

先锋聚优灵活配置混合型证券投资基金  
招募说明书（更新）  
（2023 年第 1 号）

基金管理人：先锋基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

## 重要提示

先锋聚优灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）于2017年5月15日经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）核准募集，准予注册文件名称为：《关于准予先锋聚优灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可〔2017〕714号），注册日期为：2017年5月15日。本基金基金合同于2017年9月15日生效，自该日起本基金管理人正式开始管理本基金。

先锋基金管理有限公司（以下称“基金管理人”或“管理人”）保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本基金由基金管理人依照《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同和其他有关法律法规规定募集，并经中国证监会注册。中国证监会对本基金募集的注册审查以要件齐备和内容合规为基础，以充分的信息披露和投资者适当性为核心，以加强投资者利益保护和防范系统性风险为目标，中国证监会并不对本基金的投资价值、市场前景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。

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具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），在正常市场环境下本基金的流动性风险适中。在特殊市场条件下，如证券市场的成交量发生急剧萎缩、基金发生巨额赎回以及其他未能预见的特殊情形下，可能导致基金资产变现困难或变现对证券资产价格造成较大冲击，发生基金份额净值波动幅度较大、无法进行正常赎回业务、基金不能实现既定的投资决策等风险。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者根据所持有的基金份额享受基金收益，同时承担相应的投资风险。投资人在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特定风险等。本基金属于混合型基金，

预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。投资人在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的招募说明书及基金合同等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。

基金管理人建议投资人根据自身的风险收益偏好，选择适合自己的基金产品，并且中长期持有。

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

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

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。

本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书（更新）所载内容截止日为2023年3月21日，有关财务数据和净值表现截止日为2022年12月31日（本报告中财务数据未经审计）。

## 目 录

第一部分	前言	5
第二部分	释义	6
第三部分	基金管理人	11
第四部分	基金托管人	20
第五部分	相关服务机构	25
第六部分	基金的募集	40
第七部分	基金合同的生效	44
第八部分	基金份额的申购与赎回	45
第九部分	基金的投资	56
第十部分	基金的业绩	66
第十一部分	基金的财产	68
第十二部分	基金资产的估值	70
第十三部分	基金的收益与分配	74
第十四部分	基金的费用与税收	76
第十五部分	基金的会计和审计	80
第十六部分	基金的信息披露	81
第十七部分	风险揭示	86
第十八部分	基金合同的变更、终止与基金财产的清算	91
第十九部分	基金合同的内容摘要	93

---

第二十部分 托管协议的内容摘要 .....	109
第二十一部分 对基金份额持有人的服务 .....	127
第二十二部分 招募说明书的存放及查阅方式 .....	129
第二十三部分 备查文件 .....	130
第二十四部分 其他应披露事项 .....	131

## 第一部分 前言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险规定》”）和其他相关法律法规的规定以及《先锋聚优灵活配置混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

本基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，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《招募说明书》由本基金管理人解释。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本《招募说明书》中载明的信息，或对本招募说明书作任何解释或者说明。

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

## 第二部分 释义

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：指先锋聚优灵活配置混合型证券投资基金
- 2、基金管理人：指先锋基金管理有限公司
- 3、基金托管人：指交通银行股份有限公司
- 4、基金合同、《基金合同》：指《先锋聚优灵活配置混合型证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充
- 5、托管协议或《托管协议》：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《先锋聚优灵活配置混合型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
- 6、招募说明书或《招募说明书》或本招募说明书：指《先锋聚优灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》及其定期的更新
- 7、基金份额发售公告：指《先锋聚优灵活配置混合型证券投资基金基金份额发售公告》
- 8、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等
- 9、《基金法》：指 2012 年 12 月 28 日经第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订通过，自 2013 年 6 月 1 日起实施，并经 2015 年 4 月 24 日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修改的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 10、《销售办法》：指中国证监会 2020 年 8 月 28 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 11、《信息披露办法》：指中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

12、《运作办法》：指中国证监会 2014 年 7 月 7 日颁布、同年 8 月 8 日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

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

14、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

15、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会

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

17、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

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

19、合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理办法》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、投资者：指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称

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

24、登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容

包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额登记、基金销售业务的确认、



清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等

25、登记机构：指办理登记业务的机构。基金的登记机构为先锋基金管理有限公司或接受先锋基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构

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

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

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

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

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

31、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

32、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

33、T 日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日

34、T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日（不包含 T 日），n 为自然数

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

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转换为现金的行为

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

42、基金份额类别：指根据认/申购费用、赎回费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别，各基金份额类别代码不同，基金份额净值和基金份额累计净值或有不同

43、A 类基金份额或 A 类份额：指在投资人认/申购时收取认/申购费用、赎回时收取赎回费用的，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额

44、C 类基金份额或 C 类份额：指从本类别基金资产中计提销售服务费、赎回时收取赎回费用，而不收取认/申购费用的基金份额

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

46、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

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

48、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%

49、元：指人民币元

50、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

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

52、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

53、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

54、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

55、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

56、指定媒介：指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站及其他媒介

57、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

58、基金产品资料概要：指《先锋聚优灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要》及其更新

## 第三部分 基金管理人

### 一、基金管理人概况

名称	先锋基金管理有限公司
注册地址	深圳市福田区福田街道福安社区益田路5033号平安金融中心70楼7001-7002室
办公地址	北京市朝阳区新源南路6号京城大厦A座2106
法定代表人	Wong Leah Kuen
成立日期	2016年5月16日
注册资本	15,500万元人民币
经营范围	公开募集证券投资基金管理、基金销售、特定客户资产管理和中国证监会许可的其他业务
股权结构	联合创业集团有限公司占注册资本的33.1041%，大连亚联投资管理有限公司占注册资本的33.1039%，北京鹏康投资有限公司占注册资本的21.7790%，张松孝占注册资本的4.9904%，深圳市大华信安资产管理企业（有限合伙）占注册资本的4.8290%，深圳市瑞智源投资合伙企业(有限合伙)占注册资本的2.1936%。
存续期间	持续经营
电话	400-815-9998
传真	010-58239887
联系人	张晓宇

### 二、基金管理人董事、监事、总经理、高级管理人员基本情况

#### 1、基金管理人董事

Wong Leah Kuen女士，澳大利亚籍，澳大利亚注册会计师，硕士。现任先锋基金董事长。曾任中信证券国际有限公司资产管理部、研究部首席分析师，摩根士丹利华鑫证券有限责任公司投资（银行）部中国区副总裁，兴业银行股份有限公司私人银行部总行境外投资处处长、兼任香港分行私人银行部副总经理，作为兴业银行总行特聘海外专家，任职期间兴业银行私人银行多次获奖：胡润百富最佳私人银行表现奖、亚太财富论坛2016年度国际私人财富管理中国风云榜“金臻奖”，“最具创新力奖”等。

朱柳曦先生，董事，学士。现任国美金控法务合规及政府事务部总监，

厦门金美信消费金融有限责任公司监事会主席、银盈通支付有限公司董事。曾任新华人寿保险股份有限公司北京分公司风险管控部总经理助理，新华家园养老企业管理公司公司级总监，东旭资本总裁助理兼风控法务中心总经理。

龙涌先生，董事，中国人民大学法学和北京理工大学工学双学士。现任先锋基金总经理。曾任南方证券有限公司投资部投资经理，国信证券股份有限公司投资银行事业部内核负责人兼内核办主任、资本市场部总经理，国信弘盛私募基金管理有限公司总经理，国信证券股份有限公司投资银行事业部副总经理等职。中国首批保荐代表人，并拥有中国法律职业资格、中国注册会计师资格。

陈海宁先生，董事，学士。现任深圳市远为实业有限公司副总经理，四川华亚世纪有限公司执行董事，国都证券股份有限公司董事。曾任中国华西企业公司工程师，深圳市接待办公室科长，深圳市捷宾实业发展有限公司副总经理。

殷剑峰先生，独立董事，对外经济贸易大学金融学院教授，浙商银行首席经济学家，博士生导师；兼任中国金融学会理事，中国世界经济学会常务理事，中国现代金融学会常务理事和学术委员会委员。

耿留琪先生，独立董事，高级经济师。曾任青岛电业局处长、局长助理、副局长，北京英大实业发展集团有限公司副总经理主持工作、党委书记，山东电力投资公司总经理，山东鲁能物资集团有限公司总经理，金穗期货经纪公司董事长，英大信托公司总经理、董事长、党委书记，华夏银行董事、副董事长。

邢会强先生，独立董事，毕业于北京大学法学院，法学博士。中央财经大学法学院教授、博士生导师，兼任中国法学会证券法学研究会副会长兼秘书长、北京市金融服务法学研究会会长，山西证券股份有限公司、利安人寿股份有限公司独立董事、北京万泰生物医药股份有限公司独立董事。

## 2、基金管理人监事

沈超然先生，监事，学士。现任国美信科技投资有限公司副总裁。曾任招商银行信用卡中心风险管理部策略分析师，平安银行信用卡中心风险管理部经理，平安前海征信创始组成员，上海陆金所信息科技股份有限公司

陆师兄事业部风险副总监（主持工作），平安付智能技术有限公司风险副总监（主持工作），上海益芯金融信息服务有限公司首席风险官，众安在线财产保险股份有限公司机构金融业务部负责人、金融风控中心负责人。

赵进先生，监事，硕士。现任先锋基金北京业务中心总经理。曾任中兴通讯南京研发七部工程师，先锋基金市场开发部渠道经理、总经理助理、市场总监、北京分公司执行总经理。

### 3、基金管理人高级管理人员

Wong Leah Kuen女士，董事长，履历同上。

龙涌先生，总经理，履历同上。

高明达先生，常务副总经理，硕士。曾任大通证券股份有限公司资产管理部业务经理；中航证券有限公司资产管理分公司总经理助理；中山证券机构金融二部总经理、资管四部总经理；中兵投资管理有限责任公司固定收益部业务总监；先锋基金专户投资部总监、业务运营中心总监、公司总经理、董事会秘书。

黄劲松女士，督察长，硕士。曾任海南农工贸股份有限公司审计部主任，北京大立宏源科技有限公司项目部副总经理，中邮创业基金管理股份有限公司监察稽核部总经理，先锋基金管理有限公司监察稽核部总监。

刘冬先生，首席信息官，硕士。曾任沈阳东软软件股份有限公司软件工程师；恒生电子股份有限公司软件工程师；诺安基金管理有限公司信息技术部门工程师、主管、副总经理；先锋基金金融科技部总监。

### 4、本基金基金经理

刘志强先生，金融学硕士，2013年毕业于中国人民大学，现任公司投资管理部基金经理。2008年至2019年先后任职于中国工商银行股份有限公司、中信证券股份有限公司、北京国华汇金资产管理有限公司、东兴证券股份有限公司、中荣鑫融（北京）投资管理有限公司。2019年11月加入先锋基金从事投资研究工作。

