



# 交银施罗德先进制造混合型证券投资基金

## (更新)招募说明书

(2023年第1号)

基金管理人：交银施罗德基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

二〇二三年五月

## 重要提示

交银施罗德先进制造混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）由交银施罗德先进制造股票证券投资基金变更而来，交银施罗德先进制造股票证券投资基金经2011年4月29日中国证券监督管理委员会证监许可【2011】639号文核准募集，并经2018年1月5日中国证监会证监许可【2018】62号文准予变更注册。交银施罗德先进制造混合型证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会，大会于2018年3月20日表决通过了《关于交银施罗德先进制造混合型证券投资基金调整投资范围及修改基金合同有关事项的议案》，同意交银施罗德先进制造混合型证券投资基金调整投资范围、投资策略、投资比例限制、业绩比较基准、估值方法及修改基金合同等事宜。本基金经2021年5月31日中国证监会证监许可【2021】1896号文准予变更注册。交银施罗德先进制造混合型证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会，大会于2022年1月21日表决通过了《关于交银施罗德先进制造混合型证券投资基金调整投资范围及修改基金合同有关事项的议案》，同意在交银施罗德先进制造混合型证券投资基金投资范围中增加港股通标的股票，相应调整投资策略、投资比例限制、业绩比较基准、估值方法等内容，并调整基金赎回费率、增加基金合同自动终止条款、增加C类基金份额、增加侧袋机制相关表述以及修改基金合同其他部分条款等事项，上述基金份额持有人大会决议事项自表决通过之日起生效。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对交银施罗德先进制造股票证券投资基金募集的核准以及对本基金的变更注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，但不保证投资本基金一定盈利，也不保证基金份额持有人的最低收益；因基金价格可升可跌，亦不保证基金份额持有人能全数取回其原本投资。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资者在投资本基金前，需全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对投资本基金的意愿、时机、数量等

投资行为作出独立决策。投资者根据所持有份额享受基金的收益，但同时也需承担相应的投资风险。投资本基金可能遇到的风险包括：因政治、经济、社会等因素对证券价格波动产生影响而引发的市场风险；基金管理人在基金管理运作过程中产生的基金管理风险；流动性风险（包括实施侧袋机制时的特定风险）；交易对手或债券发行人违约产生的信用风险；本基金投资策略所特有的风险；投资资产支持证券的特定风险；投资股指期货的特定风险；投资流通受限证券的特定风险；投资科创板股票的特定风险；连续50个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或基金资产净值低于5000万元情形时基金管理人依基金合同约定提前终止基金合同的风险；投资本基金特有的其他风险等等。本基金是一只混合型基金，其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。

本基金可投资于股指期货，股指期货作为一种金融衍生品，其价值取决于一种或多种基础资产或指数，其评价主要源自于对挂钩资产的价格与价格波动的预期。投资股指期货所面临的风险主要是市场风险、流动性风险、基差风险、保证金风险、信用风险和操作风险。

本基金可投资资产支持证券，资产支持证券具有一定的价格波动风险、流动性风险、信用风险等风险，基金管理人将本着谨慎和控制风险的原则进行资产支持证券投资，请基金份额持有人关注包括投资资产支持证券可能导致的基金净值波动在内的各项风险。

基金投资流动受限证券将面临证券市场流动性风险，主要表现在几个方面：基金建仓困难，或建仓成本很高；基金资产不能迅速转变成现金，或变现成本很高；不能应付可能出现的投资者大额赎回的风险；证券投资中个券和个股的流动性风险等。

本基金可投资国内依法发行上市的存托凭证，基金净值可能受到存托凭证的境外基础证券价格波动影响，与存托凭证的境外基础证券、境外基础证券的发行人及境内外交易机制相关的风险可能直接或间接成为本基金风险。具体风险烦请查阅本招募说明书“风险揭示”章节内容。

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存托凭证或选择不将基金资产投资于存托凭证，基金资产并非必然投资存托凭证。

本基金投资内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的

香港联合交易所有限公司（以下简称“香港联合交易所”）上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）的，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险（港股市场实行T+0回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比A股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对基金的投资收益造成损失）、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险（在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险）等。具体风险请查阅本基金招募说明书“风险揭示”章节的具体内容。

基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股，基金资产并非必然投资港股。

投资有风险，投资者在投资本基金前应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同、基金产品资料概要等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，自主作出投资决策，自行承担投资风险。基金的过往业绩并不代表其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并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超过前述50%比例的除外。

本招募说明书所载内容截止日为2023年05月27日，有关财务数据和净值表现截止日为2023年03月31日。本招募说明书所载的财务数据未经审计。

## 目 录

重要提示.....	1
一、绪言.....	6
二、释义.....	7
三、基金管理人.....	13
四、基金托管人.....	21
五、相关服务机构.....	24
六、基金的历史沿革.....	65
七、基金的存续.....	67
八、基金份额的申购与赎回.....	68
九、基金的转换.....	84
十、基金的投资.....	91
十一、基金的业绩.....	106
十二、基金的财产.....	109
十三、基金资产的估值.....	110
十四、基金的收益与分配.....	117
十五、基金的费用与税收.....	119
十六、基金的会计与审计.....	122
十七、基金的信息披露.....	123
十八、侧袋机制.....	130
十九、风险揭示.....	133
二十、基金合同的变更、终止与基金财产的清算.....	143
二十一、基金合同的内容摘要.....	145
二十二、托管协议的内容摘要.....	161
二十三、对基金份额持有人的服务.....	179
二十四、其他应披露事项.....	181
二十五、招募说明书的存放及查阅方式.....	185
二十六、备查文件.....	186



## 一、绪言

《交银施罗德先进制造混合型证券投资基金招募说明书》(以下简称“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“《流动性规定》”)和其他相关法律法规的规定以及《交银施罗德先进制造混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)编写。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请变更注册的。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,并经中国证监会变更注册。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。基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。



## 二、释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

1、基金或本基金：指交银施罗德先进制造混合型证券投资基金，本基金由交银施罗德先进制造股票证券投资基金变更而来

2、基金管理人或本基金管理人：指交银施罗德基金管理有限公司

3、基金托管人或本基金托管人：指中国农业银行股份有限公司

4、基金合同：指《交银施罗德先进制造混合型证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充

5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《交银施罗德先进制造混合型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充

6、招募说明书或本招募说明书：指《交银施罗德先进制造混合型证券投资基金招募说明书》，及其更新

7、发售公告：指交银施罗德先进制造股票证券投资基金根据《运作办法》变更为混合型基金前的《交银施罗德先进制造股票证券投资基金份额发售公告》

8、基金产品资料概要：指《交银施罗德先进制造混合型证券投资基金基金产品资料概要》及其更新

9、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、司法解释、部门规章、地方性法规、地方政府规章及其他对基金合同当事人有约束力的规范性文件及对该等法律法规不时作出的修订

10、《基金法》：指《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订

11、《销售办法》：指《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

12、《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

13、《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

14、《流动性规定》：指《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订



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

16、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

17、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行保险监督管理委员会

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

19、个人投资者：指符合法律法规规定的条件可以投资证券投资基金的自然人

20、机构投资者：指符合法律法规规定可以投资证券投资基金的在中华人民共和国注册登记或经政府有关部门批准设立的机构

21、合格境外投资者：指符合《合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者境内证券期货投资管理办法》及相关法律法规规定使用来自境外的资金进行境内证券期货投资的境外机构投资者，包括合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者

22、基金投资者或投资者：指个人投资者、机构投资者、合格境外投资者，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者

23、基金份额持有人：指依招募说明书和基金合同合法取得基金份额的基金投资者

24、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，销售基金份额，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

25、销售机构：指交银施罗德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

26、注册登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括基金投资者基金账户的建立和管理、基金份额注册登记、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、办理非交易过户业务等

27、注册登记机构：指办理注册登记业务的机构。基金的注册登记机构为交银施罗德基金管理有限公司或接受交银施罗德基金管理有限公司委托代为办理注册登记业务的机构

28、基金账户：指注册登记机构为基金投资者开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户

29、基金交易账户：指销售机构为基金投资者开立的、记录基金投资者通过该销售机构办理交易业务而引起的基金份额的变动及结余情况的账户

30、基金合同生效日：指根据2021年12月21日至2022年1月20日基金份额持有人大会审议通过的《关于交银施罗德先进制造混合型证券投资基金调整投资范围及修改基金合同有关事项的议案》所修订的《交银施罗德先进制造混合型证券投资基金基金合同》生效日

31、基金合同终止日：指基金合同规定的基金合同终止事由出现后，按照基金合同规定的程序终止基金合同的日期

32、基金募集期：指自交银施罗德先进制造股票证券投资基金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

33、存续期：指《交银施罗德先进制造股票证券投资基金基金合同》生效至《交银施罗德先进制造混合型证券投资基金基金合同》终止之间的不定期期限

34、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

35、日：指公历日

36、月：指公历月

37、T日：指销售机构在规定时间受理基金投资者申购、赎回或其他基金业务申请的工作日

38、T+n日：指自T日起第n个工作日（不包含T日）

39、开放日：指为基金投资者办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日（若该工作日为非港股通交易日，则本基金可不开放）

40、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

41、认购：指在交银施罗德先进制造股票证券投资基金募集期间，基金投资者申请购买基金份额的行为

42、申购：指在基金存续期内，基金投资者按基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

43、赎回：指在基金存续期内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申请将基金份额转换为现金的行为

44、场外：指不通过上海证券交易所的交易系统办理基金份额认购、申购和赎

## 回等业务的销售机构和场所

45、场内：指通过上海证券交易所的交易系统办理基金份额认购、申购和赎回等业务的销售机构和场所

46、注册登记系统：指中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统

47、证券登记结算系统：指中国证券登记结算有限责任公司上海分公司证券登记结算系统

48、基金转换：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，向基金管理人提出申请将其所持有的基金管理人管理的某一开放式基金（转出基金）的全部或部分基金份额转换为基金管理人管理的其他开放式基金（转入基金）的基金份额的行为

49、定期定额投资计划：指基金投资者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，由销售机构在基金投资者指定银行账户内自动完成扣款并于每期约定的申购日提交基金申购申请的一种投资方式

50、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变更所持基金份额销售机构的行为，包括系统内转托管及跨系统转托管

51、系统内转托管：指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（交易单元）之间进行转登记的行为

52、跨系统转托管：指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统间进行转登记的行为

53、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）超过上一工作日基金总份额的10%的情形

54、元：指人民币元

55、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

56、基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、股指期货合约、银行存款本息、基金应收款项及其他资产的价值总和

57、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的净资产值

58、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的数值

59、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

60、港股通：指内地投资者委托内地证券公司，经由内地证券交易所在香港设立的证券交易服务公司，向香港联合交易所进行申报，买卖规定范围内的香港联合交易所上市的股票

61、销售服务费：指从基金财产中计提的，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

62、A类基金份额：指在投资人申购时收取申购费用且不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额

63、C类基金份额：指在投资人申购时不收取申购费用，并从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额

64、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

65、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

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

67、特定资产：包括：（一）无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性的资产；（二）按摊余成本计量且计提资产减值准备仍导致资产价值存在重大不确定性的资产；（三）其他资产价值存在重大不确定性的资产

