

# 海富通量化先锋股票型证券投资基金更新招募说明书

(2022 年第 2 号)

基金管理人：海富通基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

## 重要提示

本基金经 2017 年 7 月 12 日中国证券监督管理委员会证监许可【2017】1210 号文准予注册募集。本基金的基金合同于 2018 年 2 月 8 日正式生效。本基金类型为契约型开放式。

本招募说明书是对原《海富通量化先锋股票型证券投资基金招募说明书》的更新，原招募说明书与本招募说明书不一致的，以本招募说明书为准。基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

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

投资有风险，投资者申购基金时应认真阅读本招募说明书基金合同、基金产品资料概要等信息披露文件，全面认识本基金产品的风险收益特征，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，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，由于基金投资者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，基金投资过程中产生的操作风险，因交收违约和投资债券引发的信用风险，基金投资对象与投资策略引致的特定风险，等等。本基金的特定风险详见招募说明书“风险揭示”章节。

本基金为股票型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

本基金可投资中小企业私募债，中小企业私募债由于发行人自身特点，存在一定的违约风险。同时单只债券发行规模较小，且只能通过两大交易所特定渠道进行转让交易，存在流动性风险。

本基金可投资于科创板股票，基金资产投资于科创板股票，会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于市场风险、流动性风险、信用风险、集中度风险、系统性风险、政策风险、退市风险等。具体风险烦请查阅本基金招募说明书的“风险揭示”章节的具体内容。本基金可根据投资策略需要或市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于科创板股票或选择不将基金资产投资于科创板股票，基金资产并非必然投资于科创板股票。

投资者应充分考虑自身的风险承受能力，并对于申购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。

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也不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在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。

本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过50%的除外。

本基金的投资范围包括存托凭证，若投资可能面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与创新企业、境外发行人、中国存托凭证发行机制以及交易机制等相关的风险。

本招募说明书约定的基金产品资料概要编制、披露与更新要求，自《信息披露办法》实施之日起一年后开始执行。

本招募说明书所载内容截止日为2022年12月23日，有关财务数据和净值表现截止日为2022年9月30日。

本招募说明书所载的财务数据未经审计。

## 目录

一、	绪言.....	4
二、	释义.....	5
三、	基金管理人.....	10
四、	基金托管人.....	21
五、	相关服务机构.....	23
六、	基金的募集.....	47
七、	基金合同的生效.....	48
八、	基金份额的申购与赎回.....	49
九、	基金的投资.....	61
十、	基金的业绩.....	73
十一、	基金的财产.....	76
十二、	基金资产的估值.....	77
十三、	基金的收益分配.....	83
十四、	基金的费用与税收.....	85
十五、	基金的会计与审计.....	88
十六、	基金的信息披露.....	89
十七、	风险揭示.....	96
十八、	基金合同的变更、终止与基金财产的清算.....	106
十九、	基金合同的内容摘要.....	109
二十、	基金托管协议的内容摘要.....	125
二十一、	对基金份额持有人的服务.....	135
二十二、	其他应披露事项.....	137
二十三、	招募说明书的存放及查阅方式.....	139
二十四、	备查文件.....	140

## 一、 绪言

《海富通量化先锋股票型证券投资基金招募说明书》（以下简称“招募说明书”或“本招募说明书”）依据《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“《流动性管理规定》”）及其他有关规定以及《海富通量化先锋股票型证券投资基金合同》编写。

本招募说明书阐述了海富通量化先锋股票型证券投资基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资人投资决策有关的全部必要事项，投资人在作出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

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

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

## 二、 释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

- 1、基金或本基金：指海富通量化先锋股票型证券投资基金
- 2、基金管理人：指海富通基金管理有限公司
- 3、基金托管人：指中国银行股份有限公司
- 4、基金合同：指《海富通量化先锋股票型证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充
- 5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《海富通量化先锋股票型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
- 6、招募说明书或本招募说明书：指《海富通量化先锋股票型证券投资基金招募说明书》及其更新
- 7、基金份额发售公告：指《海富通量化先锋股票型证券投资基金基金份额发售公告》
- 8、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等
- 9、《基金法》：指《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 10、《销售办法》：指《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 11、《信息披露办法》：指《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 12、《运作办法》：指《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 13、《流动性管理规定》：指中国证监会2017年8月31日颁布、同年10月1日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订
- 14、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

15、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会

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

17、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

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

19、合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》及相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者

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

21、基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人

22、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务

23、销售机构：指海富通基金管理有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务协议，办理基金销售业务的机构，包括可通过上海证券交易所开放式基金销售系统办理有关业务的会员单位

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

25、登记机构：指办理登记业务的机构。基金的登记机构为海富通基金管理有限公司或接受海富通基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构，本基金的登记机构为中国证券登记结算有限责任公司

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

27、基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机

构办理认购、申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务导致的基金份额变动及结余情况的账户

28、基金合同生效日：指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期

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

30、基金募集期：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过三个月

31、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

32、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

33、T日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日

34、T+n日：指自T日起第n个工作日(不包含T日)

35、开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

36、开放时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

37、《业务规则》：指《海富通基金管理有限公司证券投资基金注册登记业务规则》，是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金登记方面的业务规则，由基金管理人 and 投资人共同遵守；投资者通过上海证券交易所开放式基金销售系统办理开放式基金份额认购、申购和赎回等业务的，还须遵守上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关业务规则及其不时做出的修订

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

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

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

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

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

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

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

45、元：指人民币元

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

47、基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和

48、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

49、基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

50、基金资产估值：指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程

51、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

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

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

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



55、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

56、不可抗力：指基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

57、基金产品资料概要：指《海富通量化先锋股票型证券投资基金基金产品资料概要》及其更新

### 三、 基金管理人

#### （一）基金管理人概况

名称：海富通基金管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 36-37 层

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 36-37 层

法定代表人：杨仓兵

成立时间：2003 年 4 月 18 日

电话：021-38650999

联系人：吴晨莺

注册资本：3 亿元人民币

股权结构：海通证券股份有限公司 51%、法国巴黎资产管理 BE 控股公司 49%。

#### （二）主要人员情况

**杨仓兵先生**，董事长。历任安徽省农业科学院计财科副科长，安徽示康药业有限公司财务部经理，海通证券有限公司计划资金部资金科科长、计划资金部总经理助理、计划资金部副总经理，上海海振实业发展有限公司总经理，海通证券股份有限公司计划财务部副总经理、资金管理总部总经理。2016 年 10 月至 2019 年 4 月兼任海通证券资产管理有限公司董事。2018 年 5 月至 2019 年 3 月兼任海富通基金管理有限公司监事长。2019 年 3 月至 2019 年 4 月任海富通基金管理有限公司董事。2019 年 4 月起任海富通基金管理有限公司董事长。

**任志强先生**，董事，总经理，硕士。曾任南方证券有限公司上海分公司研究部总经理助理、南方证券研究所综合管理部副经理，华宝信托投资有限责任公司研究发展中心总经理兼投资管理部总经理、华宝信托投资有限责任公司总裁助理兼董事会秘书，华宝证券经纪有限公司董事、副总经理。华宝兴业基金管理有限公司基金经理、投资总监、副总经理，华宝兴业资产管理（香港）有限公司董事

长。2017年6月加入海富通基金管理有限公司，现任海富通基金管理有限公司董事、总经理。2018年3月至2018年7月兼任上海富诚海富通资产管理有限公司执行董事。2018年7月至2020年8月兼任上海富诚海富通资产管理有限公司董事长。2019年2月起兼任海富通资产管理（香港）有限公司董事长。

**吴淑琨先生**，董事，管理学博士。历任南京大学副教授，海通证券股份有限公司研究所宏观研究部经理、所长助理、机构业务部副总经理、企业及私人客户服务部副总主持、企业金融部总经理。现任海通证券股份有限公司战略发展部总经理。

**苏晓光先生**，董事，硕士。曾任港中旅（珠海）海洋温泉有限公司薪酬管理经理。2007年12月加入海通证券股份有限公司，历任人力资源部绩效管理专员、绩效管理部副经理、绩效管理部经理，现任海通证券股份有限公司人力资源部总经理助理。2020年11月起兼任海通创意私募基金管理有限公司董事。

**Vincent Trouillard-Perrot 先生**，董事，法国籍，硕士学位。1991年加入法国巴黎银行。1999年8月至2011年7月在法巴集团亚太区担任过多项管理职务，包括法巴私人银行香港及北亚区副总裁兼首席运营官、法巴资管日本有限公司首席执行官及法巴资管亚洲有限公司（香港）的亚洲首席执行官兼 APAC 区总监。2011年4月至2017年7月担任 Alfred Berg 资产管理公司（斯德哥尔摩）集团首席执行官职务。2017年7月至2019年8月担任法巴资管（巴黎）关联公司管理部副总监职务，2019年9月至今担任该部门总监职务，负责欧洲、拉美、中东、非洲地区业务及部分合资公司的监督管理。2020年6月至今担任法巴资产管理（巴黎）董事总经理职务，负责战略性参股及合资公司的监督管理。

**Alexandre Werno(韦历山)先生**，董事，法国籍，金融硕士学位。2007年9月至2013年4月在法国兴业投资银行全球市场部任执行董事、中国业务开发负责人职务；2013年5月至2017年11月先后任华宝兴业基金管理有限公司总经理高级顾问、常务副总经理职务；2017年11月至今任法国巴黎资产管理亚洲有限公司亚太区战略合作总监。

**王鸿祥先生**，独立董事，高级管理人员工商管理硕士（EMBA）。自1983年7月至1998年12月，在上海财经大学会计系执教，任至副教授。自1998年12月加入申能（集团）有限公司，任副总会计师直至2016年。现任海富通基金管理有限公司独立董事，爱普香料集团股份有限公司独立董事，上海豫园旅游商城股

份有限公司独立董事，上海先惠自动化技术股份有限公司独立董事。无不良诚信记录。

**杨文斌(Philip YOUNG Wen Binn)先生**，独立董事，管理学硕士(MBA)。历任美国大陆银行(芝加哥，台北)放贷经理，中华开发金控(台湾)资本市场经理，国际投资信托(台湾)执行副总经理，美银信托(香港)副总经理，日本野村资产管理(香港)投资总监，安泰人寿大中华地区投资总监，日本万通人寿投资总监及常务董事，中国平安保险集团资产管理公司投资总监。2006年7月至2009年4月任中国太平洋人寿保险股份有限公司与中国太平洋(集团)股份有限公司投资总监。2009年4月至2012年11月任太平洋资产管理有限公司投资总监。无不良诚信记录。

**刘正东先生**，独立董事，法律硕士。历任上海市人民检察院铁路运输分院助理检察员，上海市虹桥律师事务所律师。1998年11月至2018年6月任上海市君悦律师事务所主任、高级合伙人。2018年6月起至今任上海市君悦律师事务所首席合伙人、合伙人会议主席。因曾于2016年2月至2018年6月担任安徽华信国际控股股份有限公司独立董事，属于华信国际信息披露违法行为的其他直接责任人员，于2020年11月12日被中国证券监督管理委员会安徽监管局警告，并处3万元罚款。

**陈静女士**，独立董事，硕士。历任中国海洋石油总公司财务部干部，中外运-敦豪有限公司财务部经理，华盛顿普华会计师事务所(现普华永道)审计师，世界银行集团华盛顿总部高级会计官员、高级金融官员，中国证监会规划委高级顾问委员兼会计部副主任，中国投资有限责任公司财务部副总监、董事总经理。2014年5月起至今任瑞士合众集团中国董事会成员。2019年9月起任宇信科技的独立董事。无不良诚信记录。

**曹志刚先生**，监事长，经济学硕士。历任海通证券股份有限公司风险控制总部(稽核部)二级部经理、稽核部总经理助理，自2018年3月至今任稽核部副总经理。2016年11月起至今任海通吉禾股权投资基金管理有限责任公司和海通创意资本管理有限公司监事。

**Bruno Weil(魏海诺)先生**，监事，法国籍，博士。历任巴黎银行东南亚负责人、亚洲融资项目副经理，法国巴黎银行跨国企业全球业务客户经理、亚洲金融机构投行业务部负责人、零售部中国代表，南京银行副行长。现任法国巴黎银

行集团（中国）副董事长。

**胡正万先生**，监事，硕士。先后就职于成都机车车辆厂、四川省证券股份有限公司、富国基金管理有限公司。2003年4月加入海富通基金管理有限公司，历任基金会计、高级注册登记专员、注册登记负责人、基金运营副总监。2015年7月起任海富通基金管理有限公司基金运营总监。

**岳冲先生**，督察长，硕士。2001年7月至2011年1月，任职于中国海关；2011年1月至2018年10月，任职于中国证监会；2019年7月至2020年7月历任太平基金管理有限公司副总经理、督察长。2020年8月起任海富通基金管理有限公司督察长。

**何树方先生**，副总经理，博士。历任山东济宁市财政贸易委员会副科长，魁北克蒙特利尔大学研究助理（兼职），魁北克公共退休金管理投资公司分析师、基金经理助理，富国基金管理有限公司总经理助理，2011年6月加入海富通基金管理有限公司，任总经理助理。2014年11月起，任海富通基金管理有限公司副总经理。

**魏峻先生**，副总经理，经济学学士。1996年7月至2001年8月就职于交通银行深圳分行，2001年8月至2019年11月历任招商银行总行同业银行部非银行金融机构室经理、期货结算部总经理助理、同业客户部总经理助理。2019年11月加入海富通基金管理有限公司，现任海富通基金管理有限公司副总经理。

**胡光涛先生**，副总经理，博士。历任云南大学经济学院副教授，全国社会保障基金理事会法规及监管部风险控制处处长、投资部委托投资处处长、投资部（后更名为证券投资部）副主任、法规及监管部副巡视员。2015年11月至2017年10月任海富通资产管理（香港）有限公司董事长，2016年7月至2020年7月任海富通基金管理有限公司总经理助理。自2020年7月起任海富通基金管理有限公司副总经理。

**陶网雄先生**，首席信息官，硕士。历任中国电子器材华东公司会计科长、上海中土实业发展公司主管会计、海通证券股份有限公司财务副经理。2003年4月加入海富通基金管理有限公司，2003年4月至2006年4月任公司财务部负责人，2006年4月至2013年3月任财务总监。2013年4月至2020年5月任海富通基金管理有限公司副总经理。2018年7月起兼任上海富诚海富通资产管理有限公司董事。2020年5月起任海富通基金管理有限公司首席信息官。

