东吴行业轮动混合型证券投资基金
招募说明书更新

—东吴基金管理有限公司 2021 年 3 号

基金管理人：东吴基金管理有限公司

基金托管人：华夏银行股份有限公司

目录

重要提示.....1
一、绪言.....3
二、释义.....4
三、基金管理人.....8
四、基金托管人.....16
五、相关服务机构.....19
六、基金的募集.....45
七、基金合同的生效.....47
八、基金份额的申购与赎回.....48
九、与基金管理人管理的其他基金转换.....55
十、基金的投资.....58
十一、基金的业绩.....71
十二、基金财产.....73
十三、基金资产估值.....74
十四、基金的收益分配.....79
十五、基金费用与税收.....80
十六、基金的会计与审计.....82
十七、基金的信息披露.....83
十八、侧袋机制.....89
十九、基金的风险揭示.....92
二十、基金的终止与清算.....96
二十一、基金合同的内容摘要.....98
二十二、基金托管协议的内容摘要.....111
二十三、对基金份额持有人的服务.....121
二十四、其他应披露事项.....123
二十五、招募说明书存放及查阅方式.....132
二十六、备查文件.....133

重要提示

本基金根据 2008 年 2 月 22 日中国证券监督管理委员会《关于核准东吴行业轮动股票型证券投资基金募集的批复》（证监许可【2008】296 号）的核准进行募集，本基金的基金合同于 2008 年 4 月 23 日正式生效。本基金于 2015 年 8 月 7 日更名为东吴行业轮动混合型证券投资基金。

基金管理人保证《东吴行业轮动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》"）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。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券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，由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特定风险，基金运作风险，此外，本基金以 1 元初始面值进行募集，在市场波动等因素的影响下，存在单位份额净值跌破 1 元初始面值的风险等等。

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

投资有风险，投资者在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》。

基金不同于银行储蓄与债券，基金投资者有可能获得较高的收益，也有可能损失本金。投资者投资于本基金时应认真阅读本《招募说明书》。全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资者基金投资的"买者自负"原则，在投资

者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

本次招募说明书（更新）所载内容截止日为 2021 年 7 月 31 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2021 年 6 月 30 日（财务数据未经审计）。

一、绪言

本《招募说明书》依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《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》”）、其他有关规定及《东吴行业轮动混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“本基金合同”或“基金合同”）编写。

本《招募说明书》阐述了东吴行业轮动混合型证券投资基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资者投资决策有关的必要事项，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本《招募说明书》。

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

本基金根据本《招募说明书》所载明资料募集。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对未在本《招募说明书》中载明的信息，或对本《招募说明书》作出任何解释或者说明。

本招募说明书根据基金合同编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。投资者取得依基金合同所发售的基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》《运作办法》、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。

二、释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称代表如下含义：

基金或本基金：	指东吴行业轮动混合型证券投资基金；
基金合同或本基金合同：	指《东吴行业轮动混合型证券投资基金基金合同》及对该合同的任何有效修订和补充；
招募说明书或本招募说明书：	指《东吴行业轮动混合型证券投资基金招募说明书》及其更新；
基金产品资料概要	指《东吴行业轮动混合型证券投资基金基金产品资料概要》及其更新（本基金合同关于基金产品资料概要的编制、披露及更新等内容，将不晚于2020年9月1日起执行）
《证券法》：	指《中华人民共和国证券法》；
《基金法》：	指2012年12月28日经第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议通过，自2013年6月1日起施行的《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；
《信息披露办法》	指《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》；
《运作办法》	指《公开募集证券投资基金运作管理办法》；
《销售办法》	指中国证监会2013年2月17日修订通过，2013年3月15日公布，自2013年6月1日起施行的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订；
《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；
中国证监会或证监会：	指中国证券监督管理委员会；
基金合同当事人：	指受《基金合同》约束，根据《基金合同》享受权利并承担义务的法律主体；
基金管理人：	指东吴基金管理有限公司；
基金托管人：	指华夏银行股份有限公司；
基金份额持有人：	指依照基金合同、招募说明书或更新后招募说明书摘要取得和持有本基金份额的基金投资者；

注册登记业务：	指基金登记、存管、清算和交收业务，具体内容包括投资者基金账户管理、基金份额注册登记、清算及基金交易确认、发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等；
注册登记机构：	指办理基金注册登记业务的机构；
基金账户：	指注册登记机构为基金投资者开立的，用以记录各自持有的基金份额余额及其变动情况的账户；
直销机构：	指东吴基金管理有限公司；
代销机构：	指符合中国证监会和中国银监会有关规定，并与基金管理人签订了销售代理协议，代为办理销售服务业务的机构；
销售机构：	指直销机构和代销机构；
个人投资者：	指符合法律法规规定的条件可以投资证券投资基金的自然人；
机构投资者：	指符合法律法规规定可以投资证券投资基金的在中华人民共和国注册登记或经政府有关部门批准设立的机构；
合格境外机构投资者：	指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理办法》的可投资于中国境内证券的中国境外的机构投资者；
基金投资者或投资者：	指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者；
元：	指人民币元；
募集期：	指自基金份额发售之日起到基金认购截止日的时间段，最长不超过3个月；
存续期：	指基金合同生效后合法存续的不定期之期间；
基金合同生效日：	指基金达到法律规定及基金合同规定的条件下，基金管理人聘请法定机构验资并办理完毕基金合同备案手续并获得证监会书面确认后，基金合同生效的日期；
工作日：	指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日；
开放日：	指销售机构为投资者办理申购、赎回等业务的工作日；
T日：	指销售机构受理投资者有效申请的工作日；；
T+N日：	指自T日起第N个工作日（不包含T日）；
认购：	指在基金募集期内，投资者申请购买基金份额的行为；
申购：	指在本基金存续期间，投资者申请购买本基金份额的行为；

赎回：	指基金份额持有人按基金合同规定的条件，要求基金管理人购回基金份额的行为；
巨额赎回：	单个开放日针对基金的净赎回申请超过上一日该基金总份额的10%时，为该基金的巨额赎回。单个开放日的净赎回申请，是指该基金份额的赎回申请加上基金转换中该基金的转出申请，再扣除当日发生的该基金份额申购申请及基金转换中该基金的转入申请之和后得到的余额；
基金转换：	指在基金存续期间，基金份额持有人向基金管理人提出申请，将其持有的基金份额转换为该基金管理人管理的另一只基金的基金份额；
基金份额：	指向不特定的投资者发行的，表示持有人对基金享有资产所有权、收益分配权和其他相关权利，并承担相应义务的凭证；
基金收益：	基金投资所得股票红利、债券利息、票据投资收益、买卖证券差价、银行存款利息以及其它收入；
基金资产总值：	指基金所购买的各类证券及票据价值、银行存款本息和本基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和；
基金资产净值：	基金资产总值减去其总负债后的价值；
基金资产估值：	指计算、评估基金资产与负债的价值，用以确定基金资产净值和收益的过程；
流动性受限资产	指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在10个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等；
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；
销售服务费：	指从基金资产中计提的，用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务的费用；

A类基金份额：	指在投资者申购时收取前端申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额类别；
C类基金份额：	指在投资者申购时不收取前端申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，而从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额类别；
侧袋机制：	指将基金投资组合中的特定资产从原有账户分离至一个专门账户进行处置清算，目的在于有效隔离并化解风险，确保投资者得到公平对待，属于流动性风险管理工具。侧袋机制实施期间，原有账户称为主袋账户，专门账户称为侧袋账户；
特定资产：	包括：（一）无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性的资产；（二）按摊余成本计量且计提资产减值准备仍导致资产价值存在重大不确定性的资产；（三）其他资产价值存在重大不确定性的资产；
不可抗力：	指基金合同当事人无法预见、无法抗拒、无法避免且在基金合同由基金管理人、基金托管人签署之日后发生的，使基金合同当事人无法全部履行或无法部分履行基金合同的任何事件，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律法规变化、突发停电或其他突发事件、证券交易所非正常暂停或停止交易。

三、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：东吴基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区银城路 117 号 9 楼 901、902 室

办公地址：上海市浦东新区银城路 117 号瑞明大厦 9F

法定代表人：邓晖

设立日期：2004 年 9 月 2 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证券监督管理委员会证监基金字【2004】132 号

组织形式：有限责任公司（国内合资）

注册资本：1 亿元人民币

联系人：李佳

电话：（021）50509888

传真：（021）50509884

客户服务电话：400-821-0588（免长途话费）、021-50509666

公司网址：www.scfund.com.cn

股权结构：

持股单位	占总股本比例
东吴证券股份有限公司	70%
海澜集团有限公司	30%
合　　计	100%

（二）主要人员情况

1、董事会成员

马震亚先生，董事长，硕士，高级经济师，会计师，中共党员。历任苏州市审计局科员、副主任科员；苏州证券有限责任公司财务部副总经理（主持工作）；东吴证券有限责任公司财务部总经理，财务总监，东吴基金管理有限公司监事长，东吴创业投资有限公司董事长，东吴证券股份有限公司党委委员、纪委书记、董事、副总裁、财务负责人，现任东吴基金管理有限公司董事长。

张戈先生，董事，本科，中共党员。历任海澜集团有限公司海澜资本投资部投资经理，现任海澜集团有限公司海澜资本投资部投资总监。

邓晖先生，董事，硕士研究生，中共党员。历任长江证券有限责任公司董事、副总裁，

湘财证券有限责任公司副总裁，德邦证券有限责任公司副总裁，总裁兼德邦期货有限公司董事长，齐鲁证券有限公司党委委员、副总裁、总裁，长江证券（上海）资产管理有限公司董事长，长江成本资本投资有限公司董事长，长江证券股份有限公司党委副书记、总裁、副董事长、监事长，现任东吴基金管理有限公司总经理。

陈建国先生，董事，硕士研究生，经济师，中共党员。历任昆山市信托投资公司第二证券部副经理，东吴证券昆山前进中路证券营业部副总经理、福州湖东路证券营业部总经理、昆山分公司副总经理、东吴证券经纪管理总部副总经理（主持工作），现任东吴证券人力资源部总经理。

叶犇先生，董事，党校研究生，中共党员。历任中国工商银行苏州市分行观前办事处员工、分行团委、人事政工处团委副书记、计划财务处股长，中国工商银行平江支行副行长，中国工商银行苏州分行投资银行副总经理，东吴证券固定收益总部副总经理（主持工作）、固定收益总部总经理、上海分公司总经理，现任东吴证券资金运营部总经理。

周虹女士，董事，本科学历，现任海澜集团有限公司海澜资本投资部投资经理。

张婉苏女士，独立董事，经济法学博士。历任斯洛文尼亚道迈尔机电有限责任公司苏州代表处法律顾问、南京大学法学院助教、讲师，现任南京大学法学院副教授。

袁勇志先生，独立董事，教授，博士生导师。历任苏州大学管理学院教师、苏州大学人文社科处处长、苏州大学党委研究生工作部部长，现任苏州大学出版社副总编。

方志刚先生，独立董事，大学学历，民建会员。企业类会计师、中国注册会计师、资深澳洲注册会计师。历任上海上审会计师事务所审计员、部门经理，上海长信会计师事务所部门经理，上海锦江国旅股份有限公司财务部经理、上海实业联合集团长城药业有限公司财务总监；上海众华沪银会计师事务所高级经理，瑞华会计师事务所（特殊普瑞合伙）合伙人，现任上会会计师事务所（特殊普通合伙）主任会计师助理，担任长方集团股份有限公司和拟IPO企业江苏帝奥微电子股份有限公司独立董事。

2、监事会成员

袁维静女士，监事长，党校大学，高级会计师，中共党员。历任苏州市财政局工交企财处办事员、科员，江苏省高新技术风险投资公司苏州分公司副总经理，苏州市营财发展集团总公司副总经理，苏州市工业发展有限公司副总经理、副总经理兼苏州市商业银行董事，江苏省高新技术风险投资公司苏州分公司副总经理、苏州市财政信息中心副主任（聘），苏州市营财发展集团总公司副总经理、总经理，苏州国际发展集团有限公司副总会计师兼计划财务部经理、公司董事、总会计师（聘）、公司党委委员，东方水城旅游有限责任公司监事会

主席（兼），苏州信托有限公司董事长，现任东吴证券党委委员、公司副总裁兼财务负责人。

王菁女士，监事，本科学士学位，会计师，中共党员。历任东吴证券经纪分公司财务经理、东吴证券财务部总经理助理、副总经理，现任东吴证券股份有限公司财务部总经理。

沈清韵女士，监事，硕士研究生，中共党员。历任普华永道中天会计师事务所高级审计员，东吴基金管理有限公司监察稽核部总经理，风险管理部总经理，董秘，现任合规风控部总经理。

3、高管人员

邓晖先生，董事，硕士研究生，中共党员。历任长江证券有限责任公司董事、副总裁，湘财证券有限责任公司副总裁，德邦证券有限责任公司副总裁，总裁兼德邦期货有限公司董事长，齐鲁证券有限公司党委委员、副总裁、总裁，长江证券（上海）资产管理有限公司董事长，长江成本资本投资有限公司董事长，长江证券股份有限公司党委副书记、总裁、副董事长、监事长，现任东吴基金管理有限公司总经理。

陈军先生，常务副总经理，硕士。历任中国出口商品基地建设金桥公司项目经理；中信证券资产管理部投资经理；中银基金管理有限公司研究员，基金经理，助理执行总裁，副执行总裁（分管投研），现任东吴基金管理有限公司常务副总经理。

徐明先生，副总经理，硕士，中共党员。历任中国银行苏州分行营业部会计；苏州华纺经济贸易有限公司财务科会计；中创证券有限责任公司苏州十全街营业部副总经理；东吴证券有限责任公司胥江路证券营业部副总经理，总经理；东吴证券股份有限公司石路证券营业部总经理，太仓分公司总经理，常熟分公司总经理；东吴基金管理有限公司营销总监兼营销管理部总经理，现任东吴基金管理有限公司副总经理。

刘婷婷女士，督察长，硕士，中共党员。历任南京永华会计师事务所审计员、会计师；中国证监会南京特派办科员、副主任科员；江苏证监局副主任科员、主任科员、副处长、调研员。现任东吴基金管理有限公司督察长。

葛艳女士，首席信息官，硕士。历任东吴证券有限责任公司信息技术经理，东吴基金管理有限公司信息技术部总经理。现任东吴基金管理有限公司首席信息官兼信息技术部总经理。

4、基金经理

现任基金经理：

邬炜先生，中国国籍，上海财经大学经济学硕士，具备证券投资基金从业资格。曾任职中银基金管理有限公司研究员、基金经理；中保秦唐（上海）股权基金管理有限公司投资经

理。2020 年 6 月加入东吴基金管理有限公司，现任研究总监兼研究策划部总经理、基金经理。自 2020 年 8 月 4 日起至今担任东吴行业轮动混合型证券投资基金基金经理，2021 年 3 月 1 日至今担任东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金基金经理。

历任基金经理：

庞良永，2008 年 4 月 23 日至 2009 年 5 月 5 日任本基金基金经理。

任壮，2009 年 1 月 20 日至 2014 年 1 月 24 日任本基金基金经理。

刘元海，2014 年 1 月 13 日至 2015 年 5 月 29 日任本基金基金经理。

王立立，2015 年 5 月 29 日至 2020 年 8 月 4 日任本基金基金经理。

5、投资决策委员会成员

投资决策委员会：常务副总经理陈军、研究总监兼研究策划部总经理邬炜、专户投资总监兼专户投资总部总经理刘浩宇、权益投资总部副总经理刘元海、固定收益总部总经理助理陈晨，陈军任投资决策委员会主任，邬炜为投资决策委员会执行委员，王晓彤为投资决策委员会秘书。

上述人员之间不存在近亲属关系。

（三）基金管理人的职责

基金管理人应严格依法履行下列职责：

1、依法募集本基金，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、办理本基金备案手续；

3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；

4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

6、编制季度报告、中期报告和年度报告；

7、计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回价格；

8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；

9、召集基金份额持有人大会；

10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

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

12、中国证监会规定的其他职责。

（四）基金管理人承诺

1、基金管理人将根据基金合同的规定，按照招募说明书列明的投资目标、理念、策略及限制等全权处理本基金的投资。

2、基金管理人严格遵守《证券法》《基金法》《信息披露办法》《运作办法》《销售办法》，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止以下《基金法》及有关法规禁止的行为发生：

将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；

不公平地对待其管理的不同基金财产；

利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；

向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；

承销证券；

向他人贷款或者提供担保；

从事承担无限责任的投资；

买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；

向本基金管理人、基金托管人出资或者买卖本基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；

买卖与本基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与本基金管理人、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；

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；

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。

法律法规或监管部门对上述限制另有规定时从其规定。

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

越权或违规经营；

违反基金合同或托管协议；

故意损害基金份额持有人或其他基金合同当事人的合法权益；

在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；

拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；

玩忽职守、滥用职权；

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；

违反证券交易场所业务规则，利用对敲、对倒、对仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；

在公开信息披露中故意含有虚假、误导、欺诈成分；

其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

4、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、被代理人、被代表人、受雇人或任何其他第三人谋取不当利益；

（3）不泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息。

（五）基金管理人的内部控制制度

1、风险管理的理念

（1）风险管理是业务发展的保障；

（2）最高管理层负最终责任；

（3）分工明确、相互牵制的组织结构是前提；

（4）制度建设是基础；

（5）制度执行监督是保障；

2、风险管理的原则

（1）健全性原则：风险控制必须覆盖公司的各项业务、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；

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

（3）独立性原则：公司设风险管理委员会、督察长和合规风控部，各风险控制机构和人员具有并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监察和稽核；

（4）相互制约原则：公司内部部门和岗位的设置必须权责分明、相互制约，同时强化合规风控部对各部门的合规风控职能；

（5）防火墙原则：公司基金投资业务和公司自有资金投资业务应在空间上和制度上适当隔离，投资决策和交易清算应严格分离。对因业务需要知悉内幕信息的人员，应对其相应行为制定严格的审批程序和过失处罚措施；

（6）适时性原则：公司内部控制制度的制定应具有前瞻性，并且随着公司经营战略、经营方针、经营管理等内部环境的变化和国家法律、法规、政策制度等外部环境的改变而及时进行相应的修改和完善；

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

3、风险管理和内部风险控制体系结构

公司的风险管理体系结构是一个分工明确、相互牵制的组织结构,由最高管理层对风险管理负最终责任,各个业务部门负责本部门的风险评估和监控,合规风控部负责监察公司的风险管理措施的执行。具体而言,包括如下组成部分：

（1）董事会：负责制定公司的风险管理政策,对风险管理负完全的和最终的责任；

（2）风险管理委员会：作为总经理领导下的专门委员会之一,风险管理委员会负责协助经营管理层建立健全内部控制制度，保证公司内控制度适应业务发展的需要，制定公司的业务风险管理政策，主持重大业务的可行性论证，协助经营管理层处理其他有关内部控制方面的重大事项；