68、规定媒介：指符合中国证监会规定条件的用以进行信息披露的全国性报刊

及《信息披露办法》规定的互联网网站（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

69、《业务规则》：指中国证券登记结算有限责任公司相关业务规则及其不时做出的修订

70、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，且在基金合同由基金管理人、基金托管人签署之日后发生的，使基金合同当事人无法全部或部分履行基金合同的任何事件，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律法规变化、突发停电或其他突发事件、证券/期货交易所非正常暂停或停止交易

### 三、基金管理人

#### (一) 基金管理人概况

名称：交银施罗德基金管理有限公司

住所：中国(上海)自由贸易试验区银城中路188号交通银行大楼二层（裙）

办公地址：上海市浦东新区世纪大道8号国金中心二期21-22楼

邮政编码：200120

法定代表人：阮红

成立时间：2005年8月4日

注册资本：2亿元人民币

存续期间：持续经营

联系人：郭佳敏

电话：(021) 61055050

传真：(021) 61055034

交银施罗德基金管理有限公司（以下简称“公司”）经中国证监会证监基金字[2005]128号文批准设立。公司股权结构如下：

股东名称	股权比例
交通银行股份有限公司（以下使用全称或其简称“交通银行”）	65%
施罗德投资管理有限公司	30%
中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司	5%

#### (二) 主要成员情况

##### 1、基金管理人董事会成员

阮红女士，董事长，博士。历任交通银行办公室副处长、处长，交通银行海外机构管理部副总经理、总经理，交通银行上海分行副行长，交通银行资产托管部总经理，交通银行投资管理部总经理，交银施罗德基金管理有限公司总经理。

童洁萍女士，董事，硕士。现任交通银行总行个人金融业务部副总经理。历任交通银行南京分行个人金融业务部副高级经理、江苏省分行个人金融业务部副总经理、总经理、玄武支行行长。

王贤家先生，董事，学士。现任交通银行总行风险管理部/内控案防办 副总经理。历任交通银行总行国际业务部外汇资金处交易员、澳门分行资金部主管、总行



金融市场部债券投资部副高级经理、外汇交易部高级经理。

谢卫先生，董事，总经理，博士，高级经济师。现任交银施罗德基金管理有限公司总经理，兼任交银施罗德资产管理(香港)有限公司董事长、交银施罗德资产管理有限公司董事长。历任中央财经大学教师，中国社会科学院财贸所助理研究员，中国电力信托投资公司基金部副总经理，中国人保信托投资公司证券部副总经理、总经理，北京证券营业部总经理、证券总部副总经理兼北方部总经理，富国基金管理有限公司副总经理，交银施罗德基金管理有限公司副总经理。

杜伟麒(Chris Durack)先生，董事，硕士。现任施罗德投资亚太区行政总裁。历任施罗德投资澳大利亚董事兼产品及分销主管、香港行政总裁兼亚太区机构业务主管、澳大利亚行政总裁兼亚太区联席主管等职。

章骏翔先生，副董事长，硕士，美国特许金融分析师(CFA)持证人。现任施罗德投资管理(香港)有限公司亚洲投资风险主管。历任渣打银行(香港)交易风险监控，华宝兴业基金管理有限公司风险管理部总经理，法国安盛投资管理(香港)有限公司亚洲风险经理等职。

郝爱群女士，独立董事，学士。历任人民银行稽核司副处长、处长，合作司调研员，非银司副巡视员、副司长，银监会非银部副主任，银行监管一部副主任、巡视员，汇金公司派出董事。

张子学先生，独立董事，博士。现任中国政法大学民商经济法学院教授，兼任基金业协会自律监察委员会委员。历任证监会办公厅副处长、上市公司监管部处长、行政处罚委员会专职委员、副主任审理员，兼任证监会上市公司并购重组审核委员会委员、行政复议委员会委员。

黎建强先生，独立董事，博士，教育部长江学者讲座教授。现任香港大学工业工程系荣誉教授，亚洲风险及危机管理协会主席，兼任深交所上市的中联重科集团独立非执行董事。历任香港城市大学管理科学讲座教授，湖南省政协委员并兼任湖南大学工商管理学院院长。

## 2、基金管理人监事会成员

梅津芝女士，监事长，学士。高级经济师、审计师。现任交通银行工会办公室主任。历任交通银行山西省分行个人金融业务部高级经理，交通银行山西省分行副行长，交通银行个人金融业务部副总经理、私人银行部总经理。

林凯珊女士，监事，硕士。现任施罗德投资管理(香港)有限公司中国内地及



中国香港法律部主管。历任香港证券及期货事务监察委员会发牌科经理、的近律师行律师。

刘峥先生，监事，硕士。现任交银施罗德基金管理有限公司综合管理部总经理。历任交通银行上海市分行管理培训生，交通银行总行战略投资部高级投资并购经理，交银施罗德基金管理有限公司总裁办公室高级综合管理经理、副总经理。

黄伟峰先生，监事，硕士。现任交银施罗德基金管理有限公司市场总监。历任平安人寿保险公司上海分公司行政督导、营销管理经理，交银施罗德基金管理有限公司行政部总经理助理、西部营销中心总经理、机构理财部（上海）总经理兼产品开发部总经理。

### 3、基金管理人高级管理人员

谢卫先生，总经理。简历同上。

印皓女士，副总经理，硕士。历任交通银行研究开发部副主管体改规划员，交通银行市场营销部副主管市场规划员、主管市场规划员，交通银行公司业务部副高级经理、高级经理，交通银行机构业务部高级经理、总经理助理、副总经理，交银施罗德资产管理有限公司董事长。

余川女士，督察长，硕士，兼任交银施罗德资产管理有限公司董事。历任华泰证券有限责任公司综合发展部高级经理、投资银行部项目经理，银河基金管理有限公司监察部总监，交银施罗德基金管理有限公司监察稽核部总经理、监察风控副总监、投资运营总监。

马俊先生，副总经理，硕士。历任交通银行总行投资管理部高级投资分析、副高级经理，交银施罗德基金管理有限公司总裁办公室总经理、研究部副总经理、研究总监、综合管理部总经理。

### 4、本基金基金经理

刘鹏先生：基金经理。中国人民大学金融学硕士，北京理工大学经济学学士，9年证券投资行业从业经验。2014年加入交银施罗德基金管理有限公司，曾任行业分析师，现任权益部基金经理。现任交银施罗德先进制造混合型证券投资基金(2018年05月29日至今)、交银施罗德启明混合型证券投资基金(2020年05月27日至今)、交银施罗德均衡成长一年持有期混合型证券投资基金(2021年02月01日至今)的基金经理。

本基金历任基金经理：

黄义志先生(2011年06月22日至2012年08月09日);  
张科兵先生(2012年03月13日至2013年04月25日);  
王少成先生(2013年03月21日至2015年08月14日);  
任相栋先生(2015年01月21日至2018年06月22日)。

#### 5、投资决策委员会成员

委员：谢卫（总经理）

马俊（副总经理、研究总监）

王少成（权益投资总监、基金经理）

于海颖（固定收益（公募）投资总监、基金经理）

王崇（权益投资副总监、权益部一级专家、基金经理）

上述人员之间无近亲属关系，上述各项人员信息更新截止日为2023年05月27日，期后变动（如有）敬请关注基金管理人发布的相关公告。

#### （三）基金管理人的职责

- 1、依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
- 2、办理基金备案手续；
- 3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；
- 4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；
- 5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- 6、编制季度报告、中期报告和年度报告；
- 7、计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回价格；
- 8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；
- 9、按照规定召集基金份额持有人大会；
- 10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- 11、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- 12、有关法律法规和中国证监会规定的其他职责。

#### （四）基金管理人的承诺

- 1、基金管理人承诺不从事违反《证券法》的行为，并承诺建立健全内部控制

制度,采取有效措施,防止违反《证券法》行为的发生;

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

- (1) 将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资;
- (2) 不公平地对待管理的不同基金财产;
- (3) 利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益;
- (4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失;
- (5) 侵占、挪用基金财产;
- (6) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。

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

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

5、基金管理人承诺不从事其他法规规定禁止从事的行为。

#### (五) 基金经理承诺

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

2、不利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者谋取利益;

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

#### (六) 基金管理人的内部控制制度

##### 1、风险管理的原则

###### (1) 全面性原则

公司风险管理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。

###### (2) 独立性原则

公司设立独立的风险管理部,风险管理部保持高度的独立性和权威性,负责对公司各部门风险控制工作进行监督和检查。

### (3) 相互制约原则

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

### (4) 定性和定量相结合原则

建立完备的风险管理指标体系，使风险管理更具客观性和操作性。

## 2、风险管理和内部风险控制体系结构

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

### (1) 董事会

负责制定公司的风险管理政策，对风险管理负完全的和最终的责任。

### (2) 监事会

是公司常设的监事机构，对股东会负责。监事会对公司财务、公司董事、总经理及其他高级管理人员进行监督。

### (3) 合规审核及风险管理委员会

作为董事会下的专业委员会之一，对公司内部控制制度、监察稽核制度进行检查评估；审查公司财务，对公司内部管理制度、投资决策程序和运作流程进行合规性审议；对公司资产与基金资产的经营进行评估。

### (4) 风险控制委员会

作为总经理下设的专业委员会之一，风险控制委员会负责拟定公司风险管理战略及政策，制定灾难复原计划及紧急情况处理制度，确保公司风险控制符合标准，就潜在风险与相关部门协调，审阅公司审计报告及监察情况。

### (5) 督察长

独立行使督察权利；直接对董事会负责；就内部控制制度和执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能；定期和不定期地向董事会报告公司内部控制执行情况。

### (6) 风险管理部

风险管理部负责制定公司风险管理政策和防范及控制措施，组织执行，并为每一个部门的风险管理系统的发展提供协助，汇总公司业务所有的风险信息，独立识别、评估各类风险，提出风险控制建议，使公司在一种风险管理和控制的环境中实

现业务目标。

#### (7) 审计部

审计部负责按照公司要求,根据国家法律法规及行业规范,结合公司战略发展及管理目标,对公司内部控制体系的适当性及运行的效果和效率进行独立评价,协助促进公司风险管理、控制和治理过程的完善,实现合规经营目标。

#### (8) 法律合规部

法律合规部负责公司的法律、合规事务及协调实施信息披露事务,依法维护公司合法权益,评估并处理公司运营中发生的法律、合规及信息披露相关问题,及时向公司管理层及全体员工传达法规及监管要求。

#### (9) 业务部门

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

### 3、风险管理和内部风险控制的措施

#### (1) 建立内控体系,完善内控制度

公司建立、健全了内控体系,通过高管人员关于内控的明确分工,确保各项业务活动有恰当的组织授权,确保监察活动独立,并得到高管人员的支持,同时置备操作手册,并定期更新。

#### (2) 建立相互分离、相互制衡的内控机制

建立、健全了各项制度,做到基金经理分开,投资决策分开,基金交易集中,形成不同部门、不同岗位之间的制衡机制,从制度上减少和防范风险。

#### (3) 建立、健全岗位责任制

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

#### (4) 建立风险分类、识别、评估、报告、提示程序

建立了风险评估机制,通过适合的程序,确认和评估与公司运作有关的风险;公司建立了自下而上的风险报告程序,对风险隐患进行层层汇报,使各个层次的人员及时掌握风险状况,从而以最快速度作出决策。