历任基金经理：2017年9月15日至2018年12月6日期间，王颢先生任基金经理。2017年9月28日至2019年5月31日期间，王建强先生任基金经理。2019年5月20日至2021年9月10日期间，杨帅先生任基金经理。2021年9月10日至2023年1月12日期间，孙欣炎先生任基金经理。

### 5、投资决策委员会成员

投资决策委员会的成员包括：龙涌先生、高明达先生、杜旭女士、曾捷女士、杨涛先生、范力丹女士、陈嘉雯女士。

### 6、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资产净值，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、中期和年度基金报告；

11、严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

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

13、按基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有

人分配基金收益；

14、按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

25、执行生效的基金份额持有人大会的决议；

26、建立并保存基金份额持有人名册；

27、法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

#### 四、基金管理人承诺



1、基金管理人承诺不从事违反《中华人民共和国证券法》、《基金法》、《销售办法》、《运作办法》、《信息披露办法》等法律法规的行为，并承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违法行为的发生。

2、基金管理人的禁止行为：

(1) 将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；

(2) 不公平地对待公司管理的不同基金财产；

(3) 利用基金财产或职务之便为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；

(4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；

(5) 侵占、挪用基金财产；

(6) 泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

(7) 玩忽职守，不按照规定履行职责；

(8) 在没有充足资金的情况下向基金托管人发出划款指令和赎回、分红资金的划拨指令，或违规向基金托管人发出指令。

(9) 与基金托管人在行政上、财务上不独立，高级管理人员和其他从业人员相互兼职。

(10) 法律、行政法规以及中国证监会规定禁止的其他行为。

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

(1) 越权或违规经营；

(2) 违反法律法规、基金合同或托管协议；

(3) 故意损害基金份额持有人或基金合同其他当事人的合法权益；

(4) 在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；

(5) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；

(6) 玩忽职守、滥用职权，不按照规定履行职责；

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

(8) 协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易；

(9) 违反证券交易所业务规则，利用对敲、倒仓等非法手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；

(10) 贬损同行，以提高自己；

(11) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成份；

(12) 以不正当手段谋求业务发展；

(13) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；

(14) 其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

#### 4、基金经理承诺

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

(2) 不得利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者牟取利益；

(3) 不违反现行有效的有关法律法规、基金合同和中国证监会的有关规定，不泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

(4) 不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

#### 五、基金管理人的内部控制制度

为保证公司合法规范高效运作，有效防范各类风险，保障基金份额持有人利益，维护公司及公司股东的合法权益，基金管理人建立了完整、严密、高效的内部控制体系。

##### 1、公司内部控制的总体目标如下：

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

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

(3) 确保基金、公司财务和其它信息真实、准确、完整、及时。

##### 2、公司内部控制遵循以下原则：

(1) 健全性原则：内部控制包括公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员，并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个环节；

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

(3) 独立性原则：公司各机构、部门和岗位职责保持相对独立，公司基金资产、自有资产、其它资产的运作分离；

(4) 相互制约原则：公司内部部门和岗位的设置权责分明、相互制衡；

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

### 3、内部控制的制度体系

公司建立了完备有效的制度体系。公司制度体系的架构如下：

第一个层面是公司章程，是规范公司的组织与行为、公司与股东之间以及股东与股东之间权利和义务关系的具有法律约束力的文件，是确定公司与其他相关利益主体之间关系的基本规则以及保证这些规则得到具体执行的依据。

第二个层面是公司内部控制大纲，是对公司章程规定的内控原则的细化和展开，是各项基本管理制度的纲要和总揽。

第三个层面是公司基本管理制度，包括风险管理制度、投资管理制度、基金会计制度、信息披露制度、监察稽核制度、信息技术管理制度、公司财务制度、资料档案管理制度、业绩评估考核制度和紧急情况处理制度等。

第四个层面是公司各机构、部门根据业务需要制定的各种制度及实施细则等。

规章制度的制订、修改、实施流程严格遵循相应的合规程序，在保持制度稳定性的基础上，根据法律法规政策的变化及业务的发展需要及时更新完善。

### 4、风险管理和内部控制体系结构

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

（1）董事会：负责监督检查公司的合法合规运营、内部控制、风险管理，从而控制公司的整体运营风险；

（2）风险控制委员会，是董事会下设的专业委员会，负责对涉及风险管控方面的专项问题进行研究指导，为董事会决策提供参考意见；

（3）督察长：履行职责的范围涵盖公司运作的所有业务环节。独立行使督察权利，直接对董事会负责，及时向董事会及风险控制委员会提交有关公司规范运作和风险控制方面的工作报告；

（4）风险管理委员会：是经理层下设的专业委员会，是公司及基金日常运作的风险控制机构，在经理层授权范围内协助经理层工作，出具相应工作报告和专业意见供经理层决策参考；

（5）监察稽核部：负责对公司的基金运作、内部管理、系统实施和合法合规情况进行内部监督。有权对公司各部门内部风险控制制度的建立和落实情况进行检查，对公司的内部风险控制制度的合理性、有效性进行分析，并提出改进意见；

（6）其他各部门：其他各部门既是各项工作的执行者，又是其部门风险的防范者。各部门负责人是本部门风险控制的第一责任人，履行一线风控职能；各部门内部建立责权明确、相互制衡的岗位职责，制定全面、合理的业务风控制度和流程，加强对风险的控制。

#### 5、基金管理人关于内部控制制度声明书

（1）本公司承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确；

（2）本公司承诺根据市场变化和公司业务发展不断完善内部控制制度。

## 第四部分 基金托管人

### 一、基金托管人概况

#### （一）基金托管人概况

公司法定中文名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）

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

法定代表人：任德奇

住 所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号

办公地址：上海市长宁区仙霞路 18 号

邮政编码：200336

注册时间：1987 年 3 月 30 日

注册资本：742.63 亿元

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]25 号

联系人：陆志俊

电 话：95559

交通银行始建于 1908 年，是中国历史最悠久的银行之一，也是近代中国的发钞行之一。1987 年重新组建后的交通银行正式对外营业，成为中国第一家全国性的国有股份制商业银行，总部设在上海。2005 年 6 月交通银行在香港联合交易所挂牌上市，2007 年 5 月在上海证券交易所挂牌上市。交通银行连续 13 年跻身《财富》(FORTUNE)世界 500 强，营业收入排名第 137 位；列《银行家》(The Banker)杂志全球千家大银行一级资本排名第 11 位。

截至 2022 年 9 月 30 日，交通银行资产总额为人民币 12.69 万亿元。2022 年三季度，交通银行实现净利润(归属于母公司股东)人民币 680.2 亿元。

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

## （二）主要人员情况

任德奇先生，董事长、执行董事，高级经济师。

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

刘珺先生，副董事长、执行董事、行长，高级经济师。

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

徐铁先生，资产托管部总经理。

徐铁先生 2022 年 4 月起任本行资产托管部总经理；2014 年 12 月至 2022 年 4 月任本行资产托管部副总经理；2000 年 7 月至 2014 年 12 月，历任交通银行资产托管部客户经理、保险与养老金部副高级经理、高级经理、

保险保障业务部高级经理、总经理助理。徐先生 2000 年于复旦大学获经济学硕士学位。

### （三）基金托管业务经营情况

截至 2022 年 9 月 30 日，交通银行共托管证券投资基金 694 只。此外，交通银行还托管了基金公司特定客户资产管理计划、证券公司客户资产管理计划、银行理财产品、信托计划、私募投资基金、保险资金、全国社保基金、养老保障管理基金、企业年金基金、职业年金基金、期货公司资产管理计划、QFII 证券投资资产、RQFII 证券投资资产、QDII 证券投资资产、RQDII 证券投资资产、QDIE 资金、QDLP 资金和 QFLP 资金等产品。

## 二、基金托管人的内部控制制度

### （一）内部控制目标

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

### （二）内部控制原则

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

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

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

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

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

内控管理目标被有效执行。

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

### （三）内部控制制度及措施

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

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

### 三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

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

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



告中国证监会。

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

## 第五部分 相关服务机构

### 一、基金份额发售机构

#### 1、直销机构

(1) 名称：先锋基金管理有限公司

住所：深圳市福田区福田街道福安社区益田路5033号平安金融中心70楼7001-7002室

办公地址：北京市朝阳区新源南路6号京城大厦A座2106

法定代表人：Wong Leah Kuen

邮政编码：100004

电话：010-58239890

传真：010-58239887

联系人：赵进

网址：[www.xf-fund.com](http://www.xf-fund.com)

(2) 先锋基金直销网上交易

投资者可以通过本公司直销网上交易系统办理业务，具体业务办理情况及业务规则请登录本公司网站查询。

网址：[www.xf-fund.com](http://www.xf-fund.com)

#### 2、其他销售机构

(1) 交通银行股份有限公司

住所：上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：彭纯

联系人：李智明

电话：95559

(2) 中国银河证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 35 号 2-6 层

办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：陈共炎

联系人：辛国政

电话：010-83574507

（3）恒泰证券股份有限公司

住所：内蒙古呼和浩特赛罕区敕勒川大街东方君座 D 座

办公地址：内蒙古呼和浩特赛罕区敕勒川大街东方君座 D 座

法定代表人：庞介民

联系人：熊丽

电话：0471-4972675

（4）平安证券股份有限公司

住所：深圳市福田区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

办公地址：深圳市福田区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

法定代表人：曹实凡

联系人：周驰

电话：18612835256

（5）广发证券股份有限公司

住所：广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街2号618室

办公地址：广州市天河北路183号大都会广场18、19、36、38、39、40、41、42、43楼

法定代表人：孙树明

电话：95575

联系人：黄岚

（6）安信证券股份有限公司

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

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

法定代表人：王连志

联系人：陈剑虹

电话：95517

（7）华鑫证券有限责任公司

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

## 单元

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 8 号

法定代表人：俞洋

联系人：朱泽乾

电话：021-54967367

(8) 深圳众禄基金销售股份有限公司

住所：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼 801

办公地址：深圳市罗湖区梨园路 8 号 HALO 广场 4 楼

法定代表人：薛峰

联系人：龚江江

电话：15179286389

(9) 珠海盈米基金销售有限公司

住所：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼

法定代表人：肖雯

联系人：邱湘湘

电话：020-89629023

(10) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

住所：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：北京市西城区宣武门外大街 28 号富卓大厦 A 座 7 层

法定代表人：洪弘

联系人：文雯

电话：010-83363101

(11) 上海天天基金销售有限公司

住所：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号东方财富大厦

法定代表人：其实

联系人：潘世友

电话：021-54509977

(12) 上海好买基金销售有限公司

住所：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号

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

法定代表人：杨文斌

联系人：张茹

电话：021-20613999

（13）浙江同花顺基金销售有限公司

住所：浙江省杭州市文二西路 1 号 903 室

办公地址：杭州市余杭区五常街道同顺路 18 号同花顺大楼

法定代表人：凌顺平

联系人：董一峰

电话：0571-88911818

（14）北京新浪仓石基金销售有限公司

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

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

法定代表人：李昭琛

联系人：付文红

电话：010-62676405

（15）上海陆金所基金销售有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

法定代表人：王之光

联系人：宁博宇

电话：021-20665952

（16）上海联泰基金销售有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区富特北路277号3层310室