朱斌全先生，硕士，持有基金从业人员资格证书。2005年7月至2006年8月任上海涅柔斯投资管理有限公司美股交易员。2007年4月加入海富通基金管理有限公司，历任交易员、高级交易员、量化分析师、投资经理、基金经理助理。2018年11月至2022年8月任海富通阿尔法对冲混合基金经理。2019年10月至2022年12月兼任海富通富祥混合基金经理。2019年10月起兼任海富通沪深300增强（原海富通富睿混合）、海富通量化多因子混合及海富通欣益混合的基金经理。2020年10月起兼任海富通欣享混合的基金经理。2020年10月至2022年8月兼任海富通新内需混合基金经理。2022年8月起兼任海富通安益对冲混合基金经理。2022年12月起兼任海富通量化先锋股票、海富通中证500增强基金经理。林立禾先生，美国密歇根大学量化金融硕士。历任中欧基金管理有限公司风险管理部量化风控。2020年8月加入海富通基金管理有限公司，任量化研究员。2022年10月起任海富通阿尔法对冲混合的基金经理助理。2022年12月起兼任海富通中证500指数增强和海富通量化先锋股票基金经理助理。

本基金历任基金经理为：陈甄璞先生，任职时间为2018年2月至2018年5月。杜晓海先生，任职时间为2018年4月至2020年10月。纪君凯先生，任职时间为2020年7月至2022年12月。

本基金采用投资决策委员会领导下的团队式投资管理模式。投资决策委员会常设委员有：任志强，总经理；胡光涛，副总经理；杜晓海，总经理助理兼量化投资部总监；王金祥，研究部总监；陈轶平，固定收益投资总监兼债券基金部总监；周雪军，总经理助理兼公募权益投资部总监。投资决策委员会主席由总经理担任。讨论内容涉及特定基金的，则该基金经理出席会议。

上述人员之间不存在近亲属关系。

### （三）基金管理人的职责

1. 依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
2. 办理基金备案手续；
3. 自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；
4. 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

5. 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；
6. 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；
7. 依法接受基金托管人的监督；
8. 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回的价格；
9. 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
10. 编制季度报告、中期报告和年度报告；
11. 严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
12. 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；
13. 按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；
14. 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
15. 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
16. 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上；
17. 确保需要向基金投资人提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资人能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件；
18. 组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
19. 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

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

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

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

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

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

25. 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

26. 建立并保存基金份额持有人名册；

27. 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

#### **(四) 基金管理人的承诺**

1. 基金管理人将严格遵守基金合同，按照招募说明书列明的投资目标、策略及限制全权处理本基金的投资。

2. 基金管理人不得从事违反《基金法》的行为，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止下列行为的发生：

- (1) 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；
- (2) 不公平地对待其管理的不同基金财产；
- (3) 利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；
- (4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- (5) 侵占、挪用基金财产；
- (6) 泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
- (7) 玩忽职守，不按照规定履行职责；
- (8) 用基金资产承销证券；



- (9) 违反规定用基金资产向他人贷款或提供担保；
- (10) 用基金资产从事承担无限责任的投资；
- (11) 以基金资产向基金管理人、基金托管人出资；
- (12) 用基金资产从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (13) 法律、行政法规、中国证监会及基金合同禁止的其他行为。

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

- (1) 越权或违规经营；
- (2) 违反基金合同或托管协议；
- (3) 故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益；
- (4) 在包括向中国证监会报送的资料中进行虚假信息披露；
- (5) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
- (6) 玩忽职守、滥用职权，不按照规定履行职责；
- (7) 泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
- (8) 违反证券交易场所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；
- (9) 贬损同行，以提高自己；
- (10) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
- (11) 以不正当手段谋求业务发展；
- (12) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；
- (13) 法律法规禁止的其他行为。

#### 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、代理人、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，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动。

(4) 不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

## (五) 基金管理人的内部控制制度

### 1. 内部控制的原则

本基金管理人的内部控制遵循以下原则：

(1) 全面性原则：内部控制必须覆盖公司的所有部门和岗位，渗透各项业务过程和业务环节，并普遍适用于公司每一位员工；

(2) 独立性原则：公司根据业务发展的需要设立相对独立的机构、部门和岗位，并在相关部门建立防火墙；公司设立独立的风险管理部和督察稽核部，保持高度的独立性和权威性，分别履行风险管理和合规监察职责，并协助和配合督察长负责对公司各项内部控制工作进行稽核和检查；

(3) 审慎性原则：内部控制的核心是有效防范各种风险，任何制度的建立都要以防范风险、审慎经营为出发点；

(4) 有效性原则：公司内部管理制度具有高度的权威性，是所有员工严格遵守的行动指南。执行内部控制制度不能有任何例外，任何人不得拥有超越制度或违反规章的权力；

(5) 及时性原则：内部控制制度的建立应与现代科技的应用相结合，充分利用电脑网络，建立电脑预警系统，保证监控的及时性；

(6) 适时性原则：内部控制制度的制订应具有前瞻性，并且必须随着公司经营战略、经营理念等内部环境的变化和国家法律、法规、政策等外部环境的改变及时进行相应的修改和完善；

(7) 定量与定性相结合的原则：建立完备内部控制指标体系，使内部控制更具客观性和操作性；

(8) 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；

(9) 相互制约原则：公司内部部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡。

### 2. 内部控制制度

公司严格按照《基金法》及其配套法规、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》等相关法律法规的规定，按照合法合规性、全面性、审慎性、适时性原则，建立健全内部控制制度。公司内部控制制度由内部控制大纲、基本管理制度和部门业务规章等三部分有机组成。

(1) 公司内部控制大纲是对公司章程规定的内控原则的细化和展开，是公司各项基本管理制度的纲要和总揽，内部控制大纲对内控目标、内控原则、控制环境、内控措施等内容加以明确。

(2) 公司基本管理制度包括风险管理制度、合规管理制度、稽核监察制度、投资管理制度、基金会计核算制度、信息披露制度、信息技术管理制度、公司财务制度、资料档案管理制度、人力资源管理制度和紧急应变制度等。公司基本管理制度的制定和实施需事先报经公司董事会批准。

(3) 部门业务规章是在公司基本管理制度的基础上，对各部门的主要职责、岗位设置、岗位责任、业务流程和操作守则等的具体说明。部门业务规章由公司相关部门依据公司章程和基本管理制度，并结合部门职责和业务运作的要求拟定，其制定和实施需事先报经公司总经理办公会讨论通过和总经理批准。

公司致力于将国际资产管理行业成熟的专业经验同中国资产管理行业的实际情况相结合，建立既符合国际规范又行之有效的内部控制机制。

### 3. 完备严密的内部控制体系

公司建立独立的内部控制体系，董事会层面设立督察长，管理层设立独立于其他业务部门的督察稽核部和风险管理部，通过风险管理制度、合规管理制度和稽核监察制度三个层面构建独立、完整、相互制约、关注成本效益的内部监督体系，对公司内部控制和 risk 管理制度及其执行情况进行持续的监督和反馈，保障公司内部控制机制的严格落实。

风险管理制度由董事会下设的审计及风险管理委员会制定风险管理的战略和政策，由管理层的风险管理委员会负责实施，由风险管理部专职落实和监督，公司各业务部门制定审慎的作业流程和风险管理措施，全面把握风险点，将风险管理责任落实到人，实现对风险的日常管理和过程中管理，防范、化解和控制公司所面临的、潜在的和已经发生的各种风险。

合规管理制度由督察稽核部具体落实，通过对公司日常业务的各个方面和各个环节的合法合规性进行评估及检查，监督公司及员工遵守国家相关法律法规、

监管规定、公司对外承诺性文件和内部管理制度的情况，识别、防范和及时杜绝公司内部管理及基金运作中的各种违规风险，提出并完善公司各项合规管理制度，以充分维护公司客户的合法权益。

稽核监察制度在督察长的领导下严格实施，由督察稽核部协助和配合督察长履行稽核监察职能，通过检查公司内部管理制度、资讯管制、投资决策与执行、基金营销、公司财务与投资管理、基金会计、信息披露、行政管理、电脑系统等公司所有部门和工作环节，对公司自身经营、资产管理和内部管理制度等的合法性、合规性、合理性和有效性进行监督、评价、报告和建议，从而保护公司客户和公司股东的合法权益。

#### 4. 基金管理人关于内部控制制度的声明

基金管理人确知建立内部控制系统、维持其有效性以及有效执行内部控制制度是基金管理人董事会及管理层的责任，董事会承担最终责任；基金管理人特别声明以上关于内部控制和风险管理的披露真实、准确，并承诺根据市场的变化和基金管理人不断发展完善风险管理和内部控制制度。

## 四、 基金托管人

### （一） 基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期：1983年10月31日

注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整

法定代表人：刘连舸

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

**托管部门信息披露联系人：许俊**

传真：(010) 66594942

中国银行客服电话：95566

### （二） 基金托管部门及主要人员情况

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

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

### （三） 证券投资基金托管情况

截至2022年9月30日，中国银行已托管1026只证券投资基金，其中境内基金976只，QDII基金50只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型、FOF等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模

位居同业前列。

#### （四）托管业务的内部控制制度

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

2007年起，中国银行连续聘请外部会计师事务所开展托管业务内部控制审阅工作。先后获得基于“SAS70”、“AAF01/06”“ISAE3402”和“SSAE16”等国际主流内控审阅准则的无保留意见的审阅报告。2020年，中国银行继续获得了基于“ISAE3402”和“SSAE16”双准则的内部控制审计报告。中国银行托管业务内控制度完善，内控措施严密，能够有效保证托管资产的安全。

#### （五）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

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

## 五、 相关服务机构

### 一、 基金份额发售机构

#### 1、 直销机构

名称：海富通基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 36-37 层

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 36-37 层

法定代表人：杨仓兵

全国统一客户服务号码：40088-40099（免长途话费）

联系人：段卓君

电话：021-38650797/799

传真：021-38650906/908

#### 2、 其他销售机构

（1） 中国银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：刘连舸

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

客户服务中心电话：95566

联系人：路惠雯

网址：[www.boc.cn](http://www.boc.cn)

（2） 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

法定代表人：任德奇

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

客户服务中心电话：95559

联系人：高天

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

## (3) 江苏银行股份有限公司

注册地址：南京市中华路 26 号

法定代表人：夏平

办公地址：南京市中华路 26 号

客户服务中心电话：95319

联系人：滕滕

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

## (4) 宁波银行股份有限公司

注册地址：浙江省宁波市鄞州区宁东路 345 号

法定代表人：陆华裕

办公地址：浙江省宁波市鄞州区宁东路 345 号

客户服务中心电话：95574

联系人：陈佳瑜

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

## (5) 平安银行股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号

法定代表人：谢永林

办公地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号

客户服务中心电话：95511-3

联系人：赵杨

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

## (6) 招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：缪建民

办公地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦

客户服务中心电话：95555

联系人：周嘉谊

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

## (7) 中国人寿保险股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 16 号



法定代表人：白涛

办公地址：北京市西城区金融大街 16 号

客户服务中心电话：95519

联系人：秦泽伟

网址：[www.e-chinalife.com](http://www.e-chinalife.com)

（8）海通证券股份有限公司

注册地址：上海市广东路 689 号

法定代表人：周杰

办公地址：上海市广东路 689 号海通证券大厦

客户服务中心电话：95553 或 4008888001

联系人：李笑鸣

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

（9）安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道福华一路 119 号安信金融大厦

法定代表人：黄炎勋

办公地址：深圳市福田区福田街道福华一路 119 号安信金融大厦

客户服务中心电话：95517

联系人：陈剑虹

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

（10）渤海证券股份有限公司

注册地址：天津经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

法定代表人：安志勇

办公地址：天津市南开区宾水西道 8 号

客户服务中心电话：4006515988

联系人：王星

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

（11）财通证券股份有限公司

注册地址：浙江省杭州市西湖区天目山路 198 号财通双冠大厦西楼

法定代表人：章启诚

办公地址：浙江省杭州市杭大路 15 号嘉华国际商务中心 201、501、502、1103、1601-1615、1701-1716

客户服务中心电话：95336 或 4008696336

联系人：陶志华

网址：www.ctsec.com

(12) 财信证券股份有限公司

注册地址：湖南省长沙市岳麓区茶子山东路 112 号滨江金融中心 T3、T4 及裙房 718

法定代表人：刘宛晨

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 层

客户服务中心电话：95317

联系人：郭静

网址：www.cfzq.com

(13) 长城证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道金田路 2026 号能源大厦南塔楼 10-19 层

法定代表人：张巍

办公地址：深圳市福田区福田街道金田路 2026 号能源大厦南塔楼 10-19 层

客户服务中心电话：4006666888

联系人：金夏

网址：www.cgws.com

(14) 长江证券股份有限公司

注册地址：湖北省武汉市新华路特 8 号

法定代表人：李新华

办公地址：湖北省武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

客户服务中心电话：95579 或 4008888999

联系人：奚博宇

网址：www.95579.com

(15) 大同证券有限责任公司

注册地址：山西省大同市平城区迎宾街 15 号桐城中央 21 层

法定代表人：董祥

办公地址：太原市小店区长治路世贸中心 12 层

客户服务中心电话：4007121212

联系人：薛津

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

(16) 第一创业证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼

法定代表人：刘学民

办公地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼

客户服务中心电话：95358

联系人：单晶

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

(17) 东北证券股份有限公司

注册地址：长春市生态大街 6666 号

法定代表人：李福春

办公地址：长春市生态大街 6666 号

客户服务中心电话：95360

联系人：安岩岩

网址：[www.nesc.cn](http://www.nesc.cn)