（3）督察长：独立行使督察权利；直接对董事会负责；按照公司规定，定期向董事会、董事会风险控制委员会、总经理、总经理风险管理委员会报告公司经营管理的合法合规情况及风险情况，对重大事项及时报告；

（4）合规风控部：合规风控部负责公司内控机制与制度的建立、监察、评估和建议；

（5）业务部门：风险管理是每一个业务部门最首要的责任。部门经理对本部门的风险负全部责任,负责履行公司的风险管理程序,负责本部门的风险管理系统的开发、执行和维护,用于识别、监控和降低风险。

4、风险管理和内部风险控制的措施

（1）建立内控结构,完善内控制度：公司建立、健全了内控结构,高管人员关于内控有明确的分工,确保各项业务活动有恰当的组织和授权,确保监察活动是独立的,并得到高管人员的支持,同时置备操作手册,并定期更新；

（2）建立相互分离、相互制衡的内控机制：建立、健全了各项制度,做到基金经理分开,投资决策分开,基金交易集中,形成不同部门、不同岗位之间的制衡机制,从制度上减少和防范风险；

（3）建立、健全岗位责任制：建立、健全了岗位责任制,使每个员工都明确自己的任务、职责,并及时将各自工作领域中的风险隐患上报,以防范和减少风险；

（4）建立风险分类、识别、评估、报告、提示程序；建立了评估风险的委员会,使用适合的程序,确认和评估与公司运作有关的风险；公司建立了自下而上的风险报告程序,对风险隐患进行层层汇报,使各个层次的人员及时掌握风险状况,从而以最快速度作出决策。

（5）建立有效的内部监控系统；建立了足够、有效的内部监控系统,如电脑预警系统、投资监控系统,能对可能出现的各种风险进行全面和实时的监控；

（6）使用数量化的风险管理手段：采取数量化、技术化的风险控制手段,建立数量化的风险管理模型,用以提示指数趋势、行业及个股的风险,以便公司及时采取有效的措施,对风险进行分散、控制和规避,尽可能地减少损失。

（7）提供足够的培训：制定了完整的培训计划,为所有员工提供足够和适当的培训,使员工明确其职责所在,控制风险。

5、基金管理人关于内部合规控制声明书

（1）本公司承诺以上关于内部控制的披露真实、准确；

（2）本公司承诺根据市场变化和公司发展不断完善内部控制制度。

四、基金托管人

（一）基金托管人情况

1、基本情况

名称：华夏银行股份有限公司

住所：北京市东城区建国门内大街 22 号（100005）

办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号（100005）

法定代表人：李民吉

成立时间：1992 年 10 月 14 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：15387223983 元人民币

批准设立机关和设立文号： 中国人民银行[银复（1992）391 号]

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基金字[2005]25 号

联系人：郑鹏

电话：（010）85238667

传真：（010）85238680

2、主要人员情况

华夏银行资产托管部内设市场一室、市场二室、市场三室、风险与合规管理室、运营室、创新与产品室 6 个职能处室。资产托管部共有员工 49 人，高管人员拥有硕士以上学位或高级职称。

3、基金托管业务经营情况

华夏银行于 2005 年 2 月 23 日经中国证券监督管理委员会和中国银行业监督管理委员会核准，获得证券投资基金托管资格，是《证券投资基金法》和《证券投资基金托管资格管理办法》实施后取得证券投资基金托管资格的第一家银行。自成立以来，华夏银行资产托管部本着“诚实信用、勤勉尽责”的行业精神，始终遵循“安全保管基金资产，提供优质托管服务”的原则，坚持以客户为中心的服务理念，依托严格的内控管理、先进的技术系统、优秀的业务团队、丰富的业务经验，严格履行法律和托管协议所规定的各项义务，为广大基金份额持有人和资产管理机构提供安全、高效、专业的托管服务，取得了优异业绩。截至 2021 年 6 月末，托管证券投资基金、券商资产管理计划、银行理财、保险资管计划、资产支持专项计划、股权投资基金等各类产品合计 11021 只，证券投资基金 80 只，全行资产托管规模达到 57584.27 亿元。

（二）基金托管人的内部风险控制制度说明

1、内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金资产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

2、内部控制组织结构

风险管理委员会负责华夏银行股份有限公司的风险管理与内部控制工作，总行审计部对托管业务风险控制工作进行检查指导。资产托管部内部专门设置了风险与合规管理室，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，具有独立行使监督稽核工作的职权和能力。

3、内部风险控制的原则

（1）合法性原则：必须符合国家及监管部门的法律法规和各项制度并贯穿于 托管业务经营管理活动的始终；

（2）完整性原则：一切业务、管理活动的发生都必须有相应的规范程序和监督制约；监督制约必须渗透到托管业务的全过程和各个操作环节，覆盖到资产托管部所有的部门、岗位和人员；

（3）及时性原则：托管业务经营活动必须在发生时能准确及时地记录；按照“内控优先”原则，新设机构或新增业务品种时，必须做到已建立相关的规章制度；

（4）审慎性原则：必须实现防范风险、审慎经营，保证基金财产的安全与完整；

（5）有效性原则：必须根据国家政策、法律及华夏银行经营管理的发展变化进行适时修订；必须保证制度的全面落实执行，不得有任何空间、时限及人员的例外；

（6）独立性原则：资产托管部内部专门设置了风险与合规管理室，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，具有独立行使监督稽核工作的职权和能力。

4、内部控制制度及措施

具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理办法、实施细则、岗位职责、业务操作流程等，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格； 业务管理实行严格的复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；专门设置业务操作区，封闭管理，实施音像监控；指定专人负责受托资产的信息披露工作，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

（三）基金托管人对本基金管理人进行监督的方法和程序

托管人根据《基金法》《运作办法》、其他相关法律法规及基金合同的规定，对基金投资范围、投资对象、投资比例、融资比例、基金投资禁止行为、基金资产净值计算、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、基金收益分配、相关信息披露等进行监督。

1、基金托管人发现基金管理人有违反《基金法》《运作办法》、其他相关法律法规及基金合同规定的行为，应及时通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对确认。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，基金托管人应报告中国证监会。

2、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事项，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

3、基金托管人发现基金管理人有重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

五、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、直销机构：

东吴基金管理有限公司直销中心

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区银城路 117 号 9 楼 901、902 室

办公地址：上海市浦东新区银城路 117 号瑞明大厦 9F

法定代表人：邓晖

联系人：李佳

直销电话：（021）50509880

传真：（021）50509884

客户服务电话：400-821-0588

网站：www.scfund.com.cn

2、代销机构（代销机构代销东吴行业轮动混合 A/东吴行业轮动混合 C 具体情况以相关公告为准）：

（1）中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号（100005）

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号（100005）

法定代表人：姜建清

客服电话：95588

公司网址：www.icbc.com.cn

（2）中国农业银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座

法定代表人：谷澍

客服电话：95599

公司网址：www.abchina.com

（3）中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：田国立

客服电话：95533

公司网址：www.ccb.com

（4）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

客服电话：95559

公司网址：www.bankcomm.com

（5）招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：李建红

客服电话：95555

公司网址：www.cmbchina.com

（6）中信银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

法定代表人：田国立

客服电话：95558

公司网址：http：//bank.ecitic.com

（7）兴业银行股份有限公司

注册地址：福建省福州市湖东路 154 号

办公地址：福建省福州市湖东路 154 号

法定代表人：吕家进

客服热线：95561

公司网址：http://branch.cib.com.cn

（8）中国民生银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：洪崎

客服电话：95568

公司网址：www.cmbc.com.cn

（9）中国邮政储蓄银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 3 号

办公地址：北京市西城区金融大街 3 号

法定代表人：李国华

客服电话：95580

公司网址：www.psbc.com

（10）华夏银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 22 号（100005）

办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号（100005）

法定代表人：李民吉

客户服务电话：95577

公司网址：www.hxb.com.cn

（11）平安银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南中路 1099 号平安银行大厦

办公地址：深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦

法定代表人：谢永林

客服电话：95511-3

公司网址：www.bank.pingan.com

（12）宁波银行股份有限公司

注册地址：宁波市江东区中山东路 294 号

办公地址：宁波市鄞州区宁南南路 700 号宁波银行大楼

法定代表人：陆华裕

客服电话：96528、上海地区 962528

公司网址：www.nbcb.com.cn

（13）温州银行股份有限公司

注册地址：温州市车站大道华海广场 1 号楼

办公地址：温州市车站大道 196 号

法定代表人：邢增福

客服电话：0577-96699

公司网址：www.wzbank.cn

（14）烟台银行股份有限公司

注册地址：烟台市芝罘区海港路 25 号

办公地址：烟台市芝罘区海港路 25 号

法定代表人：叶文君

客服电话：4008-311-777

公司网址：www.yantaibank.net

（15）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

客服热线：95319

公司网址：www.jsbchina.cn

（16）苏州银行股份有限公司

注册地址：江苏省苏州工业园区钟园路 728 号

办公地址：江苏省苏州市工业园区钟园路 728 号

法定代表人：王兰凤

客服热线：96067

公司网址：www.suzhoubank.com

（17）天相投资顾问有限公司

注册地址：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701

办公地址：北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座 505

法定代表人：林义相

客服电话：010-66045678

传真：010-66045518

公司网址：http://jijin.txsec.com/

（18）鼎信汇金（北京）投资管理有限公司

注册地址：北京市朝阳区霄云路 40 号院 1 号楼 3 层 306 室

办公地址：北京市朝阳区霄云路 40 号院 1 号楼 3 层 306 室

法定代表人：齐凌峰

客服热线：400-158-5050

公司网址：https://www.tl50.com/

（19）和讯信息科技有限公司

注册地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号 1002 室

办公地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

法定代表人：王莉

客服热线：400-920-0022

公司网址：http：//licaike.hexun.com/

（20）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

办公地址：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

客服热线：400-003-5811

公司网址：www.win-stock.com.cn

（21）江苏汇林保大基金销售有限公司

注册地址：南京市高淳区经济开发区古檀大道 47 号

办公地址：江苏省南京市鼓楼区中山北路 105 号中环国际 1413 室

法定代表人：吴言林

客服热线：025-56663409

公司网址：www.huilinbd.com

（22）众惠基金销售有限公司

注册地址：贵州省贵阳市观山湖区长岭北路贵阳国际金融中心二期商务区第 C4 栋 30 层 1 号

办公地址：贵州省贵阳市观山湖区长岭北路贵阳国际金融中心二期商务区第 C4 栋 30 层 1 号

法定代表人：李春蓉

客服热线：400-8391818

公司网址：http://www.hyzhfund.com/

（23）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：400-699-7719

公司网址：www.xiquefund.com

（24）腾安基金销售（深圳）有限公司

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

办公地址：深圳市南山区海天二路 33 号腾讯滨海大厦 15 楼

法定代表人：刘明军

客服热线：95017

公司网址：https://www.txfund.com/

（25）民商基金销售（上海）有限公司

注册地址：上海市黄浦区北京东路 666 号

办公地址：上海市浦东新区张杨路 707 号生命人寿大厦 32 层

法定代表人：贲惠琴

客服热线：021-50206003

公司网址：www.msftec.com

（26）诺亚正行基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

办公地址：上海市杨浦区秦皇岛路 32 号 c 栋

法定代表人：汪静波

客服热线：400－821－5399

公司网址：www.noah-fund.com

（27）深圳众禄基金销售股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼 801

办公地址：深圳市罗湖区梨园路 8 号 HALO 广场 4 楼

法定代表人：薛峰

客服热线：4006-788-887

公司网址：www.zlfund.cn

（28）上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号东方财富大厦

法定代表人：其实

客服热线：95021/400-1818-188

公司网址：http://fund.eastmoney.com

（29）上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903～906 室

法定代表人：杨文斌

客服热线：400-700-9665

公司网址：www.ehowbuy.com

（30）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 栋 202 室

办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路 18 号黄龙时代广场 B 座

法定代表人：陈柏青

客服热线：4000766123

公司网址：www.fund123.cn

（31）上海长量基金销售有限公司

代销机构：上海长量基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区东方路 1267 号 11 层

法定代表人：张跃伟

客服电话：400-820-2899

公司网站：www.erichfund.com

（32）浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市西湖区文二西路 1 号元茂大厦 903 室

办公地址：杭州市余杭区五常街道同顺路 18 号同花顺大楼

法定代表人：凌顺平

客服热线：4008-773-772

公司网址：www.5ifund.com

（33）上海利得基金销售有限公司

注册地址：上海市宝山区蕴川路5475号1033室

办公地址：上海市浦东新区峨山路91弄61号10号楼14层

法定代表人：李兴春

客服电话：400-921-7755

公司网址：www.leadfund.com.cn

（34）泛华普益基金销售有限公司

注册地址：四川省成都市成华区建设路9号高地中心1101室

办公地址：成都市金牛区花照壁西顺街399号1栋1单元龙湖西宸天街B座1201号

法定代表人：于海锋

客服热线：400-080-3388

公司网址：www.puyifund.com

（35）宜信普泽（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809

办公地址：北京市朝阳区建国路88号SOHO现代城C座1809

法定代表人：戎兵

客服热线：400-6099-200

公司网址：www.yixinfund.com

（36）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

客服热线：95177

公司网址：www.snjijin.com

（37）北京恒天明泽基金销售有限公司

注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路10号五层5122室

办公地址：北京市朝阳区东三环北路甲19号SOHO嘉盛中心30层3001室

法定代表人：周斌

客服热线：4008980618

公司网址：www.chtfund.com

（38）北京汇成基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 E 世界财富中心 A 座 11 层 1108 号

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

客服热线：400-619-9059

公司网址：www.hcjijin.com

（39）一路财富（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区宝盛南路 1 号院 20 号楼 9 层 101-14

办公地址：北京市海淀区奥北科技园-国泰大厦 9 层

法定代表人：吴雪秀

客服热线：400-001-1566

公司网址：http://www.yilucaifu.com/

（40）北京钱景基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012

办公地址：北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012

法定代表人：赵荣春

客服热线：400-678-5095

公司网址：www.qianjing.com

（41）北京唐鼎耀华基金销售有限公司

注册地址：北京市延庆县延庆经济开发区百泉街 10 号 2 栋 236 室

办公地址：北京市朝阳区建国门外大街 19 号 A 座 1505 室

法定代表人：张冠宇

客服热线：400-819-9868

公司网址：www.tdyhfund.com

（42）北京植信基金销售有限公司

注册地址：北京市密云县兴盛南路 8 号院 2 号楼 106 室-67

办公地址：北京市朝阳区惠河南路盛世龙源 10 号

法定代表人：于龙

客服热线：4006-802-123

公司网址：https://www.zhixin-inv.com/

（43）杭州科地瑞富基金销售有限公司

注册地址：杭州市下城区武林时代商务中心 1604 室

办公地址：杭州市下城区上塘路 15 号武林时代 20F

法定代表人：陈刚

客服热线：0571-86915761

公司网址：www.cd121.com

（44）上海万得基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

办公地址：上海市浦东新区浦明路 1500 号万得大厦 11 楼

法定代表人：王廷富

客服热线：400-821-0203

（45）上海联泰基金销售有限公司

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

办公地址：上海市长宁区福泉北路 518 号 8 座 3 层

法定代表人：燕斌

客服热线：400-166-6788

公司网址：http：//www.66zichan.com

（46）深圳市金海九州基金销售有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室

办公地址：深圳市福田区金田路富德生命保险大厦 1106 室

法定代表人：彭维熙

客服热线：4000993333

公司网址：www.jhjzfund.com

（47）北京微动利基金销售有限公司

注册地址：北京市石景山区古城西路 113 号 3 层 342 室

办公地址：北京市石景山区古城西路 113 号 3 层 342 室

法定代表人：季长军

客服热线：400-188-5687

公司网址：www.buyforyou.com.cn

（48）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路潘园公路 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

客服热线：400-820-5369

公司网址：www.jiyufund.com.cn

（49）上海攀赢基金销售有限公司

注册地址：上海市闸北区广中西路 1207 号 306 室

办公地址：上海浦东新区银城路 116 号大华银行大厦 703 单元

法定代表人：沈茹意

客服热线：68889082

公司网址：www.pytz.cn

（50）上海陆金所基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

法定代表人：王之光

客户服务电话：4008219031

网址：www.lufunds.com

（51）珠海盈米基金销售有限公司

注册地址：珠海市横琴区宝华路 6 号 105 室-3491

办公地址：广州市海珠区阅江中路 688 号保利国际广场北塔 33 层

法定代表人：肖雯

客户服务电话：020-89629066

网址：http：//www.yingmi.cn/

（52）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

办公地址：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

客服热线：4000555671

公司网址：www.hgccpb.com

（53）奕丰基金销售有限公司

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

办公地址：深圳市南山区海德三道航天科技广场 A 座 17 楼 1704 室

法定代表人：TEOWEEHOWE（张伟豪）

客服热线：400-684-0500

公司网址：www.ifastps.com.cn

（54）上海爱建基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区西藏中路 336 号 1806-13 室

