3) 基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；
- 4) 对基金财产进行评估和变现；
- 5) 基金清算组做出清算报告；
- 6) 会计师事务所对清算报告进行审计；
- 7) 律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- 8) 将基金清算报告中国证监会；
- 9) 公布基金清算公告；
- 10) 对基金剩余财产进行分配。

### (3) 清算费用

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

### (4) 基金剩余财产的分配

基金财产按如下顺序进行清偿

- 1) 支付基金财产清算费用；
- 2) 缴纳基金所欠税款；
- 3) 清偿基金债务；
- 4) 清算后如有余额，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分

配。

#### (5) 基金财产清算的公告

清算小组成立后2日内应就清算小组的成立进行公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告。基金财产清算组做出的清算报告经具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并公告。基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

#### (6) 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存不少于15年。

### 第二十一部分 对基金份额持有人的服务

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

#### 一、基金份额持有人交易资料的寄送服务

1、每次交易结束后，投资者可在 T+2 个工作日后通过销售机构的网点查询和打印交易确认单，或在 T+1 个工作日后通过电话、网站查询交易确认情况。

2、基金管理人可以为基金份额持有人提供以电子形式为主的确认单、对账单等基金信息服务，如果基金份额持有人需要提供纸质对账单服务，请致电基金管理人客户服务中心索取。

3、对在认购期开户认购的基金持有人，在基金宣布成立后的 15 个工作日内寄出开户确认书。对首次在申购期开户并申购的基金持有人，开户确认书将在 15 个工作日内寄出。

4、每月/每季结束后，基金管理人向所有订阅电子邮件对账单及短信对账单的投资者发送电子邮件及短信对账单。

#### 二、基金红利再投资

本基金收益分配时，投资者可以选择将当期分配所得的红利再投资于本基金，注册登记机构将其所得红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额。红利再投资免收申购费用。

#### 三、定期投资计划

基金管理人可通过销售机构为投资者提供定期投资的服务。通过定期投资计划，投资者可以定期申购基金份额，具体实施时间、方法另行公告。

#### **四、网上理财服务**

通过本公司网站，投资者可获得如下服务：

1、自助开户交易：投资者可以在本公司网站上自助开户并进行网上交易业务。

2、查询服务：投资者可以通过本公司网站查询所持有基金的基金份额、交易记录等信息，同时可以修改联络信息等基本资料。

3、信息咨询服务：投资者可以利用本公司网站获取基金和基金管理人各类信息，包括基金法律文件、基金管理人最新动态、热点问题等。

#### **五、短信服务**

基金管理人向订制短信服务的基金份额持有人提供相应短信服务。

#### **六、电子邮件服务**

基金管理人为投资者提供电子邮件方式的业务咨询、投诉受理、基金份额净值等服务。

#### **七、信息订阅服务**

投资者可以通过富安达网站的客服中心、信息订制提交信息订制的申请，富安达公司将以电子邮件、手机短信的形式定期为投资者发送所订制的信息。

#### **八、客户服务中心电话服务**

投资者拨打富安达基金管理有限公司全国统一客服热线：400-630-6999 可享有如下服务：

1、自助语音服务：客服中心自助语音系统提供 7×24 小时的全天候服务，投资者可以自助查询账户余额、交易情况、基金净值等信息，也可以进行直销交易、密码修改、传真索取等操作。

2、人工电话服务：客服代表可以为投资者提供业务咨询、信息查询、资料修改、投诉受理、信息订制等服务。

3、电话留言服务：非人工服务时间或线路繁忙时，投资者可进行电话留言。

#### **九、投资者投诉与建议**

如果投资者在使用服务过程中发觉有任何需要改进的地方或不满意的地方，可通过短信、信函、客服热线及电子邮件等方式进行投诉。

对于工作日受理的投诉，原则上采取及时当日回复，对于不能及时回复的投诉，基金管理人承诺将在 2-7 个工作日之内做出相应的回复；对于非工作日提出

的投诉，基金管理人将在顺延的工作日回复。

我们的联系方式：

客服热线： 400-630-6999

客服电子邮件： [service@fadfunds.com](mailto:service@fadfunds.com)

联系地址：上海市浦东新区世纪大道 1568 号中建大厦 29 楼富安达基金管理  
有限公司 客户服务中心（收）

邮政编码： 200122

## 第二十二部分 招募说明书存放及查阅方式

本基金招募说明书存放在基金管理人、基金托管人、基金代销机构和注册登记机构的办公场所，投资者可在办公时间查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与公告的内容完全一致。

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

## 第二十三部分 备查文件

以下备查文件存放在基金管理人的办公场所，在办公时间可供免费查阅。

（一）中国证监会批准富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金募集的文件

（二）《富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

（三）《富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

（四）关于申请募集富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金之法律意见书

（五）基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

（六）基金托管人业务资格批件、营业执照

（七）中国证监会要求的其他文件

查阅方式：投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

富安达基金管理有限公司

二〇二一年五月二十五日