(18) 东海证券股份有限公司

注册地址：常州市延陵西路 23 号投资广场 18 层

法定代表人：钱俊文

办公地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦

客户服务中心电话：95531 或 4008888588

联系人：王一彦

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

(19) 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

法定代表人：范力

办公地址：苏州工业园区星阳街 5 号

客户服务中心电话：95330

联系人：陆晓

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

(20) 方正中期期货有限公司

注册地址：北京市石景山区金府路 32 号院 3 号楼 5 层 512 室

法定代表人：姜志军

办公地址：北京市朝阳区东三环北路 38 号院 1 号泰康金融大厦 22 层

客户服务中心电话：4008802277

联系人：罗雯

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

(21) 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

法定代表人：刘秋明

办公地址：上海市静安区新闸路 1508 号

客户服务中心电话：95525

联系人：姚巍

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

(22) 广发证券股份有限公司

注册地址：广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街 2 号 618 室

法定代表人：林传辉

办公地址：广东省广州市天河区马场路 26 号广发证券大厦

客户服务中心电话：95575 或致电各地营业网点

联系人：黄岚、马梦洁

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

(23) 国都证券股份有限公司

注册地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

法定代表人：翁振杰

办公地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

客户服务中心电话：4008188118

联系人：张晖

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

## (24) 国金证券股份有限公司

注册地址：成都市青羊区东城根上街 95 号

法定代表人：冉云

办公地址：成都市青羊区东城根上街 95 号

客户服务中心电话：95310

联系人：陈瑀琦、赵海帆

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

## (25) 国联证券股份有限公司

注册地址：无锡市金融一街 8 号

法定代表人：姚志勇

办公地址：无锡市金融一街 8 号国联金融大厦

客户服务中心电话：95570

联系人：庞芝慧

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

## (26) 国盛证券有限责任公司

注册地址：江西省南昌市新建区子实路 1589 号

法定代表人：周军

办公地址：江西省南昌市红谷滩新区凤凰中大道 1115 号北京银行大楼

客户服务中心电话：956080

联系人：占文驰

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

## (27) 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

法定代表人：张纳沙

办公地址：深圳市福田区福华一路 125 号国信金融大厦 37 楼

客户服务中心电话：95536

联系人：李颖

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

## (28) 红塔证券股份有限公司

注册地址：云南省昆明市北京路 155 号附 1 号

法定代表人：李素明

办公地址：云南省昆明市北京路155号附1号红塔大厦7-11楼

客户服务中心电话：956060

联系人：杨敏珺

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

（29）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

法定代表人：章宏韬

办公地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号

客户服务中心电话：95318

联系人：孙懿

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

（30）华宝证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区浦电路370号2、3、4层

法定代表人：刘加海

办公地址：上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心57楼

客户服务中心电话：4008209898

联系人：刘闻川

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

（31）华金证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区天目西路128号19层1902室

法定代表人：燕文波

办公地址：上海市浦东新区杨高南路759号30层

客户服务中心电话：4008211357

联系人：秦臻

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

（32）华龙证券股份有限公司

注册地址：兰州市城关区东岗西路638号兰州财富中心21楼

法定代表人：祁建邦

办公地址：兰州市城关区东岗西路638号兰州财富中心21楼

客户服务中心电话：95368

联系人：周鑫

网址：www.hlzq.com

（33）华西证券股份有限公司

注册地址：成都市高新区天府二街 198 号

法定代表人：杨炯洋

办公地址：成都市高新区天府二街 198 号华西证券大厦

客户服务中心电话：95584

联系人：赵静静

网址：www.hx168.com.cn

（34）华鑫证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区莲花街道福中社区深南大道 2008 号中国凤凰大厦  
1 栋 20C-1 房

法定代表人：俞洋

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 8 号

客户服务中心电话：95323，4001099918（全国）

联系人：刘熠

网址：www.cfsc.com.cn

（35）江海证券有限公司

注册地址：哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

法定代表人：赵洪波

办公地址：哈尔滨市松北区创新三路 833 号

客户服务中心电话：956007

联系人：姜志伟

网址：www.jhzq.com.cn

（36）联储证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区福田街道岗厦社区深南大道南侧金地中心大厦 9  
楼

法定代表人：吕春卫

办公地址：深圳市福田区福田街道岗厦社区深南大道南侧金地中心大厦 9 楼

客户服务中心电话：4006206868

联系人：丁倩云

网址：www.lczq.com

（37）南京证券股份有限公司

注册地址：南京市江东中路 389 号

法定代表人：李剑锋

办公地址：南京市江东中路 389 号

客户服务中心电话：95386

联系人：何斌

网址：www.njzq.com.cn

（38）平安证券股份有限公司

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

法定代表人：何之江

办公地址：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

客户服务中心电话：95511-8

联系人：周驰

网址：stock.pingan.com

（39）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

法定代表人：何伟

办公地址：上海市黄浦区四川中路 213 号 7 楼

客户服务中心电话：4008918918

联系人：邵珍珍

网址：www.shzq.com

（40）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



法定代表人：王献军

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

客户服务中心电话：95523 或 4008895523

联系人：梁丽

网址：www.swhysc.com

（41）申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号世纪商贸广场 45 层

法定代表人：杨玉成

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

客户服务中心电话：95523 或 4008895523

联系人：陈宇

网址：www.swhysc.com

（42）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

法定代表人：余维佳

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

客户服务中心电话：4008323000

联系人：徐玲娟

网址：www.csc.com.cn

（43）天风证券股份有限公司

注册地址：湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路 2 号高科大厦四楼

法定代表人：余磊

办公地址：湖北省武汉市武昌区中北路 217 号天风大厦 2 号楼 19 楼

客户服务中心电话：95391 或 4008005000

联系人：王雅薇

网址：www.tfzq.com

（44）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

法定代表人：林义相

办公地址：北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座 505

客户服务中心电话：010-66045678

联系人：谭磊

网址：jijin.txsec.com

（45）万联证券股份有限公司

注册地址：广州市天河区珠江东路 11 号 18、19 楼全层

法定代表人：袁笑一

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

客户服务中心电话：95322

联系人：丁思

网址：www.wlzq.cn

（46）西部证券股份有限公司

注册地址：陕西省西安市新城东大街 319 号 8 幢 10000 室

法定代表人：徐朝晖

办公地址：陕西省西安市新城东大街 319 号 8 幢 10000 室

客户服务中心电话：95582

联系人：梁承华

网址：www.west95582.com

（47）英大证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层

法定代表人：郝京春

办公地址：深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层

客户服务中心电话：4000188688

联系人：王晓静

网址：www.ydsc.com.cn

（48）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

法定代表人：严亦斌

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

客户服务中心电话：95564

联系人：彭莲

网址：www.ykzq.com

（49）招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道福华一路 111 号

法定代表人：霍达

办公地址：深圳市福田区福田街道福华一路 111 号招商证券大厦 23 楼

客户服务中心电话：95565

联系人：黄婵君

网址：www.newone.com.cn

（50）中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市丰台区西营街 8 号院 1 号楼 7 至 18 层 101

法定代表人：陈亮

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

客户服务中心电话：95551 或 4008888888

联系人：辛国政

网址：www.chinastock.com.cn

（51）中山证券有限责任公司

注册地址：深圳市南山区粤海街道蔚蓝海岸社区创业路 1777 号海信南方大厦 21 层、22 层

法定代表人：吴小静

办公地址：深圳市南山区粤海街道蔚蓝海岸社区创业路 1777 号海信南方大厦 21 层、22 层

客户服务中心电话：95329

联系人：罗艺琳

网址：www.zszq.com

（52）中泰证券股份有限公司

注册地址：济南市市中区经七路 86 号

法定代表人：李峰

办公地址：济南市市中区经七路 86 号

客户服务中心电话：95538

联系人：许曼华

网址：www.zts.com.cn

（53）中天证券股份有限公司

注册地址：沈阳市和平区光荣街 23 甲

法定代表人：马功勋

办公地址：沈阳市和平区光荣街 23 甲

客户服务中心电话：95346

联系人：孙丹华

网址：www.iztzq.com

（54）中信建投期货有限公司

注册地址：重庆市渝中区中山三路 107 号上站大楼平街 11-B，名义层  
11-A，8-B4,9-B、C

法定代表人：王广学

办公地址：重庆市渝中区中山三路 107 号皇冠大厦 11 楼

客户服务中心电话：4008877780

联系人：刘芸

网址：www.cfc108.com

（55）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

法定代表人：王常青

办公地址：北京市东城区朝内大街 188 号

客户服务中心电话：95587 或 4008888108

联系人：许梦园

网址：www.csc108.com

（56）中信期货有限公司

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  
13 层 1301-1305、14 层

法定代表人：张皓

办公地址：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  
13 层 1301-1305、14 层

客户服务中心电话：4009908826

联系人：梁美娜

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

（57）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

法定代表人：冯恩新

办公地址：青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座 5 层

客户服务中心电话：95548

联系人：刘晓明

网址：[sd.citics.com](http://sd.citics.com)

（58）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

法定代表人：张佑君

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

客户服务中心电话：95548

联系人：王一通

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

（59）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 501 房

法定代表人：胡伏云

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

客户服务中心电话：95548

联系人：陈靖

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

（60）中邮证券有限责任公司

注册地址：陕西省西安市唐延路 5 号（陕西邮政信息大厦 9-11 层）

法定代表人：郭成林

办公地址：北京市东城区珠市口东大街 17 号

客户服务中心电话：4008888005

联系人：史蕾

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

(61) 甬兴证券有限公司

注册地址：浙江省宁波市鄞州区海晏北路 565、577 号 8-11 层

法定代表人：李抱

办公地址：浙江省宁波市鄞州区海晏北路 565、577 号 8-11 层/上海市浦东新区南泉北路 429 号泰康保险大厦 31-32 层

客户服务中心电话：4009160666

联系人：戴璐璐

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

(62) 北京度小满基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区上地十街 10 号 1 幢

办公地址：北京市海淀区上地信息路甲 9 号

法定代表人：张旭阳

客户服务电话：95055

联系人：宋刚

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

(63) 北京汇成基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108 号

办公地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108

法定代表人：王伟刚

客户服务电话：400-619-9059

联系人：宋子琪

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

(64) 北京新浪仓石基金销售有限公司

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

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

法定代表人：李昭琛

客户服务电话：010-62675369

联系人：李唯

网址：<http://fund.sina.com.cn>

(65) 北京雪球基金销售有限公司

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：北京市朝阳区创远路 34 号院 6 号楼 15 层 1501 室

法定代表人：李楠

客户服务电话：400-159-9288（新）

联系人：袁园

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

(66) 北京展恒基金销售股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼 32 层 3201 内 3212、3211 单元

办公地址：北京顺义区后沙峪镇安富街 6 号

法定代表人：闫振杰

客户服务电话：400-818-8000

联系人：罗恒

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

(67) 北京中植基金销售有限公司

注册地址：北京市北京经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室

办公地址：北京市朝阳区建国路 91 号金地中心 A 座 28 层

法定代表人：武建华

客户服务电话：400-8180-888

联系人：孙玉

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

(68) 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

客户服务电话：4000-899-100

联系人：于秀

网址：www.yibaijin.com

(69) 凤凰金信（海口）基金销售有限公司

注册地址：宁夏银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路 142 号 14 层 1402 办  
公用房

办公地址：北京市朝阳区紫月路 18 号院 朝来高科技产业园 18 号楼

法定代表人：程刚

客户服务电话：400-810-5919

联系人：王鹤敏

网址：www.fengfd.com

(70) 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：上海市浦东新区东方路 18 号保利广场 E 座 18F

法定代表人：王莉

客户服务电话：400-920-0022

联系人：刘洋

网址：www.licaike.com

(71) 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：南京市鼓楼区中山北路 2 号绿地紫峰大厦 2005 室

法定代表人：吴言林

客户服务电话：025-66046166 转 849

联系人：孙平

网址：www.huilinbd.com

(72) 京东肯特瑞基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区西三旗建材城中路 12 号 17 号平房 157



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

法定代表人：王苏宁

客户服务电话：95118 / 400-098-8511

联系人：李丹

网址：京东金融 APP

(73) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

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

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼

法定代表人：陈柏青

客户服务电话：4000-766-123

联系人：李雁雯

网址：蚂蚁财富 APP

(74) 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：钱燕飞

客户服务电话：95177

联系人：王峰

网址：www.snjijin.com

(75) 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：上海市金山区廊下镇漕廊公路 7650 号 205 室

法定代表人：汪静波

客户服务电话：400-821-5399

联系人：李娟

网址：www.noah-fund.com

(76) 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：上海浦东新区浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 10 层

法定代表人：杨文斌

客户服务电话：400-700-9665

联系人：高源

网址：www.howbuy.com

(77) 上海基煜基金销售有限公司

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

办公地址：上海市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)

法定代表人：王翔

客户服务电话：400-820-5369

联系人：张巍靖

网址：www.jiyufund.com.cn

(78) 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：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室

法定代表人：李兴春

客户服务电话：400-032-5885

联系人：张佳慧

网址：www.leadbank.com.cn

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

法定代表人：燕斌

客户服务电话：400-118-1188

联系人：陈东

网址：www.66liantai.com

(80) 上海陆金所基金销售有限公司

注册地址：中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路 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 09 单元

法定代表人：郭坚

客户服务电话：400-866-6618

联系人：程晨

网址：www.lu.com

(81) 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 号楼二层

办公地址：上海市徐汇区徐家汇街道宛平南路 88 号金座 26 楼

法定代表人：其实

客户服务电话：400-1818-188

联系人：王超

网址：www.1234567.com.cn

(82) 上海挖财基金销售有限公司

注册地址：杭州华星路 96 号互联网金融大厦 19 楼

办公地址：上海陆家嘴世纪金融广场杨高南路 799 号 3 号楼 5 楼

法定代表人：冷飞

客户服务电话：400-711-8718

联系人：毛善波

网址：挖财宝 APP

(83) 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：中国(上海)自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

法定代表人：王廷富

客户服务电话：400-799-1888

联系人：徐亚丹

网址：www.520fund.com.cn

(84) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

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

办公地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006 室

法定代表人：陈操

客户服务电话：400-850-7771

联系人：文雯

网址：[www.new-rand.cn](http://www.new-rand.cn)

(85) 深圳众禄基金销售股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区笋岗街道梨园路物资控股置地大厦 8 楼 801

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

法定代表人：薛峰

客户服务电话：4006-788-887

联系人：童彩平

网址：[www.zlfund.cn](http://www.zlfund.cn) 及 [www.jjmmw.com](http://www.jjmmw.com)