办公地址：上海市浦东新区民生路 1299 号丁香国际大厦西塔 19 层 02/03 室

法定代表人：马金

客服热线：021-60608989

（55）京东肯特瑞基金销售有限公司

注册地址：北京是海淀区中关村东路 66 号 1 号楼 22 层 2603-06

办公地址：北京市海淀区显龙山路 19 号 1 幢 4 层 1 座 401

法定代表人：江卉

客服热线：95118

公司网址：fund.jd.com

（56）大连网金基金销售有限公司

注册地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号诺德大厦 2 层 202 室

办公地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号诺德大厦 2 层 202 室

法定代表人：樊怀东

客服热线：4000-899-100

公司网址：www.yibaijin.com

（57）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

办公地址：北京市朝阳区来广营融新科技中心 C 座 17 层

法定代表人：钟斐斐

客服热线：400-159-9288

公司网址：https://danjuanapp.com

（58）上海华夏财富投资管理有限公司

注册地址：上海市虹口区东大名路687号1幢2楼268室

办公地址：北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层

法定代表人：毛淮平

客服热线：400-817-5666

公司网址：www.amcfortune.com

（59）中信期货有限公司

注册地址：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

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

客户服务电话：400-990-8826

网址：www.citicsf.com

（60）弘业期货股份有限公司

注册地址：南京市中华路50号

办公地址：南京市中华路50号弘业大厦

法定代表人：周剑秋

客服热线：400-828-1288

公司网址：www.ftol.com.cn

（61）国泰君安证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路618号

办公地址：上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼

法定代表人：贺青

客户服务热线：95521/4008888666

公司网址：http://www.gtja.com

（62）中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址：北京市朝内大街188号

法定代表人：张佑君

客服电话：400-8888-108

公司网址：www.csc108.com

（63）国信证券股份有限公司

注册地址：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

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

客服电话：95536

公司网址：www.guosen.com.cn

（64）招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

法定代表人：霍达

客服电话：95565、4008888111

公司网址：www.newone.com.cn

（65）广发证券股份有限公司

注册地址：广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街 2 号 618 室

办公地址：广州市天河区马场路 26 号广发证券大厦

法定代表人：孙树明

客服电话：95575 或致电各地营业网点

公司网址：www.gf.com.cn

（66）中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人：张佑君

客服热线：95548

公司网址：www.cs.ecitic.com

（67）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 2-6 层

办公地址：北京市丰台区西营街 8 号院 1 号楼青海金融大厦

法定代表人：陈共炎

客服电话：4008-888-888 或 95551

公司网址：www.chinastock.com.cn

（68）海通证券股份有限公司

注册地址：上海市广东路 689 号

办公地址：上海市广东路 689 号

法定代表人：周杰

客服电话：95553

公司网址：www.htsec.com

（69）申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层（邮编：200031）

客服电话：95523 或 4008895523

公司网址：www.swhysc.com

联系人：黄莹

（70）兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 268 号

办公地址：上海市浦东新区长柳路 36 号

法定代表人：杨华辉

客服电话：95562

公司网址：www.xyzq.com

（71）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：尤习贵

客服电话：95579

公司网址：www.95579.com

（72）安信证券股份有限公司

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

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

法定代表人：黄炎勋

客服电话：95517

公司网址：www.essence.com.cn

（73）西南证券股份有限公司

注册地址：重庆市江北区桥北苑 8 号

办公地址：重庆市江北区桥北苑 8 号西南证券大厦

法定代表人：吴坚

客服热线：95355、4008096096

公司网址：www.swsc.com.cn

（74）湘财证券股份有限公司

注册地址：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼

办公地址：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼

法定代表人：孙永祥

客服电话：95351

公司网址：www.xcsc.com

（75）万联证券股份有限公司

注册地址：州市天河区珠江东路 11 号 18、19 楼全层

办公地址：广东省广州市天河区珠江东路 13 号高德置地广场 E 座 12 层

法定代表人：袁笑一

客服热线：95322

公司网址：www.wlzq.com.cn

（76）国元证券股份有限公司

注册地址：安徽省合肥市寿春路 179 号

办公地址：安徽省合肥市寿春路 179 号

法定代表人：凤良志

客服电话：95578

公司网址：www.gyzq.com.cn

（77）渤海证券股份有限公司

注册地址：天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

办公地址：天津市南开区宾水西道 8 号

法定代表人：王春峰

客服电话：400-6515-988

公司网址：www.ewww.com.cn

（78）华泰证券股份有限公司

注册地址：南京市江东中路 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：周易

客服电话：95597

公司网址：www.htsc.com.cn

（79）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 1 号楼 2001

办公地址：青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座 5 层

法定代表人：姜晓林

客服电话：95548

公司网址：www.zxzqsd.com.cn

（80）东吴证券股份有限公司

注册地址：苏州工业园区星阳街 5 号

办公地址：苏州工业园区星阳街 5 号

法定代表人：范力

客服电话：95530

公司网址：www.dwzq.com.cn

（81）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：张志刚

客服电话：95321

公司网址：www.cindasc.com

（82）东方证券股份有限公司

注册地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层、23 层、25-29 层

办公地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层、23 层、25-29 层

法定代表人：潘鑫军

客服电话：95503

公司网址：www.dfzq.com.cn

（83）长城证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 16-17 楼

办公地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 16-17 楼

法定代表人：丁益

客服电话：400-6666-888

公司网址：www.cgws.com

（84）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：周健男

客服电话：95525

公司网址：www.ebscn.com

（85）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 层、20 层

办公地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层

法定代表人：胡伏云

客服电话：95396

公司网址：www.gzs.com.cn

（86）南京证券股份有限公司

注册地址：南京市江东中路 389 号

办公地址：南京市江东中路 389 号

法定代表人：步国旬

客服电话：95386

公司网址：www.njzq.com.cn

（87）上海证券有限责任公司

注册地址：上海市黄浦区四川中路 213 号 7 楼

办公地址：上海市黄浦区四川中路 213 号 7 楼

法定代表人：李俊杰

客户服务电话：021-962518

网址：www.shzq.com

（88）国联证券股份有限公司

注册地址：无锡市金融一街 8 号

办公地址：无锡市金融一街 8 号国联大厦

法定代表人：姚志勇

客服电话：95570

公司网址：www.glsc.com.cn

（89）平安证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

办公地址：深圳市福田中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层（518048）

法定代表人：谢永林

客服热线：95511-8

公司网址：www.PINGAN.com

（90）华安证券股份有限公司

注册地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

办公地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

法定代表人：章宏韬

客服电话：95318

公司网址：www.hazq.com

（91）国海证券股份有限公司

注册地址：广西桂林市辅星路 13 号

办公地址：广西南宁市滨湖路 46 号

法定代表人：何春梅

客服热线：95563

公司网址：www.ghzq.com.cn

（92）财信证券有限责任公司

注册地址：长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 楼

办公地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26-28 楼

法定代表人：蔡一兵

客服电话：95317

公司网址：www.cfzq.com

（93）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

客服电话：95531、400-8888-588

网址：www.longone.com.cn

（94）中银国际证券有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39F

办公地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39-40F

法定代表人：许刚

客户服务电话：4006208888

公司网址：www.bocichina.com

（95）恒泰证券股份有限公司

注册地址：内蒙古呼和浩特市新城区海拉尔东街满世尚都办公商业综合楼

办公地址：内蒙古呼和浩特市新城区海拉尔东街满世尚都办公商业综合楼

法定代表人：庞介民

客服电话：956088

公司网址：www.cnht.com.cn

（96）申万宏源（西部）证券有限公司

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

办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室（邮编：830002）

法定代表人：韩志谦

客户服务电话：400-800-0562

网址：www.hysec.com

（97）中泰证券股份有限公司

注册地址：山东省济南市经七路 86 号 23 层

办公地址：山东省济南市经七路 86 号 23 层

法定代表人：李玮

客服电话：95538

公司网址：http://www.zts.com.cn/

（98）世纪证券有限责任公司

注册地址：深圳市前海深港合作区南山街道桂湾五路 128 号前海深港基金小镇对冲基金中心 406

办公地址：广东省深圳市福田区福田街道金田路 2026 号能源大厦北塔 23-25 楼

法定代表人：李强

客服电话：4008323000

公司网址：www.csco.com.cn

（99）金元证券股份有限公司

注册地址：海南省海口市南宝路 36 号证券大厦 4 层

办公地址：深圳市福田区深南大道 4001 号时代金融中心 17 层

法定代表人：王作义

客服电话：95372

公司网址：www.jyzq.com.cn

（100）中航证券有限公司

注册地址：江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼

办公地址：北京市朝阳区望京东园四区 2 号中航资本大厦 35 层

法定代表人：王晓峰

客服电话：95335

公司网址：www.avicsec.com

（101）华福证券有限责任公司

注册地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层

办公地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7 层至 10 层

法定代表人：黄金琳

客服电话：0591－95547（福建省外请先拨 0591）

公司网址：www.hfzq.com.cn

（102）上海华信证券有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心9楼

办公地址：上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心9楼

法定代表人：罗浩

客服热线：68777877

公司网址：www.cf-clsa.com

（103）五矿证券有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心47层01单元

办公地址：深圳市南山区滨海大道与后海滨路交汇处滨海大道3165号五矿金融大厦（18-25层）

法定代表人：黄海洲

客服热线：40018-40028

公司网址：www.wkzq.com.cn

（104）华鑫证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01（b）单元

办公地址：上海市徐汇区宛平南路8号

法定代表人：俞洋

客户服务电话：95323、4001099918

公司网站：www.cfsc.com.cn

（105）中国中金财富证券有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18-21层及第04层01、02、03、05、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、23单元

办公地址：深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第4、18层至21层

法定代表人：龙增来

客服热线：4006008008

公司网址：www.china-invs.cn

（106）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

办公地址：上海市徐汇区宛平南路88号金座东方财富大厦

法定代表人：戴彦

客服热线：95357

公司网址：http://www.18.cn

（107）粤开证券股份有限公司

注册地址：广州经济技术开发区科学大道60号开发区控股中心21、22、23层

办公地址：广州经济技术开发区科学大道60号开发区控股中心21、22、23层

法定代表人：严亦斌

客服热线：95564

公司网址：www.ykzq.com

（108）九州证券股份有限公司

注册地址：青海省西宁市南川工业园区创业路108号

办公地址：北京市朝阳区安立路30号仰山公园东一门2号楼

法定代表人：魏先锋

客服热线：95305

公司网址：http://www.jzsec.com

（109）国金证券股份有限公司

注册地址：四川省成都市东城根上街95号

办公地址：四川省成都市东城根上街95号

法定代表人：冉云

客服热线：95310

公司网址：www.gjzq.com.cn

（110）华宝证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道100号57层

办公地址：上海市浦东新区世博大道1859号宝武大厦1号楼7楼

法定代表人：陈林

客服电话：4008209898

公司网址：www.cnhbstock.com

（111）长城国瑞证券有限公司

注册地址：厦门市思明区莲前西路2号莲富大厦17楼

办公地址：厦门市思明区深田路46号深田国际大厦20楼

法定代表人：王勇

客服热线：400-0099-886

公司网址：www.gwgsc.com

（112）爱建证券有限责任公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道1600号1幢32楼

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道1600号1幢32楼

法定代表人：祝健

客服电话：4001962502

公司网址：www.ajzq.com

（113）华融证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街8号

办公地址：北京市朝阳区朝阳门北大街18号中国人保寿险大厦12-18层

法定代表人：张海文

客服热线：95390

公司网址：www.hrsec.com.cn

（114）方德保险代理有限公司

注册地址：北京市东城区东直门南大街3号楼7层711

办公地址：北京市东城区东直门外大街22号天恒大厦B座U•work12层02室

法定代表人：林柏均

客服热线：010-64068617

公司网址：www.fdsure.cn

（115）华瑞保险销售有限公司

注册地址：上海市嘉定区南翔镇众仁路399号运通星财富广场1号楼B座13、14层

办公地址：上海市浦东区向城路288号国华金融大厦8楼

法定代表人：路昊

客服热线：952303

公司网址：http://www.huaruisales.com

（116）阳光人寿保险股份有限公司

注册地址：海南省三亚市河东区三亚河东路海唐商务12、13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

客服热线：95510

公司网址：http://fund.sinosig.com/

（117）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

公司网址：www.e-chinalife.com

3、基金管理人可根据《基金法》《运作办法》《销售办法》和基金合同等的规定，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时履行公告义务。

（二）注册登记机构：

名称：东吴基金管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区银城路 117 号 9 楼 901、902 室

办公地址：上海市浦东新区银城路 117 号瑞明大厦 9F

法定代表人：邓晖

联系人：李佳

电话：021-50509888

传真：021-50509884

客户服务电话：400-821-0588

网站：www.scfund.com.cn

（三）律师事务所和经办律师

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：韩炯

电话：（021）31358666

传真：（021）31358600

联系人：陆奇

经办律师：黎明、陆奇

（四）会计师事务所和经办注册会计师

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层

执行事务合伙人：毛鞍宁

电话：010-58153000

传真：010-85188298

联系人：徐艳

经办注册会计师：徐艳、张亚旎

六、基金的募集

（一）基金募集的依据

本基金由基金管理人依照《基金法》《运作办法》《销售办法》、基金合同及其他有关规定募集。本基金募集申请已经中国证券监督管理委员会证监许可[2008]296 号文核准。于 2008 年 3 月 17 日起向社会公开募集。截止到 2008 年 4 月 17 日，基金募集工作已顺利结束。

（二）基金类型和存续期间

1、基金的类别：混合型证券投资基金

2、基金的运作方式：契约型开放式

3、基金的存续期间：不定期

4、基金份额的类别

本基金根据申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人申购时收取前端申购费，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资人申购时不收取前端申购费，而从本类别基金资产中计提销售服务费，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的，称为 C 类基金份额。

本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为：

计算日某类基金份额净值＝该计算日该类基金份额的基金资产净值/该计算日发售在外的该类别基金份额总数。

在不违反法律法规规定且对已有基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金管理人在履行适当程序后可以增加、减少或调整基金份额类别设置、调整现有基金份额类别的申购费率、调低赎回费率、销售服务费率或变更收费方式、停止现有基金份额类别的销售等，调整实施前基金管理人依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告，不需要召开基金份额持有人大会。

（三）募集方式

通过基金销售网点（包括基金管理人的直销中心及代销机构的代销网点，具体名单见基金份额发售公告）公开发售。

（四）募集期限

自基金份额发售之日起最长不得超过 3 个月，具体发售时间见基金份额发售公告。

（五）募集对象

符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者和机构投资者以及合格境外

机构投资者。

（六）募集情况

经江苏公证会计师事务所有限公司验资，本次募集的净认购金额为人民币3,171,531,068.11元。经中国证券登记结算公司开放式基金登记结算系统确认的本基金募集期间有效认购资金按实际适用年利率计算产生的利息共计人民币1,533,165.95元。上述资金已于2008年4月22日划入本基金在基金托管人华夏银行股份有限公司开立的基金托管专户。

本次募集有效认购户数为25,180户，按照每份基金份额面值1.00元人民币计算，本息合计募集基金份额总额为3,173,064,234.06份，已全部计入投资者账户，归投资者所有。其中东吴基金管理有限公司于2008年3月27日认购本基金，持有的基金份额总额为15,007,250.00份（含募集期利息结转的份额），认购费用为1,000.00元。

基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。

七、基金合同的生效

(一)基金备案的条件

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法规和基金合同的有关规定，本基金的募集情况已符合基金合同生效的条件。本基金于2008年4月23日得到中国证监会书面确认，基金备案手续办理完毕，基金合同自该日起正式生效。自基金合同生效之日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

(二)基金合同无法按期满足生效条件的处理

如果《基金合同》不能生效，基金管理人应当承担下列责任：

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日内返还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期存款利息。

如果《基金合同》不能生效，基金管理人、基金托管人及代销机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和代销机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。

(三)基金存续期内的基金份额持有人数量和资金数额

《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5,000万元的，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并报送解决方案。

法律法规另有规定时，从其规定。

八、基金份额的申购与赎回

（一）申购和赎回场所

本基金的申购和赎回将通过本基金管理人的直销网点及基金代销机构的代销网点进行。销售机构名单和联系方式见上述第五章“相关服务机构”第（一）条“基金份额发售机构”。

投资者可按销售机构提供的交易方式办理基金的申购和赎回。销售代理人或销售代理人的代销网点如有变动，基金管理人将在管理人网站公示。

（二）申购和赎回的办理时间

1、开放日及时间

本基金开放日为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日。具体业务办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的交易时间。基金合同生效以后,若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况,基金管理人将视情况对前述开放日进行相应的调整并公告。

基金投资者在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或者转换申请的，其基金份额申购、赎回价格为下次办理该类基金份额申购、赎回时间所在开放日的价格。

2、申购的开始日及业务办理时间

基金合同生效日后不超过 3 个月的时间起开始办理申购。具体业务办理时间在申购开始公告中规定。

3、赎回的开始日及业务办理时间

基金合同生效日后不超过 3 个月的时间起开始办理赎回。具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。

在确定申购开始与赎回开始时间后,由基金管理人最迟于开始日前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒介上公告。

（三）申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日的该类基金份额净值为基准进行计算；

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；

4、基金管理人可根据基金运作的实际情况并在不影响投资者实质利益的前提下调整上述原则。基金管理人必须在新规则开始实施 3 个工作日前在至少一种中国证监会指定的媒介上刊登公告。

（四）申购和赎回的数额限制

1、本基金的单笔最低申购（含定期定额投资）金额为 1.00 元（含申购费，A 类份额与 C 类份额分别计算，下同），追加申购单笔最低限额为 1.00 元（含申购费）；本基金的单笔最低赎回份额、最低转换转出份额为 1 份，基金份额持有人赎回时或赎回后在销售机构托管的基金份额余额不足 1 份的，在赎回时需一次性全部赎回；本基金的最低持有份额相应为 1 份。

2、销售机构可自行设置相关基金的单笔最低申购（含定期定额投资）金额、单笔最低赎回份额、最低转换转出份额、最低持有份额，但不得低于本公司设定的上述业务的最低数额限制。投资人通过各销售机构办理基金投资业务需遵循各销售机构的具体规定，敬请投资人留意。

3、投资人通过本公司直销渠道办理上述基金的投资业务，单笔最低申购（含定期定额投资）金额（含申购费）、追加申购单笔最低限额为 10.00 元（含申购费）；单笔最低赎回份额、最低转换转出份额、最低持有份额为 10 份，基金份额持有人赎回时或赎回后在直销渠道托管的基金份额余额不足 10 份的，在赎回时需一次性全部赎回。

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

5、基金管理人可以根据实际情况对以上限制进行调整，最迟在调整生效前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒介公告。

（五）申购和赎回的程序

1、申购和赎回的申请方式

基金投资者必须根据基金销售机构规定的程序，在开放日的业务办理时间向基金销售机构提出申购或赎回的申请。投资者在申购本基金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、赎回申请无效而不予成交。

2、申购和赎回申请的确认与通知

投资者T日申购基金成功后，登记结算机构在T+1日为投资者办理增加权益的登记手续，投资者自T+2日起有权赎回该部分基金份额。投资者T日赎回基金成功后，登记结算机构在T+1日为投资者办理扣除权益的登记手续。

T日规定时间受理的申请，正常情况下投资者可在T+2日通过本公司客户服务电话或到其办理业务的销售网点查询确认情况，打印确认单。

基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述登记结算办理时间进行调整并公告。但基金管理人最迟须于受理申购、赎回申请之日起3个工作日内，对申请的有效性进行确认。

3、申购和赎回申请的款项支付

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

投资者赎回申请成功后，基金管理人应指示基金托管人按有关规定划付赎回款项。赎回款项应在自受理基金投资者有效赎回申请之日起不超过7个工作日的时间内划往赎回人银行账户。在发生巨额赎回时，款项的支付办法按基金合同及本招募说明书有关规定处理。

（六）申购费与赎回费

1、本基金A类基金份额的申购费由申购A类基金份额的投资人承担，用于市场推广、销售、登记结算等各项费用。C类基金份额不收取申购费用。

2、具体申购费率如下：

A类基金份额申购金额（含申购费）	A类基金份额申购费率
100万元以下	1.50%
100万元以上（含）-200万元以下	1.20%
200万元以上（含）-500万元以下	0.80%
500万元以上（含）	1000元/笔