办公地址：上海市长宁区福泉北路518号8座3层

法定代表人：尹彬彬

电话：021-52822063

联系人：陈东

(17) 京东肯特瑞基金销售有限公司

住所：北京市海淀区海淀东三街 2 号 4 层 401-15

办公地址：北京市大兴区亦庄经济开发区科创十一街十八号院京东集团总部 A 座 17 层

法定代表人：邹保威

联系人：隋斌

电话：010-89189288

(18) 上海基煜基金销售有限公司

住所：上海市崇明县长兴镇路潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室（上海泰和经济发展区）

办公地址：上海浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 1503 室

法定代表人：王翔

联系人：吴鸿飞

电话：021-65370077-268

(19) 上海万得基金销售有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区福山路33号11楼B座

办公地址：上海市浦东新区浦明路1500号万得大厦11楼

法定代表人：黄祎

联系人：徐亚丹

电话：021-50712782

(20) 江苏汇林保大基金销售有限

公司住所：南京市高淳区砖墙集镇 78 号

办公地址：南京市新街口中山东路 9 号天时国际商贸大厦 11 楼 E 座

法定代表人：吴言林

联系人：张宏鹤

电话：025-56663409

(21) 万家财富基金销售(天津)有限公司

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

办公地址：北京市西城区丰盛胡同 28 号太平洋保险大厦 5 层

法定代表人：李修辞

联系人：邵玉磊

电话：010-59013825

（22）洪泰财富（青岛）基金销售有限责任公司

住所：山东省青岛市崂山区香港东路 195 号 9 号楼 701 室

办公地址：山东省青岛市崂山区香港东路 195 号 9 号楼 706 室

法定代表人：任淑桢

联系人：邢智

电话：010-66162800

（23）上海云湾基金销售有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路 27 号 1 号楼

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路 27 号 13 号楼 2  
层

法定代表人：桂水发

联系人：范泽杰

电话：13917243812

（24）五矿证券有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4028 号荣超经贸中心 47 层 01 单元

办公地址：深圳市福田区金田路 4028 号荣超经贸中心 47-49 层

法定代表人：黄海洲

联系人：华然

电话：0755-82564033

（25）中民财富基金销售（上海）有限公司

住所：上海市黄浦区中山南路 100 号 7 层 05 单元

办公地址：上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼  
27 层

法定代表人：弭洪军

联系人：黄鹏

电话：400-876-5716

（26）济安财富（北京）基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区太阳宫中路 16 号院 1 号楼 3 层 307

办公地址：北京市朝阳区太阳宫中路 16 号院 1 号楼 3 层 307

法定代表人：杨健

联系人：李海燕

电话：010-65309516

（27）东方财富证券股份有限公司

住所：西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城 10 栋楼

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号金座东方财富大厦

法定代表人：徐伟琴

电话：95357

联系人：付佳

（28）爱建证券有限责任公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1600 号 1 幢 32 楼

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1600 号 1 幢 32 楼

法定代表人：祝健

电话：021-32229888

联系人：姚盛盛

（29）国都证券股份有限公司

住所：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

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

电话：010-84183142

联系人：杜正中

（30）大连网金基金销售有限公司

住所：辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号诺德大厦 2 层 202 室

办公地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号诺德大厦 2 层 202



室

法定代表人：樊怀东

电话：0411-39027804

联系人：张宁

（31）东海证券股份有限公司

注册地址：江苏省常州延陵西路 23 号投资广场 18 层

办公地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦

法定代表人：赵俊

联系人：王一彦

客服电话：95531；400-888-8588

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

（32）北京虹点基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区东三环北路17号10层1015室

办公地址：北京市朝阳区东三环北路17号恒安大厦9层

法定代表人：何静

联系人：王重阳

电话：010-85643600

（33）蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

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

办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路 18 号黄龙时代广场 B 座 6F

法定代表人：祖国明

联系人：韩爱彬

客服电话：4000-766-123

公司网址：[www.fund123.cn](http://www.fund123.cn)

（34）天津国美基金销售有限公司

注册地址：天津经济技术开发区南港工业区综合服务区办公楼 D 座二  
层 202-124 室

办公地址：北京市朝阳区霄云路 26 号鹏润大厦 B 座 19 层

法定代表人：丁东华

电话：15712931404

联系人：许艳

（35）上海汇付基金销售有限公司

住所：上海市黄浦区黄河路 333 号 201 室 A 区 056 单元

办公地址：上海市徐汇区宜山路 700 号普天软件园 C5 幢

法定代表人：金佶

电话：021-34013999

联系人：甄宝林

（36）南京苏宁基金销售有限公司

住所：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

办公地址：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

法定代表人：王锋

联系人：冯鹏鹏

电话：025-66996699

（37）北京汇成基金销售有限公司

住所：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108 号

办公地址：北京市西城区西直门外大街 1 号院 2 号楼

法定代表人：王伟刚

联系人：宋子琪

电话：010-56251471

（38）北京雪球基金销售有限公司

注册地址：北京朝阳区阜通东大街 1 号院 2 单元 21 层 222507

办公地址：北京朝阳区创远路 34 号院 6 号楼 15 层 1501 室

法定代表人：钟斐斐

联系人：候芳芳

电话：010-61840688

（39）阳光人寿保险股份有限公司

注册地址：海南省三亚市迎宾路 360-1 号三亚阳光金融广场 16 层

办公地址：北京市朝阳区朝阳门外大街乙 12 号院 1 号昆泰国际大厦

12层

法定代表人：李科

联系人：王超

电话：010-85632773

传真：010-85632772

（40）光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：周健男

联系人：戴巧燕

电话：021-22169999

传真：021-22169134

（41）一路财富（北京）基金销售有限公司

住所：北京市海淀区宝盛南路 1 号院 20 号楼 9 层 101-14

办公地址：北京市海淀区奥北科技园-国泰大厦 9 层

法定代表人：吴雪秀

电话：13520209651

联系人：董宣

（42）上海长量基金销售有限公司

住所：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区东方路 1267 号 11 层

法定代表人：张跃伟

联系人：党敏

电话：021-20691935

（43）上海利得基金销售有限公司

住所：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室

办公地址：上海市虹口区东大名路 1098 弄浦江国际金融广场 18 楼

法定代表人：李兴春

电话：18516109631

联系人：陈孜明

（44）嘉实财富管理有限公司

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

办公地址：北京市朝阳区建国路 91 号金地中心 A 座 6 层

法定代表人：赵学军

联系人：李雯

电话：010-60842306

（45）上海中正达广基金销售有限公司

住所：上海市徐汇区龙腾大道 2815 号 302 室

办公地址：上海市徐汇区龙腾大道 2815 号 302 室

法定代表人：黄欣

联系人：戴珉微

电话：021-33768132

（46）奕丰基金销售有限公司

住所：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室

办公地址：深圳市南山区海德三道航天科技广场 A 座 17 楼 1704 室

法定代表人：TEO WEE HOWE

电话：13424264100

联系人：叶建

（47）国信证券股份有限公司

住所：深圳市红岭中路1012号国信证券大厦16-26层

办公地址：深圳市红岭中路1012号国信证券大厦16-26层

法定代表人：张纳沙

联系人：刘辰昕

电话：0755-82130833

（48）诺亚正行基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

办公地址：上海市杨浦区长阳路 1687 号长阳谷 2 号楼法定代表人：  
汪静波

联系电话：021-80358523

联系人：李娟

（49）和合期货有限公司

注册地址：山西省太原市迎泽区菜园东街2号

办公地址：山西省太原市迎泽区菜园东街2号

法定代表人：刘晓洁

联系电话：0351-7342798

联系人：张基甲

（50）中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址：北京市东城区朝内大街188号

法定代表人：王常春

联系电话：010-65182261

联系人：刘畅

（51）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

办公地址：深圳市福田区福田街道福华一路111号

法定代表人：霍达

联系电话：4008888111

联系人：黄婵君

（52）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

办公地址：北京市西城区金融大街16号

法定代表人：王滨

联系电话：010-63631752

联系人：杨子彤

（53）武汉市伯嘉基金销售有限公司

住所：湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际SOHO城（一期）第七幢23层1号4号

办公地址：湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际SOHO城（一

期) 第七幢23层1号4号

法定代表人：陶捷

电话：027-87006009（8004）

联系人：陆锋

（54）民生证券股份有限公司

住所：北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-18层

办公地址：北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-18层

法定代表人：冯鹤年

电话：010-85127570

联系人：王超

（55）华泰证券股份有限公司

住所：南京市江东中路228号

法定代表人：张伟

客服电话：95597

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

（56）诚通证券股份有限公司

住所：北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501

办公地址：北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501

法定代表人：张威

电话：010-83561146

联系人：田芳芳

（57）英大证券有限责任公司

住所：深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层

办公地址：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：吴骏

电话：400-018-8688

联系人：王晓静

（58）玄元保险代理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区张杨路707号1105室

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区张杨路707号1105室

法定代表人：马永谔

联系人：张苗苗

客服电话：400-080-8208

网址：<https://www.licaimofang.cn/>

（59）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B座21层、29层

法定代表人：武建华

联系人：沈晓琳

电话：400-8180-888

## 二、登记机构

名称：先锋基金管理有限公司

住所：深圳市福田区福田街道福安社区益田路5033号平安金融中心70楼7001-7002室

办公地址：北京市朝阳区新源南路6号京城大厦A座2106

法定代表人：Wong Leah Kuen

电话：010-58239890

传真：010-58239889

联系人：徐文

## 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：安冬

经办律师：安冬、陆奇

## 四、审计基金资产的会计师事务所

名称：天健会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：浙江省杭州市钱江新城钱江路1366号华润大厦B座

办公地址：广东省广州市黄埔区黄埔大道东856号保利鱼珠港A2栋4楼

执行事务合伙人：胡少先

电话：020-3760 0380

传真：020-3760 6120

联系人：燕玉嵩

经办注册会计师：燕玉嵩、刘昕



## 第六部分 基金的募集

### 一、募集的依据

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定，并于2017年5月15日经中国证监会证监许可（2017）714号文准予注册募集。

### 二、基金类别及存续期限

基金类别：混合型证券投资基金

基金运作方式：契约型、开放式

基金存续期限：不定期

### 三、基金份额分类

本基金根据认购费用、申购费用、赎回费用、销售服务费等费率收取方式的不同，将基金份额分为A类基金份额和C类基金份额。在投资者认购、申购基金时收取认购、申购费用、赎回时收取赎回费用，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为A类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费、赎回时收取赎回费用，而不收取认购、申购费用的，称为C类基金份额。相关费率的设置及费率水平在招募说明书或相关公告中列示。

本基金A类基金份额和C类基金份额分别设置基金代码。由于基金费用的不同，本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值并单独公告。