(86) 腾安基金销售（深圳）有限公司

注册地址：深圳市南山区科技中一路腾讯大厦

办公地址：深圳市南山区科技中一路腾讯大厦

法定代表人：刘明军

客户服务电话：4000-890-555

联系人：郑骏锋

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

(87) 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 9 号楼 15 层 1809

法定代表人：沈伟桦

客户服务电话：400-6099-200

联系人：刘梦轩

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

(88) 招商银行股份有限公司（招赢通）

注册地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：缪建民

客户服务电话：95555

联系人：陈芋

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

(89) 浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：杭州市文二西路1号903室

办公地址：浙江省杭州市翠柏路7号杭州电子商务产业园2楼

法定代表人：凌顺平

客户服务电话：952555

联系人：董一峰

网址：www.5ifund.com

(90) 中证金牛（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室

办公地址：北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室

法定代表人：彭运年

客户服务电话：4008-909-998

联系人：王莅晨

网址：www.jnlc.com

(91) 珠海盈米基金销售有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491

办公地址：珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491

法定代表人：肖雯

客户服务电话：020-89629066

联系人：吴煜浩

网址：www.yingmi.cn

(92) 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）

法定代表人：TAN YIK KUAN

客户服务电话：400-684-0500

联系人：叶健

网址：www.ifastps.com.cn

## 二、登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街 17 号

注册地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：于文强

电话：010-50938782

传真：010-50938907

联系人：赵亦清

## 三、出具法律意见书的律师事务所

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：俞卫锋

电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：陈颖华

经办律师：黎明、陈颖华

## 四、审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼

法定代表人：李丹

经办注册会计师：朱宏宇、胡莲莲

电话：(021) 23238888

传真：(021) 23238800

联系人：胡莲莲

## 六、 基金的募集

本基金于2017年7月12日经中国证监会证监许可[2017]1210号文件准予募集注册。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。募集期从2018年1月8日起至2018年2月2日止，共募集331,099,125.24份基金份额，有效认购户数为1278户。

## 七、 基金合同的生效

本基金的基金合同已于 2018 年 2 月 8 日正式生效。

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

法律法规另有规定时，从其规定。



## 八、 基金份额的申购与赎回

### 一、 申购和赎回场所

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。具体的销售网点将由基金管理人在招募说明书或其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并在基金管理人网站公示。基金投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。

若基金管理人或其指定的销售机构开通电话、传真或网上等交易方式，投资人可以通过上述方式进行申购与赎回，具体办法由基金管理人另行公告。

### 二、 申购和赎回的开放日及时间

#### 1、 开放日及开放时间

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

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

#### 2、 申购、赎回开始日及业务办理时间

基金管理人自基金合同生效之日起不超过3个月开始办理申购，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。

基金管理人自基金合同生效之日起不超过3个月开始办理赎回，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，基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告申购与赎回的开始时间。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的，其基金份额申购、赎回价格为下一开放日基金份额

申购、赎回的价格。

### 三、申购与赎回的原则

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

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；

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

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

### 四、申购与赎回的程序

#### 1、申购和赎回的申请方式

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

#### 2、申购和赎回的款项支付

投资人申购基金份额时，必须全额交付申购款项，投资人交付申购款项，申购成立；登记机构确认基金份额时，申购生效。若申购资金在规定时间内未全额到账，则申购不成立。

基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；登记机构确认赎回时，赎回生效。投资人赎回申请成功后，基金管理人将在T+7日(包括该日)内支付赎回款项。在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。

#### 3、申购和赎回申请的确认

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

询。若申购不成功或无效，则申购款项退还给投资人。

在法律法规允许的范围内，登记机构可根据《业务规则》，在不影响基金份额持有人利益的前提下，对上述业务办理时间进行调整。基金管理人必须在新规开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。

## 五、申购和赎回的数量限制

1、本基金单笔申购的最低金额为1元，销售机构在此最低金额基础之上另有约定的，从其约定。直销柜台单个账户首次申购的最低金额为人民币50,000元（含申购费），追加申购的最低金额为单笔人民币10,000元（含申购费）。基金管理人可根据市场情况，调整本基金申购的最低金额。

2、基金份额持有人在销售机构赎回时，单笔赎回申请不得低于1份基金份额；基金份额持有人赎回时或赎回后在销售机构（网点）保留的基金份额余额不足1份的，在赎回时需一次全部赎回。

3、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。具体请参见相关公告。

4、本基金基金份额持有人每个交易账户的最低份额余额为1份。基金份额持有人因赎回、转换等原因导致其单个基金账户内剩余的基金份额低于1份时，登记系统可对该剩余的基金份额自动进行全部赎回处理。

5、基金管理人可根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制，基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。

## 六、申购费用和赎回费用

1、本基金A类基金份额的申购费用由投资人承担，不列入基金资产，用于基金的市场推广、销售、登记等各项费用。C类基金份额不收取申购费用。

2、本基金A类基金份额的申购费率按照申购金额逐级递减，登记机构根据单笔申购的实际确认金额确定每笔申购所适用的费率并分别计算。同时对通过直

销申购 A 类基金份额的养老金客户与除此之外的其他投资人实施差别申购费率。

对于通过本公司的直销申购本基金 A 类基金份额的养老金客户，适用的申购费率如下：

申购金额 (M)	申购费率
M ≥ 500 万元	1000元/笔
200 万元 ≤ M < 500 万元	0.16%
100 万元 ≤ M < 200 万元	0.24%
M < 100 万元	0.30%

除养老金客户外的其他投资人申购本基金 A 类基金份额的申购费率如下：

申购金额 (M)	申购费率
M ≥ 500 万元	1000元/笔
200 万元 ≤ M < 500 万元	0.80%
100 万元 ≤ M < 200 万元	1.20%
M < 100 万元	1.50%

3、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。对持续持有期少于 30 日的投资人，将赎回费全额计入基金财产；对持续持有期长于 30 日少于 3 个月的投资人，将赎回费总额的 75% 计入基金财产；对持续持有期长于 3 个月但少于 6 个月的投资人，将赎回费总额的 50% 计入基金财产；对持续持有期长于 6 个月的投资人，应当将赎回费总额的 25% 计入基金财产。未计入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。

赎回费率随赎回基金份额持有期限的增加而递减，具体费率如下：

份额持有期 (Y)	A类基金份额赎回费率	C类基金份额赎回费率
Y < 7日	1.50%	1.50%
7日 ≤ Y < 30日	0.75%	0.50%
30日 ≤ Y < 180日	0.50%	0
Y ≥ 180日	0	0

4、基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟

应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

5、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以对基金申购费用实行一定的优惠。

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

## 七、申购份额与赎回金额的计算

### 1、申购份额的计算

本基金的申购金额包括申购费用和净申购金额。登记机构根据单次申购的实际确认金额确定每次申购所适用的费率并分别计算，计算公式如下：

#### 1) A类基金份额的申购份额计算公式

申购费用 = 申购金额 × 申购费率 / (1 + 申购费率)

(如适用固定金额申购费，申购费用 = 固定金额申购费)

净申购金额 = 申购金额 - 申购费用

申购份额 = 净申购金额 / T日A类基金份额净值

#### 2) C类基金份额的申购份额计算公式

申购份额 = 申购金额 / T日C类基金份额净值

申购费以四舍五入方式保留到小数点后两位。申购份额以四舍五入方式保留到小数点后两位，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

例：(1) 某投资者（非养老金客户）投资 5,000 元申购本基金 A 类份额，对应申购费率为 1.50%，假设申购当日 A 类基金份额净值为 1.1280 元，则其可得到的申购份额为：

申购费用 =  $5,000 \times 1.50\% / (1 + 1.50\%) = 73.89$  元

净申购金额 =  $5,000 - 73.89 = 4926.11$  元

申购份额 =  $4,926.11 / 1.1280 = 4,367.12$  份

即：该投资者投资 5,000 元申购本基金 A 类份额，假设申购当日基金份额净值为 1.1280 元，则投资者可获得 4,367.12 份 A 类基金份额。

例：（2）某投资者（非养老金客户）投资 5,000 元申购本基金 C 类份额，对应申购费率为 0%，假设申购当日 C 类份额基金份额净值为 1.1280 元，则其可得到的申购份额为：

$$\text{申购份额} = 5,000 / 1.1280 = 4,432.62 \text{ 份}$$

即：该投资者投资 5,000 元申购本基金 C 类份额，假设申购当日基金份额净值为 1.1280 元，则投资者可获得 4,432.62 份 C 类基金份额。

## 2、赎回金额的计算

投资者在赎回基金份额需缴纳一定的赎回费用。计算公式如下：

$$\text{赎回金额} = \text{赎回份额} \times \text{T 日相应类别份额基金份额净值}$$

$$\text{赎回费} = \text{赎回份额} \times \text{T 日相应类别份额基金份额净值} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{净赎回金额} = \text{赎回金额} - \text{赎回费}$$

赎回费、赎回金额以四舍五入方式保留小数点后两位，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

例：（1）某基金份额持有人持有本基金 10,000 份 A 类基金份额 30 日后（未满 180 日）决定赎回，对应的赎回费率为 0.5%，假设赎回当日 A 类基金份额净值是 1.1480 元，则可得到的净赎回金额为：

$$\text{赎回总金额} = 10,000 \times 1.1480 = 11,480.00 \text{ 元}$$

$$\text{赎回费用} = 11,480 \times 0.5\% = 57.40 \text{ 元}$$

$$\text{净赎回金额} = 11,480.00 - 57.40 = 11,422.60 \text{ 元}$$

即：某基金份额持有人持有 10,000 份本基金 A 类基金份额 30 日后（未满 180 日）赎回，假设赎回当日本基金 A 类份额净值是 1.1480 元，则可得到的净赎回金额为 11,422.60 元。

例：（2）某基金份额持有人持有本基金 10,000 份 C 类基金份额 30 日后决定赎回，对应的赎回费率为 0%，假设赎回当日 C 类基金份额净值是 1.1480 元，则可得到的净赎回金额为：

$$\text{净赎回金额} = 10,000 \times 1.1480 = 11,480.00 \text{ 元}$$

即：某基金份额持有人持有 10,000 份本基金 C 类基金份额 30 日后赎回，假设赎回当日本基金 C 类份额净值是 1.1480 元，则可得到的净赎回金额为 11,480.00 元。

### 3、基金份额净值的计算公式

T日的基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。计算公式为：

$$T \text{ 日某类份额基金份额净值} = T \text{ 日该类份额基金资产净值} / T \text{ 日该类份额基金份额的余额数量}$$

本基金各类份额的份额净值的计算，保留到小数点后4位，小数点后第5位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

## 八、申购与赎回的登记

1、基金投资人提出的申购和赎回申请，在基金管理人规定的时间之前可以撤销。

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

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

4、基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述登记办理时间进行调整，并最迟于调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

## 九、拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

1、因不可抗力导致基金无法正常运作。

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

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

4、接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。

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

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

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

8、申请超过基金管理人设定的基金总规模、单日净申购比例上限、单个投资人单日或单笔申购金额上限的。

9、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第1、2、3、5、6、8、9项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

#### 十、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。

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

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

4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

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

6、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总



量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。若出现上述第4项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

## 十一、巨额赎回的情形及处理方式

### 1、巨额赎回的认定

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

### 2、巨额赎回的处理方式

当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。

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

(2) 部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的该类基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

若基金发生巨额赎回，在出现单个基金份额持有人超过基金总份额20%的赎回申请(简称“大额赎回申请人”)情形下，基金管理人应当延期办理赎回申请。基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额10%的前提下，优先确认其他赎回申请人(简称“小额赎回申请人”)的赎回申请；若小额赎回申

请人的赎回申请在当日予以全部确认，则基金管理人在仍可接受赎回申请的范围内对大额赎回申请人的赎回申请按比例确认，对大额赎回申请人未予确认的赎回申请延期办理；若小额赎回申请人的赎回申请在当日未予全部确认，则对未确认的赎回申请（含小额赎回申请人的其余赎回申请与大额赎回申请人的全部赎回申请）延期办理。延期办理的赎回申请适用本条规定的延期赎回或取消赎回的规则；同时，基金管理人应当对延期办理的事宜在指定媒介上刊登公告。

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

### 3、巨额赎回的公告

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

## 十二、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

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

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

3、如发生暂停的时间超过1日，暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应根据《信息披露办法》的规定在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近1个开放日各类基金份额的基金份额净值。

## 十三、基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换业务，基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及基金合同的规定制定并公告，并提前告知基金托管人与相关机构。

#### 十四、基金份额的转让

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

#### 十五、基金的非交易过户

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

继承，是指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；

捐赠，指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体；

司法强制执行，是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。

办理非交易过户必须提供基金登记机构要求提供的相关资料，对于符合条件的非交易过户申请按基金登记机构的规定办理，并按基金登记机构规定的标准收费。

#### 十六、基金的转托管

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

#### 十七、定期定额投资计划

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

## 十八、基金份额的冻结和解冻

基金登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻,以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。

## 九、 基金的投资

### 一、 投资目标

本基金通过多因子量化模型方法，精选股票进行投资，在严格控制风险的前提下，力争获取超越比较基准的投资回报。

### 二、 投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、债券（包括国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、短期融资券、超级短期融资券、中期票据、地方政府债、中小企业私募债及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。

基金的投资组合比例为：股票资产及存托凭证占基金资产的80%-95%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；股指期货及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

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

### 三、 投资策略

#### 1、 资产配置策略

本基金为股票型基金，在进行资产配置决策时，依据量化择时模型，对宏观经济、政策预期、市场情绪、投资者行为等指标进行监控，精确把握市场方向，在本基金的投资比例范围内对组合中股票、债券等资产的仓位进行调整。

## 2、股票投资策略

量化投资有别于传统定性的投资方法，量化投资较少依赖定性判断，而是将适当的投资逻辑和思想、直觉等反映在量化模型中，利用计算机来处理大量信息、总结归纳市场的规律、建立可重复使用并反复优化的投资策略。其中多因子量化模型是国内外市场上被广泛运用的定量分析框架，在这一框架下，股票收益可分解为一系列因子收益及权重的组合。多因子模型致力于寻找持续稳健的超额收益因子，并进而根据因子收益的预测，形成股票超额收益的预测结果。模型的逻辑在于因子动量的可持续性，即股票的当期因子和下期收益率之间存在序列相关性，该相关性显著且持续稳定；通过一系列数量化的方法挑选出这些因子，并赋予相应权重，计算股票在这些因子上的综合得分，精选得分高的股票构建投资组合。