3、赎回费随基金持有时间的增加而递减，费率如下：

A类基金份额持有时间	A类基金份额赎回费率
7 天以内（不含 7 天）	1.50%
7 天-1 年（含 1 年）	0.50%
1 年-2 年（含 2 年）	0.25%
2 年以上	0
C 类基金份额持有时间	C类基金份额赎回费率
7 天以内（不含 7 天）	1.50%
7 天-30 天（不含 30 天）	0.50%
30 天以上（含 30 天）	0

4、本基金赎回费由赎回人承担，在投资者赎回基金份额时收取。其中，须依法扣除所收取A类基金份额赎回费总额的25%归入基金资产，其余用于支付登记结算费、销售手续费等各项费用。对持续持有期少于7日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产。对于持续持

有期少于30日的C类基金份额所收取的赎回费，赎回费用全额归入基金财产。

5、基金管理人可以调整申购费率、赎回费率或收费方式，并最迟将于新的费率或收费方式开始实施前3个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒介公告。

（七）申购份数与赎回金额的计算方式

1、申购份数的计算

（1）A类基金份额的申购

净申购金额=申购金额/（1+申购费率）

申购费用=申购金额-净申购金额

申购份数＝净申购金额/T日A类基金份额净值

基金份数以四舍五入的方法保留小数点后两位，由此误差产生的损失或收益归入基金资产。

（2）C类基金份额的申购

申购份数=申购金额/T日C类基金份额净值

基金份数以四舍五入的方法保留小数点后两位，由此误差产生的损失或收益归入基金资产。

2、赎回金额的计算

在先进先出的原则下，A类或C类基金份额赎回金额的计算方法如下：

赎回总额＝赎回份数×T日该类基金份额净值

赎回费用＝赎回总额×该类基金份额赎回费率

赎回金额=赎回总额-赎回费用

3、T日的各类基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

4、申购份额、余额的处理方式：申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后，以当日该类基金份额净值为基准计算，计算结果保留到小数点后二位，第三位四舍五入，由此产生的误差在基金资产中列支。

5、赎回金额的处理方式：赎回金额为按实际确认的有效赎回份额以当日该类基金份额净值为基准并扣除相应的费用，计算结果保留到小数点后二位，第三位四舍五入，由此产生的误差在基金资产中列支。本基金各类基金份额净值的计算，均保留到小数点后四位，小数点后第五位四舍五入。

（八）拒绝或暂停申购的情形

除出现如下情形，基金管理人不得拒绝或暂停基金投资者的申购申请：

1、不可抗力的原因导致基金无法正常运作；

2、证券交易所交易时间非正常停市，导致无法计算当日的基金净值；

3、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，或可能对基金业绩产生负面影响，从而损害已有基金份额持有人的利益；

4、基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔申购；

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

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数的比例达到或者超过基金份额总数的50%，或者有可能导致投资者变相规避前述50%比例要求的情形；

7、法律、法规规定或中国证监会认定的其它可暂停申购的情形。

发生上述1、2、3、5、7项暂停申购情形时，基金管理人应当在指定媒介上刊登暂停申购公告。基金管理人决定拒绝接受某些投资者的申购申请时，申购款项将退回投资者账户。在暂停申购的情形消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理并予以公告。

（九）暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

除下列情形外，基金管理人不得拒绝接受或暂停支付基金投资者的赎回款项：

1、不可抗力的原因导致基金无法正常运作；

2、证券交易场所交易时间非正常停市，导致当日基金资产净值无法计算；

3、因市场剧烈波动或其它原因而出现连续巨额赎回，导致本基金的现金支付出现困难；

4、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、法律法规规定或经中国证监会核准的其他情形。

发生上述情形之一的，基金管理人应当在当日向中国证监会备案，并及时公告。已接受的赎回申请，基金管理人应当足额兑付；如暂时不能足额兑付，应当按单个账户已被接受的赎回申请量占已接受的赎回申请总量的比例分配给赎回申请人，其余部分在后续开放日予以兑付，并以后续开放日的基金份额净值为依据计算赎回金额，延期支付最迟不得超过20个工作日。投资者在申请赎回时可选择将当日未获受理部分予以撤销。

在暂停赎回的情形消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并予以公告。

（十）巨额赎回的情形及处理方式

1、巨额赎回的认定

单个开放日基金净赎回申请超过上一日基金总份额的10%时，为巨额赎回。

2、巨额赎回的处理方式

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

（1）接受全额赎回：当基金管理人认为有能力兑付投资者的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行；

（2）部分延期赎回：当基金管理人认为兑付投资者的赎回申请有困难，或认为为兑付投资者的赎回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比例不低于上一日基金总份额10%的前提下，对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；未受理部分除投资者在提交赎回申请时选择将当日未获受理部分予以撤销者外，延迟至下一开放日办理。转入下一开放日的赎回申请不享有赎回优先权并将以该下一个开放日的该类基金份额净值为依据计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止；

（3）如发生单个开放日内单个基金份额持有人申请赎回的基金份额占前一开放日基金总份额的比例超过 20%时，本基金管理人可以对该单个基金份额持有人超过前述约定比例的赎回申请实施延期赎回。

对该单个基金份额持有人不超过前述比例的赎回申请，与当日其他赎回申请一起，按上述“（1）全额赎回”或“（2）部分延期赎回”方式处理。如下一开放日，该单一基金份额持有人剩余未赎回部分仍旧超出前述比例约定的，继续按前述规则处理，直至该单一基金份额持有人单个开放日内申请赎回的基金份额占前一开放日基金总份额的比例低于前述比例。

在不违反法律法规的前提下，基金管理人在履行适当程序后，有权根据当时市场环境调整前述比例及处理规则，并在指定媒介上进行公告。

当发生巨额赎回并部分延期赎回时，基金管理人应在2日内通过指定媒体、基金管理人的公司网站或销售代理人的网点刊登公告，或邮寄、传真等方式通知基金份额持有人，并说明有关处理方法。

本基金连续2个开放日以上发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过20个工作日，并应当在至少一种中国证监会指定的信息披露媒介公告。

（十一）申购和赎回暂停期间与重新开放的公告

暂停申购或暂停赎回结束、基金重新开放时，基金管理人应在至少一种中国证监会指定的信息披露媒介公告：

1、如果发生暂停的时间为1日，基金管理人应于重新开放日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒介刊登基金重新开放申购或赎回的公告并公告最新的各类基金份额净值。

2、如果发生暂停的时间超过1日但少于两周，暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前1个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒介刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最新的各类基金份额净值。

3、如果发生暂停的时间超过两周，暂停期间，基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次。暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前2日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒介刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最新的各类基金份额净值。

（十二）实施侧袋机制期间本基金的申购与赎回

本基金实施侧袋机制的，本基金的申购与赎回安排详见招募说明书“侧袋机制”章节的规定或届时发布的相关公告。

九、与基金管理人管理的其他基金转换

（一）基金转换业务的适用范围

基金管理人将根据具体情况确定基金转换业务的适用范围，并将另行公告。

（二）适用销售机构

根据业务需要，本基金管理人将选择适用销售机构开办此业务并将按有关规定予以公告。

（三）业务办理时间

基金办理转换业务的开放日为上海证券交易所和深圳证券交易所交易日（本公司公告暂停转换时除外）。具体业务办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的交易时间。

（四）基金转换业务规则

1、基金转换是指开放式基金份额持有人将其持有的某只基金的部分或全部份额转换为同一基金管理人管理的另一只开放式基金的份额；

2、基金转换只能转换为基金管理人管理的、同一注册登记人登记存管的、同一基金账户下的基金份额，并只能在同一销售机构进行，且该销售机构须同时代理拟转出基金及拟转入基金的销售；

3、拟转出的基金必须处于可赎回状态，拟转入的基金必须处于可申购状态；

4、目前只开通前端收费模式下进行基金转换，而不能将前端收费基金份额转换为后端收费基金份额，或将后端收费基金份额转换为前端收费基金份额。如今后开通后端收费模式基金的转换业务，具体转换业务规则以相关公告内容为准；

5、基金转换遵循“份额转换”的原则，转换申请份额精确到小数点后2位，单笔转换申请份额不得低于1份；

6、对于基金分红时，权益登记日申请转换转出的基金份额享有该次分红权益，权益登记日申请转换转入的基金份额不享有该次分红权益；

7、基金转换采取未知价法，即基金的转换价格以转换申请受理当日各转出、转入基金的份额净值为基准进行计算；

8、转换业务遵循“先进先出”的业务规则，先确认的认购或者申购的基金份额在转换时先转换；

9、单个开放日基金净赎回份额及净转换转出申请份额之和超出上一开放日基金总份额的10%时，为巨额赎回。发生巨额赎回时，基金转出与基金赎回具有相同的优先级，基金管理人可根据基金资产组合情况，决定全额转出或部分转出，并且对于基金转出和基金赎回，

将采取相同的比例确认。在转出申请得到部分确认的情况下，未确认的转出申请将不予以顺延；

10、转入基金的持有时间将重新计算，与转出基金的持有时间无关；

11、投资者在Ｔ日办理的基金转换申请，基金注册登机构在T+1日内为投资者对该交易的有效性进行确认，在T+2日后（包括该日）投资者可通过基金份额发售机构或以基金份额发售机构规定的其他方式查询成交情况；

12、基金转换费用由基金持有人承担；

13、基金管理人将根据今后发行的其他开放式基金的具体情况对本业务规则进行补充和调整。

（五）基金转换费及份额计算方法

1、基金转换费用由转出基金的赎回费和转出与转入基金的申购费补差两部分构成，具体收取情况视每次转换时两只基金的申购费率差异情况和赎回费率而定。基金转换费用由基金份额持有人承担。

转换公式如下：

（1）转出金额＝转出基金份额×转出基金Ｔ日该类基金份额净值（此处的Ｔ日指基金转换申请日，下同）

（2）转出赎回费＝转出金额×转出基金赎回费率

（3）转入金额＝转出金额－转出赎回费

（4）如果，转出基金的申购费率＜转入基金的申购费率，

申购补差费率＝转入基金的申购费率－转出基金的申购费率

申购补差费＝转入金额×申购补差费率／（1＋申购补差费率）

转入净额＝转入金额－申购补差费

如果，转出基金的申购费率≥转入基金的申购费率，

转入净额＝转入金额

（5）如果，转入份额＝转入净额÷转入基金Ｔ日该类基金份额净值

其中，转入基金的申购费率和转出基金的申购费率均以转出金额为确定依据。

2、转出金额、转出基金转换费的计算保留小数点后两位，第三位四舍五入，由此产生的误差在转出基金资产中列支；转入份额、申购补差费的计算保留小数点后两位，第三位四舍五入，由此产生的误差在转入基金资产中列支。

3、对于实行级差申购费率(不同申购金额对应不同申购费率)的基金，以转入总金额对

应的转出基金申购费率、转入基金申购费率计算申购补差费用；如转入总金额对应转出基金申购费或转入基金申购费为固定费用时，申购补差费用视为0。

4、计算基金转换费用所涉及的申购费率和赎回费率均按基金合同、更新的招募说明书规定费率执行，对于通过基金管理人网上交易、费率优惠活动期间发生的基金转换业务，按照基金管理人最新公告的相关费率计算基金转换费用。

十、基金的投资

（一）投资目标

本基金为混合型基金，通过对行业轮动规律的把握，侧重投资于预期收益较高的行业，并重点投资具有成长优势、估值优势和竞争优势的上市公司股票，追求超额收益。

（二）投资理念

把握行业轮动规律、投资优势公司股票、追求超额收益。

在稳定快速发展的中国经济中，市场需求、技术进步、政策变动、行业整合等因素变动均对各行业带来了不同的机遇和挑战，行业的周期性和结构性分化是中长期现象，在股票市场中表现为行业投资收益的中长期轮动。把握各行业发展趋势和市场波动特征，并对行业资产进行科学配置，是基金控制风险、获取稳定收益的有效方法。既然每一市场周期中都有收益率高于和低于大盘指数的行业，那么只要判断出下一周期优于大盘指数的行业进行投资，就可以获得超额收益。

（三）投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、权证、以及法律法规或经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的60%-95%，债券投资比例为基金资产的0-35%，权证投资比例不高于基金资产净值的3%，现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金根据行业轮动规律，80%以上的非现金基金资产投资于具有“三重优势”的股票、债券、权证等资产。

如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

（四）投资策略

本基金采取自上而下策略，根据对宏观经济、政策和证券市场走势的综合分析，确定基金资产在股票、衍生产品、债券和现金上的配置比例。采取行业轮动策略，对股票资产在不同行业之间进行适时的行业轮动，动态增大预期收益率较高的行业配置，减少预期收益率较低的行业配置。对于股票投资策略，重点投资具有成长优势、估值优势和竞争优势的上市公司股票，追求超额收益。

1、行业配置策略

本基金行业配置策略是通过东吴行业轮动识别模型实现的，东吴行业轮动识别模型从行

业利润增长趋势和行业动态估值水平两个维度构建。以A股整体估值水平和A股整体利润增长率作为基准，同时结合国际估值的比较，将《东吴基金管理公司行业分类》中所有行业分成四类：

- A 类行业：行业利润增长速度高（大于 A 股整体利润增长率，但必须大于 0）、甚至加速增长，并且估值水平低；
- B 类行业：行业利润增长速度高、甚至加速增长，但估值水平高；
- C 类行业：行业利润增长速度低、甚至负增长，但估值水平低；
- D 类行业：行业利润增长速度低、甚至负增长，并且估值水平高。

从行业投资价值看，从高到低依次排序为：A类行业最值得关注，其次是B类行业，然后是C类行业，D类行业投资风险最大。

本基金通过行业轮动识别模型把握行业轮动路径，评估各行业的风险收益水平，并确定股票资产在各行业之间的配置，具体配置原则是：1）对于行业利润增长速度高、甚至加速增长，并且估值水平低的A区行业，配置比例高，最高可达股票资产的100%；2）对于行业利润增长速度高、甚至加速增长，但估值水平高的B区行业，配置比例较高，但最高不超过股票资产的60%；3）对于行业利润增长速度低，但增长速度呈现加速迹象，并且估值水平低的C区行业，配置比例较高，但最高不超过股票资产的40%；4）对于行业利润增长速度低、甚至负增长，并且估值水平高的D区行业，原则上不予配置，只重点关注个股。

另外本基金将通过以下两个层面控制行业轮动判断失误带来的投资风险：1）本基金将定期对行业轮动规律进行分析和识别，降低行业轮动判断失误带来的投资风险。具体做法是：每个季度，本基金将重新评估行业利润增长趋势和行业估值水平，并对行业类型进行重新分类和调整。基金经理据此对各行业的配置比例进行适当调整，从而降低行业波动风险。如果在宏观经济环境、行业基本面、或市场指数发生重大变化情况下，本基金对行业类型划分可进行临时调整。2）本基金通过对行业资产配置比例的限制，避免行业过度集中带来投资风险，降低行业轮动判断失误带来的投资风险。具体原则是：本基金持有一个行业的总资产不超过基金资产净值的30%，或者不超过该行业流通市值占A股流通市值的2倍。

2、选股策略

本基金，首先从公司利润增长和股票估值水平两个维度，精选出持续增长，并且具有估值优势的股票作为初选股票池。在此基础上，本基金根据东吴企业竞争优势评价体系，选出具有竞争优势的股票作为本基金的股票池。本基金股票投资组合具体构建程序如下：

1）根据东吴企业成长、估值优势识别模型构建初选股票池

东吴企业成长、估值优势识别模型是基于上市公司利润增长和股票动态估值水平两个维度构建的。具体做法是：采用数学中几何矢量图的方法，将股票估值指标和公司利润增长率分别作为几何矢量图的横坐标和纵坐标，并以A股整体估值水平和A股整体利润增长率作为基准，同时结合国际估值的比较，将所有股票分成四类：

- **A** 类股票：利润增长速度高、甚至加速增长，并且估值水平低；
- B 类股票：利润增长速度高、甚至加速增长，但估值水平高；
- C 类股票：利润增长速度低、甚至负增长，但估值水平低；
- D 类股票：利润增长速度低、甚至负增长，并且估值水平高。

本基金选择A类股票，B类股票，以及C类股票中利润增长速度为正，或者利润增长速度虽为负，但呈现加速增长的股票作为本基金的初选股票池。对于D类股票，将被剔除本基金股票池，除了具有明确重组方案的以外。

2）根据东吴企业竞争优势评价体系构建基金股票池

本基金根据波特的五种竞争力模型和价值链分析内容、以及企业能力理论和企业资源理论等，构建出独特的东吴企业竞争优势评价体系，来综合评价上市公司的竞争优势和未来成长能力。东吴企业竞争优势评价体系包括五方面内容：战略管理优势、技术优势、市场优势、管理运营优势、资源及其它附加优势。每个方面又有细分指标，具体见表1。

表 1 东吴企业竞争优势评价体系

竞争优势维度	具体内容	
战略管理优势	公司治理结构	控股股东与上市公司关系（上市公司经营上独立性与控股股东的自律性）
		董事会、监事会的职能及运作效率
	战略决策	企业家精神以及核心管理层团队合作能力
		企业对外部环境的认识程度（对行业竞争动态、行业技术的未来发展认识的明确程度；对新事业领域的关注程度）
		战略规划、实施、调整能力
		企业文化
	组织设计	组织结构及创新能力
		管理制度（内控制度完善程度）
		人员结构和薪酬制度（激励机制的有效性）

技术优势	技术来源的自主性（自有知识产权，还是引进）
	技术领先；技术壁垒
	创新能力（新产品开发费用占销售收入比重；技术开发效率）
市场优势	商誉（拥有世界品牌、中国驰名商标、较高行业知名度）
	营销渠道及网络
	市场地位（国内或某地区的行业领导者、提供独特细分市场产品、行业垄断者或竞争寡头；国内、国际市场份额）
管理运营优势	企业年度经营计划实施能力
	财务管理能力（应收帐款周转率、存货周转率）
	成本控制能力（营业费用、管理费用、财务费用、毛利率与利润率比较分析）
资源及其他附加优势	拥有稀缺、垄断的生产要素资源和社会资源；兼并重组；股东及政府政策扶持；独特盈利模式；企业一体化程度等

资料来源：东吴基金

评分准则：1）五大优势评分主要依据各大竞争优势具体内容进行。2）战略管理优势、技术优势、市场优势、以及管理运营优势四大优势评分采用四分法：很好（21~25）；较好（14~20）；一般（7~13）；较差（0~6）。考虑附加优势对企业竞争优势有正有负影响，评分采用三分法：很好（6~10）；较好（1~5）；差（-10~0）。3）根据行业分析师评分结果，统计计算出上市公司竞争优势综合评分值=战略管理优势+技术优势+市场优势+管理运营优势+附加优势，作为上市公司竞争优势的评价。