#### (5) 建立有效的内部监控系统

建立了足够、有效的内部监控系统,如电脑预警系统、投资监控系统,对可能

出现的各种风险进行全面和实时的监控。

(6) 使用数量化的风险管理手段

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

(7) 提供足够的培训

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



## 四、基金托管人

### (一) 基金托管人情况

#### 1、基本情况

名称：中国农业银行股份有限公司（简称中国农业银行）

住所：北京市东城区建国门内大街69号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座

法定代表人：谷澍

成立日期：2009年1月15日

批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复[2009]13号

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]23号

注册资本：34,998,303.4万元人民币

存续期间：持续经营

联系电话：010-66060069

传真：010-68121816

联系人：秦一楠

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分，总行设在北京。经国务院批准，中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于2009年1月15日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡，成为国内网点最多、业务辐射范围最广，服务领域最广，服务对象最多，业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外，中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉，每年位居《财富》世界500强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行，中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念，坚持审慎稳健经营、可持续发展，立足县域和城市两大市场，实施差异化竞争策略，着力打造“伴你成长”服务品牌，依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品，致力为广大客户提供优质的金融服务，与广大客户共创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行，经验丰富，服务优质，业绩突出，2004年被英国《全球托管人》评为中国“最佳托管银行”。2007年



中国农业银行通过了美国SAS70内部控制审计，并获得无保留意见的SAS70审计报告。自2010年起中国农业银行连续通过托管业务国际内控标准（ISAE3402）认证，表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设，品牌声誉进一步提升，在2010年首届“‘金牌理财’TOP10颁奖盛典”中成绩突出，获“最佳托管银行”奖。2010年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的“最佳资产托管奖”。2012年荣获第十届中国财经风云榜“最佳资产托管银行”称号；2013年至2017年连续荣获上海清算所授予的“托管银行优秀奖”和中央国债登记结算有限责任公司授予的“优秀托管机构奖”称号；2015年、2016年荣获中国银行业协会授予的“养老金业务最佳发展奖”称号；2018年荣获中国基金报授予的公募基金20年“最佳基金托管银行”奖；2019年荣获证券时报授予的“2019年度资产托管银行天玑奖”称号；2020年被美国《环球金融》评为中国“最佳托管银行”；2021年荣获全国银行间同业拆借中心首次设立的“银行间本币市场优秀托管行”奖；2022年在权威杂志《财资》年度评选中首次荣获“中国最佳保险托管银行”。

中国农业银行证券投资基金托管部于1998年5月经中国证监会和中国人民银行批准成立，目前内设风险合规部/综合管理部、业务管理部、客户一部、客户二部、客户三部、客户四部、系统与信息管理部、营运管理部、营运一部、营运二部，拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

## 2、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工近283名，其中具有高级职称的专家60名，服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强，高级管理层均有20年以上金融从业经验和高级技术职称，精通国内外证券市场的运作。

## 3、基金托管业务经营情况

截止到2023年3月31日，中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共808只。

### （二）基金托管人的内部风险控制制度说明

#### 1、内部控制目标

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

## 2、内部控制组织结构

风险管理委员会总体负责中国农业银行的风险管理与内部控制工作，对托管业务风险管理和内部控制工作进行监督和评价。托管业务部专门设置了风险管理处，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，独立行使监督稽核职权。

## 3、内部控制制度及措施

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

### (三) 基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

基金托管人通过参数设置将《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议规定的投资比例和禁止投资品种输入监控系统，每日登录监控系统监督基金管理人的投资运作，并通过基金资金账户、基金管理人的投资指令等监督基金管理人的其他行为。

当基金出现异常交易行为时，基金托管人应当针对不同情况进行以下方式的处理：

- 1、电话提示。对媒体和舆论反映集中的问题，电话提示基金管理人；
- 2、书面警示。对本基金投资比例接近超标、资金头寸不足等问题，以书面方式对基金管理人进行提示；
- 3、书面报告。对投资比例超标、清算资金透支以及其他涉嫌违规交易等行为，书面提示有关基金管理人并报中国证监会。

## 五、相关服务机构

### (一) 基金份额销售机构

#### 1、直销机构

本基金直销机构为基金管理人直销柜台以及基金管理人的网上直销交易平台(网站及手机APP,下同)。

机构名称:交银施罗德基金管理有限公司

住所:中国(上海)自由贸易试验区银城中路188号交通银行大楼二层(裙)

办公地址:上海市浦东新区世纪大道8号国金中心二期21-22楼

法定代表人:阮红

成立时间:2005年8月4日

电话:(021)61055724

传真:(021)61055054

联系人:傅鲸

客户服务电话:400-700-5000(免长途话费),(021)61055000

网址:www.fund001.com

个人投资者可以通过基金管理人网上直销交易平台办理开户、本基金的申购、赎回、转换及定期定额投资等业务,具体交易细则请参阅基金管理人网站。

网上直销交易平台网址:www.fund001.com

#### 2、代销机构

(1)名称:中国建设银行股份有限公司

住所:北京市西城区金融大街25号

办公地址:北京市西城区金融大街25号

法定代表人:田国立

电话:(010)66275654

传真:(010)66275654

客户服务电话:95533

网址:www.ccb.com

(2)名称:杭州银行股份有限公司

住所:杭州市庆春路46号杭州银行大厦

办公地址：杭州市庆春路46号杭州银行大厦

法定代表人：陈震山

电话：(0571) 85108195、85120696

传真：(0571) 86475527

联系人：严峻、夏帆

客户服务电话：96523

网址：www.hzbank.com.cn

(3) 名称：华夏银行股份有限公司

住所：北京市东城区建国门内大街22号

办公地址：北京市东城区建国门内大街22号

法定代表人：李民吉

客户服务电话：95577

网址：www.hxb.com.cn

(4) 名称：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

办公地址：深圳市深南东路5047号

法人代表：谢永林

电话：0755-22166574

传真：0755-82080406

联系人：赵杨

客服电话：95511-3或95501

网址：bank.pingan.com

(5) 名称：北京银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街甲17号首层

办公地址：北京市西城区金融大街甲17号首层

法定代表人：张东宁

传真：(010) 66226045

联系人：孔超

客户服务电话：95526

网址：www.bankofbeijing.com.cn

(6) 名称：宁波银行股份有限公司

住所：宁波市江东区中山东路294号

法定代表人：陆华裕

电话：(021) 63586210

传真：(021) 63586215

联系人：胡技勋

客户服务电话：96528（上海地区962528）

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

(7) 名称：中国民生银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街2号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街2号

法定代表人：洪崎

电话：(010) 58560666

传真：(010) 57092611

联系人：许野

客户服务电话：95568

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

(8) 名称：中信银行股份有限公司

住所：北京市东城区朝阳门北大街9号

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街9号

法定代表人：朱鹤新

电话：(010) 89936330

传真：(010) 85230024

联系人：丰靖

客户服务电话：95558

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

(9) 名称：上海银行股份有限公司

住所：上海市银城中路168号

办公地址：上海市银城中路168号

法定代表人：金煜

电话：(021) 68475888

传真：(021) 68476111

联系人：张萍

客户服务电话：(021) 962888

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

(10) 名称：招商银行股份有限公司

住所：深圳市福田区深南大道7088号

办公地址：深圳市福田区深南大道7088号

法定代表人：缪建民

电话：(0755) 83198888

传真：(0755) 83195109

联系人：季平伟

客户服务电话：95555

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

(11) 名称：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：任德奇

电话：(021) 58781234

传真：(021) 58408483

联系人：范瑞波

客户服务电话：95559

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

(12) 名称：中国农业银行股份有限公司

住所：北京市东城区建国门内大街69号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座

法定代表人：周慕冰

联系电话：010-66060069

传真：010-68121816

联系人：贺倩

客户服务电话：95599

网址：www.abchina.com

(13) 名称：中国工商银行股份有限公司

住所：北京市复兴门内大街55号

办公地址：北京市复兴门内大街55号

法定代表人：陈四清

客户服务电话：95588

网址：www.icbc.com.cn

(14) 名称：东莞农村商业银行股份有限公司

住所：东莞市东城区鸿福东路2号

办公地址：东莞市东城区鸿福东路2号

法定代表人：王耀球

电话：(0769) 22866254

传真：(0769) 22866282

联系人：林培珊

客户服务电话：(0769) 961122

网址：www.drcbank.com

(15) 名称：江苏常熟农村商业银行股份有限公司

住所：江苏省常熟市新世纪大道58号

办公地址：江苏省常熟市新世纪大道58号

法定代表人：宋建明

联系电话：(0512) 52909128

传真：(0512) 52909122

联系人：黄晓

客户服务电话：962000

网址：www.csrbank.com

(16) 名称：江苏银行股份有限公司

住所：南京市中华路26号

办公地址：南京市中华路26号

法定代表人：夏平



电话：(025) 58587018

传真：(025) 58587038

联系人：田春慧

客户服务电话：95319

网址：www.jsbchina.cn

(17) 名称：江苏江南农村商业银行股份有限公司

住所：江苏省常州市和平中路413号

办公地址：江苏省常州市和平中路413号

法定代表人：陆向阳

电话：0519-80585939

传真：0519-89995170

联系人：蒋姣

客户服务电话：96005

网址：<http://www.jnbank.com.cn>

(18) 名称：上海浦东发展银行股份有限公司

住所：上海市中山东一路12号

办公地址：上海市中山东一路12号

法定代表人：郑杨

电话：(021) 61618888

传真：(021) 61618888

联系人：朱瑛

客户服务电话：95528

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

(19) 名称：中国邮政储蓄银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街3号

办公地址：北京市西城区金融大街3号

法定代表人：李国华

传真：(010) 68858117

联系人：陈春林

客户服务电话：95580

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

(20) 名称: 中国光大银行股份有限公司

住所: 北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心

办公地址: 北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心

法定代表人: 李晓鹏

电话: (010) 63639681

传真: (010) 63639709

联系人: 刘昭宇

客户服务电话: 95595

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

(21) 名称: 兴业银行股份有限公司

注册地址: 福建省福州市湖东路154号中山大厦

办公地址: 上海市浦东新区银城路 167 号兴业银行大厦

法定代表人: 吕家进

联系人: 蔡宣铭

联系电话: 021-52629999

客服热线: 95561

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

(22) 名称: 南京银行股份有限公司

住所: 南京市玄武区中山路288号

办公地址: 南京市玄武区中山路288号

法定代表人: 胡升荣

电话: 025-86776111

传真: 025-86775054

客户服务电话: 95302

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

(23) 名称: 光大证券股份有限公司

住所: 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: 薛峰

电话：(021) 22169999

传真：(021) 22169134

联系人：刘晨

客户服务电话：10108998

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

(24) 名称：中信证券股份有限公司

住所：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦

法定代表人：张佑君

电话：010-60838888

客服电话：95548

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

(25) 名称：中国中金财富证券有限公司

住所：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层-21层及第04层01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23单元

办公地址：深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第04、18层至21层

法定代表人：高涛

电话：(0755) 88320851

联系人：胡芷境

客户服务电话：95532/400-600-8008

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

(26) 名称：东北证券股份有限公司

住所：长春市自由大路1138号

办公地址：长春市自由大路1138号

法定代表人：矫正中

电话：(0431) 85096709

联系人：潘锴

客户服务电话：4006000686, (0431) 85096733

网址：[www.nesc.cn](http://www.nesc.cn)