本基金通过量化多因子选股模型进行个股精选，充分考虑价值、成长、流动性、动量等十一个因子，并对其进行动态跟踪形成股票超额收益的预测结果。基于多因子模型对股票收益预期的结果，结合组合风险水平、交易成本、流动性等因素进行投资组合优化，构建风险调整后的最优组合。

本基金投资存托凭证的策略依照上述境内上市交易的股票投资策略执行。

## 3、债券投资策略

在债券组合的具体构造和调整上，本基金综合运用久期调整、收益率曲线策略、类属配置等组合管理手段进行日常管理。另外，本基金债券投资将适当运用杠杆策略，通过债券回购融入资金，然后买入收益率更高的债券以获得收益。

## 4、资产支持证券投资策略

对于资产支持证券，本基金将综合考虑市场利率、发行条款、支持资产的构成和质量等因素，研究资产支持证券的收益和风险匹配情况，在严格控制风险的基础上选择投资对象，追求稳定收益。

## 5、股指期货投资策略

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的。本基金管理人将充分考虑股指期货的流动性及风险收益特征，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约进行多头或空头套期保值等策略操作。法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

## 6、权证投资策略

权证为本基金辅助性投资工具，本基金将在控制风险的前提下，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适当参与。

#### 7、中小企业私募债券投资策略

与传统的信用债相比，中小企业私募债券由于以非公开方式发行和转让，普遍具有高风险和高收益的显著特点。本基金对中小企业私募债券的投资将着力分析个券的实际信用风险，并寻求足够的收益补偿，增加基金收益。本基金管理人将对个券信用资质进行详尽的分析，从动态的角度分析发行人的企业性质、所处行业、资产负债状况、盈利能力、现金流、经营稳定性等关键因素，进而预测信用水平的变化趋势，决定投资策略。在流动性风险控制，本基金会将重点放在一级市场，并根据中小企业私募债券整体的流动性情况来调整持仓规模，严格防范流动性风险。

### 四、投资决策和程序

#### 1、决策依据

- (1) 投资决策须符合有关法律、法规和基金合同的规定；
- (2) 投资决策是根据本基金产品的特征决定不同风险资产的配比；
- (3) 投资部策略分析师、固定收益分析师、定量分析师各自独立完成相应的研究报告，为投资策略提供依据。

#### 2、决策程序

本基金采用投资决策委员会领导下的团队式投资管理模式。投资决策委员会定期或不定期就投资管理业务的重大问题进行讨论。基金经理、分析师、交易员在投资管理过程中既密切合作，又责任明确，在各自职责内按照业务程序独立工作并合理地相互制衡。具体的决策流程如下：

(1) 投资决策委员会依据国家有关基金投资方面的法律和行业管理法规，决定公司针对市场环境重大变化所采取的对策；决定投资决策程序和风险控制系统及做出必要的调整；对旗下基金重大投资的批准与授权等。

(2) 投资部门负责人在公司有关规章制度授权范围内，对重大投资进行审查批准；并且根据基金合同的有关规定，在组合业绩比较基准的基础上，制定各组合资产和行业配置的偏差度指标。

(3) 分析师根据宏观经济、货币财政政策、行业发展动向和上市公司基本

面等进行分析，提出宏观策略意见、债券配置策略及行业配置意见。

(4) 定期不定期召开部门例会，基金经理们在充分听取各分析师意见的基础上，确立公司对市场、资产和行业的投资观点，该投资观点是指导各基金进行资产和行业配置的依据。

(5) 基金经理在投资部门负责人授权下，根据部门例会所确定的资产配置策略以及偏差度指标，在充分听取策略分析师宏观配置意见、定量分析师量化模型配置意见及固定收益分析师的债券配置意见的基础上，进行投资组合的资产及证券配置。

(6) 基金经理下达交易指令到交易室进行交易。

(7) 风险管理部负责对投资组合进行事前、事中、事后的风险评估与控制。

(8) 风险管理部负责完成内部基金业绩评估，并完成有关评价报告。

投资决策委员会有权根据市场变化和实际情况的需要，对上述投资管理程序做出调整。

## 五、投资限制

### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

(1) 基金投资组合中股票资产及存托凭证占基金资产的 80%-95%；

(2) 每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；

(3) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；

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

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

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



(7) 本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

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

基金管理人将按照中国金融期货交易所要求的内容、格式与时限向交易所报告所交易和持有的卖出期货合约情况、交易目的及对应的证券资产情况等；

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

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

(11) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

(12) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

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

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

(15) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

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

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

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

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

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

(21) 本基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

(22) 本基金持有单只中小企业私募债券，其市值不得超过本基金资产净值的 10%；

(23) 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该比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

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

(25) 本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行，与境内上市交易的股票合并计算；

(26) 法律法规及中国证监会规定的其他投资比例限制。

除上述第 (2)、(18)、(23)、(24) 项外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。但中国证监会规定的特殊情形除外，法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。期间，本基金的投资范围、投资策略应当符合本基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

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

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

(1) 承销证券；

(2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；

- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- (6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

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他有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先的原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按相关法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

## 六、业绩比较基准

本基金业绩比较基准： $\text{中证500指数收益率} \times 80\% + \text{上证国债指数收益率} \times 20\%$

中证500指数包含了沪深300指数成份股之外的A股市场中流动性较好、代表性较强的中小盘股票，综合反映了沪深市场内中小市值公司的整体情况。上证国债指数是以上海证券交易所上市的所有固定利率国债为样本，按照国债发行量加权而成，是上证指数系列的第一只债券指数。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时，本基金管理人可以与基金托管人协商一致报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告，不需要召开基金份额持有人大会。

## 七、风险收益特征

本基金为股票型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

## 八、基金管理人代表基金行使股东权利和债权人权利的处理原则及方法

- 1、有利于基金资产的安全与增值；
- 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和债权人权利，保护基金份额持有人的利益。

## 九、投资组合报告

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 12 月 23 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止至 2022 年 9 月 30 日（“报告期末”）。

### 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	112,518,052.26	90.61
	其中：股票	112,518,052.26	90.61
2	固定收益投资	4,043.01	0.00
	其中：债券	4,043.01	0.00
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	11,549,539.39	9.30
7	其他资产	103,038.96	0.08
8	合计	124,174,673.62	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	3,975,354.00	3.22
B	采矿业	9,869,005.00	8.00
C	制造业	78,811,927.43	63.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,178,384.00	2.58
E	建筑业	411,312.00	0.33
F	批发和零售业	1,524,896.70	1.24
G	交通运输、仓储和邮政业	4,530,043.00	3.67
H	住宿和餐饮业	205,344.00	0.17
I	信息传输、软件和信息技术服务业	766,352.00	0.62
J	金融业	4,255,262.65	3.45
K	房地产业	3,717,402.00	3.01
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	692,233.00	0.56
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	580,536.48	0.47
S	综合	-	-
	合计	112,518,052.26	91.23

## 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 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	002487	大金重工	71,900	2,882,471.00	2.34
2	300850	新强联	30,190	2,659,739.00	2.16
3	300761	立华股份	72,600	2,658,612.00	2.16
4	600487	亨通光电	136,100	2,477,020.00	2.01

5	600522	中天科技	97,700	2,195,319.00	1.78
6	002594	比亚迪	8,300	2,091,683.00	1.70
7	600256	广汇能源	169,200	2,077,776.00	1.68
8	600188	兖矿能源	40,500	2,031,885.00	1.65
9	300014	亿纬锂能	23,700	2,005,020.00	1.63
10	688800	瑞可达	13,643	1,773,590.00	1.44

#### 4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	4,043.01	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,043.01	0.00

#### 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	127066	科利转债	12	1,382.23	0.00
2	128136	立讯转债	12	1,334.23	0.00
3	128135	洽洽转债	11	1,326.55	0.00

#### 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

本基金投资股指期货根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的。本基金管理人将充分考虑股指期货的流动性及风险收益特征，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约进行多头或空头套期保值等策略操作。法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

## 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

根据本基金合同，本基金暂不投资国债期货。

### 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

根据本基金合同，本基金暂不投资国债期货。

## 11 投资组合报告附注

11.1 报告期内本基金投资的中天科技（600522），因时任董事会秘书、时任副总经理等公司工作人员在机构调研会上透露公司重要业务板块订单量和预测性数据等信息，且公司董事会秘书未勤勉尽责，未能及时发现、阻止上述行为，公司相关信息披露不公平，信息披露管理制度存在缺陷，于2022年1月11日被上海证券交易所予以监管警示。因前期部分会计核算和会计处理存在差错，导致多期定期报告相关财务信息披露不准确，违反了《公开发行证券的公司信息披露编报规则第15号——财务报告的一般规定》、《上海证券交易所股票上市规则》等规定，2022年6月17日上海证券交易所对江苏中天科技股份有限公司及时任财务总监予以监管警示。

对该证券的投资决策程序的说明：公司主营光纤通信和电力传输，在国内率先建成海底光缆完整生产线，拥有海底光缆制造的核心技术，旗下子公司中天科技海缆有限公司是我国第一家拥有完全自主知识产权的海底光缆厂商。经过本基金管理人内部严格的投资决策流程，该证券被纳入本基金的实际投资组合。

其余九名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

11.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	101,976.58
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,062.38
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	103,038.96

### 11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	128136	立讯转债	1,334.23	0.00
2	128135	洽洽转债	1,326.55	0.00

### 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未存在流通受限情况。



## 十、基金的业绩

基金业绩截止日为 2022 年 9 月 30 日。

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

### 一、本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

海富通量化先锋股票 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
2018年2月8日（基金合同生效日）-2018年12月31日	-19.27%	1.08%	-21.22%	1.21%	1.95%	-0.13%
2019年1月1日-2019年12月31日	41.74%	1.19%	22.17%	1.18%	19.57%	0.01%
2020年1月1日-2020年12月31日	47.34%	1.47%	17.57%	1.30%	29.77%	0.17%
2021年1月1日-2021年12月31日	22.35%	1.28%	13.30%	0.78%	9.05%	0.50%
2018年2月8日（基金合同生效日）-2022年9月30日	61.80%	1.32%	5.84%	1.14%	55.96%	0.18%

海富通量化先锋股票 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
2018年2月8	-18.01%	1.08%	-21.22%	1.21%	3.21%	-0.13%

日（基金合同生效日）-2018年12月31日						
2019年1月1日-2019年12月31日	41.19%	1.19%	22.17%	1.18%	19.02%	0.01%
2020年1月1日-2020年12月31日	46.77%	1.47%	17.57%	1.30%	29.20%	0.17%
2021年1月1日-2021年12月31日	21.87%	1.28%	13.30%	0.78%	8.57%	0.50%
2018年2月8日（基金合同生效日）-2022年9月30日	61.92%	1.32%	5.84%	1.14%	56.08%	0.18%

## 二、本基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

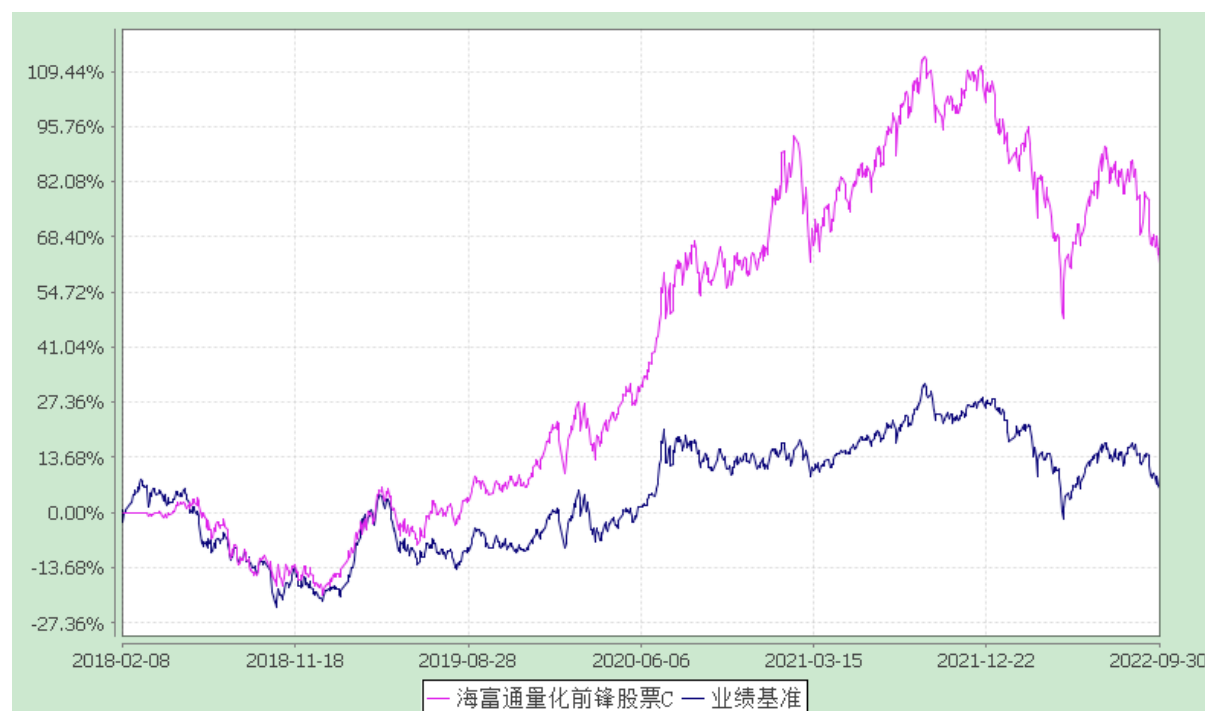
### 1. 海富通量化先锋股票 A

(2018年2月8日至2022年9月30日)



### 2. 海富通量化先锋股票 C

(2018年2月8日至2022年9月30日)



注：本基金合同于2018年2月8日生效。按基金合同规定，本基金自基金合同生效起6个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二部分（二）投资范围、（四）投资限制中规定的各项比例。

## 十一、 基金的财产

### 一、基金资产总值

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

### 二、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### 三、基金财产的账户

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

### 四、基金财产的保管和处分

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

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

## 十二、 基金资产的估值

### 一、 估值日

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

### 二、 估值对象

本基金所拥有的股票、存托凭证、权证、股指期货合约、债券、资产支持证券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