在初选股票池基础上，本基金根据上市公司竞争优势综合分值，分行业选出竞争优势综合分值最大的前50%作为本基金股票池。

3）本基金股票池的构建

根据东吴企业成长、估值优势识别模型和东吴企业竞争优势评价体系，精选出具有成长优势、估值优势、并具备竞争优势的股票作为本基金股票池。

本基金股票池具体构建流程见图1。

东吴企业竞争优势评价体系

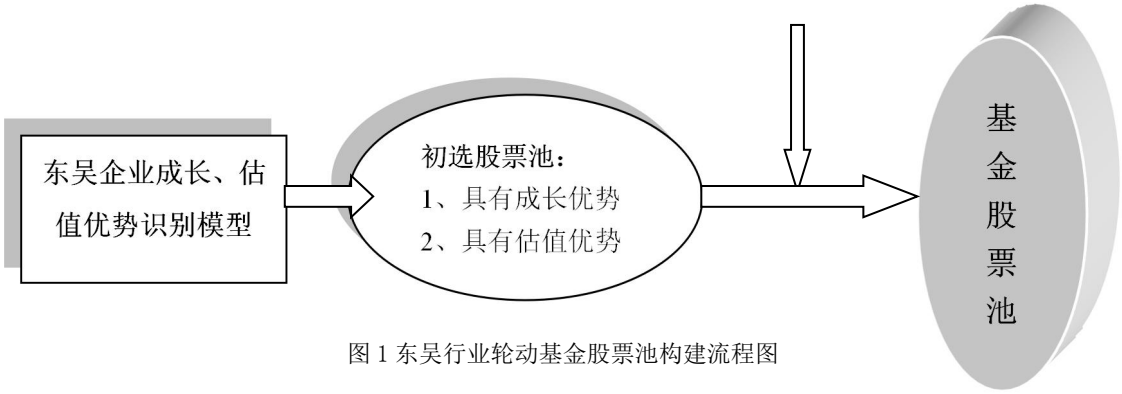


图 1 东吴行业轮动基金股票池构建流程图

资料来源：东吴基金

3、债券投资策略

本基金采取积极的债券投资管理策略。制定具体投资策略自上而下考虑的因素是：基础利率、债券收益率曲线、市场波动、个券的相对价值和套利可能性。与之相对应，本基金分别采取利率预期策略、骑乘收益率策略、相机抉择策略、相对价值策略和套利交易策略。结合投资策略的制定构造债券组合，分别在子弹式组合、梯式组合和杠铃式组合当中进行选择。在债券品种选择上，本基金遵循相对价值原则和流动性原则。现券的相对价值原则指选择到期收益率处于收益率曲线上方的个券，在到期收益率接近的券种之间，选择久期较短者，在久期接近的券种之间，选择凸性较大者；本基金在品种选择上优先考虑流动性高的个券。

4、权证投资策略

本基金权证投资将以价值分析为基础，在采用数量化模型分析其合理定价的基础上，把握市场的短期波动，进行积极操作，追求在风险可控的前提下实现稳健的超额收益。具体投资方法如下：

1）考量标的股票合理价值、标的股票价格、行权价格、行权时间、行权方式、股价历史与预期波动率和无风险收益率等要素，估计权证合理价值；

2）根据权证合理价值与其市场价格间的差幅以及权证合理价值对定价参数的敏感性，结合标的股票合理价值考量，决策买入、持有或沽出权证。

（五）比较基准

75%*沪深300指数+25%*中证全债指数。

该基金原业绩比较基准“中信标普全债指数”自2015年9月28日变更为“中证全债指数”。更改业绩比较基准的原因是中信标普全债指数停止发布，且更改为中证全债指数的原因是中证全债指数的编制方案以及风险收益情况与中信标普全债指数较相近。

如果指数编制单位停止计算编制该指数或更改指数名称、或有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，经与基金托管人协商一致，基金管理人履行相关的程序后，可变更业绩比较基准并及时公告。

（六）风险收益特征

本基金是一只进行主动投资的混合型基金，其风险和预期收益均高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金，在证券投资基金中属于风险较高、预期收益较高的基金产品。前款有关风险收益特征的表述是基于投资范围、投资比例、证券市场普遍规律等做出的概述性描述，代表了一般市场情况下本基金的长期风险收益特征。销售机构(包括基金管理人直销机构和其他销售机构)根据相关法律法规对本基金进行风险评价，不同销售机构采用的评价方法也不同，因此销售机构的风险等级评价与基金法律文件中风险收益特征的表述可能存在不同。本基金的风险等级可能有相应变化，具体风险评级结果应以销售机构的评级结果为准。

（七）投资决策流程

本基金具有严密科学的投资决策流程和明确的分级授权体系，具体如下：

1、投资决策委员会：决策基金总体战略、资产配置、审议股票池、对基金经理提出的仓位与组合预案进行审议与决策，就风险事项与风险管理委员会沟通；

2、基金经理：参与构建股票池、提出资产配置方案、实施具体投资计划。基金经理必须严格按照《投资管理流程》进行操作，资产配置方案经投资决策委员会审议通过后，以《资产配置方案决议》的形式形成书面结果，作为基金经理投资操作的依据，同时给分管领导、投资管理部总经理及风险控制部门备案，以便监控；

3、集中交易室：执行基金经理的交易指令、反馈交易指令的执行情况、监督交易指令的合规合法性；

4、研究平台：构建股票池、为投资决策委员会提供投资决策咨询支持、为基金经理投资提供支持；

5、金融工程小组：通过对投资组合的跟踪与评估，为投资决策委员会和基金经理提供投资实际效果的反馈意见，以优化改进投资决策；

6、风险控制部门：由风险管理委员会、合规风控部等构成。合规风控部对投资决策及实际投资进行稽查并定期和不定期向风险管理委员会提供相关报告，定期评估投资组合风险与收益水平并向风险管理委员会提供投资组合风险评估报告。风险管理委员会就风险事项和风险评估报告进行审议并与投资决策委员会沟通，以监控投资决策流程和各级决策权限的行

使是否合法合规及科学合理。

（八）投资限制

基金管理人将依据有关法律法规及《基金合同》规定，运作管理本基金。

1、本基金投资组合将遵循以下限制：

（1）本基金参与股票发行申购所申报的金额不得超过本基金的总资产，所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次的股票发售总量；

（2）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%；

（3）本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券总和，不得超过该证券的10%，并按有关规定履行信息披露义务；

（4）本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的千分之五；本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的百分之三；本公司管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的百分之十；因在股权分置改革中被动获得权证、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权证投资比例不符合上述比例限制，基金管理人将在十个交易日内进行调整并使之符合比例；

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

（6）不得违反基金合同关于投资范围、投资策略和投资比例的约定；

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

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

（9）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；

（10）遵守中国证监会规定的其他比例限制；

（11）除上述第（5）、（8）、（9）项之外，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比例不符合上述比例，基金管理人应当在十个交易日内进行调整并使之比例符合上述规定。法律法规另有规定时，从其规定。

2、禁止用本基金资产从事以下行为：

（1）承销证券；

（2）向他人贷款或提供担保、抵押；

（3）从事承担无限责任的投资；

（4）从事房地产等实业投资；

（5）买卖其它基金份额，但是国务院另行规定的除外；

（6）向基金管理人、基金托管人出资或买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或债券；

（7）买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或与基金管理人、基金托管人有重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券；

（8）从事内幕交易、操作证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

（9）当时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定的其他禁止行为。

（九）侧袋机制的实施和投资运作安排

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

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

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

（十）基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则和方法

1、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营；

2、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；

3、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利，保护基金份额持有人的利益；

4、有利于基金资产的安全与增值。

（十一）基金投资组合报告

东吴行业轮动混合型开放式证券投资基金(以下简称“本基金”)基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、

准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人华夏银行股份有限公司根据基金合同规定，于2021年7月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至2021年6月30日（未经审计）。

1、 报告期末基金资产组合情况：

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	297,061,282.68	87.02
	其中：股票	297,061,282.68	87.02
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	20,295,600.00	5.95
	其中：债券	20,295,600.00	5.95
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	23,046,508.78	6.75
8	其他资产	985,174.15	0.29
9	合计	341,388,565.61	100.00

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	11,290.28	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	217,092,542.75	67.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
E	建筑业	11,014.44	0.00

F	批发和零售业	95,577.58	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	30,477.64	0.01
J	金融业	34,721.10	0.01
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	40,887,980.87	12.68
N	水利、环境和公共设施管理业	78,934.33	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	38,805,723.30	12.03
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	297,061,282.68	92.10

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股票。

3、期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

3.1 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	300750	宁德时代	59,201	31,660,694.80	9.82
2	300015	爱尔眼科	272,085	19,312,593.30	5.99
3	300776	帝尔激光	116,800	17,445,248.00	5.41
4	300327	中颖电子	189,100	16,116,993.00	5.00
5	603259	药明康德	99,020	15,505,541.80	4.81
6	002049	紫光国微	86,400	13,322,016.00	4.13

7	300347	泰格医药	68,100	13,163,730.00	4.08
8	300390	天华超净	268,900	12,915,267.00	4.00
9	002241	歌尔股份	287,500	12,287,750.00	3.81
10	300957	贝泰妮	40,230	10,925,886.21	3.39

3.2 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的全国中小企业股份转让系统挂牌股票投资明细

本基金本报告期末未持有全国中小企业股份转让系统挂牌股票。

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	5,016,000.00	1.56
2	央行票据	-	-
3	金融债券	15,031,500.00	4.66
	其中：政策性金融债	15,031,500.00	4.66
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	248,100.00	0.08
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	20,295,600.00	6.29

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	200314	20 进出 14	150,000	15,031,500.00	4.66
2	019640	20 国债 10	50,160	5,016,000.00	1.56
3	127038	国微转债	1,641	164,100.00	0.05
4	113050	南银转债	840	84,000.00	0.03

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

9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期未投资股指期货。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期未投资国债期货。

10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期未投资国债期货。

11、投资组合报告附注

11.1本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

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

11.2基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

11.3其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	516,533.31
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	376,427.37
5	应收申购款	92,213.47
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	985,174.15

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。

11.6投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

十一、基金的业绩

本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利，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,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

（一）东吴行业轮动基金历史时间段净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较

东吴行业轮动混合 A

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
2008.04.23-2008.12.31	-26.56%	1.63%	-31.79%	2.31%	5.23%	-0.68%
2009.01.01-2009.12.31	42.10%	1.71%	72.60%	1.54%	-30.50%	0.17%
2010.01.01-2010.12.31	19.05%	1.71%	-8.88%	1.19%	27.93%	0.52%
2011.01.01-2011.12.31	-37.26%	1.66%	-17.81%	0.98%	-19.45%	0.68%
2012.01.01-2012.12.31	-2.86%	1.90%	6.67%	0.96%	-9.53%	0.94%
2013.01.01-2013.12.31	-26.13%	1.70%	-5.29%	1.05%	-20.84%	0.65%
2014.01.01-2014.12.31	23.88%	1.21%	41.10%	0.92%	-17.22%	0.29%
2015.01.01-2015.12.31	32.94%	3.29%	6.10%	1.87%	26.84%	1.42%
2016.01.01-2016.12.31	-9.50%	2.18%	-7.96%	1.05%	-1.54%	1.13%
2017.01.01-2017.12.31	0.15%	1.21%	16.25%	0.48%	-16.10%	0.73%
2018.01.01-2018.12.31	-41.71%	1.92%	-16.77%	1.00%	-24.94%	0.92%
2019.01.01-2019.12.31	55.09%	1.33%	28.29%	0.93%	26.80%	0.40%
2020.01.01-2020.12.31	73.33%	1.77%	21.17%	1.07%	52.16%	0.70%
2021.01.01-2021.06.30	6.07%	1.64%	0.76%	0.99%	5.31%	0.65%
2008.04.23-2021.06.30	38.76%	1.86%	64.52%	1.22%	-25.76%	0.64%

东吴行业轮动混合 C

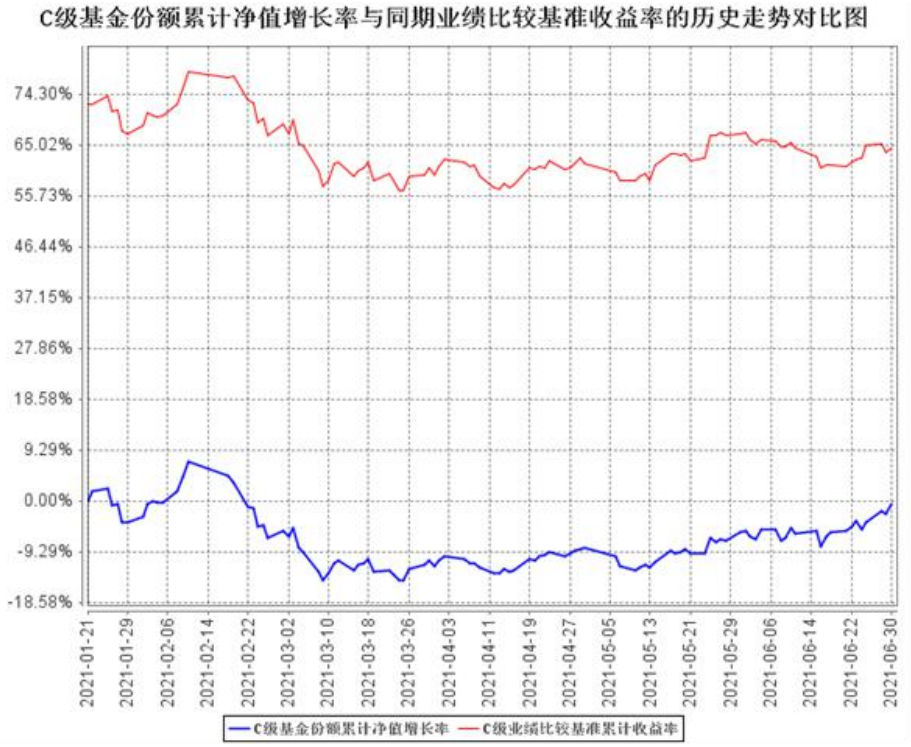
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
2021.01.21-2021.06.30	-0.46%	1.55%	-2.98%	0.98%	2.52%	0.57%

注：1、比较基准=75%*沪深 300 指数+25%*中证全债指数

2、本基金于 2021 年 1 月 21 日开始分为 A、C 两类。

（二）东吴行业轮动基金累计净值增长率历史走势图：

自基金合同生效以来基金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



注：1、比较基准=75%*沪深 300 指数+25%*中证全债指数

2、本基金于 2021 年 1 月 21 日开始分为 A、C 两类，C 类基金份额的同期业绩比较基准收益率与 A 类基金份额保持一致。

十二、基金财产

（一）基金资产总值

基金资产总值是指基金拥有的各类证券及票据、银行存款本息和基金应收的基金申购款以及其他资产的价值总和。

其构成主要有：

1、银行存款及其应计利息；

2、清算备付金及其应收利息；

3、根据有关规定缴纳的保证金；

4、应收证券交易清算款；

5、应收基金申购款；

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、权证投资及其估值调整；

9、其他投资及其估值调整；

10、其他资产等。

（二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

（三）基金财产的帐户

基金开立专用银行存款账户和证券账户，与基金管理人、基金托管人、基金代销机构、注册登记机构自有资产账户以及其他基金的资产账户相独立。基金专用账户须报中国证监会备案。

（四）基金财产的保管和处分

本基金财产独立于基金管理人、基金托管人和基金代销机构的固有财产，并由基金托管人保管，基金管理人、基金托管人不得将基金财产归入其固有财产。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，归入基金财产。

基金管理人、基金托管人和基金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、扣押或其它权利。基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。除依据《基金法》《运作办法》《基金合同》及其它有关规定承担基金财产本身债务之外，基金财产不得被强制执行。

十三、基金资产估值

（一）估值目的

基金资产估值的目的是客观、准确地反映基金资产是否保值、增值，依据经基金资产估值后确定的基金资产净值而计算出的各类基金份额净值，是计算基金申购与赎回价格的基础。

（二）估值日

本基金的估值日为相关的证券交易场所的正常营业日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非营业日。

（三）估值方法

本基金按以下方式进行估值：

1、证券交易所上市的有价证券的估值

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

（2）交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

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

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

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

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

（3）首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的市价（收盘价）估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3、因持有股票而享有的配股权，从配股除权日起到配股确认日止，如果收盘价高于配股价，按收盘价高于配股价的差额估值。收盘价等于或低于配股价，则估值为零。

4、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

5、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

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

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

根据《基金法》，基金管理人计算并公告基金资产净值，基金托管人复核、审查基金管理人计算的基金资产净值。因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。

（四）估值对象

基金所拥有的股票、债券、权证和银行存款本息等资产和负债。

（五）估值程序

基金日常估值由基金管理人进行。基金管理人完成估值后，将估值结果加盖业务公章以书面形式加密传真至基金托管人，基金托管人按法律法规、《基金合同》规定的估值方法、时间、程序进行复核，复核无误后在基金管理人传真的书面估值结果上加盖业务公章返回给基金管理人；月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

（六）估值差错的确认与处理

各类基金份额净值的计算保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入。当估值或份额净值计价错误实际发生时，基金管理人应当立即纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。当错误达到或超过该类基金份额净值的 0.25%时，基金管理人应报中国证监会备案；当估值错误偏差达到该类基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告，并报中国证监会备案。因基金估值错误给投资者造成损失的，应先由基金管理人承担，基金管理人对不应由

其承担的责任，有权向过错人追偿。

关于差错处理，本合同的当事人按照以下约定处理：

1、差错类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或注册登记机构、或代理销售机构、或投资者自身的过错造成差错，导致其他当事人遭受损失的，过错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”给予赔偿承担赔偿责任。

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水平无法预见、无法避免、无法抗拒，则属不可抗力，按照下述规定执行。

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

2、差错处理原则

（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，则其应当承担相应赔偿责任。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（“受损方”），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）差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人过错造成基金资产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人过错造成基金资产损失时，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

资产的损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错方追偿；

（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、《基金合同》或其他规定，基金管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔责任，则基金管理人有权向出现过错的当事人进行追索，并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失；

（7）按法律法规规定的其他原则处理差错。

3、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的交易数据的，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对某类基金份额净值计算错误偏差达到该类基金份额净值的0.25%时，基金管理人应当报告中国证监会；基金管理人及基金托管人对某类基金份额净值计算错误偏差达到该类基金份额净值的0.5%时，基金管理人应当公告并报中国证监会备案。

（七）暂停估值的情形及处理

1、与本基金投资有关的证券交易场所遇法定节假日或因其它原因暂停营业时；

2、因不可抗力或其它情形致使基金管理人无法准确评估基金资产价值时；

3、当特定资产占前一估值日基金资产净值50%以上的，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停估值；

4、中国证监会和《基金合同》认定的其他情形。

（八）特殊情形的处理

1、基金管理人按估值方法的第6项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理；

2、由于证券交易所及其登记结算公司发送的数据错误，或由于其它不可抗力原因，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、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。