本基金在募集期开放A类基金份额和C类基金份额的认购，投资者可自行选择认购、申购的基金份额类别。本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。

基金管理人可调整认/申购各类基金份额的最低金额限制及规则，无需召开基金份额持有人大会，基金管理人必须在开始调整之日前依照《信息披露办法》的规定在指定媒介刊登公告。

根据基金运作情况，基金管理人可在不违反法律法规、基金合同的约定以及不损害已有基金份额持有人权益的情况下，经与基金托管人协商，在履行适当程序后停止现有基金份额类别的销售、或者调低现有基金份额类别的费率水平、或者增加新的基金份额类别等，调整前基金管理人需及

时公告并报中国证监会备案，不需召开基金份额持有人大会审议。

#### 四、募集期限

本基金募集期限自2017年8月7日至2017年9月8日。

#### 五、募集方式及场所

通过各销售机构的基金销售网点公开发售，各销售机构的具体名单见基金份额发售公告以及基金管理人届时发布的调整销售机构的相关公告。

#### 六、募集对象

符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、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。

#### 七、认购时间

本基金发售募集期间每天的具体业务办理时间，由基金份额发售公告或各销售机构的相关公告或者通知规定。

各个销售机构在本基金发售募集期内对于个人投资者或机构投资者的具体业务办理时间可能不同，若发售公告没有明确规定，则由各销售机构自行决定每天的业务办理时间。

#### 八、认购的数额限制

认购以金额申请。投资人认购基金份额时，需按销售机构规定的方式全额交付认购款项，投资人可以多次认购本基金份额。通过基金管理人直销机构或网上交易平台认购本基金时，首次单笔最低认购金额为10元人民币（含认购费，下同），单笔追加认购最低金额为10元人民币。其他销售机构每个基金账户每次认购金额不得低于10元人民币，其他销售机构另有规定的，从其规定。

认购申请一经受理不得撤销。

如本基金单个投资人累计认购的基金份额数达到或者超过基金总份额的50%，基金管理人可以采取比例确认等方式对该投资人的认购申请进行限制。基金管理人接受某笔或者某些认购申请有可能导致投资者变相规避前述50%比例要求的，基金管理人有权拒绝该等全部或者部分认购申请。投资人认购的基金份额数以基金合同生效后登记机构的确认为准。

#### 九、认购费用

本基金的认购费率随认购金额的增加而递减，具体费率结构如下表所示。投资人认购 A 类基金份额需缴纳认购费用，认购 C 类基金份额无需缴纳认购费用。

A 类基金份额投资人需缴纳的认购费用按认购金额的大小划分为四档；本基金 C 类基金份额不收取认购费用，而是从该类别基金资产中计提销售服务费。

具体认购费率如下表所示：

	单笔金额	认购费率
A 类基金份额	100 万元以下	1.20%
	100 万元（含）—200 万元	0.80%
	200 万元（含）—500 万元	0.60%
	500 万元以上（含）	每笔 1000 元
C 类基金份额	0	

本基金的认购费由认购 A 类基金份额的投资人承担。基金认购费用不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、登记等募集期间发生的各项费用。募集期间发生的信息披露费、会计师费和律师费等各项费用，不从基金财产中列支。若投资人重复认购本基金 A 类基金份额时，需按单笔认购金额对应的费率分别计算认购费用。

## 十、认购份额的计算

本基金的基金份额发售面值为每份基金份额人民币1.00元。

基金认购份额计算方法：

### 1、认购A类基金份额的计算

认购费用适用比例费率时，认购份额的计算方法如下：

$$\text{净认购金额} = \text{认购金额} / (1 + \text{认购费率})$$

$$\text{认购费用} = \text{认购金额} - \text{净认购金额}$$

$$\text{认购份额} = (\text{净认购金额} + \text{认购利息}) / \text{基金份额发售面值}$$

认购费用适用固定金额时，认购份额的计算方法如下：

$$\text{认购费用} = \text{固定金额}$$

$$\text{净认购金额} = \text{认购金额} - \text{认购费用}$$

$$\text{认购份额} = (\text{净认购金额} + \text{认购利息}) / \text{基金份额发售面值}$$

## 2、认购C类基金份额的计算：

认购份额=（认购金额+认购利息）/基金份额发售面值

认购金额的计算保留到小数点后两位，小数点两位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

例：某投资人投资10,000元认购本基金的A类基金份额，则其所对应的认购费率为1.20%。假定该笔认购金额产生利息5元，则其可得到的A类基金份额计算如下：

净认购金额=10,000/（1+1.20%）=9,881.42元

认购费用=10,000-9,881.42=118.58元

认购份额=（9,881.42+5）/1.00=9,886.42份

即：该投资人投资10,000元认购本基金的A类基金份额，假定该笔认购金额产生利息5元，在基金发售结束后，其所获得的A类基金份额为9,886.42份。

## 十一、认购的方法与确认

### 1、认购方法

投资人认购时间安排、投资人认购应提交的文件和办理的手续，由基金管理人根据相关法律法规及基金合同，在基金份额发售公告中确定并披露。

### 2、认购确认

基金销售机构认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购的确认以登记机构的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利，否则，由此产生的投资者任何损失由投资者自行承担。

## 十二、募集资金利息的处理方式

有效认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有，其中利息转份额以登记机构的记录为准。

## 十三、募集期内募集资金的管理

基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。

## 第七部分 基金合同的生效

本基金基金合同已于2017年9月15日生效，自该日起本基金管理人正式开始管理本基金。

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。

法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。

## 第八部分 基金份额的申购与赎回

### 一、申购和赎回场所

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。具体的销售机构将由基金管理人在招募说明书或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，并予以公告。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基金份额的申购与赎回。具体办法由基金管理人或相关销售机构另行公告。

### 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

基金管理人已于2017年10月16日起开始办理本基金基金份额的日常申购、赎回业务，详情请参见基金管理人2017年10月13日刊登的《先锋聚优灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务公告》。

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。

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。如遇证券交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其它非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程时，则赎回款项的支付时间可相应顺延。在发生巨额赎回或基金合同约定的延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。

##### 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。若申购不成功或无效，则申购款项本金退还给投资人。

销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代

表销售机构确实接收到申购、赎回申请。申购、赎回的确认以登记机构的确认结果为准。对于申购申请及申购份额的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利。

在法律法规允许的范围内，基金管理人或登记机构可根据相关业务规则，对上述业务办理时间进行调整，本基金管理人将于开始实施前按照有关规定予以公告。

## 五、申购和赎回的数量限制

1、基金管理人直销机构每个基金账户首次最低申购金额为10元人民币（含申购费，下同），单笔追加申购最低金额为10元人民币；已在直销机构有认/申购本基金记录的投资者不受首次申购最低金额的限制；通过基金管理人网上交易平台申购本基金时，每次最低申购金额为10元人民币。其他销售机构每个基金账户单笔申购最低金额为10元人民币，其他销售机构另有规定的，从其规定。

2、投资者可将其持有的全部或部分基金份额赎回，本基金不设最低赎回份额和最低持有份额限制。

3、投资者可多次申购，对单个投资者的累计持有份额不设上限限制，但单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的50%（在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过50%的除外）。

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

5、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额等数量限制。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公告并报中国证监会备案。

## 六、申购和赎回的价格、费用和用途

### 1、申购费

本基金基金份额分为A类和C类两类不同的类别。本基金A类基金份额的申购费率按申购金额的大小划分为四档，随申购金额的增加而递减（适用固定金额费率的申购除外）；投资者申购C类基金份额不收取申购费用，



而是从该类别基金资产中计提销售服务费。具体申购费率如下表所示：

	单笔金额	申购费率
A类基金份额	100万元以下	1.50%
	100万元（含）—200万元	1.00%
	200万元（含）—500万元	0.80%
	500万元以上（含）	每笔1000元
C类基金份额	0	

本基金的申购费用应在投资人申购A类基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用。

## 2、赎回费

本基金的赎回费率按照持有时间递减，即相关基金份额持有时间越长，所适用的赎回费率越低，具体赎回费率如下表所示：

A类基金份额		C类基金份额	
持有期限	赎回费率	持有期限	赎回费率
Y<7日	1.50%	Y<7日	1.50%
7日≤Y<30日	0.75%		
30日≤Y<1年	0.50%	7日≤Y<30日	0.50%
1年≤Y<2年	0.25%		
Y≥2年	0	Y≥30日	0

（注：Y：持有时间；1年=365日）

投资者可将其持有的全部或部分基金份额赎回。赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。对于A类基金份额持有期少于30日的基金份额所收取的赎回费，赎回费用全额归入基金财产；对于A类基金份额持有期不少于30日但少于3个月的基金份额所收取的赎回费，赎回费用75%归入基金财产；对于A类基金份额持有期不少于3个月但小于6个月的基金份额所收取的赎回费，赎回费用50%归入基金财产；对于A类基金份额持有期不少于6个月的基金份额所收取的赎回费，赎回费用25%归入基金财产。未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。对于C类份额持有期少于30日的基金份额所收取的赎回

费，将全额计入基金资产。（注：1个月=30日）

3、基金管理人可以按照基金合同的相关规定调整申购、赎回费率或调整收费方式，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

4、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，定期和不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，基金管理人可以按中国证监会要求履行必要手续后，对投资人适当调低基金申购费率，并进行公告。

## 七、申购份额与赎回金额的计算方式

### 1、申购份额的计算

申购本基金的申购费用采用前端收费模式（即申购基金时缴纳申购费），投资人的申购金额包括申购费用和净申购金额。申购份额的计算方式如下：

（1）申购A类基金份额的计算方式：

当申购费用适用比例费率时，申购份额的计算方法如下：

净申购金额=申购金额/（1+申购费率）

申购费用=申购金额-净申购金额

申购份额=净申购金额/申购当日该类别基金份额净值

当申购费用为固定金额时，申购份额的计算方法如下：

申购费用=固定金额

净申购金额=申购金额-申购费用

申购份额=净申购金额/申购当日该类别基金份额净值

（2）申购C类基金份额的计算方式：

申购份额=申购金额/申购当日该类别的基金份额净值

上述计算结果均按照四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产。

例：某投资者投资50,000元申购本基金的A类基金份额，假设申购当日A类基金份额净值为1.1500元，则可得到的A类基金份额为：

净申购金额=50,000/（1+1.50%）=49,261.08元

申购费用=50,000-49,261.08=738.92元

申购份额=49,261.08/1.1500=42,835.72份

即：投资者投资50,000元申购本基金的A类基金份额，假设申购当日A类基金份额净值为1.1500元，则其可得到42,835.72份A类基金份额。

## 2、赎回金额的计算

基金份额持有人在赎回本基金时缴纳赎回费，基金份额持有人的赎回净额为赎回金额扣减赎回费用。其中：

$$\text{赎回总金额} = \text{赎回份额} \times \text{赎回当日该类别基金份额净值}$$

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

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

赎回费用计算结果按照四舍五入方法，保留到小数点后两位；赎回金额结果按照四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产。