### 三、 估值方法

#### 1、 证券交易所上市的有价证券的估值

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

(2) 交易所上市实行净价交易的债券选取估值日第三方估值机构提供的相应品种对应的估值净价估值，具体估值机构由基金管理人与基金托管人另行协商约定；

(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估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

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

(3) 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估值方法估值；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、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。

4、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。

5、股票指数期货合约估值方法：

(1) 股票指数期货合约一般以估值当日结算价格进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值；

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

(3) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

6、当本基金发生大额申购或赎回情形时，本基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。

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。

8、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基

金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

9、本基金投资存托凭证的估值核算，依照境内上市交易的股票进行。

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

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

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

#### 四、估值程序

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

基金管理人每个工作日计算基金资产净值及各类基金份额的基金份额净值，并按规定公告。

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

#### 五、估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后4位以内(含第4位)发生估值错误时，视为基金份额净值错误。

基金合同的当事人应按照以下约定处理：

##### 1、估值错误类型

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

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

## 2、估值错误处理原则

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

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

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

（4）估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

## 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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



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

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

4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

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

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

(3) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

## 六、暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

3、当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商一致的，基金管理人应当暂停估值；

4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

## 七、基金净值的确认

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

## 八、特殊情况的处理方法

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

2、由于证券交易场所、期货交易所及其登记结算公司发送的数据错误，或由于其他不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

## 十三、 基金的收益分配

### 一、基金利润的构成

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

### 二、基金可供分配利润

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

### 三、基金收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为12次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的10%，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金各类份额默认的收益分配方式是现金分红；本基金不同份额类别基金份额，其分红方式相互独立、互不影响；投资者不同基金交易账户设置的基金分红方式相互独立、互不影响；

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的某一类基金份额净值减去该类份额每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

### 四、收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

由于不同基金份额类别对应的可分配收益不同，基金管理人可相应制定不同的收益分配方案。

### 五、收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

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

### 六、基金收益分配中发生的费用

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

## 十四、 基金的费用与税收

### 一、基金费用的种类

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

### 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起2-5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

#### 2、基金托管人的托管费

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

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

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起2-5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

### 3、基金的销售服务费

本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金份额的资产净值0.4%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.4\% \div \text{当年天数}$$

H为 C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为 C类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计算，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起2-5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人代收，基金管理人收到后再根据相关协议支付给销售机构。

上述“一、基金费用的种类”中第4—10项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

### 三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

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

### 四、基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执

行。

## 十五、 基金的会计与审计

### 一、基金会计政策

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

### 二、基金的年度审计

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



## 十六、 基金的信息披露

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

### 二、信息披露义务人

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

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

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内,将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的全国性报刊(以下简称“指定报刊”)及指定互联网网站(以下简称“指定网站”)等媒介披露,并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

### 三、本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息,不得有下列行为:

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

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

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

## 五、公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

（一）基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议、基金产品资料概要

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

2、基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。《基金合同》生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在指定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。

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

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

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

（二）基金份额发售公告

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

（三）《基金合同》生效公告

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

#### （四）基金净值信息

《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和各类基金份额的基金份额净值。

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各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值。

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

#### （五）基金份额申购、赎回价格

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

#### （六）基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告

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

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

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

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

如报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额20%的情形，为保障其他投资者的权益，基金管理人至少应当在定期报告“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定风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

基金管理人应当在基金年度报告和中期报告中披露基金组合资产情况及其

流动性风险分析等。

#### （七）临时报告

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

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

- 1、基金份额持有人大会的召开及决定的事项；
- 2、《基金合同》终止、基金清算；
- 3、转换基金运作方式、基金合并；
- 4、更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；
- 5、基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；
- 6、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- 7、基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人的实际控制人变更；
- 8、基金募集期延长；
- 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、基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；
- 17、本基金开始办理申购、赎回；
- 18、本基金发生巨额赎回并延期办理；
- 19、本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；
- 20、本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；
- 21、调整基金份额类别；
- 22、发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项；
- 23、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；
- 24、基金信息披露义务人认为可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的其他事项或中国证监会规定的其他事项。

#### （八）澄清公告

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

#### （九）基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

#### （十）清算报告

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

#### （十一）投资股指期货信息披露

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

#### （十二）投资权证信息披露

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

#### （十三）投资中小企业私募债券信息披露

基金管理人在本基金投资中小企业私募债券后两个交易日内，在中国证监会指定媒介披露所投资中小企业私募债券的名称、数量、期限、收益率等信息。

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

#### （十四）投资资产支持证券信息披露

基金管理人应在基金年度报告及中期报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细。

基金管理人应在基金季度报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期末按市值占基金净资产比例大小排序的前 10 名资产支持证券明细。

#### （十五）投资于存托凭证的信息披露

本基金投资存托凭证的信息披露依照境内上市交易的股票执行。

#### （十六）中国证监会规定的其他信息。

## 六、信息披露事务管理

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

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

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

#### **七、信息披露文件的存放与查阅**

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

八、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。

## 十七、 风险揭示

### 一、投资于本基金的主要风险有：

#### （一） 本基金特有的风险

1. 本基金为股票型证券投资基金，基金资产主要投资于股票市场，因此股市的波动将影响到基金业绩及持有人回报。本基金的股票资产及存托凭证占基金资产的 80%-95%，受到股市系统性风险的影响较大，无法完全规避市场整体下跌风险和个股下跌风险，基金净值可能受到影响。本基金坚持价值和长期投资理念，重视股票投资风险的防范，但是基于投资范围的规定，本基金的波动性可能较高，面临的市场风险较大。

2. 本基金基于量化模型进行股票投资决策，量化模型投资方法有别于传统的价值分析投资方法。一方面，面对不断变换的市场环境，量化投资策略所遵循的模型理论均处于不断发展和完善的过程中；另一方面，在量化模型的实际运用中，核心参数假定的变动均可能影响整体效果的稳定性；最后，定量模型存在对历史数据的依赖。因此，在实际运用过程中，遵循量化模型构建的投资组合在一定程度上可能无法达到预期的投资效果。

#### 3. 科创板特有风险

本基金可投资于科创板股票，与之相关的风险主要包括：

##### （1） 市场风险

科创板个股集中来自新一代信息技术、高端装备、新材料、新能源、节能环保及生物医药等高新技术和战略新兴产业领域。大多数企业为初创型公司，企业未来盈利、现金流、估值均存在不确定性，与传统二级市场投资存在差异，整体投资难度加大，个股市场风险加大。

科创板个股上市前五日无涨跌幅限制，第六日开始涨跌幅限制在正负 20% 以内，个股波动幅度较其他股票加大，市场风险随之上升。

##### （2） 流动性风险

科创板整体投资门槛较高，个人投资者必须满足交易满两年并且资金在 50 万以上才可参与，二级市场上个人投资者参与度相对较低，机构持有个股大量流



通盘导致个股流动性较差，基金组合存在无法及时变现及其他相关流动性风险。

### （3）信用风险

科创板试点注册制，对经营状况不佳或财务数据造假的企业实行严格的退市制度，科创板个股存在退市风险。

### （4）集中度风险

科创板为新设板块，初期可投标的较少，投资者容易集中投资于少量个股，市场可能存在高集中度状况，整体存在集中度风险。

### （5）系统性风险

科创板企业均为市场认可度较高的科技创新企业，在企业经营及盈利模式上存在趋同，所以科创板个股相关性较高，市场表现不佳时，系统性风险将更为显著。

### （6）政策风险

国家对高新技术产业扶持力度及重视程度的变化会对科创板企业带来较大影响，国际经济形势变化对战略新兴产业及科创板个股也会带来政策影响。

### （7）退市风险

科创板上市公司退市制度设计较主板市场更为严格、退市时间更短、退市速度更快，与主板市场相比，可能导致科创板市场上市公司退市的情形更多，退市速度可能更快，退市以后可能面临股票无法交易的情况，购买该公司股票的投资者将可能面临本金全部损失的风险。

4. 本基金在开放日可能出现巨额赎回，导致基金资产变现困难，出现延期赎回或暂停赎回的风险。

## （二）市场风险

基金主要投资于证券市场，而证券市场价格因受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响而产生波动，从而导致基金收益水平发生变化，产生风险。主要的风险因素包括：

1. 政策风险。因财政政策、货币政策、产业政策、地区发展政策等国家宏观政策发生变化，导致市场价格波动，影响基金收益而产生风险。

2. 经济周期风险。随着经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化，基金投资的收益水平也会随之变化，从而产生风险。

3. 利率风险。金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。

利率直接影响着债券的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。基金投资于债券和股票，其收益水平可能会受到利率变化的影响。

4. 上市公司经营风险。上市公司的经营状况受多种因素的影响，如管理能力、行业竞争、市场前景、技术更新、财务状况、新产品研究开发等都会导致公司盈利发生变化。如果基金所投资的上市公司经营不善，其股票价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，使基金投资收益下降。上市公司还可能出现难以预见的变化。虽然基金可以通过投资多样化来分散这种非系统风险，但不能完全避免。特别地，如果上市公司涉嫌财务操纵、内幕交易、关联交易等情形，或被监管部门处罚，将严重损害持有人利益。

5. 购买力风险。基金投资的目的是基金资产的保值增值，如果发生通货膨胀，基金投资于证券所获得的收益可能会被通货膨胀抵消，从而影响基金资产的保值增值。

### （三）信用风险

当基金持有的债券、票据的发行人违约，不按时偿付本金或利息时，或交易对手违约时，将直接导致资产的损失，产生信用风险。本基金面临的信用风险包括：

（1）违约风险：债券或票据发行人不能按时履行其偿付本息和利息的义务，或回购交易中融资方违约无法按时支付回购本金和利息所带来的违约风险；

（2）降级风险：由于债券或票据发行人的基本面发生不利变化，导致其财务状况恶化、偿债能力降低等原因，信用评级机构调低债券及发行人信用等级的风险，从而导致债券价格下降的风险；

（3）信用利差风险：信用利差风险是指信用类债券当前的价格不合理，没有真实反映发行人的信用利差水平，并由此导致的预期信用利差放大从而债券价格下跌的风险；

（4）交易对手风险：在债券、票据、债券回购或协议存款的交易过程中，由于交易对手方不能足额按时交割，导致本基金可能无法收到或足额收到应得的证券或价款而产生损失，或导致基金不能及时抓住市场机会，对投资收益产生影响。

### （四）管理风险

基金管理人的专业技能、研究能力及投资管理水平直接影响到其对信息的占

有、分析和对经济形势、证券价格走势的判断，进而影响基金的投资收益水平。同时，基金管理人的投资管理制度、风险管理和内部控制制度是否健全，能否有效防范道德风险和其他合规性风险，以及基金管理人的职业道德水平等，也会对基金的风险收益水平造成影响。

#### **（五） 流动性风险**

我国证券市场作为新兴转轨市场，市场整体流动性风险较高。基金投资组合中的股票和债券会因各种原因面临较高的流动性风险，使证券交易的执行难度提高，买入成本或变现成本增加。此外，基金投资者的赎回需求可能造成基金仓位调整和资产变现困难，加剧流动性风险。

为了克服流动性风险，本基金将在坚持分散化投资和精选个股原则的基础上，通过一系列风险控制指标加强对流动性风险的跟踪、防范和控制，但基金管理人并不保证完全避免此类风险。

#### **（六） 操作和技术风险**

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

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

#### **（七） 合规性风险**

指基金管理或运作过程中，违反国家法律、法规或基金合同有关规定的风险。

#### **（八） 收益率曲线风险**

收益率曲线风险是指与债券收益率曲线非平行移动有关的风险。本基金投资涉及债券收益率曲线策略，由于久期等指标对利率风险的衡量是建立在收益率曲线只发生平行位移的前提下，但收益率曲线可能会发生扭曲或蝶形等非平行变化，并导致久期等指标无法全面反映利率风险的真实水平。久期相同的货币市场工具组合若期限结构配置不同，则其收益率水平在收益率曲线发生非平行位移时会产生较大的差异。

#### **（九） 杠杆放大风险**

本基金或采用杠杆操作、息差放大的投资策略，市场风险、信用风险、流动

性风险、操作风险均会相应增加，特别是，当收益率的实际走势与预期走势相反的情况下，市场出现融资的成本高于买入的债券的收益率，杠杆放大从而导致委托资产净值出现较大的损失。

#### （十） 资产支持证券风险

本基金投资品种包含资产支持证券品种，由于资产支持证券一般都针对特定机构投资者发行，且仅在特定机构投资者范围内流通转让，该品种的流动性较差，且抵押资产的流动性较差，因此，持有资产支持证券可能给组合资产净值带来一定的风险。另外，资产支持证券还面临提前偿还和延期支付的风险。

#### （十一） 存托凭证特有风险

本基金投资存托凭证在承担境内上市交易股票投资的共同风险外，还将承担与存托凭证、创新企业发行、境外发行人以及交易机制相关的特有风险，具体包括但不限于以下风险：

##### （1）与存托凭证相关的风险

1) 存托凭证是新证券品种，由存托人签发、以境外证券为基础在中国境内发行，代表境外基础证券权益。存托凭证持有人实际享有的权益与境外基础证券持有人的权益虽然基本相当，但不能等同于直接持有境外基础证券。

2) 基金买入或者持有红筹公司境内发行的存托凭证，即被视为自动加入存托协议，成为存托协议的当事人。存托协议可能通过红筹公司和存托人商议等方式进行修改，基金无法单独要求红筹公司或者存托人对存托协议作出额外修改。

3) 基金持有红筹公司存托凭证，不是红筹公司登记在册的股东，不能以股东身份直接行使股东权利；基金仅能根据存托协议的约定，通过存托人享有并行使分红、投票等权利。

4) 存托凭证存续期间，存托凭证项目内容可能发生重大、实质变化，包括但不限于存托凭证与基础证券转换比例发生调整、红筹公司和存托人可能对存托协议作出修改，更换存托人、更换托管人、存托凭证主动退市等。部分变化可能仅以事先通知的方式，即对基金生效。基金可能无法对此行使表决权。