（九）实施侧袋机制期间的基金资产估值

本基金实施侧袋机制的，应根据本章节的约定对主袋账户资产进行估值并披露主袋账户的基金净值信息，暂停披露侧袋账户的基金净值信息。

十四、基金的收益分配

（一）基金收益的构成

基金收益包括：基金投资所得红利、股息、债券利息、票据投资收益、买卖证券差价、银行存款利息以及其他收入。因运用基金资产带来的成本或费用的节约计入收益。

（二）基金净收益

基金净收益为基金收益扣除按国家有关规定可以在基金收益中扣除的费用后的余额。

（三）基金收益分配原则

1、由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

2、投资者可以选择现金分红方式或红利再投资分红方式,以投资者在分红权益登记日前的最后一次选择的方式为准，投资者选择分红的默认方式为现金分红；

3、基金投资当期出现亏损,则不进行收益分配；

4、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；

5、基金当期收益应先弥补前期亏损后,才可进行当期收益分配；

6、在符合有关基金分红条件的前提下,基金收益每年至多分配 12 次,至少分配 1 次，但若成立不满 3 个月则可不进行收益分配；

7、全年合计的基金收益分配比例不得低于本基金年度已实现净收益的 50%；

8、法律、法规或监管机关另有规定的，从其规定。

（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，并由基金托管人核实后确定，在 2 日内公告，请投资者留意本基金指定的信息披露媒体。

（五）基金收益分配中发生的费用

1、收益分配采用红利再投资方式的免收再投资的费用；

2、收益分配时发生的银行转账等手续费用由基金份额持有人自行承担。

（六）实施侧袋机制期间的收益分配

本基金实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配。

十五、基金费用与税收

（一）基金运作相关费用

1、管理费；

基金管理费以基金资产净值的 1.5％年费率计提。

在通常情况下，基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.5％年费率计提。

计算方法如下：

H＝E×年管理费率÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给本基金管理人。

若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

2、托管费；

基金托管费按基金资产净值的 0.25%年费率计提。

在通常情况下，基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25%年费率计提。

计算方法如下：

H＝E×年托管费率÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金资产中一次性支付给本基金托管人。

若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

3、C 类基金份额的销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值的 0.40%年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

H＝E×0.40%÷当年天数

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前两个工作日内从基金财产中一

次性支付给基金管理人，由基金管理人代付给销售机构。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

4、投资交易费用；

5、银行划汇费用；

6、基金信息披露费用；

7、基金份额持有人大会费用；

8、基金合同生效后与基金相关的会计师费和律师费；

9、按照国家有关规定的其他费用。

上述第 4 项至第 9 项费用由本基金管理人向基金托管人发出划款指令后，基金托管人按费用实际支出金额从基金财产中支付，列入当期基金费用。

（二）基金销售相关费用

本基金申购费、赎回费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式请详见本招募说明书“八、基金份额的申购与赎回”中的“（六）申购费与赎回费”与“（七）申购份数与赎回金额的计算方式”中的相关规定。

本基金转换费率由基金管理人届时另行规定。

（三）实施侧袋机制期间的基金费用

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

（四）基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十六、基金的会计与审计

（一）基金会计政策

1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；

2、基金的会计年度为公历年度的 1 月 1 日至 12 月 31 日；本基金首次募集的会计年度按如下原则：如果基金合同生效少于 3 个月，可以并入下一个会计年度；

3、基金核算以人民币为记账本位币,以人民币元为记账单位；

4、会计制度执行国家有关会计制度；

5、本基金独立建账、独立核算；

6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算,按照有关规定编制基金会计报表；

7、本基金托管人与本基金管理人就本基金的基金资产净值、各类基金份额净值、报表等进行核对并确认。

（二）基金审计

1、本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本基金的年度财务报表进行审计。

2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人和基金托管人同意，并报中国证监会备案。

3、基金管理人（或基金托管人）认为有充足理由更换会计师事务所，须经基金托管人（或基金管理人）同意，更换会计师事务所在 2 日内公告。

十七、基金的信息披露

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

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

本基金信息披露义务人包括基金管理人、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应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的全国性报刊（以下简称“指定报刊”）及指定互联网网站（以下简称“指定网站”）等媒介披露，并保证基金投资者能够按照本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公开披露的基金信息，不得有下列行为：

1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；

2、对证券投资业绩进行预测；

3、违规承诺收益或者承担损失；

4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构；

5、登载任何自然人、法人和非法人组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；

6、中国证监会禁止的其他行为。

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。

一、公开披露的基金信息

1、基金招募说明书、基金合同、基金托管协议、基金产品资料概要

本基金募集申请经中国证监会核准后，基金管理人在基金份额发售的3 日前，将基金招募说明书、基金合同摘要登载在指定报刊和网站上；基金管理人、基金托管人应当将基金合同、基金托管协议登载在网站上。

（1）基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容；

本基金合同生效后，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。

（2）基金合同是界定基金合同当事人的各项权利、义务关系，明确基金份额持有人大会召开的规则及具体程序，说明基金产品的特性等涉及基金投资者重大利益的事项的法律文件；

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

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

2、基金份额发售公告

基金管理人就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于指定报刊和网站上。

3、基金募集情况

4、基金合同生效公告

基金管理人在本基金合同生效的次日在指定报刊和网站上登载基金合同生效公告。

5、基金份额上市交易公告书

基金份额获准在证券交易所上市交易的，基金管理人应当在基金份额上市交易的三个工作日前，将基金份额上市交易公告书登载在指定网站上，并将上市交易公告书提示性公告登载在指定报刊上。

6、基金净值信息

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

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过指定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日的各类基金份额净值和各类基金份额累计净值；

基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在指定网站披露半年度和年度

最后一日的各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。

7、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。

8、基金定期报告

包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告。

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

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

基金管理人应当在季度结束之日起15个工作日内，编制完成基金季度报告，将季度报告登载在指定网站上，并将季度报告提示性公告登载在指定报刊上；

如基金合同生效不足两个月，本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；

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，为保障其他投资者利益，基金管理人至少应当在定期报告“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。

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

9、临时报告

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在两日内编制临时报告书，并登载在指定报刊和指定网站上；

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

（1）基金份额持有人大会的召开及决定的事项；

（2）基金合同终止、基金清算；

（3）转换基金运作方式、基金合并；

（4）更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；

（5）基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；

（6）基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；

（7）基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人的实际控制人变更；

（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，但中国证监会另有规定的除外；

（14）基金收益分配事项；

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

（16）某一类基金份额净值计价错误达该类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）发生涉及本基金申购、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。

10、澄清公告

在本基金合同存续期限内，任何公共媒介中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金

份额价格产生误导性影响或者引起较大波动，以及可能损害基金份额持有人权益的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会、基金上市交易的证券交易所。

11、基金份额持有人大会决议

12、清算报告

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

13、实施侧袋机制期间的信息披露

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

14、中国证监会规定的其他信息

二、信息披露事务管理

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

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

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和本基金合同的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、各类基金份额净值、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。

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。

上市交易公告书公布后，应当分别置备于基金管理人的住所和基金上市交易的证券交易所，供公众查阅、复制；

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。

十八、侧袋机制

（一）侧袋机制的实施条件、实施程序

当基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，根据最大限度保护基金份额持有人利益的原则，基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制，无需召开基金份额持有人大会。基金管理人应当在启用侧袋机制当日报中国证监会及公司所在地中国证监会派出机构备案。

基金管理人应当在启用侧袋机制后及时发布临时公告，并及时聘请符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所进行审计并披露专项审计意见。

（二）实施侧袋机制期间基金份额的申购与赎回

1、启用侧袋机制当日，基金登记机构以基金份额持有人的原有账户份额为基础，确认相应侧袋账户基金份额持有人名册和份额；当日收到的申购申请，按照启用侧袋机制后的主袋账户份额办理；当日收到的赎回申请，仅办理主袋账户的赎回申请并支付赎回款项；

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

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

4、申购赎回的具体事项安排详见基金管理人届时的相关公告。

（三）实施侧袋机制期间的基金投资

侧袋机制实施期间，招募说明书“基金的投资”章节约定的投资组合比例、投资策略、组合限制、业绩比较基准、风险收益特征等约定仅适用于主袋账户。基金管理人计算各项投资运作指标和基金业绩指标时应当以主袋账户资产为基准。

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

基金管理人不得在侧袋账户中进行除特定资产处置变现以外的其他投资操作。

（四）实施侧袋机制期间的基金估值

本基金实施侧袋机制的，基金管理人和基金托管人应对主袋账户资产进行估值并披露主袋账户的基金净值信息，暂停披露侧袋账户份额净值。侧袋账户的会计核算应符合《企业会计准则》的相关要求。

（五）实施侧袋账户期间的基金费用

1、本基金实施侧袋机制的，主袋账户的管理费、托管费按主袋账户基金资产净值作为基数计提。

2、与侧袋账户有关的费用可从侧袋账户中列支，但应待侧袋账户资产变现后方可列支，有关费用可酌情收取或减免，但不得收取管理费。因启用侧袋机制产生的咨询、审计费用等由基金管理人承担。

（六）侧袋账户中特定资产的处置变现和支付

特定资产以可出售、可转让、恢复交易等方式恢复流动性后，基金管理人应当按照基金份额持有人利益最大化原则，采取将特定资产予以处置变现等方式，及时向侧袋账户份额持有人支付对应变现款项。

侧袋机制实施期间，无论侧袋账户资产是否全部完成变现，基金管理人都应当及时向侧袋账户全部份额持有人支付已变现部分对应的款项。若侧袋账户资产无法一次性完成处置变现，基金管理人在每次处置变现后均应按照相关法律法规要求及时发布临时公告。

侧袋账户资产全部完成变现并终止侧袋机制后，基金管理人应及时聘请符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所进行审计并披露专项审计意见。

（七）侧袋机制的信息披露

1、临时公告

在启用侧袋机制、处置特定资产、终止侧袋机制以及发生其他可能对投资者利益产生重大影响的事项后基金管理人应及时发布临时公告。

2、基金净值信息

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

3、定期报告

侧袋机制实施期间，基金管理人应当在基金定期报告中披露报告期内侧袋账户及特定资产的相关信息，基金定期报告中的基金会计报表仅需针对主袋账户进行编制。侧袋账户相关信息在定期报告中单独进行披露，包括但不限于：

（1）侧袋账户的基金代码、基金名称、侧袋账户成立日期等基本信息；

（2）侧袋账户的初始资产、初始负债；

（3）特定资产的名称、代码、发行人等基本信息；

（4）报告期内的特定资产处置进展情况、与处置特定资产相关的费用情况及其他与特定资产状况相关的信息；

（5）可根据特定资产处置进展情况披露特定资产的可变现净值或净值参考区间，该净值或净值区间并不代表特定资产最终的变现价格，不作为基金管理人对特定资产最终变现价格的承诺；

（6）可能对投资者利益存在重大影响的其他情况及相关风险提示。

（八）本部分关于侧袋机制的相关规定，凡是直接引用法律法规或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人经与基金托管人协商一致并履行适当程序后，在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

十九、基金的风险揭示

（一）市场风险

金融市场价格受经济因素、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，产生风险，主要包括：

1、政策风险

货币政策、财政政策、产业政策和证券市场监管政策等国家政策的变化对证券市场产生一定的影响，可能导致市场价格波动，从而影响基金收益。

2、利率风险

金融市场利率波动会导致股票市场及利息收益的价格和收益率的变动，同时直接影响企业的融资成本和利润水平。基金投资于股票和债券，收益水平会受到利率变化的影响。

3、信用风险

指基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，或者上市公司信息披露不真实、不完整，都可能导致基金资产损失和收益变化。

4、通货膨胀风险

由于通货膨胀率提高，基金的实际投资价值会因此降低。

5、再投资风险

再投资风险反映了利率下降对固定收益证券和回购等利息收入再投资收益的影响。当利率下降时，基金从投资的固定收益证券和回购所得的利息收入进行再投资时，将获得比以前少的收益率。

6、法律风险

由于法律法规方面的原因，某些市场行为受到限制或合同不能正常执行，导致了基金资产损失的风险。

（二）管理风险

在基金管理运作过程中基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的占有和对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平。因此，本基金可能因为基金管理人和基金托管人的管理水平、管理手段和管理技术等因素影响基金收益水平。

（三）流动性风险

本基金属于开放式基金，基金份额可以在基金合同约定的时间和场所进行申购和赎回，因此会面临一定的流动性风险。所谓流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。在基金交易过程中，可能会发生巨额赎回的情形，从

而导致基金仓位调整的困难，引发流动性风险，甚至影响各类基金份额净值。

1、本基金拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

（1）拟投资市场的流动性风险：本基金拟投资于国内依法发行上市的股票、债券、权证、以及法律法规或经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。上述资产均存在规范的交易场所，运作时间长，市场透明度较高，运作方式规范，历史流动性状况良好，正常情况下能够及时满足基金变现需求，保证基金按时应对赎回要求。极端市场情况下，上述资产可能出现流动性不足，导致基金资产无法变现，从而影响投资者按时收到赎回款项。根据过往经验统计，绝大部分时间上述资产流动性充裕，流动性风险可控，当遇到极端市场情况时，基金管理人会按照基金合同及相关法律法规要求，及时启动流动性风险应对措施，保护基金投资者的合法权益；

（2）拟投资行业的流动性风险：股票投资方面，本基金将在考虑行业生命周期、景气程度、估值水平以及股票市场行业轮动规律的基础上决定行业的配置，同时本基金将根据宏观经济和证券市场环境的变化，及时对行业配置进行动态调整。债券投资方面，本基金通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势以及不同类属的收益率水平、流动性和信用风险等因素，以久期控制和结构分布策略为主，以收益率曲线策略、利差策略等为辅，构造能够提供稳定收益的债券和货币市场工具组合。因此本基金在投资运作过程中的行业配置较为灵活，在综合考虑宏观因素及行业基本面的前提下进行配置，不以投资于某单一行业为投资目标，行业分散度较高，受到单一行业流动性风险的影响较小；

（3）投资资产的流动性风险：本基金针对流动性较低资产的投资进行了严格的限制，以降低基金的流动性风险：本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。本基金绝大部分基金资产投资于 7 个工作日可变现资产，包括可在交易所、银行间市场正常交易的股票、债券、非金融企业债务融资工具及同业存单，7 个工作日内到期或可支取的逆回购、银行存款，7 个工作日内能够确认收到的各类应收款项等，上述资产流动性情况良好。

2、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：

（1）当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金申购赎回申请的措施。基金份额持有人存在不能及时赎回基金份额的风险；

（2）若本基金发生了巨额赎回，基金管理人有可能采取延缓支付赎回款项的措施以应

对巨额赎回，具体措施请见基金合同及招募说明书中“基金份额的申购与赎回”部分“巨额赎回的处理方式”。因此在巨额赎回情形发生时，基金份额持有人存在不能及时赎回基金份额的风险；

（3）本基金基金份额，对持续持有期少于 7 日的投资人，收取 1.5%的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产。赎回费在投资者赎回基金份额时收取；

（4）当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停估值。投资者可能面临所查询到的净值不能及时、准确地反映基金投资的市场价值的风险。

3、实施侧袋机制对投资者的影响

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

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

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

启用侧袋机制后，基金管理人计算各项投资运作指标和基金业绩指标时仅需考虑主袋账户资产，并根据相关规定对分割侧袋账户资产导致的基金净资产减少进行按投资损失处理，因此本基金披露的业绩指标不能反映特定资产的真实价值及变化情况。

具体措施详见招募说明书“侧袋机制”章节的相关内容。

（四）策略风险

本基金存在投资策略风险，即本基金的业绩表现不一定领先于市场平均水平。另外，在精选个股的实际操作过程中，基金管理人可能限于知识、技术、经验等因素而影响其对相关信息、经济形势和证券价格走势的判断，其精选出的个股的业绩表现不一定持续优于其他股票。

（五）其它风险

1、技术风险

计算机、通讯系统、交易网络等技术保障系统或信息网络支持出现异常情况,可能导致基金日常的申购赎回无法按正常时限完成、注册登记系统瘫痪、核算系统无法按正常时限显示产生净值、基金的投资交易指令无法及时传输等风险。

2、战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致基金资产的损失。

3、金融市场危机、行业竞争、代理机构违约、托管行违约等超出基金管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致基金或者基金份额持有人的利益受损。

二十、基金的终止与清算

（一）基金的终止

有下列情形之一的，基金合同应当终止：

1、基金份额持有人大会决定终止的；

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

3、《基金合同》约定的其他情形；

4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

出现上述情况之一后，须依法律法规和本基金合同的规定对基金进行清算，本基金合同于中国证监会对清算结果批准并予以公告后终止。

（二）基金清算

1、基金清算小组成立：自基金终止之日起30个工作日内成立清算小组,基金清算小组在中国证监会的监督下进行基金清算，在基金财产清算小组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

2、基金清算小组组成：基金清算小组成员由基金管理人、基金托管人、律师、具有从事证券相关业务资格的注册会计师以及中国证监会指定的人员组成。基金清算小组可以聘用必要的工作人员。

3、基金清算小组职责：基金清算小组负责基金资产的保管、清理、估价、变现和分配。基金清算小组可以依法以基金的名义进行必要的民事活动。

（三）基金清算程序

1、基金合同终止后，由基金财产清算小组统一接管基金财产；

2、基金财产清算小组对基金财产进行清理和确认；

3、对基金财产进行评估；

4、对基金财产进行变现；

5、将基金清算结果报告中国证监会；

6、公布基金清算公告；

7、进行基金剩余资产的分配。

（四）清算费用

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

（五）基金剩余资产的分配

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。

（六）基金清算的公告

基金终止并报中国证监会备案后 2 个工作日内由基金清算小组公告，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；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金清算结果由基金清算小组经中国证监会批准后 3 个工作日内公告。

（七）清算账册及文件的保存

基金清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

二十一、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

（1）按本《基金合同》的规定取得基金收益；

（2）参与分配清算后的剩余基金财产；

（3）按《基金合同》的规定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）按本《基金合同》的规定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）因基金管理人、基金托管人、销售机构的过错导致基金份额持有人损失的求偿权；

（9）法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

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

2、基金份额持有人的义务

（1）遵守《基金合同》；

（2）缴纳基金认购、申购、赎回款项及法律法规和《基金合同》规定的费用；

（3）在持有基金份额范围内承担基金亏损或者合同终止的有限责任；

（4）不从事任何有损基金及基金份额持有人合法权益的活动；

（5）返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人、基金托管人及基金管理人的代理人处获得的不当得利；

（6）法律法规和《基金合同》规定的其他义务。

3、基金管理人的权利

（1）自基金合同生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金资产；

（2）依照《基金合同》获得基金认购和申购费用、基金赎回手续费以及基金管理费等其他法律法规规定的费用；

（3）销售基金份额；

（4）担任或委托其他符合条件的机构担任基金注册与过户登记人办理基金注册与过户登记业务并获得《基金合同》规定的费用；

（5）依据《基金合同》及有关法律规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其它监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