例：某投资者赎回本基金10,000份A类基金份额，持有期3年，赎回适用费率为0，假设赎回当日A类基金份额净值为1.3350元，则其可得净赎回金额为：

$$\text{赎回总金额} = 10,000 \times 1.3350 = 13,350.00 \text{元}$$

$$\text{赎回费用} = 13,350.00 \times 0 = 0.00 \text{元}$$

$$\text{净赎回金额} = 13,350.00 - 0.00 = 13,350.00 \text{元}$$

即：投资者赎回本基金10,000份A类基金份额，持有期3年，假设赎回当日A类基金份额净值为1.3350元，则可得到的净赎回金额为13,350.00元。

例：某投资者赎回本基金10,000份C类基金份额，持有期20天，赎回适用费率为0.50%，假设赎回当日C类基金份额的净值是1.1480元，则其可得净赎回金额为：

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

$$\text{赎回费用} = 11,480.00 \times 0.50\% = 57.40 \text{元}$$

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

即：投资者赎回本基金10,000份C类基金份额，持有期20天，假设赎回当日C类基金份额净值为1.1480元，则可得到的净赎回金额为11,422.60元。

## 3、基金份额净值计算

本基金A类基金份额和C类基金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。

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

## 八、申购与赎回的登记

投资人申购基金成功后，登记机构在T+1日为投资人登记权益并办理登记手续，投资人自T+2日（含该日）后有权赎回该部分基金份额。

投资人赎回基金成功后，登记机构在T+1日为投资人办理扣除权益的登记手续。

基金管理人可以在法律法规允许的范围内，对上述登记办理时间进行调整，但不得实质影响投资人的合法权益，并最迟于开始实施前3日在指定媒介及基金管理人网站公告。

## 九、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。若进行上述延期办理，对于单个基金份额持有人当日赎回申请超过上一开放日基金总份额10%以上的部分，将自动进行延期办理。对于其余当日非自动延期办理的赎回申请，应当按单个账户非自动延期办理的赎回申请量占非自动延期办理的赎回申请总量的比例，确定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别基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

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

### 3、巨额赎回的公告

当发生上述巨额赎回并延期办理时，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，同时在指定媒介刊登公告。

## 十、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或者因不可抗力导致基金管理人无法接受投资人的申购申请。

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

3、证券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、基金管理人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或对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时。

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、当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市

场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。

#### 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接受投资人的申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项本金将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

#### 十一、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无法正常运作或者因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。

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

3、证券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、发生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，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请。

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

7、基金合同约定、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，基金管理人当日应立即向中国证监会备案，并在规定期限内指定媒介刊登暂停公告。

2、上述暂停申购或赎回情况消除的，基金管理人应于重新开放日公布最近1个开放日各类基金份额的基金份额净值。

3、基金管理人可以根据暂停申购或赎回的时间，依照《信息披露办法》的有关规定，最迟于重新开放日在指定媒介上刊登重新开放申购或赎回的公告；也可以根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间，届时不再另行发布重新开放的公告。

## 十三、基金转换

本基金已于2017年10月16日开始办理转换业务。转换业务规则可详见刊登于本公司网站的《先锋基金管理有限公司开放式基金业务规则》及《先锋聚优灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务公告》。

## 十四、基金的非交易过户

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

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

## 十五、基金的转托管

基金份额持有人可办理已持有基金份额在不同销售机构之间的转托管，

基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。

## 十六、定期定额投资计划

本基金已于 2017 年 10 月 16 日开始办理定期定额投资业务。定期定额投资业务规则可详见刊登于本公司网站的《先锋基金管理有限公司开放式基金业务规则》及《先锋聚优灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务公告》。

## 十七、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。

## 十八、基金份额的转让

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

## 十九、其他业务

在不违反法律法规及中国证监会规定的前提下，基金管理人可在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情形下，办理基金份额的质押业务或其他基金业务，基金管理人可制定相应的业务规则，并依照《信息披露办法》的有关规定进行公告。



## 第九部分 基金的投资

### 一、投资目标

本基金以资产配置为导向，在股票、债券、短期金融工具等之间进行动态选择，在控制风险的前提下追求基金资产的长期稳健增值。

### 二、投资范围

本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证、国债、金融债券、地方政府债、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、企业债券、公司债券、可转换公司债券（含可分离交易可转债）、可交换公司债券、资产支持证券、次级债、同业存单、债券回购、银行存款、货币市场工具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）。

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。

股票投资占基金资产的比例范围为0-95%。本基金每个交易日日终应当保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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

### 三、投资策略

#### 1、大类资产配置

从宏观经济环境和证券市场走势进行研判，结合考虑相关类别资产的风险收益水平，动态调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例，优化投资组合。

#### 2、股票投资策略

本基金采用自上而下与自下而上相结合的选股策略，从宏观经济转型、政策制度导向、产业的升级与变革等多个角度，前瞻性地判断下一阶段可能涌现出的新经济领域和板块，同时从定性和定量的角度，自下而上地分析上市公司的基本面情况和估值水平，精选具有投资价值的个股。

在行业的配置选择上，本基金将持续跟踪、研究分析受益于宏观经济转型、政策制度导向、产业的升级与变革等的典型产业，在避免行业集中度过高的基础上，选择其中受益程度高、成长性好的相关主题行业进行重点配置。

在个股的具体选择策略上，采取自下而上的方式，主要从定量分析、定性分析两个方面对上市公司进行考察，精选个股。并根据市场走势与上市公司基本面的变化，适时调整股票投资组合。

#### 定量分析

(1) 成长性指标：主营业务收入增长率、净利润增长率等；

(2) 财务指标：毛利率、营业利润率、净利率、净资产收益率、经营活动净收益/利润总额等；

(3) 估值指标：市盈率（PE）、市盈率相对盈利增长比率（PEG）、市销率（PS）和总市值。绝对估值与相对估值相结合。

#### 定性分析

(1) 公司的核心竞争力，体现在行业地位、市场占有率、产品、技术、品牌、营销、资源、渠道等多个方面；

(2) 具有良好的公司管理能力和治理结构。

### 3、债券投资策略

通过对宏观经济趋势、金融货币政策、供求因素、估值因素、市场行为因素等进行评估分析，对固定收益类资产和货币资产等的预期收益进行动态跟踪，从而决定其配置比例。固定收益类资产中，本基金将采取久期管理、收益率曲线策略、类属配置等积极投资策略，在不同券种之间进行配置。

### 4、资产支持证券投资策略

资产支持证券主要包括资产抵押贷款支持证券（ABS）、住房抵押贷款支持证券（MBS）等证券品种。本基金将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析，并辅助采用数量化定价模型，评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。

### 5、权证投资策略

本基金将在严格控制风险的前提下，主动进行权证投资。基金权证投资将以价值分析为基础，在采用数量化模型分析其合理定价的基础上，把握市场的短期波动，进行积极操作，追求在风险可控的前提下实现稳健的超额收益。

#### 四、投资限制

##### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

- （1）股票投资占基金资产的比例范围为0-95%；
- （2）本基金每个交易日日终应当保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；
- （3）本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的10%；
- （4）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的10%；
- （5）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的3%；
- （6）本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的10%；
- （7）本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的0.50%；
- （8）本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的10%；
- （9）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的20%；
- （10）本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的10%；
- （11）本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%；
- （12）本基金应投资于信用级别评级为BBB以上(含BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标

准，应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出；

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

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

（15）基金总资产不得超过基金净资产的140%；

（16）本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的15%；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%；

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

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

（19）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述第（2）、（12）、（17）、（18）条外，因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

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

如果法律法规或监管部门对上述投资组合比例限制进行变更的，以变

更后的规定为准。如法律法规或监管部门取消上述限制，且适用于本基金，在履行适当程序后本基金投资不再受相关限制，不需要经过基金份额持有人大会审议。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

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

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或从事其他重大关联交易的，应当符合本基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

如果法律、行政法规或监管机关取消上述禁止规定，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

## 五、业绩比较基准

沪深300指数收益率×55%+中债总指数收益率×45%

沪深300指数是中证指数有限公司依据国际指数编制标准并结合中国市场的实际情况编制的沪深两市统一指数，科学地反映了我国证券市场的整体业绩表现，具有一定的权威性和市场代表性，业内也普遍采用。因此，沪深300指数是衡量本基金股票投资业绩的理想基准。中债总指数是由中央国债登记结算公司编制的具有代表性的债券市场指数。

如果今后法律法规发生变化，或者有其他代表性更强、更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时，在符合法律法规的规定和基金合同的约定且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人与基金托管人协商一致并按照监管部门要求履行适当程序后可变更业绩比较基准并及时公告。

## 六、风险收益特征

本基金为混合型基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。

## 七、基金管理人代表基金行使相关权利的处理原则及方法

- 1、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使相关权利，保护基金份额持有人的利益；
- 2、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；
- 3、有利于基金财产的安全与增值；
- 4、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

## 八、基金的投资组合报告

本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。

本基金的基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金基金合同规定复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至 2022 年 12 月 31 日（本报告中财务数据未经审计）。

### 1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	2,897,088.50	91.76
	其中：股票	2,897,088.50	91.76
2	基金投资	-	-

3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的 买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付 金合计	250,490.81	7.93
8	其他各项资产	9,708.69	0.31
9	合计	3,157,288.00	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	-	-
B	采矿业	79,391.00	2.55
C	制造业	2,536,922.33	81.51
D	电力、热力、燃气 及水生产和供应 业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和 邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和 信息技术服务业	66,330.00	2.13
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务 业	-	-

M	科学研究和技术服务业	214,445.17	6.89
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,897,088.50	93.09

### 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	603688	石英股份	700	91,924.00	2.95
2	688390	固德威	254	82,064.86	2.64
3	603596	伯特利	1,000	79,800.00	2.56
4	688499	利元亨	506	79,634.28	2.56
5	603979	金诚信	3,100	79,391.00	2.55
6	002049	紫光国微	600	79,092.00	2.54
7	002459	晶澳科技	1,300	78,117.00	2.51
8	688063	派能科技	247	77,965.55	2.51
9	688202	美迪西	363	77,642.07	2.49
10	002594	比亚迪	300	77,091.00	2.48

### 4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。



## 5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

## 10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 11 投资组合报告附注

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

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

### 11.2 报告期内基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 11.3 其他资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	3,204.75

2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	6,503.94
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,708.69