5) 存托凭证存续期间，对应的基础证券等财产可能出现被质押、挪用、司法冻结、强制执行等情形，基金可能存在失去应有权利的风险。

6) 存托人可能向存托凭证持有人收取存托凭证相关费用。

7) 存托凭证退市的，基金可能面临存托人无法根据存托协议的约定卖出基

础证券，基金持有的存托凭证无法转到境内其他市场进行公开交易或者转让，存托人无法继续按照存托协议的约定为基金提供相应服务等风险。

#### (2) 与创新企业发行相关的风险

创新企业证券首次公开发行的价格可能高于公司每股净资产账面值，或者高于公司在境外其他市场公开发行的股票或者存托凭证的发行价格或者二级市场交易价格。

#### (3) 与境外发行人相关的风险

1) 红筹公司在境外注册设立，其股权结构、公司治理、运行规范等事项适用境外注册地公司法等法律法规的规定；已经在境外上市的，还需要遵守境外上市地相关规则。投资者权利及其行使可能与境内市场存在一定差异。此外，境内股东和境内存托凭证持有人享有的权益还可能受境外法律变化影响。

2) 红筹公司可能仅在境内市场发行并上市较小规模的股票或者存托凭证，公司大部分或者绝大部分的表决权由境外股东等持有，境内投资者可能无法实际参与公司重大事务的决策。

3) 红筹公司存托凭证的境内投资者可以依据境内《证券法》提起证券诉讼，但境内投资者无法直接作为红筹公司境外注册地或者境外上市地的投资者，依据当地法律制度提起证券诉讼。

#### (4) 与交易机制相关的风险

1) 境内外市场证券停复牌制度存在差异，红筹公司境内外上市的股票或者存托凭证可能出现在一个市场正常交易而在另一个市场实施停牌等现象。

2) 红筹公司在境外上市股票或存托凭证的价格可能因基本面变化、第三方研究报告观点、境内外交易机制差异、异常交易情形、做空机制等出现较大波动，可能对境内证券价格产生影响。

3) 在境内法律及监管政策允许的情况下，红筹公司现在及将来境外发行的股票可能转移至境内市场上市交易，或者公司实施配股、非公开发行、回购等行为，从而增加或者减少境内市场的股票或者存托凭证流通数量，可能引起交易价格波动。

4) 基金持有的红筹公司境内发行的证券，暂不允许转换为公司在境外发行的相同类别的股票或者存托凭证；基金持有境内发行的存托凭证，暂不允许转换为境外基础证券。

## （十二） 股指期货风险

本基金以套期保值为主要目的或投资股指期货，所面临的特定风险主要有：

（1）杠杆风险。股指期货交易采用保证金交易方式，由于高杠杆特征，潜在损失可能成倍放大。

（2）到期日风险。股指期货合约到期时，交易所将按照交割结算价将基金持有的股指期货合约进行现金交割，届时股指期货合约持有者将无法继续持有到期合约。另外，期货交割日可能会出现期货合约与现货指数不完全收敛，或基差向不利方向变动，影响套利收益。

（3）保证金追加风险。在套利过程中，股指期货市场的变动可能会造成保证金不足，引发股指期货合约的强行平仓，由于强行平仓价格的不确定性，可能会造成收益率的减小甚至本金的损失。在极端情况下，由于市场向不利方向运行，或保证金比例临时大幅提高，导致出现保证金不足、又未能在规定的时间内补足，或因其他原因导致中国金融期货交易所对结算会员（也即期货公司）下的经纪账户强行平仓时，基金资产可能因被连带强行平仓而遭受损失。

（4）盯市结算风险。股指期货采取保证金交易，保证金账户实行当日无负债结算制度，对资金管理要求较高。假如市场走势对本基金财产不利，期货经纪公司会按照期货经纪合同约定的时间和方式通知基金管理人追加保证金，以使资产管理计划财产能继续持有未平仓合约。如出现极端行情，市场持续向不利方向波动导致期货保证金不足，又未能在规定时间内补足，按规定保证金账户将被强制平仓，甚至已缴付的所有保证金都不能弥补损失，从而导致超出预期的损失。

（5）套利策略的风险。套利组合建立时，首先，有冲击成本对预期收益率的影响；其次，遇到指数成分股停牌，需要重新迅速调整组合结构；沪深 300 指数成分会定期调整，套利组合合理应作相对的调整；最后，套利运行过程中，成分股个体行为（配股、分拆、合并）导致权重变化，需要及时调整组合持仓。这些都会导致基差的存在。如发生基差向不利方向变动、套利模型错误、由于流动性不足导致市场冲击成本过大或者股指期货部分被强行平仓或强行减仓而无法继续持有，都将影响套利策略的效率，极端情况下可导致套利失败。

（6）无法平仓的风险。假如市场剧烈变化的情况下，基金管理人可能难以或无法将持有的未平仓合约平仓，例如市场达到涨跌停板或现货组合因停牌等情况无法卖出。

(7) 强行减仓的风险。在极端情况下，基金持有的期货合约可能被期货交易所强行减仓，从而使得基金无法继续持有股指期货合约，从而导致套利失败。

### (十三) 投资中小企业私募债券的风险

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

### (十四) 其他风险

1、本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险

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

2、因基金业务快速发展而在制度建设、人员配备、风险管理和内控制度等方面不完善而产生的风险；

3、因金融市场危机、行业竞争压力可能产生的风险；

4、战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，可能严重影响证券市场运行，导致基金资产损失；

5、其他意外导致的风险。

### (十五) 流动性风险评估

#### (1) 基金申购、赎回安排

基金管理人自基金合同生效之日起不超过三个月开始办理申购、赎回，开放日为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。因此，投资者

可能面临基金暂停申购及赎回的风险。此外，在本基金发生巨额赎回情形时，基金持有人还可能面临延期赎回或暂停赎回的风险。

### （2）投资市场、行业及资产的流动性风险评估

本基金为股票型基金，以开放方式运作。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、债券（包括国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、短期融资券、超级短期融资券、中期票据、地方政府债、中小企业私募债及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。基金的投资组合比例为：股票资产及存托凭证占基金资产的80%-95%。从A股市场的历史停牌及成交情况来看，流动性情况总体可控。在其他可投资标的中，利率债和高信用评级短期融资券、银行存款等金融工具的流动性情况相对较好，低信用评级次级债等金融工具的流动性情况相对较差；但由于市场利率环境的变化，发行主体信用资质的恶化等各方面原因也可能导致部分信用债、资产支持证券等品种面临流动性相对较差的情况。

根据《流动性管理规定》，基金管理人需根据基金投资人结构调整基金投资组合的流动性及变现情况，确保基金组合资产的变现能力与投资者赎回需求相匹配。基金管理人将密切监控投资组合流动性风险指标，及时调整组合持仓结构，严格控制组合杠杆比率，限制流通受限资产比例等。

### （3）巨额赎回下的流动性风险管理措施

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

当本基金发生巨额赎回且现金类资产不足以支付赎回款项时，基金管理人将在充分评估基金组合资产变现能力、投资比例变动与基金单位份额净值波动的基础上，审慎接受、确认赎回申请。当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的



10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的该类基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。若基金发生巨额赎回，在出现单个基金份额持有人超过基金总份额 20%的赎回申请（简称“大额赎回申请人”）情形下，基金管理人应当延期办理赎回申请。基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额 10%的前提下，优先确认其他赎回申请人（简称“小额赎回申请人”）的赎回申请：若小额赎回申请人的赎回申请在当日予以全部确认，则基金管理人在仍可接受赎回申请的范围内对大额赎回申请人的赎回申请按比例确认，对大额赎回申请人未予确认的赎回申请延期办理；若小额赎回申请人的赎回申请在当日未予全部确认，则对未确认的赎回申请（含小额赎回申请人的其余赎回申请与大额赎回申请人的全部赎回申请）延期办理。具体可见《招募说明书》“八 基金份额的申购与赎回”中“十一、巨额赎回的情形及处理方式”的相关内容。

（4）实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响  
本基金在面临大规模赎回的情况下有可能因为无法变现造成流动性风险。

如果出现流动性风险，基金管理人经与基金托管人协商，在确保投资者得到公平对待的前提下，可实施备用的流动性风险管理工具，包括但不限于暂停接受赎回申请、延期办理巨额赎回申请、延缓支付赎回款项、暂停估值、收取短期赎回费、摆动定价等，作为特定情形下基金管理人流动性风险管理的辅助措施，同时基金管理人应时刻防范可能产生的流动性风险，对流动性风险进行日常监控，保护持有人的利益。当实施备用的流动性风险管理工具时，有可能无法按合同约定的时限支付赎回款项，或增加赎回成本。

## 二、声明

- 1、投资人投资于本基金，须自行承担投资风险；
- 2、除基金管理人直接办理本基金的销售外，本基金还通过其他基金销售机构销售，基金管理人与基金销售机构都不能保证其收益或本金安全。

## 十八、 基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### 一、《基金合同》的变更

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

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

### 二、《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

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

### 三、基金财产的清算

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

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

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

#### 4、基金财产清算程序：

- (1) 《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；

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

5、基金财产清算的期限为6个月。

#### 四、清算费用

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

#### 五、基金财产清算剩余资产的分配

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

#### 六、基金财产按下列顺序清偿：

- (1) 支付清算费用；
- (2) 交纳所欠税款；
- (3) 清偿基金债务；
- (4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款(1)－(3)项规定清偿前，不得分配给基金份额持有人。

#### 七、基金财产清算的公告

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

5个工作日内由基金财产清算小组进行公告，基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。。

#### 八、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。

## 十九、 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

#### (一) 基金份额持有人的权利与义务

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

同一类别的每份基金份额具有同等的合法权益。

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

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

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

- (1) 认真阅读并遵守《基金合同》、招募说明书等信息披露文件；
- (2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；
- (3) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；

- (4) 缴纳基金认购、申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；
- (5) 在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；
- (6) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；
- (7) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- (8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## (二) 基金管理人的权利与义务

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

- (1) 依法募集资金；
- (2) 自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
- (3) 依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- (4) 销售基金份额；
- (5) 召集基金份额持有人大会；
- (6) 依据《基金合同》及有关法律规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- (7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- (8) 选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；
- (9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；
- (10) 依据《基金合同》及有关法律规规定决定基金收益的分配方案；
- (11) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；
- (12) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东与债权人权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

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

(14) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券、期货经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；

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

(16) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

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

(2) 办理基金备案手续；

(3) 自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；

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

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

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

(7) 依法接受基金托管人的监督；

(8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回的价格；

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(10) 编制季度报告、中期报告和年度报告；

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

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

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

(14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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



- (25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- (26) 建立并保存基金份额持有人名册；
- (27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

### (三) 基金托管人的权利与义务

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

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

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

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

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

(5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

(6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

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

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

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

- (5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
- (6) 按规定开设基金财产的资金账户、证券账户、期货账户等投资所需账户，按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
- (7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；
- (8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、各类基金份额的基金份额净值、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；如果基金管理人未执行《基金合同》规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；
- (11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；
- (12) 建立并保存基金份额持有人名册；
- (13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
- (14) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；
- (15) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
- (16) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；
- (17) 参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- (18) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人；
- (19) 因违反《基金合同》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- (20) 按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义

务，基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿；

- (21) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- (22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务

## 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组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

本基金份额持有人大会暂不设立日常机构。在本基金存续期内，基金份额持有人大会可以设立日常机构，日常机构的设立与运作应当根据相关法律法规和中国证监会的规定进行。

### (一) 召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

- (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) 调整基金管理人、基金托管人的报酬标准或调高销售服务费，但法律法规要求调整该等报酬标准或调高销售服务费的除外；
- (6) 变更基金类别；
- (7) 本基金与其他基金的合并；
- (8) 变更基金投资目标、范围或策略，但法律法规和中国证监会另有规定的除外；
- (9) 变更基金份额持有人大会程序；
- (10) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- (11) 单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；

(12) 对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

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

2、在符合法律法规及本基金合同规定、并且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

(1) 调低销售服务费；

(2) 法律法规要求增加的基金费用的收取；

(3) 调整本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式、调整基金份额类别；

(4) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；

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

(6) 基金管理人、销售机构、登记机构调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则；

(7) 在中国证监会允许的范围内推出新业务或服务；

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

## (二) 会议召集人及召集方式

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

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。

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

60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集，并自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

4、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求

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

5、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

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

（三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

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

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

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

#### （四）基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式或通讯开会方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

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

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

（2）经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的 1/2（含 1/2）。

参加基金份额持有人大会的基金份额持有人的基金份额低于上述规定比例的，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会，应当有代表 1/3 以上（含 1/3）基金份额的基金份额持有人或其代理人参加，方可召开。

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

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

（1）会议召集人按《基金合同》约定公布会议通知后，在 2 个工作日内连

续公布相关提示性公告；

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

(3) 本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的 1/2（含 1/2）；

若本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会，应当有代表 1/3 以上（含 1/3）基金份额的基金份额持有人或其代理人参加，方可召开。

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

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

#### （五）议事内容与程序

##### 1、议事内容及提案权

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

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

## 2、议事程序

### (1) 现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的 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。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

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

### (2) 通讯开会

在通讯开会的情况下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后 2 个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

### (六) 表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1、一般决议，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的 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或其代理人所持表决权的 2/3 以上（含 2/3）通过方可做出。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》、与其他基金合并以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交



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

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

### （七）计票

#### 1、现场开会

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

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

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

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

#### 2、通讯开会

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

### （八）生效与公告

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

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

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

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

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

### 三、基金合同的变更、终止与基金财产的清算方式

#### （一）《基金合同》的变更

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

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

#### （二）《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

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

### （三）基金财产的清算

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

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

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

#### 4、基金财产清算程序：

- （1）《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；
- （2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- （3）对基金财产进行估值和变现；
- （4）制作清算报告；
- （5）聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- （6）将清算报告报中国证监会备案并公告；
- （7）对基金财产进行分配。

#### 5、基金财产清算的期限为 6 个月。

### （四）清算费用

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

### （五）基金财产清算剩余资产的分配

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

### （六）基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国

证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算小组进行公告，基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。。

(七) 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。

#### 四、争议解决方式

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会按照其届时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

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

《基金合同》受中国法律管辖。

#### 五、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

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

## 二十、 基金托管协议的内容摘要

### 一、 托管协议当事人

#### (一) 基金管理人

名称：海富通基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 36-37 层

法定代表人：杨仓兵

成立时间：2003 年 4 月 18 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监基字[2003]48 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：3 亿元人民币