（6）提议召开基金份额持有人大会；

（7）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

（8）选择、委托、更换基金销售代理人，对基金销售代理人的相关行为进行监督和处理。如认为基金销售代理人违反本《基金合同》、基金销售与服务代理协议及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其它监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

（9）依据本《基金合同》及有关法律规定决定基金收益的分配方案；

（10）在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；

（11）在符合有关法律法规和《基金合同》的前提下，制订和调整开放式基金业务规则，决定和调整基金的除托管费率和调高管理费率、调高销售服务费率之外的相关费率结构和收费方式；

（12）依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使基金所投资的证券项下的权利；

（13）在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；

（14）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；

（15）法律法规和《基金合同》规定的其它权利。

4、基金管理人的义务

（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,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产；

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

（4）配备足够的专业人员办理基金份额的认购、申购与赎回业务或委托符合条件的其它机构代理该项业务；

（5）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符合条件的其它机构代理该项业务；

（6）建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金资产和基金管理人的资产相互独立,保证不同基金在资产运作、财务管理等方面相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；

（7）除依据法律法规和《基金合同》及其它有关规定外,不得以基金资产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金资产；

（8）依法接受基金托管人的监督；

（9）采取适当合理的措施使基金份额认购、申购、赎回的计算方法符合基金合同等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回的价格；

（10）严格按照《基金法》等法律法规和《基金合同》的有关规定，履行信息披露及报告义务；

（11）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告，编制季度报告、中期报告和年度报告；

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

（13）按《基金合同》规定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》的规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

（15）不谋求对上市公司的控股和直接管理；

（16）依据《基金法》等法律法规和《基金合同》的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会计账册、报表、记录和其他相关资料；

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

（19）参加基金资产清算组,参与基金资产的保管、清理、估价、变现和分配；

（20）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；

（21）因违反合同导致基金资产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

（22）基金托管人因违反合同造成基金资产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

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

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

（25）执行生效的基金份额持有人大会的决定；

（26）法律、法规和《基金合同》规定的其它义务。

5、基金托管人的权利

（1）自本基金合同生效之日起，依法律法规和本基金合同的规定安全保管基金资产；

（2）依《基金合同》约定获得基金托管费、其他法定收入和其他法律法规允许或监管部门批准的约定收入；

（3）监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人有违反本基金合同及国家法律法规行为，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

（4）以基金托管人和基金联名的方式在中国证券登记结算有限公司上海分公司和深圳分公司开设证券账户；

（5）以基金托管人名义开立证券交易资金账户，用于证券交易资金结算业务；

（6）以基金的名义在中央国债登记结算有限公司开设银行间债券托管账户负责基金的债券及资金的清算；

（7）提议召开基金份额持有人大会；

（8）在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

（9）法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

6、基金托管人的义务

（1）以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金资产；

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

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

（4）除依据法律法规和《基金合同》的规定外，不得利用基金资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资产；

（5）保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

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

（7）保守基金商业秘密，除法律法规和《基金合同》另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；

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

（9）办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

（10）对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人有未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

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

（12）建立并保存基金份额持有人名册；

（13）按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

（14）依据基金管理人的指令或有关规定，将基金份额持有人的基金赎回和分红款项划往指定账户；

（15）按照规定召集基金份额持有人大会；

（16）按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；

（17）参加基金资产清算组，参与基金资产的保管、清理、估价、变现和分配；

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

（19）因违反合同导致基金资产的损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

（20）基金管理人因违反合同造成基金资产损失时，应为基金份额持有人的利益向基金管理人追偿；

（21）执行生效的基金份额持有人大会的决定；

（22）法律法规和《基金合同》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

基金份额持有人大会由基金份额持有人或基金份额持有人的合法授权代表共同组成。

1、召开事由

当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

（1）终止基金合同；

（2）更换基金管理人；

（3）更换基金托管人；

（4）转换基金运作方式；

（5）变更基金类别；

（6）变更基金投资目标、范围或策略；

（7）变更基金份额持有人大会程序；

（8）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准或提高销售服务费率，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准或提高销售服务费率的除外；

（9）变更《基金合同》(《基金合同》中规定可由基金管理人和基金托管人协商后变更而无需召开基金份额持有人大会的情形除外)；

（10）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。

以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后变更《基金合同》，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）在《基金合同》规定的范围内变更本基金的申购费率、赎回费率、调低销售服务费率或变更收费方式；

（3）因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行变更；

（4）对《基金合同》的变更对基金份额持有人利益无实质性不利影响或变更不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化；

（5）除按照法律法规和《基金合同》规定应当召开基金份额持有人大会的以外的其它情形。

2、会议召集方式

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

（2）基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集；

（3）基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起十日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起六十日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集；

（4）代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起十日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起六十日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10％（含 10％）以上的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起十日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起六十日内召开；

（5）如在上述第（4）条情况下，基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前三十日报中国证监会备案；

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

3、通知

召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 30 天，在中国证监会指定的至少一种全国性信息披露报刊上公告通知。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

（1）会议召开的时间、地点、方式；

（2）会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；

（3）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；

（4）代理投票授权委托书送达时间和地点；

（5）会务常设联系人姓名及联系电话。

采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定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、书面表决意见的寄交的截止时间和收取方式。

4、会议的召开方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式或通讯开会方式召开。

会议的召开方式由会议召集人确定，但更换基金管理人和基金托管人必须以现场开会方式召开。

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

第一，亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托书符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定；

第二，经核对，汇总到会者出示的在权利登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的 50%（含 50%）。

（2）通讯开会。通讯开会应以书面方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

第一，召集人按《基金合同》规定公布会议通知后，在两个工作日内连续公布相关提示性公告；

第二，召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见；

第三，本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的 50%（含 50%）；

第四，上述第三项中直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托书符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定；

第五，会议通知公布前报中国证监会备案。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者；表面符合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。

5、议事内容与程序

（1）议事内容及提案权

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

基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权利登记日基金总份额 10%（含 10%）以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案；也可以在现场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 20 天提交召集人。

基金份额持有人大会的召集人发出召集现场会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开日 15 天前公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少有 15 天的间隔期。基金份额持有人大会的召集人发出以通讯方式开会的通知后，该次基金份额持有人大会不得增加、减少或修改需由该次基金份额持有人大会审议表决的提案。

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。

召集人对于基金管理人、基金托管人和基金份额持有人提交的临时提案进行审核，符合条件的应当在大会召开日 15 天前公告。大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

第一，关联性。大会召集人对于提案涉及事项与基金有直接关系，并且不超出法律法规和《基金合同》规定的基金份额持有人大会职权范围的，应提交大会审议；对于不符合上述要求的，不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会上进行解释和说明。

第二，程序性。大会召集人可以对提案涉及的程序性问题做出决定。如将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。

单独或合并持有权利登记日基金总份额 10%（含 10%）以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，或基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于六个月。

（2）议事程序

现场开会：

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第 7 条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人所持表决权的 50%以上（含 50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。

通讯开会：

在通讯开会的情况下，公告会议通知时应当同时公布提案，在所通知的表决截止日期后两个工作日内统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

6、表决

除法律法规另有规定或基金合同另有约定外，基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

（1）一般决议，一般决议须经参加大会的基金份额持有人所持表决权的 50%以上（含 50%）通过方为有效；除下列第 2 项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

（2）特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二（含三分之二）以上通过方可做出。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、决定终止基金合同以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

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

7、计票

（1）现场开会

如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。

监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。如果会议主持人或基金份额持有人对于提交的表决结果有怀疑，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

计票过程应由公证机关予以公证。

（2）通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

（3）公证机关对计票过程全程予以公证，并在公告基金份额持有人大会决议时公告公证书全文、公证机关及公证员姓名。

8、生效与公告

基金份额持有人大会决议应当由会议召集人自通过之日起五日内报中国证监会核准或者备案，并自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

除非《基金合同》或法律法规另有规定，生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人和基金托管人均有法律约束力。

基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 日内在至少一种中国证监会指定的信息披露媒介公告。

9、实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定

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

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

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

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

（4）在参与基金份额持有人大会投票的基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日相关基金份额的二分之一、召集人在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内就原定审议事项重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）相关基金份额的持有人参与或授权他人参与基金份额持有人大会投票；

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

（6）一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过；

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

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

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

（三）基金合同的解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

有下列情形之一的，基金合同应当终止：

1、基金份额持有人大会决定终止的；

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

3、《基金合同》约定的其他情形；

4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

基金资产清算：

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

2、基金资产清算组组成：基金资产清算组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师组成。基金资产清算组可以聘用必要的工作人员。

3、基金资产清算组职责：基金资产清算组负责基金资产的保管、清理、估价、变现和分配。基金资产清算组可以依法以自己的名义进行必要的民事活动。

4、基金资产清算程序

(1)基金合同终止后，由基金资产清算组统一接管基金；

(2)对基金资产和债权债务进行清理和确认；

(3)对基金资产进行估值和变现；

(4)制作清算报告；

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

(6)将清算报告报中国证监会备案并公告；

(7)对清算后的剩余基金财产进行分配。

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

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。

基金资产清算报告报中国证监会备案后5个工作日内由基金资产清算组公告，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；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金清算结果由基金资产清算组经中国证监会批准后3个工作日内公告。

（四）争议解决方式

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点在北京，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，仲裁费由败诉方承担。

本《基金合同》受中国法律管辖。

（五）基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

《基金合同》可印制成册，存放在基金管理人和基金托管人的营业场所，投资者可免费查阅；也可按工本费购买《基金合同》印制件或复印件；如涉及争议事项需协商、仲裁或诉讼的，《基金合同》条款及内容应以《基金合同》正本为准。

二十二、基金托管协议的内容摘要

（一）托管协议当事人

1、基金管理人

名称：东吴基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区银城路 117 号 9 楼 901、902 室

法定代表人：邓晖

电话：（021）50509888

传真：（021）50509884

成立时间：2004 年 9 月 2 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证券监督管理委员会证监基金字【2004】132 号

组织形式：有限责任公司（国内合资）

注册资本：1 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、特定客户资产管理、中国证监会许可的其他业务（依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动）

2、基金托管人

名称：华夏银行股份有限公司

住所：北京市东城区建国门内大街 22 号（100005）

办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号（100005）

法定代表人：李民吉

电话：（010）95577

传真：（010）85238680

成立时间：1992 年 10 月 14 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：15,387,223,983 元人民币

批准设立机关和设立文号：中国人民银行[银复（1992）391 号]

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基金字 [2005]25 号

存续期间：持续经营

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；提供保管箱服务；结汇、售汇业务；保险兼业代理业务；经中国银行业监督管理委员会批准的其他业务。

（二）基金托管人对基金管理人的业务监督、核查

1、基金托管人对基金投资范围、投资对象的监督

基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督，对存在疑义的事项进行核查。

本基金将投资于以下金融工具：

具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、各类有价债券、权证及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金主要投资于国内具有成长优势、估值优势和竞争优势的上市公司股票，能够提供固定收益、具有良好流动性的国债、企业债、可转债以及其它固定收益产品。

若法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围；同时，权证等有关投资品种的投资比例，在法律法规和监管机构允许的情况下，也可进一步扩大。

本基金不得投资于相关法律、法规、部门规章及《基金合同》禁止投资的投资工具。

2、基金托管人对基金投融资比例的监督

基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人对基金投融资比例进行监督的内容包括但不限于：基金合同约定的基金投资资产配置比例、单一投资类别比例限制、融资限制、股票申购限制、基金投资比例符合《基金法》及相关法律法规规定、基金合同约定的时间要求、法规允许投资比例调整期限等。

（1）按法律法规的规定及基金合同的约定，本基金的投资资产配置比例为：

股票资产的配置占基金资产的 60%-95%，债券资产的配置占基金资产的 0-35%，权证的配置占基金资产净值的 0-3%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

（2）根据法律法规的规定及基金合同的约定，本基金投资组合遵循以下投资限制：

①持有一家上市公司的股票，其市值不得超过基金资产净值的 10%；

②本基金与由本基金管理人管理、本基金托管人托管的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%；

③本基金投资股权分置改革中产生的权证，在任何交易日买入的总金额，不超过上一交

易日基金资产净值的 0.5%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，本公司管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%。其它权证的投资比例，遵从法规或监管部门的相关规定；

④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百分之十，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百分之二十；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百分之十；本基金管理人管理、本基金托管人托管的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券合计规模的百分之十；

⑤现金和到期日不超过 1 年的政府债券不低于 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

⑥本基金资产参与股票发行申购，所申报的金额不得超过本基金的总资产，所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

⑦本基金管理人管理、本基金托管人托管的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理、本基金托管人托管的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；

⑧本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

⑨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；

⑩本基金不得违反本基金合同关于投资范围、投资策略和投资比例的约定。

《基金法》及其他有关法律法规或监管部门取消上述限制的，履行适当程序后，基金不受上述限制。

（3）法规允许的基金投资比例调整期限

除上述第⑤、⑧、⑨项之外，由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例，不在限制之内，但基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，以达到规定的投资比例限制要求。法律法规另有规定的从其规定。

侧袋机制实施期间，本基金的投资组合比例、投资策略、组合限制、业绩比较基准、风

险收益特征等约定仅适用于主袋账户。

（4）本基金可以按照国家的有关规定进行融资。

（5）相关法律、法规或部门规章规定的其他比例限制。

基金托管人对基金投资的监督和检查自本基金合同生效之日起开始。

3、基金托管人对基金投资禁止行为及关联交易行为的监督

基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对本协议第十五条基金投资禁止行为进行监督。

根据法律法规有关基金禁止从事关联交易的规定，基金管理人和基金托管人应事先以书面方式相互提供与本机构有控股关系的股东、与本机构有其他重大利害关系的公司名单及其更新，加盖公章，并确保所提供的关联交易方名单的真实性、完整性、全面性，并负责及时更新该名单。名单变更后基金管理人或基金托管人应及时发送对方，对方于 2 个工作日内进行回函确认已知名单的变更。如果基金托管人在运作中严格遵循了监督流程，基金管理人仍违规进行关联交易，并造成基金财产损失的，由基金管理人承担责任。

若基金托管人发现基金管理人与上述关联交易名单中列示的关联方进行法律法规禁止基金从事的关联交易时，基金托管人应及时提醒并协助基金管理人采取必要措施阻止该关联交易的发生，若基金托管人采取必要措施后仍无法阻止关联交易发生时，基金托管人有权向中国证监会报告。对于交易所场内已成交的关联交易，基金托管人无法阻止该关联交易的发生，只能进行结算，基金托管人不承担由此造成的损失，同时向中国证监会报告。

4、基金托管人对基金管理人参与银行间债券市场的监督

(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，并按照审慎的风险控制原则在该名单中约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金托管人在收到名单后 2 个工作日内回函确认收到该名单。基金管理人应定期或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，名单中增加或减少银行间市场交易对手时须向基金托管人提出书面申请，基金托管人于 2 个工作日内回函确认收到后，对名单进行更新。基金管理人收到基金托管人书面确认后，被确认调整的名单开始生效，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。

如果基金托管人发现基金管理人与不在名单内的银行间市场交易对手进行交易，应及时提醒基金管理人撤销交易，经提醒后基金管理人仍执行交易并造成基金财产损失的，基金托

管人不承担责任。发生此种情形时，托管人有权报告中国证监会。

(2)基金托管人对于基金管理人参与银行间市场交易的交易方式的控制。基金管理人在银行间市场进行现券买卖和回购交易时，需按交易对手名单中约定的该交易对手所适用的交易结算方式进行交易。如果基金托管人发现基金管理人没有按照事先约定的有利于信用风险控制的交易方式进行交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人与交易对手重新确定交易方式，经提醒后仍未改正时造成基金财产损失的，基金托管人不承担责任。

(3)基金管理人负责对交易对手的资信控制，按银行间债券市场的交易规则进行交易，基金托管人则根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督。发现交易对手存在违约风险时应及时提醒基金管理人。

5、基金托管人对基金管理人选择存款银行进行监督

本基金投资银行存款的信用风险主要包括存款银行的信用等级、存款银行的支付能力等涉及到存款银行选择方面的风险。本基金的存款的核心银行应当是具有证券投资基金托管人资格、证券投资基金代销业务资格或合格境外机构投资者托管人资格的商业银行。本基金投资除核心存款银行以外的银行存款出现由于存款银行信用风险而造成的损失时，先由基金管理人负责赔偿，之后有权要求相关责任人进行赔偿，如果基金托管人在运作过程中遵循上述监督流程，则对于由于存款银行信用风险引起的损失，不承担赔偿责任。基金管理人与基金托管人协商一致后，可以根据当时的市场情况对于核心存款银行名单进行调整。

6、基金托管人根据法律法规的规定及基金合同的约定，对基金资产净值计算、各类基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查。

7、基金托管人对上述事项的监督与核查中发现基金管理人实际投资运作中违反法律法规的规定、基金合同和本托管协议的约定，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到通知后应在下一工作日前及时核对，并以书面形式给基金托管人发出回函，就基金托管人的疑义进行解释或举证。

在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。基金托管人有义务要求基金管理人赔偿因其违反基金合同而致使投资者遭受的损失。

8、基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律法规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，并报告中国证监会。基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律法规或者违反基金合同约定的，应当立即通知基金管理

人，并报告中国证监会。

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

10、基金托管人发现基金管理人有重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

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

（三）基金管理人对基金托管人的业务核查

1、根据《基金法》及相关法律法规的规定和基金合同的约定，基金管理人对基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括但不限于基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和各类基金份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

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

3、基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、基金合同、托管协议及其他有关规定时，基金管理人应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正。基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式向基金管理人发出回函。在限期内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正，并予协助配合。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应报告中国证监会。

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

基金托管人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据托管协议的规定行使核查权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍基金管理人进行有效核查，情节严重或经基金管理人提出警告仍不改正的，基金管理人应报告中国证监会。

（四）基金财产的保管

1、基金财产保管的原则

(1)基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产；

(2)基金托管人应安全保管基金财产。未经基金管理人的正当指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何财产；

(3)基金托管人按照规定开立基金财产的资金账户和证券账户；(4)基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，与基金托管人的其他业务和其他基金的托管业务实行严格的分账管理，确保基金财产的完整与独立；

(5)对于因基金投资、基金申（认）购过程中产生的应收财产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金托管人处的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金财产造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失，基金托管人对此不承担责任。

2、募集资金的验证

基金募集期内销售机构按销售与服务代理协议的约定，将认购资金划入基金管理人在具有托管资格的商业银行开设的“东吴基金管理有限公司基金募集专户”。该账户由基金管理人开立并管理。基金募集期满，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》《运作办法》等有关规定后，由基金管理人聘请具有从事证券业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的 2 名以上（含 2 名）中国注册会计师签字方为有效。验资完成，基金管理人应将募集到的全部资金存入基金托管人为基金开立的基金托管专户中，基金托管人在收到资金当日出具确认文件。