#### 11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## 第十部分 基金的业绩

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。基金业绩数据截至 2022 年 12 月 31 日。

本基金基金合同生效日为 2017 年 9 月 15 日，基金合同生效以来基金投资业绩与同期业绩比较基准的比较如下表所示：

### 1 先锋聚优A净值表现

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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
基金合同生效日至2017年12月31日	0.35%	0.79%	2.57%	0.40%	-2.22%	0.39%
2018年1月1日至2018年12月31日	-25.62%	0.94%	-10.72%	0.73%	-14.90%	0.21%
2019年1月1日至2019年12月31日	8.99%	1.21%	21.35%	0.67%	-12.36%	0.54%
2020年1月1日至2020年12月31日	43.43%	1.70%	16.51%	0.77%	26.92%	0.93%
2021年1月1日至2021年12月31日	8.77%	1.16%	-0.03%	0.65%	8.80%	0.51%
2022年1月1日至2022年12月31日	-15.42%	1.84%	-10.78%	0.70%	-4.64%	1.14%
自基金合同生效起至2022年12月31日	7.34%	1.38%	15.50%	0.69%	-8.16%	0.69%

### 2 先锋聚优C净值表现

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

基金合同生效日至2017年12月31日	0.21%	0.79%	2.57%	0.40%	-2.36%	0.39%
2018年1月1日至2018年12月31日	-22.96%	0.97%	-10.72%	0.73%	-12.24%	0.24%
2019年1月1日至2019年12月31日	8.51%	1.21%	21.35%	0.67%	-12.84%	0.54%
2020年1月1日至2020年12月31日	43.13%	1.70%	16.51%	0.77%	26.62%	0.93%
2021年1月1日至2021年12月31日	8.56%	1.16%	-0.03%	0.65%	8.59%	0.51%
2022年1月1日至2022年12月31日	-15.60%	1.84%	-10.78%	0.70%	-4.82%	1.14%
自基金合同生效起至2022年12月31日	9.86%	1.39%	15.50%	0.69%	-5.64%	0.70%

## 第十一部分 基金的财产

### 一、基金资产总值

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

### 二、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### 三、基金财产的账户

基金托管人根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立托管资金专门账户、证券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、登记机构和基金销售机构以其自有的财产承担其自身的法律责任，其债权人不得对本基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。除依法律法规和《基金合同》的规定处分外，基金财产不得被处分。

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

## 第十二部分 基金资产的估值

### 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

基金所拥有的股票、权证、债券和银行存款本息、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) 交易所上市的非固定收益类有价证券（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固定收益品种按估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值，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固定收益品种按估值日收盘价减去收盘价中所含的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，按最近交易日收盘价减去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，以第三方估值机构提供的价格数据估值；对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，按成本估值。

4、同一证券同时在两个或两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。

5、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。

6、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，按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。

#### 四、估值程序

1、各类基金份额净值是按照每个工作日闭市后，该类基金资产净值除以当日该类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。特殊情况下，基金管理人可与基金托管人、登记机构协商增加基金份额净值计算位数，以维护基金投资人利益。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人于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。如遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将各类基金份额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，由基金管理人按约定对外公布。

## 五、估值错误的处理

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

基金合同的当事人应按照以下约定处理：

### 1、估值错误类型

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

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

### 2、估值错误处理原则

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

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

（3）因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义



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

（4）估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

### 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

（4）根据估值错误处理的方法，需要修改登记机构交易数据的，由登记机构进行更正，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0.50%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基金估值；

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的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的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 5 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理；

2、由于不可抗力原因，或由于证券交易所、证券经纪机构或登记结算公司发送的数据错误，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但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、基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

## 第十三部分 基金的收益与分配

### 一、基金利润的构成

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20%，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该类别基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

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

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

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在对基金份额持有人利益无实质不利影响的情况下，基金管理人可在法律法规允许的前提下与基金托管人协商一致并按照监管部门要求履行适当程序后酌情调整以上基金收益分配原则，此项调整不需要召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在指定媒介公告。

### 四、收益分配方案

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

### 五、基金收益分配方案的确定、公告与实施

1、本基金收益分配方案由基金管理人拟定、由基金托管人复核后确定，基金管理人按法律法规的规定公告并向中国证监会备案。

2、本基金收益分配的发放日距离收益分配基准日的时间不超过15个工作日。在分配方案公布后，依据分配方案的规定，基金管理人就支付的现金红利向基金托管人发送划款指令，基金托管人按照基金管理人的指令及时进行分红资金的划付。

3、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### **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，登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为对应类别的基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。

## 第十四部分 基金的费用与税收

### 一、基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、本基金从C类份额的基金财产中计提的销售服务费；
- 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、诉讼费和仲裁费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、基金的开户费用、账户维护费用；
- 10、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

### 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.80%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日支付。

#### 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 0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日支付。

### 3、C 类基金份额的销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.20% 年费率计提。计算方法如下：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

C 类基金份额销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人代付给销售机构。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日支付。

本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务，基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。

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

### 三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

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

#### 四、基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## 第十五部分 基金的会计和审计

### 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从业资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意。
- 3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所需在2日内在指定媒介公告并报中国证监会备案。



## 第十六部分 基金的信息披露

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

### 二、信息披露义务人

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

本基金信息披露义务人按照法律法规和中国证监会的规定披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。

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、法人或者其他组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；
- 6、中国证监会禁止的其他行为。

四、本基金公开披露的信息应采用中文文本。如同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证两种文本的内容一致。两种文本发生歧义的，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

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。

基金募集申请在中国证监会注册后，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；基金管理人、基金托管人应当将《基金合同》、基金托管协议登载在网站上。

## （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登载《基金合同》生效公告。

## （四）基金资产净值、基金份额净值

《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，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，分别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。

基金管理人应当公告中期和年度最后一个市场交易日基金资产净值和各类基金份额的基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定媒介。

#### （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份额发售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、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。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。

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

基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，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。

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

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

#### （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；
- 2、终止《基金合同》；
- 3、转换基金运作方式；
- 4、更换基金管理人、基金托管人；
- 5、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- 6、基金管理人股东及其出资比例发生变更；
- 7、基金募集期延长；
- 8、基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动；
- 9、基金管理人的董事在一年内变更超过百分之五十；
- 10、基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过百分之三十；
- 11、涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或者仲裁；
- 12、基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查；
- 13、基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚，基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚；
- 14、重大关联交易事项；
- 15、基金收益分配事项；
- 16、管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- 17、基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；
- 18、基金改聘会计师事务所；
- 19、变更基金销售机构；
- 20、更换登记机构；
- 21、本基金开始办理申购、赎回；
- 22、本基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；
- 23、本基金发生巨额赎回并延期办理；

- 24、本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；
- 25、本基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；
- 26、新增或调整本基金份额类别设置；
- 27、发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；
- 28、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）投资资产支持证券信息披露

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

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

#### （十一）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，指定专人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的规定。

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、各类基金份额的基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告和定期更新的招募说明书、基金

产品资料概要等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人出具书面文件或者盖章确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定媒介中选择披露信息的报刊。

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。

### 七、信息披露文件的存放与查阅

招募说明书公布后，应当分别置备于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的住所，供公众查阅、复制。

基金定期报告公布后，应当分别置备于基金管理人和基金托管人的住所，以供公众查阅、复制。

## 第十七部分 风险揭示

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

基金在投资运作过程中可能面临各种风险，既包括市场风险，也包括 基金自身的管理风险、技术风险和合规风险等。巨额赎回风险是开放式基 金所特有的一种风险，对于本基金来说，巨额赎回即当单个交易日基金的 净赎回申请超过上一开放日基金总份额的10%时，投资人将可能无法及时 赎回持有的全部基金份额。

基金分为股票基金、混合基金、债券基金、货币市场基金等不同类型， 投资人投资不同类型的基金将获得不同的收益预期，也将承担不同程度的 风险。一般来说，基金的收益预期越高，投资人承担的风险也越大。

投资人应当认真阅读基金合同、招募说明书等基金法律文件，了解基 金的风险收益特征，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状 况等判断基金是否和投资人的风险承受能力相适应。

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

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产， 但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩及其净值 高低并不预示其未来业绩表现，基金管理人管理的其他基金的业绩不构成 对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负” 原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险， 由投资人自行承担。

投资人应当通过基金管理人或具有基金销售业务资格的其他机构申购 和赎回基金，基金销售机构名单详见本基金基金份额发售公告。

本基金在认购期内按1.00元面值发售并不改变基金的风险收益特征。投资人按1.00元面值购买基金份额以后，有可能面临基金份额净值跌破1.00元、从而遭受损失的风险。

投资于本基金的主要风险包括：

### 一、系统性风险

系统性风险是指因整体政治、经济、社会等环境因素对股票债券价格产生影响而形成的风险，主要包括政策风险，经济周期风险，利率风险，购买力风险等因素。

#### 1、政策风险

货币政策、财政政策、产业政策等国家宏观经济政策和法律法规的变化对证券市场产生一定影响，从而导致市场价格波动，影响基金收益而产生的风险。

#### 2、经济周期风险

经济运行具有周期性的特点，经济运行周期性的变化会对基金所投资的证券的基本面产生影响，从而影响证券的价格而产生风险。

#### 3、利率风险

金融市场利率的波动会直接导致股票市场及债券市场的价格和收益率产生变动，同时也影响到证券市场资金供求状况，以及拟投资上市公司的融资成本和利润水平。上述变化将直接影响证券价格和本基金的收益。

#### 4、购买力风险

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

#### 5、汇率风险

汇率的变动可能会影响基金投资标的的价格和基金资产的实际购买力。

#### 6、其他风险

因战争、自然灾害等不可抗力产生的风险。

### 二、非系统性风险

非系统性风险是指个别证券特有的风险，包括企业的信用风险、经营风险、财务风险及债券发行人的信用风险等。拟投资上市公司的经营状况受到多种因素影响，如管理层能力、财务状况、市场前景、行业竞争能力、



技术更新、研究开发、人员素质等都会导致上市公司盈利发生变化。如果基金所投资的上市公司经营不善，将导致其股票价格下跌或股息、红利减少，从而使基金投资收益下降。基金可以通过多样化投资来分散这种非系统性风险。

### 1、基金管理风险

基金管理风险指基金管理人在基金管理实施过程中产生的风险，主要包括管理风险、交易风险、流动性风险、运营风险及道德风险。

### 2、管理风险

在基金管理运作过程中，由于基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等主观因素的限制而影响其对信息的占有以及对经济形势、证券价格走势的判断，或者由于基金数量模型设计不当或实施差错导致基金收益水平偏离业绩基准从而影响基金收益水平。对主要业务人员如基金经理的依赖也可能产生管理风险。

### 3、交易风险

由于交易权限或业务流程设置不当导致交易执行流程不畅通，交易指令的执行产生偏差或错误，或者由于故意或重大过失未能及时准确执行交易指令，事后也未能及时通知相关人员或部门，导致基金利益的直接损失。

### 4、流动性风险

在市场或者个别证券流动性不足的情况下，基金管理人可能无法迅速、低成本地调整基金投资组合，从而对基金收益造成不利影响。

由于开放式基金的特殊要求，本基金必须保持一定的现金比例以应付赎回要求，在管理现金头寸时，有可能存在现金不足的风险或现金过多所导致的收益下降风险。

#### （1）拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

本基金的投资市场主要为证券交易所、全国银行间债券市场等流动性较好的规范型交易场所，主要投资对象为具有良好流动性的金融工具（包括国内依法发行上市的股票、债券和货币市场工具等），同时本基金基于分散投资的原则在行业和个券方面未有高集中度的特征，综合评估在正常市场环境下本基金的流动性风险适中。