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务

存续期间：持续经营

#### (二) 基金托管人

名称：中国银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街1号

法定代表人：刘连舸

成立时间：1983年10月31日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整

经营范围：吸收人民币存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；从事同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱服务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；发行和代理发

行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代客外汇买卖；外汇信用卡的发行和代理国外信用卡的发行及付款；资信调查、咨询、见证业务；组织或参加银团贷款；国际贵金属买卖；海外分支机构经营与当地法律许可的一切银行业务；在港澳地区的分行依据当地法令可发行或参与代理发行当地货币；经中国人民银行批准的其他业务。

存续期间：持续经营

## 二、 基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

（一）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对基金管理人的下列投资运作进行监督：

1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、债券（包括国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、短期融资券、超级短期融资券、中期票据、地方政府债、中小企业私募债及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。

基金的投资组合比例为：股票资产及存托凭证占基金资产的80%-95%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；股指期货及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

基金管理人应将拟投资的股票库、债券库等各投资品种的具体范围及时提供给基金托管人。基金管理人可以根据实际情况的变化，对各投资品种的具体范围予以更新和调整，并及时通知基金托管人。基金托管人根据上述投资范围对基金的投资进行监督；

2、对基金投融资比例进行监督；

（1）基金投资组合中股票资产及存托凭证占基金资产的80%-95%；

（2）每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保

留的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；

(3) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的10%；

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

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

(6) 本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的95%；其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

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

(8) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应占基金资产的80%-95%；

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

(10) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的3%；

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

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

(13) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的20%；

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

(15) 本基金应投资于信用级别评级为BBB以上（含BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级

报告发布之日起3个月内予以全部卖出；

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

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

(18) 本基金总资产不得超过基金净资产的140%；

(19) 本基金持有单只中小企业私募债券，其市值不得超过本基金资产净值的10%；

(20) 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该比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(21) 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；

(22) 本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行，与境内上市交易的股票合并计算；

(23) 法律法规及中国证监会规定的其它投资比例限制。

除上述第(2)、(15)、(20)、(21)项外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整。但中国证监会规定的特殊情形除外，法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。期间，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

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

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

（二）基金托管人应根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金资产净值计算、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复核。

（三）基金托管人在上述第（一）、（二）款的监督和核查中发现基金管理人违反上述约定，应及时提示基金管理人，基金管理人收到提示后应及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函并改正。在限期内，基金托管人有权随时对提示事项进行复查。基金管理人对基金托管人提示的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应及时向中国证监会报告。

（四）基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律法规、本协议的规定，应当拒绝执行，及时提示基金管理人，并依照法律法规的规定及时向中国证监会报告。基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律法规、本协议规定的，应当及时提示基金管理人，并依照法律法规的规定及时向中国证监会报告。

（五）基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查，包括但不限于：在规定时间内答复基金托管人并改正，就基金托管人的疑义进行解释或举证，提供相关数据资料和制度等。

### 三、基金管理人对基金托管人的业务核查

1、在本协议的有效期内，在不违反公平、合理原则以及不妨碍基金托管人遵守相关法律法规及其行业监管要求的基础上，基金管理人有权对基金托管人履行本协议的情况进行必要的核查，核查事项包括但不限于基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户、证券账户和期货账户等投资所需账户、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、基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、无正当理由未执行或延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反法律法规、《基金合同》及本协议有关规定时，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正，基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金管理人发出回函。在限期内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应依照法律法规的规定报告中国证监会。

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

#### 四、基金财产的保管

##### （一）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，未经基金管理人的合法合规指令或法律法规、《基金合同》及本协议另有规定，不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。
- 3、基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户、证券账户和期货结算账户等投资所需账户。
- 4、基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立。
- 5、除依据《基金法》、《运作办法》、《基金合同》及其他有关法律法规规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

##### （二）基金合同生效前募集资金的验资和入账

1、基金募集期满或基金管理人宣布停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定的，由基金管理人在法定期限内聘请具有从事相关业务资格的会计师事务所对基金进行验资，并出具验资报告，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。

2、基金管理人应将属于本基金财产的全部资金划入在基金托管人处为本基金开立的基金银行账户中，并确保划入的资金与验资确认金额相一致。

### （三）基金的银行账户的开设和管理

1、基金托管人应负责本基金的银行账户的开设和管理。

2、基金托管人以本基金的名义开设本基金的银行账户。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。本基金的一切货币收支活动,包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益、收取申购款,均需通过本基金的银行账户进行。

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

4、基金银行账户的管理应符合法律法规的有关规定。

### （四）基金进行定期存款投资的账户开设和管理

基金管理人以基金名义在基金托管人认可的存款银行的指定营业网点开立存款账户,基金托管人负责该账户银行预留印鉴的保管和使用。在上述账户开立和账户相关信息变更过程中,基金管理人应提前向基金托管人提供开户或账户变更所需的相关资料。

### （五）基金证券账户、结算备付金账户及其他投资账户的开设和管理

1、基金托管人应当代表本基金,以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司开设证券账户。

2、本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或转让本基金的证券账户,亦不得使用本基金的证券账户进行本基金业务以外的活动。

3、基金托管人以自身法人名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户,用于办理基金托管人所托管的包括本基金在内的全部基金在证券、期货交易所进行证券、期货投资所涉及的资金结算业务。结算备付金的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

4、在本托管协议生效日之后,本基金被允许从事其他投资品种的投资业务的,涉及相关账户的开设、使用的,若无相关规定,则基金托管人应当比照并遵守上述关于账户开设、使用的规定。

### （六）债券托管专户的开设和管理

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和银行间市场清算所股份有限公司开设银行间债券市场债券托管账户，并代表基金进行银行间债券市场债券和资金的清算。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报备。

#### （七）基金财产投资的有关有价凭证的保管

基金财产投资的实物证券、银行定期存款存单等有价凭证由基金托管人负责妥善保管。基金托管人对其以外机构实际有效控制的有价凭证不承担责任。

#### （八）与基金财产有关的重大合同及有关凭证的保管

基金托管人按照法律法规保管由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同及有关凭证。基金管理人代表基金签署有关重大合同后应在收到合同正本后30日内将一份正本的原件提交给基金托管人。除本协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时应当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。重大合同由基金管理人与基金托管人按规定各自保管至少15年。

### 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。某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数后的价值。

2、基金管理人应每个工作日对基金财产估值。估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算业务指引》及其他法律法规的规定。用于基金信息披露的基金净值信息由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个工作日结束后计算得出当日的各类基金份额净值，并在盖章后以双方约定的方式发送给基金托管人。基金托管人应对净值计算结果进行复核，并以双方约定的方式将复核结果传送给基金管理人，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

3、当相关法律法规或《基金合同》规定的估值方法不能客观反映基金财产公允价值时，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

4、基金管理人、基金托管人发现基金估值违反《基金合同》订明的估值方法、程序以及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，双方应及时进行协商和纠正。

5、当基金资产的估值导致基金份额净值小数点后四位内（含第四位）发生

差错时，视为基金份额净值估值错误。当基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当计价错误达到基金份额净值的0.25%时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；当计价错误达到基金份额净值的0.5%时，基金管理人应当及时进行公告。如法律法规或监管机关对前述内容另有规定的，按其规定处理。

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

7、由于证券交易所、期货交易所及其登记结算公司发送的数据错误，或由于其他不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

8、如果基金托管人的复核结果与基金管理人的计算结果存在差异，且双方经协商未能达成一致，基金管理人可以按照其对基金份额净值的计算结果对外予以公布，基金托管人可以将相关情况报中国证监会备案。

## 六、基金份额持有人名册的登记与保管

### （一）基金份额持有人名册的内容

基金份额持有人名册的内容包括但不限于基金份额持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册包括以下几类：

- 1、基金募集期结束时的基金份额持有人名册；
- 2、基金权益登记日的基金份额持有人名册；
- 3、基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册；
- 4、每半年度最后一个交易日的基金份额持有人名册。

### （二）基金份额持有人名册的提供

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

### （三）基金份额持有人名册的保管

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

## 七、托管协议的终止与修改

### （一）托管协议的变更

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行变更。变更后的新协议，其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突。变更后的新协议应当报中国证监会备案。

### （二）托管协议的终止

发生以下情况，本托管协议应当终止：

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

### （三）基金财产的清算

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

## 二十一、对基金份额持有人的服务

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

### 一、资料发送服务

基金管理人负责向通过基金管理人的直销中心认购或申购本基金的基金份额持有人发送相关资料，基金销售机构将负责向通过其销售网点认购或申购本基金的基金份额持有人发送相关资料。

#### 1. 投资人对账单服务：

基金份额持有人可通过以下方式查阅对账单：

- 1) 基金份额持有人可登陆本基金管理人的网站账户自动查询系统查阅对账单。
- 2) 基金份额持有人可通过网站、电话等方式向本基金管理人定制定期电子对账单，每月度、季度、年度结束后 15 个工作日内由客户服务中心向选择电子对账单服务的基金份额持有人发送电子对账单。
- 3) 基金份额持有人也可拨打基金管理人客服热线索取纸质对账单，亦可通过销售机构网点进行查询。

#### 2. 其他相关的信息资料

不定期的法律法规宣传、市场评论，产品推荐等。

### 二、红利再投资服务

本基金收益分配时，基金份额持有人可以选择将当期分配所得的红利再投资于本基金，登记机构将基金份额持有人所获现金红利按除权日经除权后的基金份额净值自动转为基金份额。红利再投资免收申购费用。

### 三、在线服务

通过基金管理人网站、微信及 APP 的在线客服、客服信箱，投资人可以实现咨询、投诉、建议和寻求各种帮助。

网站提供了基金公告、公司动态、基金常识等各种信息，投资人可以根据各

自的使用习惯自行查询或定制。

基金管理人为现有投资人提供了基金账户查询、交易明细查询、对账单发送方式设置、修改查询密码等服务。

#### 四、资讯服务

投资人如果了解申购和赎回等交易情况、基金账户余额、基金产品与服务等信息，请拨打基金管理人客户服务中心电话或登录公司网站进行咨询、查询。

##### 1、客户服务电话

全国统一客户服务号码：40088-40099（免长途话费）

传真：021-50479997

##### 2、互联网站

基金管理人网址：<http://www.hftfund.com>

电子信箱：[info@hftfund.com](mailto:info@hftfund.com)

##### 3、官方微信服务号：fund\_hft

#### 五、投诉和建议受理

投资者可以通过基金管理人提供的客户服务电话、在线客服、书信、电子邮件、传真等渠道对基金管理人和销售机构所提供的服务进行投诉或提出建议。投资者还可以通过代销机构的服务电话对该代销机构提供的服务进行投诉或提出建议。

**六、如本招募说明书存在任何您/贵机构无法理解的内容，请通过上述方式联系基金管理人。请确保投资前，您/贵机构已经全面理解了本招募说明书。**



## 二十二、 其他应披露事项

### 一、基金登记机构

#### 1. 委托与更换程序

基金管理人委托中国证监会认定的机构办理本基金的登记业务。基金管理人委托上述机构办理登记业务，应与其签订委托代理协议，以明确基金管理人与其在投资人基金账户管理、基金份额登记过户、基金清算和交收、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和非交易过户等事宜中的权利和义务，保护基金投资人和基金份额持有人的合法权益。

登记机构的更换程序：

(1) 提名：由基金管理人提名。

(2) 备案：新任登记机构报中国证监会审查资格并备案后，原任登记机构方可退任。

(3) 公告：基金登记机构更换，由基金管理人在更换前 30 个工作日在指定媒体上公告。

(4) 交接：原基金登记机构应做出处理基金登记事务的报告，并与新任基金登记机构完成业务移交手续，向新任基金登记机构提交完整的书面材料和电子数据；新任基金登记机构与基金管理人核对全部基金份额持有人账户资料，确保准确无误；在业务移交后，原基金登记机构仍有义务保留本基金正式移交日之前的登记业务的全部资料和电子数据一年，并有义务在该期限内协助新任基金登记机构处理有关问题，保障基金份额持有人的合法权益；如因原基金登记机构业务移交产生的问题，原基金登记机构仍有协助解决之义务。

**2. 基金管理人现时委托中国证券登记结算有限责任公司办理本基金的登记业务。**

#### 3. 基金登记机构概况

基金登记机构：中国证券登记结算有限责任公司

法定代表人：于文强

注册资本：100 亿元

注册地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

组织形式：有限责任公司

营业期限：长期

中国证券登记结算有限责任公司是经国务院同意、中国证券监督管理委员会批准，在国家工商行政管理局注册登记的中国唯一的证券登记结算机构。由上海证券交易所、深圳证券交易所共同出资组建，公司设在北京。

公司实行董事会领导下的总经理负责制，设有 5 个部门和 2 个分公司，分别是综合管理部、登记托管部、结算部、技术部、业务发展部、中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司。

中国证券监督管理委员会是公司主管部门，公司业务接受中国证券监督管理委员会的监管。

公司经营范围：

- (1) 证券账户和结算账户的设立和管理；
- (2) 证券登记与过户；
- (3) 证券托管与转托管；
- (4) 证券和资金的清算与交收；
- (5) 受发行人委托办理证券权益分配等代理人服务；
- (6) 中国证券监督管理委员会批准的其他业务。

## 二十三、 招募说明书的存放及查阅方式

基金招募说明书、定期报告、临时报告与公告等文本存放在基金管理人和销售机构的办公场所和营业场所，在办公时间内可供免费查阅。投资人也可以直接登录基金管理人的网站 [www.hftfund.com](http://www.hftfund.com) 进行查阅。上述备查的文件其内容与所公告的内容完全一致。

## 二十四、 备查文件

本招募说明书的备查文件包括：

- (1) 中国证监会对海富通量化先锋股票型证券投资基金募集申请准予注册的文件
- (2) 《海富通量化先锋股票型证券投资基金基金合同》
- (3) 《海富通量化先锋股票型证券投资基金托管协议》
- (4) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (5) 基金托管人业务资格批件、营业执照
- (6) 法律意见书
- (7) 注册登记协议
- (8) 中国证监会要求的其他文件

备查文件存放地点为基金管理人、基金托管人的住所；投资人如需了解详细的信息，可向基金管理人、基金托管人申请查阅。