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

3、基金的银行账户的开设和管理

基金托管人以基金托管人的名义其营业机构开设基金托管专户，用于基金交易的资金清算和保管基金的银行存款。基金托管专户是指基金托管人在集中托管模式下，代表所托管的基金与中国证券登记结算有限责任公司进行一级结算的专用账户。该账户的开设和管理由基金托管人负责。本基金的一切货币收支活动，均需通过基金托管人的基金托管专户进行。

基金托管专户的开立和使用，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与本基金无关的任何银行账户；亦不得使用基金的任何银行账户进行本基金业务以外的活动。

基金托管专户的管理应符合《银行账户管理办法》《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》以及中国人民银行的其他规定。

4、基金证券账户和证券交易资金账户的开设和管理

基金托管人以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限公司上海分公司/深圳分公司开设证券账户。

基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司开立基金证券交易资金账户，用于证券交易所场内交易清算。

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

5、债券托管账户的开设和管理

（1）基金合同生效后，基金管理人负责以基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表基金进行交易；基金托管人负责以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司开设银行间债券市场债券托管账户，并由基金托管人负责基金的债券的后台匹配及资金的清算。在上述手续办理完毕之后，由基金托管人负责向中国人民银行进行报备；

（2）同业拆借市场交易账户和债券托管账户根据中国人民银行、中国外汇交易中心和中央国债登记结算有限责任公司的有关规定，由基金管理人和基金托管人签订补充协议，进行使用和管理。基金管理人和基金托管人应共同负责为基金对外签订全国银行间国债市场回购主协议，正本由基金托管人保管，基金管理人保存副本。

6、其他账户的开设和管理

在本托管协议订立日之后，本基金被允许从事符合法律法规规定和基金合同约定的其他投资品种的投资业务时，如果涉及相关账户的开设和使用，由基金管理人协助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，法律法规另有规定的从其规定。

7、基金财产投资的有关实物证券的保管

实物证券由基金托管人存放于基金托管人的保管库；也可存入中央国债登记结算有限责任公司或中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司或票据营业中心的代保管库。保管凭证由基金托管人持有。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。由基金管理人移交托管人保管的实物证券，基金管理人对其合法性和真实性负责。基金托管人对托管人以外机构实际有效控制的证券不承担责任。属于基金托管人实际有效控制下的实物证券在基金托管人保管期间发生损坏、灭失，由此产生的责任应由基金托管人承

担。

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

（五）基金资产净值计算与复核

1、基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。各类基金份额净值是指计算日该类基金资产净值除以计算日该类基金份额总份额后的价值。各类基金份额净值的计算保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入。

2、基金管理人应每个开放日对基金资产估值。估值原则应符合基金合同、《证券投资基金会计核算办法》及其他有关法律法规的规定。用于基金信息披露的基金资产净值和各类基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的各类基金份额资产净值并以加密传真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，签名、盖章并以加密传真方式传送给基金管理人，由基金管理人对基金净值予以公布。

3、基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人、基金托管人共同承担。本基金的会计责任方是基金管理人，与本基金有关的会计问题如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。

（六）基金份额持有人名册的保管

基金管理人和基金托管人须分别妥善保管的基金份额持有人名册，包括基金合同生效日、基金合同终止日、基金份额持有人大会权益登记日、每年 6 月 30 日、12 月 31 日的基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容必须包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册由注册登记机构编制，由注册登记机构和基金管理人共同保管。保管方式可以采用电子或文档的形式。保管期限不少于 15 年，本协议另有规定的除外。

基金管理人应当及时向基金托管人提交下列日期的基金份额持有人名册：基金合同生效日、基金合同终止日、基金份额持有人大会权利登记日、每年 6 月 30 日、每年 12 月 31 日的

基金份额持有人名册。其中每年 12 月 31 日的基金份额持有人名册应于次月开始后的前十个工作日内提交；基金合同生效日、基金合同终止日等涉及到基金重要事项日期的基金份额持有人名册应于发生日后十个工作日内提交。

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，除经友好协商可以解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点在北京，仲裁裁决是终局性的并对相关各方均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

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

本协议受中国法律管辖。

（八）托管协议的变更与终止

1、托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议的内容进行变更。变更后的托管协议，其内容不得与基金合同的规定有任何冲突。基金托管协议的变更报中国证监会核准后生效。

2、基金托管协议终止的情形

发生以下情况，本托管协议终止：

（1）基金合同终止；

（2）基金托管人解散、依法被撤销、依法被宣告破产或有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、依法被宣告破产或有其他基金管理人接管基金管理权；

（4）发生法律法规或基金合同规定的终止事项。

二十三、对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务，并将根据基金份额持有人的需要和市场的变化增加、修改这些服务项目。以下是主要的服务内容：

（一）持有人注册登记服务

基金管理人委托注册登记人为基金份额持有人提供注册登记服务。基金注册登记人配备安全、完善的电脑系统及通讯系统，准确、及时地为基金投资者办理基金账户、基金份额的登记、管理、托管与转托管，股东名册的管理，权益分配时红利的登记、派发，基金交易份额的清算过户和基金交易资金的交收等服务。

（二）持有人交易记录查询及定期对帐单服务

1、本基金份额持有人可通过基金管理人的客户服务中心查询历史交易记录。

2、定期对账单服务

基金管理人设立客户服务部门。对账单服务分为电子对账单服务和纸质对账单服务。每月度、季度、年度结束后 10 个工作日内，客户服务部门将通过邮件向所有选择电子对账单服务的基金份额持有人发送电子对账单，记录该持有人最近一月度，或一季度或一年度内所有申购、赎回、非交易过户等交易发生的时间、金额、数量、价格以及当前账户的余额等。每年度结束后 30 个工作日内，客户服务部门将向本年度有交易的或持有份额的，且选择纸质对账单服务的基金份额持有人寄送该持有人最近一年度纸质对账单。基金份额持有人也可通过基金公司网站下载电子对账单或拨打基金公司客服热线索取电子或纸质对账单，亦可通过销售机构网点进行查询。

（三）红利再投资服务

若基金份额持有人选择红利再投资形式进行基金收益分配，该持有人当期分配所得基金收益将按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额，且不收取任何申购费用。若基金份额持有人不选择此项服务，本基金将按照默认的现金分红方式对红利予以发放。

（四）定期定额投资计划

在技术条件成熟时，基金管理人可利用直销网点或代理销售网点为投资者提供定期定额投资的服务。通过定期定额投资计划，投资者可以通过固定的渠道，定期定额申购基金份额，具体方法另行公告。

（五）客户服务中心（CallCenter）

客服中心自动语音系统提供 7*24 小时基金交易情况、基金账户余额、基金产品与服务等信息查询。

客服中心人工坐席在每个工作日提供不少于 8 小时的坐席服务，投资者可以通过拨打热线获得业务咨询、信息查询、服务投诉、资料修改、疑难解答、客户投诉/意见/建议处理、信函补寄、基金信息的定制等专项服务。

客户服务电话：4008210588

（六）网络服务

公司网站可为客户提供下列服务：信息定制、在线账户查询、信息下载、专家在线咨询、举办网上活动等。

客户还可通过公司网站直接进行网上交易，享受一站式服务。

公司网站：www.scfund.com.cn

二十四、其他应披露事项

（1）2020 年 08 月 04 日在中国证券报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴行业轮动混合型证券投资基金基金经理变更公告》；

（2）2020 年 08 月 05 日在中国证券报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴行业轮动混合型证券投资基金更新招募说明书以及摘要》；

（3）2020 年 08 月 20 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于公司督察长变更的公告》；

（4）2020 年 08 月 21 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于参加招商银行股份有限公司费率优惠的公告》；

（5）2020 年 08 月 28 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司旗下全部基金 2020 年中期报告提示性公告》；

（6）2020 年 08 月 28 日在中国证券报、上海证券报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《关于《东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金 2020 年中期报告》和《东吴行业轮动混合型证券投资基金 2020 年中期报告》更正公告》；

（7）2020 年 08 月 28 日在中国证券报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴行业轮动混合型证券投资基金更新招募说明书以及产品资料概要》；

（8）2020 年 08 月 31 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于参加恒泰证券股份有限公司费率优惠的公告》；

（9）2020 年 08 月 31 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于暂停手机 APP、微信服务号认购、申购（含定期定额）及转换转入业务的公告》；

（10）2020 年 08 月 31 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金开通在中国人寿保险股份有限公司的定期定额业务及转换业务的公告》；

（11）2020 年 08 月 31 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于参加中国人寿保险股份有限公司费率优惠的公告》；

（12）2020 年 09 月 11 日在中国证券报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴行业轮动混合型证券投资基金更新招募说明书以及产品资料概要》；

（13）2020 年 09 月 11 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于参加江苏银行股份有限公司费率优惠的公告》；

（14）2020 年 10 月 22 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于调整旗下部分基金单笔最低申购（含定期定额投资）金额、单笔最低赎回份额、转换转出及最低持有份额的公告》；

（15）2020 年 10 月 23 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于参加海通证券股份有限公司费率优惠的公告》；

（16）2020 年 10 月 23 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于参加华鑫证券有限责任公司费率优惠的公告》；

（17）2020 年 10 月 26 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于终止大泰金石基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告》；

（18）2020 年 10 月 28 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司旗下全部基金 2020 年 3 季度报告提示性公告》；

（19）2020 年 10 月 28 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于参加方德保险代理有限公司费率优惠的公告》；

（20）2020 年 10 月 31 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于参加北京肯特瑞基金销售有限公司费率优惠的公告》；

（21）2020 年 11 月 03 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于参加部分代销机构费率优惠的公告》；

（22）2020 年 11 月 26 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网

站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于网上直销平台暂停农行网银直连支付开户与签约业务的公告》；

（23）2020 年 12 月 01 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于参加部分代销机构费率优惠的公告》；

（24）2020 年 12 月 12 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于参加宁波银行股份有限公司同业基金销售平台费率优惠的公告》；

（25）2020 年 12 月 12 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于参加信达证券股份有限公司费率优惠的公告》；

（26）2020 年 12 月 23 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司首席信息官任职公告》；

（27）2020 年 12 月 30 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加中国工商银行股份有限公司个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告》；

（28）2020 年 12 月 30 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行股份有限公司基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告》；

（29）2020 年 12 月 30 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国工商银行股份有限公司“2021 倾心回馈”基金定投优惠活动的公告》；

（30）2021 年 01 月 01 日在公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司管理的基金 2020 年年度资产净值公告》；

（31）2021 年 01 月 06 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海攀赢基金销售有限公司为代销机构、开通定期定额及转换业务并参加费率优惠的公告》；

（32）2021 年 01 月 08 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于参加平安银行股份有限公司费率优惠的公告》；

（33）2021 年 01 月 12 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于参加华宝证券有限责任公司费率优惠的公告》；

（34）2021 年 01 月 13 日在中国证券报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴行业轮动混合型证券投资基金暂停大额申购（含定期定额）、大额转换转入业务的公告》；

（35）2021 年 01 月 15 日在中国证券报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴行业轮动混合型证券投资基金分红公告》；

（36）2021 年 01 月 15 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增喜鹊财富基金销售有限公司为代销机构、开通定期定额及转换业务并参加费率优惠的公告》；

（37）2021 年 01 月 20 日在中国证券报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于东吴行业轮动混合型证券投资基金增加 C 类基金份额并修改基金合同和托管协议的公告》；

（38）2021 年 01 月 20 日在公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴行业轮动混合型证券投资基金托管协议》；

（39）2021 年 01 月 20 日在公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴行业轮动混合型证券投资基金基金合同》；

（40）2021 年 01 月 20 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于暂停使用招商银行直付通服务办理直销网上交易部分业务的公告》；

（41）2021 年 01 月 21 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司旗下基金 2020 年 4 季度报告提示性公告》；

（42）2021 年 01 月 22 日在公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴行业轮动混合型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告》；

（43）2021 年 01 月 22 日在中国证券报、证券时报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金 C 类基金份额净值和份额累计净值计算与披露方法的说明公告》；

（44）2021 年 01 月 23 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京蛋卷

基金销售有限公司为代销机构、开通定期定额及转换业务并参加费率优惠的公告》；

（45）2021 年 01 月 25 日在公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴行业轮动混合型证券投资基金更新招募说明书以及产品资料概要》；

（46）2021 年 01 月 26 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金开通在北京植信基金销售有限公司的定期定额业务及转换业务的公告》；

（47）2021 年 01 月 26 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金开通在华瑞保险销售有限公司的定期定额业务及转换业务的公告》；

（48）2021 年 01 月 27 日在中国证券报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下东吴行业轮动混合型证券投资基金 C 类基金份额新增代销机构并开通定期定额投资及转换业务的公告》；

（49）2021 年 01 月 27 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增深圳市金海九州基金销售有限公司为代销机构、开通转换业务并参加费率优惠的公告》；

（50）2021 年 01 月 27 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金开通在光大证券股份有限公司的定期定额业务的公告》；

（51）2021 年 02 月 03 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增民商基金销售（上海）有限公司为代销机构、开通转换业务并参加费率优惠的公告》；

（52）2021 年 02 月 05 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于新增基金直销账户的公告》；

（53）2021 年 02 月 26 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增众惠基金销售有限公司为代销机构、开通定期定额及转换业务并参加费率优惠的公告》；

（54）2021 年 03 月 02 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金新增民生证券股份有限公司为代销机构、开通定期定额及转换业务并参加费率优惠的公告》；

（55）2021 年 03 月 04 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增爱建证券有限责任公司为代销机构、开通定期定额及转换业务并参加费率优惠的公告》；

（56）2021 年 03 月 10 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增弘业期货股份有限公司为代销机构、开通定期定额及转换业务并参加费率优惠的公告》；

（57）2021 年 03 月 17 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金开通在东方财富证券股份有限公司的定期定额业务的公告》；

（58）2021 年 03 月 23 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海爱建基金销售有限公司为代销机构并参加费率优惠的公告》；

（59）2021 年 03 月 24 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增兴业银行股份有限公司为代销机构、开通定期定额及转换业务并参加费率优惠的公告》；

（60）2021 年 03 月 31 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司旗下部分基金 2020 年年度报告提示性公告》；

（61）2021 年 03 月 31 日在公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴行业轮动混合型证券投资基金 2020 年年度报告》；

（62）2021 年 04 月 01 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于暂停中民财富基金销售（上海）有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告》；

（63）2021 年 04 月 02 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增和耕传承基金销售有限公司为代销机构、开通定期定额及转换业务并参加费率优惠的公告》；

（64）2021 年 04 月 02 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中国人寿保险股份有限公司为代销机构、开通定期定额及转换业务的公告》；

（65）2021 年 04 月 10 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网

站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于暂停上海汇付基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告》；

（66）2021 年 04 月 15 日在公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴行业轮动混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告》；

（67）2021 年 04 月 19 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于暂停北京晟视天下基金销售有限公司相关销售业务的公告》；

（68）2021 年 04 月 21 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司旗下基金 2021 年 1 季度报告提示性公告》；

（69）2021 年 05 月 27 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增粤开证券股份有限公司为代销机构、开通定期定额及转换业务并参加费率优惠的公告》；

（70）2021 年 06 月 03 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增腾安基金销售（深圳）有限公司为代销机构、开通定期定额业务并参加费率优惠的公告》；

（71）2021 年 06 月 08 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于参加腾安基金销售（深圳）有限公司费率优惠活动的公告》；

（72）2021 年 06 月 11 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增财咨道信息技术有限公司为代销机构、开通定期定额及转换业务并参加费率优惠的公告》；

（73）2021 年 06 月 16 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于恢复使用招商银行直付通服务办理直销网上交易部分业务的公告》；

（74）2021 年 06 月 16 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于网上直销平台恢复农行网银直连支付开户与签约业务的公告》；

（75）2021 年 06 月 19 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海华夏

财富投资管理有限公司为代销机构、开通定期定额及转换业务并参加费率优惠的公告》；

（76）2021 年 06 月 25 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金关于在公司直销开展赎回费率优惠活动的公告》；

（77）2021 年 06 月 25 日在公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于提醒客户谨防虚假 APP、网站、二维码、公众号诈骗的风险提示》；

（78）2021 年 06 月 30 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加交通银行股份有限公司手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告》；

（79）2021 年 06 月 30 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金开通在深圳市金海九州基金销售有限公司的定期定额业务的公告》；

（80）2021 年 07 月 01 日在公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司管理的基金 2021 年半年度基金净值公告》；

（81）2021 年 07 月 03 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于终止东吴基金手机 APP 服务及微信服务号交易功能的公告》；

（82）2021 年 07 月 05 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于在直销网上交易平台开展转换业务申购补差费率优惠的公告》；

（83）2021 年 07 月 12 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金招募说明书及基金产品资料概要的补充提示》；

（84）2021 年 07 月 14 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增鼎信汇金（北京）投资管理有限公司为代销机构、开通定期定额及转换业务并参加费率优惠的公告》；

（85）2021 年 07 月 16 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于参加鼎信汇金（北京）投资管理有限公司费率优惠的公告》；

（86）2021 年 07 月 20 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网

站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司旗下基金 2021 年 2 季度报告提示性公告》；

（87）2021 年 07 月 20 日在公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴行业轮动混合型证券投资基金 2021 年第 2 季度报告》；

（88）2021 年 07 月 22 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华融证券股份有限公司为代销机构、开通定期定额及转换业务并参加费率优惠的公告》；

（89）2021 年 07 月 24 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于参加国金证券股份有限公司费率优惠的公告》；

（90）2021 年 07 月 27 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金增加侧袋机制并相应修改法律文件的公告》；

（91）2021 年 07 月 27 日在公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴行业轮动混合型证券投资基金基金合同》；

（92）2021 年 07 月 27 日在公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴行业轮动混合型证券投资基金托管协议》；

（93）2021 年 07 月 28 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴基金管理有限公司关于参加招商证券股份有限公司费率优惠的公告》；

（94）2021 年 07 月 30 日在公司网站、中证信息网站等媒介上公告了《东吴行业轮动混合型证券投资基金更新招募说明书》。

二十五、招募说明书存放及查阅方式

本招募说明书存放在本基金管理人、基金托管人、销售代理人和注册登记机构的办公场所,投资者可在办公时间免费查阅；按支付工本费后，可在合理时间内取得本基金招募说明书复制件或复印件。投资人也可在基金管理人指定的网站上进行查阅。

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。

二十六、备查文件

(一)中国证监会核准“东吴行业轮动股票型证券投资基金”募集的文件

(二)《东吴行业轮动混合型证券投资基金基金合同》

(三)《东吴行业轮动混合型证券投资基金托管协议》

(四)法律意见书

(五)基金管理人业务资格批件、营业执照

(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

东吴基金管理有限公司

二零二一年九月十三日