(27) 名称：中银国际证券有限责任公司

住所：上海市银城中路200号39层

办公地址：中国上海浦东银城中路200号中银大厦39-40层

法定代表人：许刚

联系人：李丹

客户服务电话：400-620-8888

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

(28) 名称：华福证券有限责任公司

住所：福州市五四路157号新天地大厦7、8层

办公地址：福州市五四路新天地大厦7至10层

法定代表人：黄金琳

电话：(0591) 87383623

传真：(0591) 87383610

客户服务电话：(0591) 96326

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

(29) 名称：东方证券股份有限公司

住所：上海市中山南路318号2号楼22层-29层

法定代表人：王益民

电话：(021) 63325888

传真：(021) 63326173

联系人：吴宇

客户服务电话：95503

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

(30) 名称：方正证券股份有限公司

住所：湖南长沙芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层

办公地址：湖南长沙芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层

法定代表人：雷杰

电话：(010) 68546765

传真：(010) 68546792

联系人：徐锦福

客户服务电话：95571

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

(31) 名称: 中国民族证券有限责任公司

住所: 北京市西城区金融街5号新盛大厦A座6-9层

办公地址: 北京市西城区金融街5号新盛大厦A座6-9层

法定代表人: 赵大建

客户服务电话: 400-889-5618

网址: [www.e5618.com](http://www.e5618.com)

(32) 名称: 德邦证券有限责任公司

住所: 上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼

办公地址: 上海市福山路500号城建大厦26楼

法定代表人: 姚文平

电话: (021) 68761616

传真: (021) 68767981

客户服务电话: 4008-888-128

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

(33) 名称: 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: 黄炎勋

电话: (0755) 82558305

传真: (0755) 82558355

联系人: 陈剑虹

客户服务电话: 400-800-1001

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

(34) 名称: 中航证券有限公司

住所: 南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦41楼

办公地址: 南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦41楼

法定代表人: 杜航

电话: (0791) 86768681

传真: (0791) 86770178

联系人：戴蕾

客户服务电话：400-8866-567

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

(35) 名称：中信建投证券股份有限公司

住所：北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街188号

法定代表人：王常青

电话：(010) 85130588

传真：(010) 65182261

联系人：魏明

客户服务电话：95587

网址：[www.csc108.com](http://www.csc108.com)

(36) 名称：中原证券股份有限公司

住所：郑州市郑东新区商务外环路10号

办公地址：郑州市郑东新区商务外环路10号

法定代表人：菅明军

联系人：程月艳 李盼盼

电话：0371-69099881/2

客户服务电话：95377

网址：<https://www.ccnew.com>

(37) 名称：国信证券股份有限公司

住所：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16-26楼

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16-26楼

法定代表人：何如

电话：(0755) 82130833

传真：(0755) 82133952

联系人：周杨

客户服务电话：95536

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

(38) 名称：恒泰证券股份有限公司

住所：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号

办公地址：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号

法定代表人：庞介民

电话：(0471) 4979037

传真：(0471) 4961259

联系人：王旭华

客户服务电话：(0471) 4960762, (021) 68405273

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

(39) 名称：华泰证券股份有限公司

住所：江苏省南京市江东中路228号

办公地址：江苏省南京市建邺区江东中路228号华泰证券广场

法定代表人：张伟

电话：(0755) 82492193

传真：(0755) 82492962

联系人：胡子豪

客户服务电话：95597

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

(40) 名称：湘财证券股份有限公司

住所：湖南省长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼

办公地址：湖南省长沙市天心区湘府中路198号标志商务中心11楼

法定代表人：林俊波

电话：(021) 68634518

传真：(021) 68865680

联系人：钟康莺

客户服务电话：400-888-1551

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

(41) 名称：兴业证券股份有限公司

住所：福州市湖东路268号

办公地址：上海市浦东新区长柳路36号

法定代表人：杨华辉



电话： 021-38565547

联系人： 乔琳雪

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

客户服务电话： 95562

(42) 名称： 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： 广州市天河区马场路26号广发证券大厦

法定代表人： 孙树明

电话： (020) 66338888

传真： (020) 87553600

联系人： 马梦洁

客户服务电话： 95575

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

(43) 名称： 海通证券股份有限公司

住所： 上海市淮海中路98号

办公地址： 上海市广东路689号

法定代表人： 王开国

电话： (021) 23219000

传真： (021) 23219100

联系人： 李笑鸣

客户服务电话： 95553或拨打各城市营业网点咨询电话

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

(44) 名称： 华龙证券股份有限公司

住所： 兰州市城关区东岗西路638号财富中心

办公地址： 兰州市城关区东岗西路638号财富中心

法定代表人： 李晓安

电话： (0931) 4890208

传真： (0931) 4890628

联系人： 李昕田

客户服务电话： 4006898888、(0931) 4890208

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

(45) 名称: 华宝证券股份有限公司

住所: 中国上海市陆家嘴环路166号未来资产大厦27楼

办公地址: 中国上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心57楼

法定代表人: 陈林

电话: (021) 68777222

传真: (021) 68777822

联系人: 赵洁

客户服务电话: 400-820-9898

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

(46) 名称: 长城国瑞证券有限公司

住所: 厦门市莲前西路2号莲富大厦17楼

办公地址: 厦门市莲前西路2号莲富大厦17楼

法定代表人: 王勇

电话: (0592) 5161642

传真: (0592) 5161640

联系人: 赵钦

客户服务电话: (0592) 5163588

网址: [www.xmzq.cn](http://www.xmzq.cn)

(47) 名称: 爱建证券有限责任公司

住所: 上海市南京西路758号24楼

办公地址: 上海市浦东新区世纪大道1600号32楼

法定代表人: 张建华

电话: (021) 32229888

传真: (021) 68728703

联系人: 陈敏

客户服务电话: (021) 63340678

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

(48) 名称: 长江证券股份有限公司

住所: 武汉市新华路特8号长江证券大厦

办公地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦

法定代表人：胡运钊

电话：(027) 65799999

传真：(027) 85481900

联系人：李良

客户服务电话：95579或4008-888-999

网址：www.95579.com

(49) 名称：招商证券股份有限公司

住所：深圳市福田区福田街道福华一路111号

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层

法定代表人：霍达

电话：(0755) 82943666

传真：(0755) 82943636

联系人：黄婵君

客户服务电话：400-8888-111, 95565

网址：www.newone.com.cn

(50) 名称：国泰君安证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路618号

办公地址：上海市静安区南京西路768号国泰君安大厦

法定代表人：贺青

联系电话：021-38676666

传真：021-38670666

联系人：朱雅崑

服务热线：95521 / 4008888666

网址：www.gtja.com

(51) 名称：中国银河证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

办公地址：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

电话：010-83574507

联系人：辛国政

客户服务电话：400-888-8888

网址：www.chinastock.com.cn

(52) 名称：申万宏源证券有限公司

住所：上海市徐汇区长乐路989号世纪商贸广场45层

办公地址：上海市徐汇区长乐路989号世纪商贸广场45层

法定代表人：杨玉成

电话：(021) 33389888

联系人：李清怡

客户服务电话：95523或4008895523

网址：www.sywg.com

(53) 名称：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

法定代表人：王少华

客户服务电话：400-818-8118

网址：www.guodu.com

(54) 名称：平安证券股份有限公司

住所：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场裙楼8楼

办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场裙楼8楼(518048)

法定代表人：杨宇翔

电话：(0755) 22627802

传真：(0755) 82400862

联系人：郑舒丽

客户服务电话：95511-8

网址：www.pingan.com

(55) 名称：中信证券（山东）有限责任公司

住所：青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001

办公地址：青岛市市南区东海西路28号龙翔广场东座5层

法定代表人：姜晓林

电话：0531-89606166

传真：0532-85022605

联系人：焦刚

客户服务电话：95548

网址：sd.citics.com

(56) 名称：申万宏源西部证券有限公司

住所：新疆乌鲁木齐市建设路2号

办公地址：北京市西城区太平桥大街19号宏源证券

法定代表人：冯戎

电话：(010) 88085858

传真：(010) 88085195

联系人：李巍

客户服务电话：4008-000-562

网址：www.hysec.com

(57) 名称：中泰证券股份有限公司

住所：山东省济南市市中区经七路86号

办公地址：山东省济南市市中区经七路86号

法定代表人：李玮

电话：(0531) 68889155

传真：(0531) 68889752

联系人：许曼华

客户服务电话：95538

网址：www.zts.com.cn

(58) 名称：江海证券有限公司

住所：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号

法定代表人：孙名扬

电话：(0451) 85863719

传真：(0451) 82287211

联系人：刘爽

客户服务电话：400-666-2288

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

(59) 名称: 中国国际金融股份有限公司

住所: 北京建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

办公地址: 北京建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

法定代表人: 毕明建

电话: (010) 65051166

传真: (010) 85679203

联系人: 杨涵宇

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

(60) 名称: 瑞银证券有限责任公司

住所: 北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层

办公地址: 北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层

法定代表人: 程宜荪

电话: (010) 58328112

传真: (010) 58328740

联系人: 牟冲

客户服务电话: 400-887-8827

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

(61) 名称: 长城证券有限责任公司

住所: 深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层

法定代表人: 黄耀华

电话: (0755) 83516289

传真: (0755) 83516199

联系人: 匡婷

客户服务电话: (0755) 33680000, 400-6666-888

网址: [www.cc168.com.cn](http://www.cc168.com.cn)

(62) 名称: 国金证券股份有限公司

住所: 四川省成都市东城根上街95号

办公地址: 成都市东城根上街95号

法定代表人: 冉云

电话：(028) 86690057, (028) 86690058

传真：(028) 86690126

联系人：刘婧漪 贾鹏

客户服务电话：95310

网址：www.gjzq.com.cn

(63) 名称：渤海证券股份有限公司

住所：天津经济技术开发区第二大街42号写字楼101室

办公地址：天津市南开区宾水西道8号

法定代表人：安志勇

电话：(022) 28451991

传真：(022) 28451892

联系人：蔡霆

客户服务电话：956066

网址：www.ewww.com.cn

(64) 名称：信达证券股份有限公司

住所：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼信达金融中心

办公地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼信达金融中心

法定代表人：张志刚

电话：(010) 63081000

传真：(010) 63081344

联系人：尹旭航

客户服务电话：95321

网址：www.cindasc.com

(65) 名称：西南证券股份有限公司

住所：重庆市江北区桥北苑8号

办公地址：重庆市江北区桥北苑8号西南证券大厦

法定代表人：吴坚

电话：(023) 63786141

传真：(023) 63786212

联系人：张煜



客户服务电话：95355、400-809-6096

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

(66) 名称：国新证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街8号

办公地址：北京市西城区金融大街8号

法定代表人：宋德清

电话：(010) 58568235

传真：(010) 58568062

联系人：黄恒

客户服务电话：(010) 58568118

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

(67) 名称：联讯证券股份有限公司

住所：惠州市江北东江三路55号广播电视新闻中心西面一层大堂和三、四层

办公地址：惠州市江北东江三路55号广播电视新闻中心西面一层大堂和三、四  
层

法定代表人：徐刚

电话：(021) 33606736

传真：(021) 33606760

联系人：陈思

客户服务电话：95564

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

(68) 名称：华西证券股份有限公司

住所：四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦

办公地址：四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦

法定代表人：杨炯洋

电话：(028) 86135991

传真：(028) 86150400

联系人：周志茹

客户服务电话：95584

网址：[www.hx168.com.cn](http://www.hx168.com.cn)