#### （2）巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

基金出现巨额赎回情形下，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况或巨额赎回份额占比情况决定全额赎回或部分延期赎回。同时，如本基金单个基金份额持有人在单个开放日申请赎回基金份额超过基金总份额一定比例以上的，基金管理人有权对其采取延期办理赎回申请或延缓支付赎回款项的措施。

(3) 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

在市场大幅波动、流动性枯竭等极端情况下发生无法应对投资者巨额赎回的情形时，基金管理人将以保障投资者合法权益为前提，严格按照法律法规及基金合同的规定，谨慎选取延期办理巨额赎回申请、暂停接受赎回申请、延缓支付赎回款项、收取短期赎回费、暂停估值等流动性风险管理工具作为辅助措施。对于各类流动性风险管理工具的使用，基金管理人将依照严格审批、审慎决策的原则，及时有效地对风险进行监测和评估，使用前经过内部审批程序并与基金托管人协商一致。在实际运用各类流动性风险管理工具时，投资者的赎回申请、赎回款项支付等可能受到相应影响，基金管理人将严格依照法律法规及基金合同的约定进行操作，全面保障投资者的合法权益。

### 5、运营风险

由于运营系统、网络系统、计算机或交易软件等发生技术故障或瘫痪等情况而无法正常工作完成基金的申购、赎回、登记、清算交收等指令而产生的操作风险，或者由于操作过程效率低下或人为疏忽和错误而产生的操作风险。

### 6、道德风险

是指员工违背职业道德、法规和公司制度，通过内幕信息、利用工作程序中的漏洞或其他不法手段谋取不正当利益所带来的风险。

## 三、本基金的特定风险

1、本基金股票投资占基金资产的比例范围为0-95%，相对灵活的资产配置比例容易造成收益波动率大幅提升的风险。

2、本基金可投资资产支持证券，相关风险包括：（1）与基础资产相关的风险：主要包括特定原始权益人破产风险、现金流预测风险等基础资产

相关的风险；（2）与资产支持证券相关的风险：主要包括资产支持证券信用增级措施相关风险、资产支持证券的利率风险、资产支持证券的流动性风险、评级风险等与资产支持证券相关的风险；（3）其他风险：主要包括政策风险、税收风险、发生不可抗力事件的风险、技术风险和操作风险。

## 第十八部分 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应当报中国证监会备案，且自决议生效后两个工作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剩余财产中支付。

#### **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会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

#### **七、基金财产清算账册及文件的保存**

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 第十九部分 基金合同的内容摘要

### 一、基金合同当事人的权利与义务

#### （一）基金管理人的权利与义务

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

- （1）依法募集资金；
- （2）自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
- （3）依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- （4）销售基金份额；
- （5）按照规定召集基金份额持有人大会；
- （6）依据《基金合同》及有关法律、法规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律、法规规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- （7）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- （8）选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；
- （9）担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；
- （10）依据《基金合同》及有关法律、法规规定决定基金收益的分配方案；
- （11）在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；
- （12）依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- （13）在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；
- （14）以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- （15）选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；

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

(17) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

(1) 依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构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资产净值，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、中期和年度基金报告；

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

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

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

(14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(26) 建立并保存基金份额持有人名册；

(27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## (二) 基金托管人的权利与义务

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



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

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

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

(4) 根据相关市场规则，为基金开设证券账户、托管资金专门账户等投资所需账户，为基金办理证券交易资金清算；

(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托管资金专门账户、证券账户和投资所需其他账户，按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

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

(8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、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、中期和年度基金报告出具意见，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) 从基金管理人或其委托的登记机构处接收并保存基金份额持有人名册；

(13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

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

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

(16) 按照法律法规和《基金合同》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。

(三) 基金份额持有人

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

同一类别每份基金份额具有同等的合法权益。

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) 根据基金合同的约定，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、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；

(9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

(1) 认真阅读并遵守《基金合同》、招募说明书等信息披露文件；

(2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；

(3) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；

(4) 缴纳基金认购、申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；

(5) 在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；

(6) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；

(7) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；

(9) 遵守基金管理人、基金托管人、销售机构和登记机构的相关交易及业务规则；

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

(11) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

## 二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由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不设日常机构。

### （一）召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

(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提高销售服务费；

(6) 变更基金类别；

(7) 本基金与其他基金的合并；

(8) 变更基金投资目标、范围或策略；

(9) 变更基金份额持有人大会程序；

(10) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；

(11) 单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的

基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；

（12）对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

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

2、在不违反法律法规和基金合同约定的情况下，以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

（1）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）在法律法规和基金合同规定的范围内且在对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下变更收费方式、调整本基金的基金份额类别的设置；

（4）因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；

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

（6）在符合有关法律法规且在对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，经中国证监会允许，基金管理人在法律法规规定的范围内调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则；

（7）在法律法规或中国证监会允许的范围内且在对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下推出新业务或服务；

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

## （二）会议召集人及召集方式

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

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。

3、基金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、通讯开会方式及法律法规、监管机关允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。基金管理人、基金托管人须为基金份额持有人行使投票权提供便利。

1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托证明委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或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二分之一（含二分之一）；若到会者在权益登记日所持有的有效基金份额少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、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到会者在权益登记日代表的有效的基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之一

（含三分之一）。

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式在表决截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）本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）；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三分之一以上（含三分之一）基金份额的持有人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见；

（4）上述第（3）项中直接出具意见的基金份额持有人或受托代表他人出具意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具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，并与登记机构记录相符。

3、在法律法规和监管机关允许的情况下，经会议通知载明，本基金的基金份额持有人亦可采用其他非书面方式授权其代理人出席基金份额持有人大会。在会议召开方式上，本基金亦可采用其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开基金份额持有人大会，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。



## （五）议事内容与程序

### 1、议事内容及提案权

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

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

### 2、议事程序

#### （1）现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第（七）条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

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

#### （2）通讯开会

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

## （六）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

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

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

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

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

#### （七）计票

##### 1、现场开会

（1）如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人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 个工作日内在指定媒介公告。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，基金管理人经与基金托管人协商一致并提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

## 三、基金合同解除和终止的事由、程序

### （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应当报中国证监会备案，且自决议生效后两个工作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剩余财产中支付。

#### （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会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

#### （七）基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

### 四、争议解决方式

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交北京仲裁委员会，根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点在北京市，仲裁裁决是终局性的并对相关各方均有约束力，除非仲裁裁决另有规定，仲裁费用由败诉方承担。

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

《基金合同》受中国法律管辖。

### 五、基金合同存放地和投资人取得合同的方式

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

## 第二十部分 托管协议的内容摘要

### 一、基金托管协议当事人

#### （一）基金管理人

名称：先锋基金管理有限公司

住所：深圳市福田区福田街道福安社区益田路5033号平安金融中心70楼7001-7002室

办公地址：北京市朝阳区新源南路6号京城大厦A座2106

法定代表人：Wong Leah Kuen

成立时间：2016年5月16日

批准设立机关：中国证监会

批准设立文号：中国证监会证监许可〔2016〕859号

经营范围：公开募集证券投资基金管理、基金销售、特定客户资产管理和中国证监会许可的其他业务

注册资本：15,500万元人民币

组织形式：有限责任公司

存续期间：持续经营

#### （二）基金托管人

名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）

住所：上海市浦东新区银城中路188号（邮政编码：200120）

办公地址：上海市长宁区仙霞路18号（邮政编码：200336）

法定代表人：牛锡明

成立时间：1987年3月30日

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

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字〔1998〕25号

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

注册资本：742.62亿元人民币

组织形式：股份有限公司

存续期间：持续经营

## 二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

### （一）基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权

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

本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证、国债、金融债券、地方政府债、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、企业债券、公司债券、可转换公司债券（含可分离交易可转债）、可交换公司债券、资产支持证券、次级债、同业存单、债券回购、银行存款、货币市场工具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）。

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。

股票投资占基金资产的比例范围为 0-95%。本基金每个交易日日终应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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

基金托管人对基金管理人业务进行监督和核查的义务自基金合同生效日起开始履行。

2、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金投资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督：

（1）股票投资占基金资产的比例范围为 0-95%；

（2）本基金每个交易日日终应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

(3) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；

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

(5) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

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

(7) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.50%；

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

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

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

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

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

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

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

(15) 基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

(16) 本基金管理人管理的、且由本基金托管人托管的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的、且由本基金托管人托管的全部投资组合持



有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%；

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

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

（19）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。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。除上述第（2）、（12）、（17）、（18）条外，因证券市场波动、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不符合基金合同约定的投资比例规定的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整。

如果法律法规或监管部门对上述投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。如法律法规或监管部门取消上述限制，且适用于本基金，在履行适当程序后本基金投资不再受相关限制，不需要经过基金份额持有人大会审议。

基金托管人依照上述规定对本基金的投资组合限制及调整期限进行监督。

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

- （1）承销证券；
- （2）违反规定向他人贷款或者提供担保；
- （3）从事承担无限责任的投资；
- （4）买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；
- （5）向本基金的基金管理人、基金托管人出资；

(6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

(7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

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

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，如适用于本基金，可不受上述规定的限制。

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

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

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

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

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

基金投资银行定期存款的，基金管理人应根据法律法规的规定及基金合同的约定，确定符合条件的所有存款银行的名单，并及时提供给基金托

管人，基金托管人应据以对基金投资银行存款的交易对手是否符合有关规定进行监督。

本基金投资银行存款应符合如下规定：

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

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

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

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

#### 6、基金托管人对基金投资流通受限证券的监督

（1）流通受限证券与上文所述的流动性受限资产并不完全一致，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。本基金投资流通受限证券，应遵守《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。

（2）基金管理人应在基金首次投资流通受限证券前，向基金托管人提供经基金管理人董事会批准的有关基金投资流通受限证券的投资决策流程、风险控制制度。基金投资非公开发行股票，基金管理人还应提供基金管理人董事会批准的流动性风险处置预案。上述资料应包括但不限于基金投资流通受限证券的投资额度和投资比例控制情况。基金管理人应至少于首次执行投资指令之前两个工作日将上述资料书面发至基金托管人，保证基金

托管人有足够的时间进行审核。基金托管人应在收到上述资料后两个工作日内，以书面或其他双方认可的方式确认收到上述资料。

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

### 三、基金管理人对于基金托管人的业务核查

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

基金管理人定期和不定期地对基金托管人保管的基金资产进行核查。基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复并改正。

基金管理人发现基金托管人未对基金资产实行分账管理、擅自挪用基金资产、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、《基金合同》、本协议及其他有关规定的，应及时以

书面形式通知基金托管人在限期内纠正，基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金管理人发出回函。在限期内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应报告中国证监会。对基金管理人按照法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的，基金托管人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