(69) 名称: 东莞证券股份有限公司

住所: 广东省东莞市莞城区可园南路一号

办公地址: 广东省东莞市莞城区可园南路一号

电话: (0769) 22115712

传真: (0769) 22115712

联系人: 李荣

客户服务电话: 95328

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

(70) 名称: 第一创业证券股份有限公司

住所: 深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场 B 座25、26层

办公地址: 深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场 B 座25、26层

法定代表人: 刘学民

电话: (0755) 25832852

传真: (0755) 25831718

联系人: 崔国良

客户服务电话: 4008881888

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

(71) 名称: 财通证券股份有限公司

注册地址: 杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心201、501、502、1103、1601-1615、1701-1716

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

法定代表人: 沈继宁

电话: 0571-87789160

联系人: 陶志华

客户服务电话: 95336, 40086-96336

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

(72) 名称: 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号东方财富大厦

法定代表人：徐伟琴

电话：(021) 021-23586603

传真：(021) 021-23586860

联系人：付佳

客户服务电话：95357

网址：<http://www.18.cn>

(73) 名称：中信证券华南股份有限公司

住所：广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19层、20层

办公地址：广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19层、20层

法定代表人：胡伏云

电话：020-88836999

传真：020-88836984

联系人：陈靖

客服电话：(020) 95396

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

(74) 名称：大同证券有限责任公司

注册地址：山西省大同市城区迎宾街15号桐城中央21层

办公地址：太原市长治路 111 号山西世贸中心 A 座 F12、F13

邮政编码：030600

法定代表人：董祥

电话：(0351) 4130322

传真：(0351) 7219891

客服电话：4007121212

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

(75) 名称：方正中期期货有限公司

住所：北京市石景山区金府路32号院3号楼5层512室

办公地址：北京市朝阳区东三环北路38号院1号泰康金融大厦22层

法定代表人：姜志军

联系电话：010-85881211

传真：010-85881394

联系人：罗雯

客户服务电话：4008802277

网址：www.founderfu.com

(76) 名称：联储证券有限责任公司

住所：深圳市福田区福田街道岗厦社区深南大道南侧金地中心大厦9楼

办公地址：北京市朝阳区安定路5号院3号楼中建财富国际中心27层联储证券

法定代表人：吕春卫

传真：010-86499401

联系人：祝博文、张婉婷

客服电话：400-620-6868

网址：www.lczq.com

(77) 名称：东兴证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层

法定代表人：徐勇力

电话：(010) 66555316

传真：(010) 66555246

联系人：汤漫川

客户服务电话：400-8888-993

网址：www.dxzq.net

(78) 名称：浙商证券股份有限公司

住所：浙江省杭州市江干区五星路201号

办公地址：浙江省杭州市江干区五星路201号

法定代表人：吴承根

电话：(0571) 87901964

传真：(0571) 87901955

联系人：胡相斌

客户服务电话：95345

网址：www.stocke.com.cn

(79) 名称：西部证券股份有限公司

住所：陕西省西安市新城东大街319号8幢10000室

办公地址：陕西省西安市新城区东大街 319 号 8 幢 10000 室

法定代表人：徐朝晖

电话：029-87211668

传真：

联系人：张吉安

客户服务电话：95582

网址：www.west95582.com

(80) 名称：国元证券股份有限公司

住所：中国安徽省合肥市梅山路18号安徽国际金融中心A座

办公地址：中国安徽省合肥市梅山路18号安徽国际金融中心A座

法定代表人：俞仕新

联系电话：0551-62207400

传真：0551-62207148

联系人：汪先哲

客户服务电话：95578

网址：www.gyzq.com.cn

(81) 名称：天相投资顾问有限公司

住所：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701

办公地址：北京市西城区新街口外大街28号C座5层

法定代表人：林义相

电话：(010) 66045529

传真：(010) 66045518

联系人：尹伶

客户服务电话：(010) 66045678

网址：<http://www.txsec.com>, [www.jjm.com.cn](http://www.jjm.com.cn)

(82) 名称：北京钱景财富投资管理有限公司

住所：北京市海淀区丹棱街6幢1号9层1008-1012

办公地址：北京市海淀区丹棱街6幢1号9层1008-1012

法定代表人：赵荣春

电话：(010) 57418829

传真：(010) 57569671

联系人：魏争

客户服务电话：400-678-5095

网址：[www.niuji.net](http://www.niuji.net)

(83) 名称：上海大智慧基金销售有限公司

住所：上海市浦东新区杨高南路428号1号楼10-11层

办公地址：上海市浦东新区杨高南路428号1号楼10-11层

法定代表人：申健

电话：021-0219988-35374

传真：021-20219923

联系人：张蜓

客户服务电话：021-20292031

网址：<https://www.wg.com.cn>

(84) 名称：上海利得基金销售有限公司

住所：上海浦东新区峨山路91弄61号陆家嘴软件园10号楼12楼

办公地址：上海浦东新区峨山路91弄61号陆家嘴软件园10号楼12楼

法定代表人：沈继伟

电话：021-50583533

传真：021-50583633

联系人：徐鹏

客服电话：400-005-6355

网址：[a.leadfund.com.cn](http://a.leadfund.com.cn)

(85) 名称：上海凯石财富基金销售有限公司

住所：上海市黄浦区西藏南路765号602-115室

办公地址：上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦4楼

法定代表人：陈继武

电话：021-63333319

传真：021-63332523

联系人：李晓明

客服电话：4000 178 000

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

(86) 名称: 北京虹点基金销售有限公司

住所: 北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙房2层222单元

办公地址: 北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙房2层222单元

法定代表人: 胡伟

电话: (010) 65951887

传真: (010) 65951887

联系人: 姜颖

客户服务电话: 400-618-0707

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

(87) 名称: 诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司

住所: 上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室

办公地址: 上海杨浦区秦皇岛路32号C栋 2楼

法定代表人: 汪静波

电话: (021) 38600735

传真: (021) 38509777

联系人: 方成

客户服务电话: 400-821-5399

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

(88) 名称: 上海好买基金销售有限公司

住所: 上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室

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

传真: (021) 68596916

联系人: 薛年

客户服务电话: 400-700-9665

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

(89) 名称: 上海长量基金销售投资顾问有限公司

住所: 上海市浦东新区高翔路526号2幢220室

办公地址: 上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层



法定代表人：张跃伟

电话：(021) 20691832

传真：(021) 20691861

联系人：单丙焯

客户服务电话：400-820-2899

网址：www.erichfund.com

(90) 名称：深圳众禄基金销售有限公司

住所：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼

办公地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼

法定代表人：薛峰

电话：(0755) 33227953

传真：(0755) 33227951

联系人：汤素娅

客户服务电话：4006-788-887

网址：www.zlfund.cn, www.jjmmw.com

(91) 名称：蚂蚁(杭州)基金销售有限公司

住所：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西溪路556号

法定代表人：王珺

联系人：韩爱彬

客户服务电话：95188-8

网址：www.fund123.cn

(92) 名称：深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

住所：深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#

办公地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座9层

法定代表人：陈操

电话：(010) 58325395

传真：(010) 58325282

联系人：刘宝文

客户服务电话：400-850-7771

网址: <http://8.jrj.com.cn/>

(93) 名称: 北京展恒基金销售股份有限公司

住所: 北京市顺义区后沙峪镇安富街6号

办公地址: 北京市朝阳区安苑路15-1号邮电新闻大厦2层

法定代表人: 闫振杰

电话: (010) 59601366-7024

传真: (010) 62020355

联系人: 马林

客户服务电话: 400-888-6661

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

(94) 名称: 一路财富(北京)信息科技有限公司

住所: 北京市西城区车公庄大街9号五栋大楼C座702

办公地址: 北京西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座22层2208

法定代表人: 吴雪秀

电话: 010-88312877

传真: 010-88312099

联系人: 苏昊

客户服务电话: 400-001-1566

网址: <http://www.yilucaifu.com/>

(95) 名称: 和讯信息科技有限公司

住所: 北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层

办公地址: 北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层

法定代表人: 王莉

电话: (021) 20835789

传真: (021) 20835879

联系人: 周轶

客户服务电话: 4009200022

网址: <http://licaike.hexun.com/>

(96) 名称: 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：上海市徐汇区龙田路195号3C座10楼

法定代表人：其实

电话：(021) 54509998

传真：(021) 64385308

联系人：潘世友

客户服务电话：400-1818-188

网址：www.1234567.com.cn

(97) 名称：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楼

法定代表人：燕斌

电话：021-52822063

传真：021-52975270

联系人：凌秋艳

客户服务电话：4000-466-788

网址：www.66zichan.com

(98) 名称：珠海盈米财富管理有限公司

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B1201-1203

法定代表人：肖雯

电话：(020) 89629099

传真：(020) 89629011

联系人：黄敏嫦

客户服务电话：(020) 89629066

网址：www.yingmi.cn

(99) 名称：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：上海市昆明路518号北美广场A1002-A1003室

法定代表人：王翔

电话：(021) 35385521

传真：(021) 55085991

联系人：蓝杰

客户服务电话：400-820-5369

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

(100) 名称：宜信普泽投资顾问(北京)有限公司

住所：北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809

办公地址：北京市朝阳区建国路88号SOHO现代城C座1809

法定代表人：沈伟桦

电话：010-52855713

传真：010-85894285

联系人：程刚

客户服务电话：400-6099-200

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

(101) 名称：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号元茂大厦903

办公地址：浙江省杭州市西湖区翠柏路7号电子商务产业园2号楼 2楼

法定代表人：凌顺平

电话：(0571) 88911818

传真：(0571) 86800423

联系人：吴强

客户服务电话：400-877-3772

网址：[www.5ifund.com](http://www.5ifund.com)

(102) 名称：中信期货有限公司

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

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

法定代表人：张皓

电话：010-60833754

传真：021-60819988

联系人：刘宏莹

客服电话：400-990-8826

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

(103) 名称：上海陆金所资产管理有限公司

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：郭坚

电话：(021) 20665952

传真：(021) 22066653

联系人：宁博宇

客户服务电话：4008219031

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

(104) 名称：北京中植基金销售有限公司

住所：北京市经济技术开发区宏达北路10号五层5122室

办公地址：北京市朝阳区东三环北路甲19号SOHO嘉盛中心30层3001室

法定代表人：李悦

电话：(010) 56642600

传真：(010) 56642623

联系人：张晔

客户服务电话：4007868868

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

(105) 名称：北京汇成基金销售有限公司

住所：北京市西城区宣武门外大街甲1号4层401-2

办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲1号环球财讯中心D座4层401-2

法定代表人：王伟刚

电话：(010) 56282140

传真：(010) 62680827

联系人：张林

客户服务电话：400-619-9059

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

(106) 名称: 奕丰基金销售有限公司

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

办公地址: 深圳市南山区海德三路海岸大厦A座17楼1704室

法定代表人: TEO WEE HOWE

电话: (0755) 89460500

传真: (0755) 21674453

联系人: 叶健

客户服务电话: 400-684-0500

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

(107) 名称: 北京创金启富基金销售有限公司

住所: 北京市西城区民丰胡同31号中水大厦215A

办公地址: 北京市西城区白纸坊东街2号经济日报社A综合楼712室

法定代表人: 梁蓉

电话: (010) 66154828

传真: (010) 63583991

联系人: 李婷婷

客户服务电话: 400-6262-818

网址: [www.5irich.com](http://www.5irich.com)