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

#### 四、基金财产的保管

##### （一）基金财产保管的原则

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

2、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。

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

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和独立。

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

##### （二）基金募集资产的验证

基金募集期满或基金提前结束募集之日起10日内，由基金管理人聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的2名以上（含2名）中国注册会计师签字有效。验资完成，基金管理人应将募集到的全部资金存入基金托管人为基金开立的基金银行存款账户中，基金托管人在收到资金当日出具相关证明文件。

##### （三）基金的银行存款账户的开立和管理

1、基金托管人应负责本基金银行存款账户的开立和管理。

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

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

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

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

#### （四）基金证券交收账户、资金交收账户的开立和管理

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

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

基金管理人不得对基金证券交收账户、资金交收账户进行证券的超卖或超买。

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

#### （五）债券托管账户的开立和管理

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

进行交易，由基金管理人在中国外汇交易中心开设同业拆借市场交易账户。

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

#### （六）其他账户的开立和管理

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

（七）基金财产投资的有关实物证券、银行存款定期存单等有价凭证的保管

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

银行存款定期存单等有价凭证由基金托管人负责保管。

#### （八）与基金财产有关的重大合同的保管

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

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

### 五、基金资产净值计算和会计核算

#### （一）基金资产净值及基金份额净值的计算与复核

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

基金管理人应每工作日对基金资产估值。估值原则应符合《基金合同》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》及其他法律、法规的规定。用于基金信息披露的基金资产净值和



各类基金份额的基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金资产净值，以约定方式发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核后，将复核结果反馈给基金管理人，由基金管理人各类基金份额的基金份额净值予以公布。

本基金按以下方法估值：

#### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

(1) 交易所上市的非固定收益类有价证券（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固定收益品种按估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值，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固定收益品种按估值日收盘价减去收盘价中所含的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，按最近交易日收盘价减去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，以第三方估值机构提供的价格数据估值；对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，按成本估值。

4、同一证券同时在两个或两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。

5、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。

6、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，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，按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。

## (二) 净值差错处理

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

(1) 如采用本协议第八章“基金资产净值及基金份额净值的计算与复核”中估值方法的第(1)－(6)进行处理时，若基金管理人净值计算出错，基金托管人在复核过程中没有发现，且造成基金份额持有人损失的，应根

据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金，就实际向投资者或基金支付的赔偿金额，由基金管理人与基金托管人按照管理费率 and 托管费率的比例各自承担相应的责任；

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

（3）基金管理人、基金托管人按估值方法的第（5）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。

由于证券交易所、证券经纪机构及登记结算公司发送的数据错误，或由于其他不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施消除或降低由此造成的影响。

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

### （三）基金会计制度

按国家有关部门制定的会计制度执行。

### （四）基金账册的建立

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

### （五）会计数据和财务指标的核对

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

以基金管理人的账册为准。

#### （六）基金定期报告的编制和复核

基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。月度报表的编制，应于每月终了后5个工作日内完成。定期报告文件应按中国证监会的要求公告。季度报表的编制，应于每季度终了后15个工作日内完成；基金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。在上半年结束之日起两个月内完成中期报告编制并公告；在每年结束之日起三个月内完成年度报告编制并公告。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。

基金管理人在月初3个工作日内完成上月度报表的编制，经盖章后，以传真方式将有关报表提供基金托管人；基金托管人收到后在2个工作日内进行复核，并将复核结果及时书面通知基金管理人。对于季度报告、中期报告、年度报告、更新招募说明书等定期报告，基金管理人和基金托管人应在上述监管部门规定的时间内完成编制、复核及公告。基金托管人在复核过程中，发现双方的报表存在不符时，基金管理人和基金托管人应共同查明原因，进行调整，调整以双方认可的账务处理方式为准。如果基金管理人与基金托管人不能于应当发布公告之日前就相关报表达成一致，基金管理人有权按照其编制的报表对外发布公告，基金托管人有权就相关情况报证监会备案。

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

### 六、基金份额持有人名册的的保管

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

基金份额持有人名册，包括基金募集期结束时的基金份额持有人名册、基金权益登记日的基金份额持有人名册、基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册、每年最后一个交易日的基金份额持有人名册，由基金

登记机构负责编制和保管，并对基金份额持有人名册的真实性、完整性和准确性负责。

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

（一）基金管理人于《基金合同》生效日及《基金合同》终止日后10个工作日内向基金托管人提供由登记机构编制的基金份额持有人名册；

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

（三）基金管理人于每年最后一个交易日后10个工作日内向基金托管人提供由登记机构编制的基金份额持有人名册；

（四）除上述约定时间外，如果确因业务需要，基金托管人与基金管理人商议一致后，由基金管理人向基金托管人提供由登记机构编制的基金份额持有人名册。

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

## 七、争议解决方式

双方当事人同意，因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交北京仲裁委员会，根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点在北京市，仲裁裁决是终局性的并对双方均有约束力，除非仲裁裁决另有规定，仲裁费用由败诉方承担。

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

本协议受中国法律管辖。

## 八、托管协议的变更、终止与基金财产的清算

### （一）基金托管协议的变更

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

中国证监会备案。

## （二）基金托管协议的终止

- 1、《基金合同》终止；
- 2、基金托管人解散、依法被撤销、破产，被依法取消基金托管资格或因其他事由造成其他基金托管人接管基金财产；
- 3、基金管理人解散、依法被撤销、破产，被依法取消基金管理资格或因其他事由造成其他基金管理人接管基金管理权。
- 4、发生《基金法》、《销售办法》、《运作办法》或其他法律法规规定的终止事项。

## （三）基金财产的清算

### 1、基金财产清算组

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

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

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

### 2、基金财产清算程序

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

基金财产清算的期限为 6 个月。

### 3、清算费用

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

### 4、基金剩余财产的分配

基金财产按如下顺序进行清偿

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

### 5、基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告。基金财产清算组做出的清算报告经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算组进行公告。

### 6、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存期限不少于 15 年。

## 第二十一部分 对基金份额持有人的服务

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

### 一、主动通知服务

基金管理人通过短信、电子邮件、邮寄信件、传真或主动致电等方式按基金份额持有人意愿为基金份额持有人提供各项主动通知服务。主动通知服务内容包括账户交易确认通知以及基金份额持有人相关的基金管理人公告及重要信息通知等服务。请基金份额持有人留意各联系方式的完整性和准确性。

### 二、查询服务

基金管理人开通了24小时自助语音服务和网上查询服务。基金份额持有人可通过以上方式进行基金管理人信息查询和持有人账户信息查询。客服专员在工作时间还可为基金份额持有人提供周到的人工查询、答疑服务。

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

### 三、资料索取服务

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

### 四、资讯服务定制

为进一步提升服务品质，满足基金份额持有人个性化需要，基金管理人将根据需要适时推出全方位资讯服务定制计划。基金份额持有人届时可通过客户服务热线、客服邮箱定制各类资讯服务，敬请投资人留意。

基金管理人会按照基金份额持有人的要求通过电子邮件、短信等方式提供交易确认通知、持有基金周净值、对账单等资讯服务。

基金管理人可不定期发送其他资讯，以便基金份额持有人及时了解基金管理人发布的公告信息、市场研判、最新动态等。



## 五、基金理财业务咨询

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

## 六、投诉建议受理

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

## 七、互动活动

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

## 八、基金管理人客户服务中心联系方式

客户服务热线：400-815-9998

人工坐席服务时间：周一至周五（除节假日）9：00-17：00

网址：[www.xf-fund.com](http://www.xf-fund.com)

客服邮箱：[service@xf-fund.com](mailto:service@xf-fund.com)

九、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。

## 第二十二部分 招募说明书的存放及查阅方式

本招募说明书存放在基金管理人、基金托管人及基金销售机构的住所，投资者可免费查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复印件或复印件。投资人也可在基金管理人指定的网站上进行查阅。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

## 第二十三部分 备查文件

（一）中国证监会准予先锋聚优灵活配置混合型证券投资基金募集注册的文件

（二）《先锋聚优灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

（三）《先锋聚优灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

（四）关于申请募集注册先锋聚优灵活配置混合型证券投资基金之法律意见书

（五）基金管理人业务资格批件、营业执照

（六）基金托管人业务资格批件、营业执照

（七）中国证监会要求的其他文件

上述备查文件存放在基金管理人和基金销售机构的办公场所和营业场所，基金投资人可免费查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

## 第二十四部分 其他应披露事项

本基金2022年07月01日至2023年03月21日在中国证监会指定报刊和指定网站发布的公告：

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	先锋基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站、证监会指定网站	2022/7/9
2	先锋聚优灵活配置混合型证券投资基金2022年第二季度报告	证券日报、基金管理人网站、证监会指定网站	2022/7/21
3	先锋基金管理有限公司关于暂停喜鹊财富基金销售有限公司、钱景基金销售有限公司销售机构办理相关销售业务的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站、证监会指定网站	2022/8/5
4	先锋基金管理有限公司关于网上直销平台开通“超级现金宝”货币基金赎回转认/申购业务以及开展费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站、证监会指定网站	2022/8/15
5	先锋聚优灵活配置混合型证券投资基金2022年中期报告	证券日报、基金管理人网站、证监会指定网站	2022/8/31
6	先锋基金管理有限公司旗下基金2022年中期报告的更正公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站、证监会指定网站	2022/9/20
7	先锋聚优灵活配置混合型证券投资基金2022年第三季度报告	证券日报、基金管理人网站、证监会指定网站	2022/10/26
9	先锋聚优灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2022年第1号）	证券日报、基金管理人网站、证监会指定网站	2022/10/26
8	先锋聚优灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	证券日报、基金管理人网站、证监会指定网站	2022/10/26

10	先锋基金管理有限公司关于先锋聚优灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	证券日报、基金管理人网站、证监会指定网站	2022/12/29
12	先锋聚优灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新（更新）（2022年第2号）	证券日报、基金管理人网站、证监会指定网站	2022/12/31
11	先锋聚优灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	证券日报、基金管理人网站、证监会指定网站	2022/12/31
13	先锋基金管理有限公司旗下基金改聘会计师事务所的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站、证监会指定网站	2023/1/11
14	先锋基金管理有限公司关于先锋聚优灵活配置混合型证券投资基金的基金经理变更公告	证券日报、基金管理人网站、证监会指定网站	2023/1/13
15	先锋聚优灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	证券日报、基金管理人网站、证监会指定网站	2023/1/17
16	先锋聚优灵活配置混合型证券投资基金2022年第四季度报告	证券日报、基金管理人网站、证监会指定网站	2023/1/19
17	先锋基金管理有限公司关于董事长（法定代表人）变更的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站、证监会指定网站	2023/1/20
18	先锋基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站、证监会指定网站	2023/1/20
19	先锋基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站、证监会指定网站	2023/1/20
20	先锋基金管理有限公司关于北京办公地址变更的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、	2023/3/21

		基金管理人网站、证监会 指定网站	
--	--	---------------------	--

先锋基金管理有限公司

2023年3月23日