(108) 名称: 上海云湾投资管理有限公司

住所: 中国(上海)自由贸易试验区新金桥路27号13号楼2层, 200127

办公地址: 上海市锦康路308号6号楼6层

法定代表人: 戴新装

电话: (021) 20538888

传真: (021) 20538999

联系人: 江辉

客户服务电话: 400-820-1515

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

(109) 名称: 中证金牛(北京)投资咨询有限公司

住所：北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室

办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲一号环球财讯中心A座5层

法定代表人：钱昊旻

电话：(010) 59336533

传真：(010) 59336500

联系人：孟汉霄

客户服务电话：4008-909-998

网址：www.jnlc.com

(110) 名称：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

电话：(010) 60619607

传真：8610-62676582

联系人：付文红

客户服务电话：(010) 62675369

网址：www.xincai.com

(111) 名称：北京肯特瑞基金销售有限公司

住所：北京市海淀区西三旗建材城中路12号17号平房157

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

法定代表人：王苏宁

电话：95118

传真：010-89189566

联系人：李丹

客服热线：95118

网址：kenterui.jd.com

(112) 名称：北京雪球基金销售有限公司



住所：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507

办公地址：北京市朝阳区创远路 34 号院融新科技中心 C 座 17 层

法定代表人：钟斐斐

电话：(010) 61840688

传真：(010) 84997571

联系人：侯芳芳

客户服务电话：400-1599-288

网址：<https://danjuanapp.com>

(113) 名称：凤凰金信（银川）投资管理有限公司

住所：宁夏回族自治区银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路142号14层  
1402(750000)

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（100000）

法定代表人：程刚

电话：(010) 58160168

传真：(010) 58160173

联系人：张旭

客户服务电话：400-810-5919

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

(114) 名称：深圳市金斧子基金销售有限公司

住所：深圳市南山区粤海街道科苑路16号东方科技大厦18楼

办公地址：深圳市南山区粤海街道科苑路科兴科学园B3单元7楼

法定代表人：赖任军

电话：(0755) 66892301

传真：(0755) 66892399

联系人：张焯

客户服务电话：400-9500-888

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

(115) 名称：格上富信投资顾问有限公司

住所：北京市朝阳区东三环北路19号楼701内09室

办公地址：北京市朝阳区东三环北路19号楼701内09室

法定代表人：李悦章

电话：(010) 85594745

传真：(010) 65983333

联系人：张林

客户服务电话：400-066-8586

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

(116) 名称：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：上海市浦东新区福山路33号9楼

法定代表人：王廷富

电话：021-50712782

传真：021-50710161

联系人：徐亚丹

客户服务电话：400-821-0203

网址：[www.520fund.com.cn](http://www.520fund.com.cn)

(117) 名称：天津万家财富资产管理有限公司

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

办公地址：北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦5层

法定代表人：李修辞

电话：(010) 59013828

传真：(010) 59013707

联系人：王芳芳

客户服务电话：010-59013842

网址：<http://www.wanjiawealth.com/>

(118) 名称：上海挖财金融信息服务有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室

法定代表人：胡燕亮

电话：(021) 50810687

传真：(021) 58300279

联系人：李娟

客户服务电话：(021) 50810673

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

(119) 名称：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

电话：(021) 38789658

传真：(021) 68880023

联系人：王宫

客户服务电话：400-021-8850

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

(120) 名称：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

电话：025-66996699

传真：025-66996699

联系人：冯鹏鹏

客户服务电话：95177

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

(121) 名称：北京度小满基金销售有限公司

住所：北京市海淀区上地十街10号1幢1层101

办公地址：北京市海淀区信息路甲9号奎科大厦

法定代表人：张旭阳

电话：010-61952703

传真：010-61951007

联系人：盛超

客户服务电话：95599-9

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

(122) 名称: 北京唐鼎耀华投资咨询有限公司

住所: 北京市延庆县延庆经济开发区百泉街10号2栋236室

办公地址: 北京市朝阳区东三环北路38号院1号泰康金融中心38层

法定代表人: 张冠宇

电话: (010) 85870662

传真: (010) 59200800

联系人: 刘美薇

客户服务电话: 400-819-9868

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

(123) 名称: 上海华夏财富投资管理有限公司

住所: 上海市虹口区东大名路687号1幢2楼268室

办公地址: 北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层

法定代表人: 毛淮平

电话: 010-88066632

传真: 010-63136184

联系人: 张静怡

客户服务电话: 400-817-5666

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

(124) 名称: 江苏汇林保大基金销售有限公司

住所: 南京市高淳区经济开发区古檀大道47号

办公地址: 江苏省南京市鼓楼区中山北路105号中环国际1413室

法定代表人: 吴言林

电话: 025-66046166转837

传真: 025-56663409

联系人: 孙平

客户服务电话: 025-66046166

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

(125) 名称: 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：马永谱

电话：(021) 50701053

传真：(021) 50701053

客户服务电话：400-080-8208

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

(126) 名称：阳光人寿保险股份有限公司

住所：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

电话：(010) 85632771

传真：(010) 85632773

联系人：王超

客户服务电话：95510

网址：<http://fund.sinosig.com>

(127) 名称：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：(0411-39027810)

传真：(0411-39027835)

联系人：于秀

客户服务电话：4000-899-100

网址：<http://www.yibaijin.com>

(128) 名称：中国人寿保险股份有限公司

住所：中国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号中国人寿广场A座

法定代表人：王滨

客户服务电话：95519

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

(129) 名称：和耕传承基金销售有限公司

住所：河南自贸试验区郑州片区（郑东）东风南路东康宁街北6号楼5楼503

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

法定代表人：温丽燕

电话：0371-85518395

传真：0371-85518397

联系人：胡静华

客户服务电话：4000555671

网址：www.hgccpb.com

（130）名称：腾安基金销售（深圳）有限公司

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

办公地址：深圳市南山区海天二路33号腾讯滨海大厦

法定代表人：刘明军

电话：95017（拨通后转1转8）

联系人：谭广峰

客户服务电话：95017（拨通后转1转8）

网址：<http://www.tenganxinxi.com/>

（131）名称：北京植信基金销售有限公司

住所：北京市密云区兴盛南路8号院2号楼106室-67

办公地址：北京市朝阳区惠河南路盛世龙源10号

法定代表人：王军辉

电话：010-56075718

传真：010-67767615

联系人：张喆

客户服务电话：4006-802-123

网址：www.zhixin-inv.com

（132）名称：上海钜派钰茂基金销售有限公司

住所：上海市浦东新区泥城镇新城路2号24幢N3187室

办公地址：上海市闵行区闵虹路166弄中庚环球创意中心T2栋9层

法定代表人：洪思夷

电话：021-52265962

联系人：王世之

客户服务电话：400-021-2428

网址：www.jp-fund.com

(133) 名称：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10层1005

办公地址：北京市朝阳区太阳宫中路16号院1号楼11层1105

法定代表人：杨健

电话：010-65309516

传真：010-65330699

联系人：宋静

客户服务电话：400-673-7010

网址：www.jianfortune.com

A类基金份额的场内销售机构是指由中国证监会核准的具有开放式基金销售资格，并经上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的上海证券交易所会员（以下简称“有资格的上交所会员”），名单详见上海证券交易所网站。

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其它符合要求的机构销售本基金，并在管理人网站公示。

## （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

办公地址：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：韩炯

电话：(021) 31358666

传真：(021) 31358600

联系人：丁媛

经办律师：黎明、丁媛

(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）

注册地址：中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路1318号星展银行大厦507单元01室

办公地址：中国上海市浦东新区东育路588号前滩中心42楼

执行事务合伙人：李丹

电话：(021) 23238888

传真：(021) 23238800

联系人：金诗涛

经办注册会计师：沈兆杰、金诗涛

## 六、基金的历史沿革

交银施罗德先进制造混合型证券投资基金由交银施罗德先进制造股票证券投资基金更名而成。

交银施罗德先进制造股票证券投资基金经中国证监会证监许可[2011]639号文核准，自2011年5月23日起向社会公开募集，于2011年6月17日结束募集工作，并于2011年6月22日获得中国证监会的书面确认，《交银施罗德先进制造股票证券投资基金基金合同》自该日起生效。

根据《基金法》、《运作办法》、《关于实施〈公开募集证券投资基金运作管理办法〉有关问题的规定》、《交银施罗德先进制造股票证券投资基金基金合同》及基金管理人于2015年8月5日发布的《交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金变更基金类别及修改基金名称并相应修改基金合同和托管协议的公告》，交银施罗德先进制造股票证券投资基金的基金类别自2015年8月8日变更为混合型基金，基金名称由“交银施罗德先进制造股票证券投资基金”修改为“交银施罗德先进制造混合型证券投资基金”。

自2018年2月13日至2018年3月19日交银施罗德先进制造混合型证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会，大会于2018年3月20日审议通过了《关于交银施罗德先进制造混合型证券投资基金调整投资范围及修改基金合同有关事项的议案》，内容包括交银施罗德先进制造混合型证券投资基金调整投资范围、投资策略、投资比例限制、业绩比较基准、估值方法及修改基金合同等事项，上述基金份额持有人大会决议事项自表决通过之日起生效。自2018年3月21日起，根据《关于交银施罗德先进制造混合型证券投资基金调整投资范围及修改基金合同有关事项的议案》修改而成的《交银施罗德先进制造混合型证券投资基金基金合同》生效。

自2021年12月21日至2022年1月20日交银施罗德先进制造混合型证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会，大会于2022年1月21日审议通过了《关于交银施罗德先进制造混合型证券投资基金调整投资范围及修改基金合同有关事项的议案》，内容包括在交银施罗德先进制造混合型证券投资基金的投资范围中增加港股通标的股票，相应调整投资策略、投资比例限制、业绩比较基准、估值方法等内容，并调整基金赎回费率、增加基金合同自动终止条款、增加C类基金份额、增加侧袋机制相关表述及修改基金合同其他条款等事项，上述基金份额持有人大会决议

事项自表决通过之日起生效。自2022年1月24日起,根据《关于交银施罗德先进制造混合型证券投资基金调整投资范围及修改基金合同有关事项的议案》修改而成的《交银施罗德先进制造混合型证券投资基金基金合同》生效。

## 七、基金的存续

《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50个工作日出现前述情形的,基金合同终止,不需召开基金份额持有人大会。法律法规或监管机构另有规定时,从其规定。

## 八、基金份额的申购与赎回

### (一) 申购和赎回的场所

投资者可通过下述场所按照规定的方式进行申购或赎回：

#### 1、直销机构

本基金直销机构为基金管理人以及基金管理人的网上直销交易平台。

名称：交银施罗德基金管理有限公司

住所：中国(上海)自由贸易试验区银城中路188号交通银行大楼二层（裙）

办公地址：上海市浦东新区世纪大道8号国金中心二期21-22楼

电话：(021) 61055724

传真：(021) 61055054

联系人：傅鲸

客户服务电话：400-700-5000（免长途话费），(021) 61055000

网址：www.fund001.com

个人投资者可以通过基金管理人网上直销交易平台办理开户、本基金A类基金份额和C类基金份额的申购、赎回、转换及定期定额投资等业务，具体交易细则请参阅基金管理人网站。

网上直销交易平台网址：www.fund001.com

#### 2、不通过上海证券交易所交易系统办理相关业务的场外销售机构

本基金的场外销售机构请见本招募说明书“五、相关服务机构”章节或拨打基金管理人客户服务电话进行咨询。

3、通过上海证券交易所交易系统办理相关业务的上海证券交易所会员单位，目前场内交易只支持A类前端基金份额的申购。具体名单详见上海证券交易所网站。

投资者可通过上述场所按照规定的方式进行申购或赎回。本基金管理人可根据情况变更或增减基金销售机构，并在管理人网站公示。

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。

### (二) 申购和赎回的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

基金投资者在开放日申请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（若该工作日为非港股通交易日，则本基金可不开放）。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。

若出现新的证券/期货交易市场、证券/期货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》的有关规定在规定媒介上公告。

## 2、申购、赎回开始日及业务办理时间

本基金A类基金份额已于2011年9月13日起开放申购、赎回业务。

本基金C类基金份额已于2022年1月24日起开放申购、赎回业务。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。基金投资者在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或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）申购和赎回的原则

1、“未知价”原则，即基金份额的申购与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、基金采用金额申购和份额赎回的原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、基金份额持有人赎回时，除指定赎回外，基金管理人按“先进先出”的原则，对该持有人账户在该销售机构托管的基金份额进行处理，即注册登记确认日期在先的基金份额先赎回，注册登记确认日期在后的基金份额后赎回，以确定被赎回基金份额的持有期限和所适用的赎回费率；

4、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，但申请经登记机构受理的不得撤销；

5、基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可更改上述原则，但最迟应在新的原则实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

### （四）申购和赎回的数额限定

#### 1、申购金额的限制

场外申购时，场外销售机构每个账户单笔申购的最低金额为单笔1元，如果销

售机构业务规则规定的最低单笔申购金额高于1元，以该销售机构的规定为准。

直销机构首次申购的最低金额为单笔100万元，追加申购的最低金额为单笔10万元；已在直销机构有认购或申购过本基金管理人管理的任一基金（包括本基金）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直销交易平台办理基金申购业务的不受直销机构单笔申购最低金额的限制，申购最低金额为单笔1元。本基金直销机构单笔申购最低金额可由基金管理人酌情调整。

场内申购时，每笔申购金额最低为1000元人民币，同时每笔申购必须是100元的整数倍，并且单笔申购最高不超过99,999,900元。

## 2、赎回份额的限制

场外赎回时，赎回的最低份额为1份基金份额，如果销售机构业务规则规定的最低单笔赎回份额高于1份，以该销售机构的规定为准；场内赎回时，赎回的最低份额为50份基金份额，同时赎回份额必须是整数份额，并且单笔赎回最多不超过99,999,999份基金份额。

## 3、最低保留余额的限制

每个工作日投资者在单个交易账户保留的本基金份额余额少于1份时，若当日该账户同时有份额减少类业务（如赎回、转换出等）被确认，则基金管理人有权将投资者在该账户保留的本基金份额一次性全部赎回。

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

5、基金管理人可根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整上述规定的数量或比例限制，基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

## （五）申购和赎回的程序

### 1、申购和赎回的申请方式

投资者必须根据基金销售机构规定的程序，在开放日的业务办理时间向基金销售机构提出申购或赎回的申请。

投资者在申购本基金时须按销售机构规定的方式备足申购资金，否则所提交的



申购申请不成立。

投资者在提交赎回申请时，必须持有足够的基金份额余额，否则所提交的赎回申请不成立。

## 2、申购和赎回申请的确认

T 日规定时间受理的申请，正常情况下，注册登记机构在T+1 日内（包括该日）为投资者对该交易的有效性进行确认，基金投资者应在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，否则如因申请未得到注册登记机构的确认而产生的后果，由投资者自行承担。

基金管理人可以在法律法规允许的范围内，依法对上述申购和赎回申请的确认时间进行调整，并必须在调整实施日前按照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

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、赎回申请的确认以注册登记机构的确认结果为准。

## 3、申购和赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式，若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成立。投资人全额交付申购款项，申购成立；注册登记机构确认基金份额时，申购生效。若申购不成立或无效，基金管理人或基金管理人指定的销售机构将基金投资者已缴付的申购款项本金退还给投资者。

投资人递交赎回申请，赎回成立；注册登记机构确认赎回时，赎回生效。基金投资者赎回申请成功后，基金管理人将通过注册登记机构及其相关销售机构在T+7 日（包括该日）内将赎回款项划往基金份额持有人账户。在发生巨额赎回或基金合同载明的其他暂停赎回或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。

## 4、申购和赎回基金份额的份额注册登记

(1) 投资者T 日申购基金成功后，正常情况下，注册登记机构在T+1 日为投资者增加权益并办理注册登记手续，投资者自T+2 日（含该日）起有权赎回该部分基金份额。

(2) 投资者T 日赎回基金成功后，正常情况下，基金注册登记机构在T+1 日为投资者扣除权益并办理相应的注册登记手续。



(3) 基金管理人可在法律法规允许的范围内, 对上述注册登记办理时间进行调整, 并最迟于开始实施前按照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

## (六) 基金的申购费和赎回费

### 1、申购费用

本基金基金份额分为A类基金份额和C类基金份额, 投资人申购A类基金份额在申购时支付申购费用; 申购C类基金份额不支付申购费用, 并从该类别基金资产中计提销售服务费。

本基金A类基金份额提供两种申购费用的支付模式。投资者可以选择前端收费模式, 即在申购时支付申购费用; 也可以选择后端收费模式, 即在赎回时才支付相应的申购费用, 该费用随基金份额的持有时间递减。场外申购可以采取前端收费模式和后端收费模式, 场内申购目前只支持前端收费模式。

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

投资者可以多次申购本基金, 申购费率按每笔申购申请单独计算。

本基金A类基金份额(非养老金客户)的申购费率如下:

A类基金份额申购费率(前端)	申购金额(含申购费)	A类基金份额前端申购费率
	50万元以下	1.5%
	50万元(含)至100万元	1.2%
	100万元(含)至200万元	0.8%
	200万元(含)至500万元	0.5%
	500万元以上(含500万元)	每笔交易1000元
A类基金份额申购费率(后端)	持有时间	A类基金份额后端申购费率
	1年以内(含)	1.8%
	1年—3年(含)	1.2%
	3年—5年(含)	0.6%
	5年以上	0

持有A类基金份额的投资人因红利自动再投资而产生的A类基金份额, 不收取相应的申购费用。

本基金对通过基金管理人直销柜台申购本基金A类前端基金份额的养老金客户实施特定申购费率。

养老金客户指基本养老保险与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金等, 具体包括全国社会保障基金、可以投资基金的地方社会

保障基金、企业年金单一计划以及集合计划、企业年金理事会委托的特定客户资产管理计划、企业年金养老金产品。如将来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，基金管理人可在招募说明书更新或发布临时公告将其纳入养老金客户范围。

通过基金管理人直销柜台申购本基金A类前端基金份额的养老金客户特定申购费率如下表：

A类基金份额特定申购费率(前端)	申购金额(含申购费)	A类基金份额前端特定申购费率
	50万元以下	0.60%
	50万元(含)至100万元	0.48%
	100万元(含)至200万元	0.32%
	200万元(含)至500万元	0.20%
500万元以上(含500万)	每笔交易1000元	

有关养老金客户实施特定申购费率的具体规定以及活动时间如有变化，敬请投资人留意基金管理人发布的相关公告。

投资者通过直销机构交易享有如下费率优惠，有关费率优惠活动的具体费率折扣及活动起止时间如有变化，敬请投资者留意本基金管理人的有关公告，届时费率优惠相关事项以最新公告为准：

1) 通过本基金管理人直销柜台办理本基金A类前端基金份额申购业务的投资者，享受前端申购费率一折优惠；对上述实施特定申购费率的养老金客户而言，以其目前适用的特定申购费率和上述一般申购费率的一折优惠中孰低者执行。若享有折扣前的原申购费率为固定费用的，则按原固定费率执行，不再享有费率折扣。

2) 通过本基金管理人网上直销交易平台办理本基金A类前端基金份额申购及定期定额投资业务的个人投资者享受前端申购费率及定期定额投资费率优惠，赎回费率标准不变。具体优惠费率请参见本基金管理人网站列示的网上直销交易平台申购费率表、定期定额投资费率表或相关公告。

本公司基金网上直销业务已开通的银行卡及各银行卡交易金额限额请参阅本公司网站。

本基金管理人可根据业务情况调整上述交易费用和限额要求，并依据相关法规的要求提前进行公告。

## 2、赎回费用

(1) 本基金A类基金份额的赎回费率如下：

A类基金份额的赎回费率	持有期限	A类基金份额赎回费率
	7日以内	1.5%
	7日(含)—30日	0.75%
	30日(含)—6个月	0.5%
	6个月以上(含)	0

本基金A类基金份额的赎回费用由赎回A类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7日的投资人收取1.5%的赎回费,对持续持有期大于等于7日但少于30日的投资人收取0.75%的赎回费,并将上述赎回费全额计入基金财产;对持续持有期大于等于30日但少于3个月的投资人收取0.5%的赎回费,并将赎回费总额的75%计入基金财产;对持续持有期大于等于3个月但少于6个月的投资人收取0.5%的赎回费,并将赎回费总额的50%计入基金财产。上述“月”指的是30个自然日。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。

(2) 本基金C类基金份额的赎回费率如下:

C类基金份额的赎回费率	持有期限	C类基金份额赎回费率
	7日以内	1.5%
	7日(含)—30日	0.5%
	30日以上(含)	0

本基金C类基金份额的赎回费用由赎回C类基金份额的基金份额持有人承担,在基金份额持有人赎回C类基金份额时收取,对C类基金份额持有人收取的赎回费全额计入基金财产。

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

4、基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情况下根据市场情况制定基金促销计划,针对投资人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销售费用。

5、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以及监管部门、自律规则的规定。

#### (七) 申购和赎回的数额和价格

## 1、申购和赎回数额、余额的处理方式

(1) 申购份额余额的处理方式：申购A类基金份额或C类基金份额的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用（如有）后，以当日该类基金份额的基金份额净值为基准计算，场外申购份额计算结果保留到小数点后2位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。场内申购有效份额的计算截位保留到整数位，剩余部分折回金额返还投资者，折回金额的计算保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

(2) 赎回金额的处理方式：赎回金额为按实际确认的A类基金份额和C类基金份额有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用（如有），赎回金额计算结果保留到小数点后2位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

## 2、申购份额的计算

### (1) A类基金份额的申购

场外申购A类基金份额可以采取前端收费模式和后端收费模式，场内申购A类基金份额目前只支持前端收费模式。

#### 1) 前端收费模式：

申购总金额=申请总金额

净申购金额=申购总金额/（1+申购费率）

（注：对于适用固定金额申购费用的申购，净申购金额=申购总金额-固定申购费用金额）

申购费用=申购总金额-净申购金额

（注：对于适用固定金额申购费用的申购，申购费用=固定申购费用金额）

申购份额=（申购总金额-申购费用）/ T日A类基金份额净值

场内申购金额的有效份额保留到整数位，剩余部分对应申购资金返还投资者。

例一：某投资者投资40,000元申购本基金A类基金份额，假设申购当日A类基金份额净值为1.0400元，如果其选择前端收费方式，申购费率为1.5%，则其可得到的申购份额为：

申购总金额=40,000元

净申购金额=40,000/（1+1.5%）=39,408.87元

申购费用=40,000-39,408.87=591.13元

申购份额= (40,000-591.13) / 1.0400=37,893.14份

如果投资者是场外申购, 申购份额为37,893.14份。

如果投资者是场内申购, 则申购份额为37,893份, 其余0.14份对应金额返回给投资者。

## 2) 后端收费模式:

申购总金额=申请总金额

申购份额=申购总金额/T日A类基金份额净值

当投资者提出赎回时, 后端认购费用的计算方法为:

后端申购费用=赎回份额×申购日基金份额净值×后端申购费率

例二: 某投资者投资40,000元申购本基金A类基金份额, 假设申购当日A类基金份额净值为1.0400元, 如果其选择后端收费方式, 则其可得到的申购份额为:

申购份额 = 40,000 / 1.0400 = 38,461.54份

即: 投资者投资40,000元申购本基金A类基金份额, 假设申购当日A类基金份额净值为1.0400元, 则可得到38,461.54份A类基金份额, 但其在赎回时需根据其持有时间按对应的后端申购费率交纳后端申购费用。

## (2) C类基金份额的申购

如果投资者选择申购C类基金份额, 则申购份额的计算方法如下:

申购总金额=申请总金额

申购份额=申购总金额/T日C类基金份额净值

例三: 某投资者投资40,000元申购本基金的C类基金份额, 假设申购当日C类基金份额净值为1.0400元, 则其可得到的申购份额为:

申购份额=40,000/1.0400=38,461.54份

即: 投资者投资40,000元申购本基金的C类基金份额, 假设申购当日C类基金份额净值为1.0400元, 则其可得到38,461.54份C类基金份额。

## 3、赎回金额的计算

赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日该类基金份额净值并扣除相应的费用, 赎回金额单位为元, 计算结果保留到小数点后两位, 第三位四舍五入。

### (1) A类基金份额的赎回

1) 如果投资者在申购A类基金份额时选择交纳前端申购费用, 则赎回金额的计算方法如下:



赎回费用=赎回份额×T日A类基金份额净值×赎回费率

赎回金额=赎回份额×T日A类基金份额净值-赎回费用

例四：某投资者赎回通过前端申购持有的10,000份A类基金份额，持有期限为30日，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1.0160元，则其可得到的赎回金额为：

赎回费用 = 10,000×1.0160×0.5% = 50.80元

赎回金额 = 10,000×1.0160-50.80 = 10,109.20元

即：投资者赎回本基金10,000份A类基金份额，假设赎回当日A类基金份额净值是1.0160元，则其可得到的赎回金额为10,109.20元。

2) 如果投资者在申购A类基金份额时选择交纳后端申购费用，则赎回金额的计算方法如下：

赎回总额=赎回份额×T日A类基金份额净值

后端申购费用=赎回份额×申购日A类基金份额净值×后端申购费率

赎回费用=赎回总额×赎回费率

赎回金额=赎回总额-后端申购费用-赎回费用

例五：某投资者赎回通过后端申购持有的10,000份A类基金份额，持有期限为30日，对应的后端申购费率是1.8%，赎回费率为0.5%，假设赎回当日A类基金份额净值是1.0160元，申购时的A类基金份额净值为1.0100元，则其可得到的赎回金额为：

赎回总额=10,000×1.0160=10,160元

后端申购费用=10,000×1.0100×1.8%=181.80元

赎回费用=10,160×0.5%=50.80元

赎回金额=10,160-181.80-50.80=9,927.40元

即：投资者赎回本基金10,000份A类基金份额，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1.0160元，投资者对应的后端申购费率是1.8%，申购时的A类基金份额净值为1.0100元，则其可得到的赎回金额为9,927.40元。

## (2) C类基金份额的赎回

投资者赎回C类基金份额，赎回金额的计算方法如下：

赎回费用=赎回份额×T日C类基金份额净值×赎回费率

赎回金额=赎回份额×T日C类基金份额净值-赎回费用

例六：某投资者赎回持有的10,000份C类基金份额，假设持有时间为20日，对应的赎回费率为0.5%，假设赎回当日C类基金份额净值是1.0160元，则其可得到的赎回金额为：

$$\text{赎回费用} = 10,000 \times 1.0160 \times 0.5\% = 50.80 \text{元}$$

$$\text{赎回金额} = 10,000 \times 1.0160 - 50.80 = 10,109.20 \text{元}$$

即：投资者赎回本基金10,000份C类基金份额，假设持有时间为20日，对应的赎回费率为0.5%，假设赎回当日C类基金份额净值是1.0160元，则其可得到的赎回金额为10,109.20元。

#### 4、基金份额净值的计算公式

A类基金份额净值=A类基金份额的基金资产净值总额/发行在外的A类基金份额总数

C类基金份额净值=C类基金份额的基金资产净值总额/发行在外的C类基金份额总数

本基金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。本基金A类基金份额和C类基金份额的份额净值的计算，均保留到小数点后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) 拒绝或暂停申购的情形及处理方式

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受基金投资者的申购申请：

- 1、因不可抗力导致基金无法正常运作；
- 2、证券/期货交易所交易时间非正常停市或港股通临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；
- 3、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况；
- 4、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或基金管理人认为会损害已有基金份额持有人利益的其他情形；
- 5、基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔申购；
- 6、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例超过50%，或者变相规避50%集中度的。出现上述情形时，基金管理人有权将上述申购申请全部或部分确认失败；
- 7、港股通交易每日额度不足。

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，基金管理人应当暂停基金估值，并采取暂停接受基金申购申请的措施。

9、法律法规规定、中国证监会认定或基金合同约定的其他情形。

发生上述除第5、6项以外的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规定媒介上刊登暂停申购公告。如果基金投资者的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资者。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。

### **(九) 暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式**

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受基金投资者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、证券/期货交易所交易时间非正常停市或港股通临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；

3、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回；

4、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况；

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

6、法律法规规定、中国证监会认定或基金合同约定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项时，基金管理人应及时报中国证监会备案，已成功确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，可延期支付。

若出现上述第3项所述情形，按基金合同的相关条款处理。投资者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。暂停赎回或延缓支付款项的场内处理，按照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规定办理。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) 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）超过前一工作日的基金总份额的10%，即认为是发生了巨额赎回。

## 2、巨额赎回的处理方式

### （1）巨额赎回的场外处理方式

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基金投资者的赎回申请时，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基金投资者的赎回申请有困难或认为支付投资者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工作日基金总份额的10%的前提下，对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；基金投资者未能赎回部分，投资者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，当日未获赎回的部分申请将被撤销。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基金份额净值为基础计算赎回金额，并以此类推，直到全部赎回为止。如基金投资者在提交赎回申请时未作明确选择，投资者未能赎回部分作自动延期赎回处理。

本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一日基金总份额20%的情形下，基金管理人有权采取如下措施：对于基金份额持有人当日超过20%的赎回申请，可以对其赎回申请延期办理；对于基金份额持有人未超过上述比例的部分，基金管理人可以根据前段“1) 全额赎回”或“2) 部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。但是，如该类基金份额持有人在当日选择取消赎回，则其当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。

### （2）巨额赎回的场内处理方式

巨额赎回业务的场内处理，按照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规定办理。

## 3、巨额赎回的公告

当发生巨额赎回并延期赎回时，基金管理人应当通过邮寄、传真、刊登公告或者通知基金销售机构代为告知等方式在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日内在规定媒介上刊登公告。

连续2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；已经确认成功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，并应当在规定媒介上进行公告。

#### （十一）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在规定媒介上刊登暂停公告。

2、暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应依照《信息披露管理办法》的有关规定，在规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个工作日各类基金份额的基金份额净值。

#### （十二）转托管

本基金的份额采用分系统登记的原则。场外申购的基金份额登记在注册登记系统基金份额持有人开放式基金账户下；场内申购的基金份额登记在证券登记结算系统基金份额持有人上海证券账户下。

##### 1、系统内转托管

系统内转托管是指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构之间或证券登记结算系统内不同会员单位之间进行转登记的行为。

##### 2、跨系统转托管

（1）跨系统转托管是指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统之间进行转登记的行为。

（2）本基金跨系统转托管的具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司的相关规定办理。

基金管理人、注册登记机构、办理转托管的销售机构因技术系统性能限制或其它合理原因，可以暂停该业务或者拒绝基金份额持有人的转托管申请。

#### （十三）定期定额投资计划

定期定额投资计划是基金申购业务的一种方式，投资人可通过向相关销售机构提交申请，约定每期申购日、扣款金额及扣款方式，由指定的销售机构在投资人指定资金账户内自动扣款并于每期约定的申购日提交基金的申购申请。定期定额投资

计划并不构成对基金日常申购、赎回等业务的影响，投资人在办理相关基金定期定额投资计划的同时，仍然可以进行日常申购、赎回业务。本基金2011年9月7日刊登公告自2011年9月13日起开通A类基金份额的定期定额投资计划业务，本基金2022年2月23日刊登公告自2022年2月28日起开通C类基金份额的定期定额投资计划业务，具体开通销售机构名单和业务规则参见相关公告。

#### **(十四) 定期定额赎回业务**

投资人可通过中国农业银行股份有限公司申请办理本基金A类基金份额的定期定额赎回业务。定期定额赎回业务是指投资人可以委托中国农业银行股份有限公司每月固定时间从指定的基金账户代投资人赎回固定份额的基金。本基金2011年9月7日刊登公告自2011年9月13日起在中国农业银行股份有限公司下属各销售网点开通A类基金份额定期定额赎回业务。

投资人通过中国农业银行股份有限公司办理本基金A类基金份额的定期定额赎回业务，相关流程和业务规则遵循中国农业银行股份有限公司的有关规定。详情请咨询当地中国农业银行股份有限公司的销售网点或中国农业银行股份有限公司客户服务热线（95599）。

#### **(十五) 基金的非交易过户**

指注册登记机构受理继承、捐赠、司法强制执行和经注册登记机构认可的其它情况而产生的非交易过户。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者。

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注册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注册登记机构的有关规定办理，并按注册登记机构规定的标准收费。

#### **(十六) 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。

#### **(十七) 实施侧袋机制期间本基金的申购与赎回**

本基金实施侧袋机制的，本基金的申购和赎回安排详见招募说明书“侧袋机

制”部分的规定或相关公告。

#### **(十八) 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。

## 九、基金的转换

### (一) 基金转换

基金转换是指开放式基金份额持有人将其持有某只基金的部分或全部份额转换为同一基金管理人管理的另一只开放式基金份额。基金转换只能在同一销售机构进行。

### (二) 转换业务办理时间

本基金2011年9月7日刊登公告自2011年9月13日起开放A类基金份额的日常转换业务，本基金2022年2月23日刊登公告自2022年2月28日起开放C类基金份额的日常转换业务。

办理基金间转换的时间为上海证券交易所、深圳证券交易所交易日。若出现新的证券交易市场或交易所交易时间更改或其它原因，基金管理人将视情况进行相应的调整并公告。

投资人可在基金开放日申请办理基金转换业务，具体办理时间与基金申购、赎回业务办理时间相同。由于各销售机构的系统差异以及业务安排等原因，开展该业务的时间可能有所不同，投资人应以各销售机构公告的时间为准。

本基金转换业务具体开通销售机构名单参见相关公告。

### (三) 基金转换的程序

1、申请方式：书面申请或销售机构公布的其他方式。

2、基金转换申请的确认

正常情况下，T日规定时间受理的申请，注册登记机构在T+1日内为投资人对该交易的有效性进行确认，在T+2日后(包括该日)投资人可向销售机构查询转换的确认情况。

3、基金转换的注册登记

注册登记机构以收到有效转换申请的当天作为转换申请日(T日)。投资人转换基金成功的，注册登记机构将在T+1日对投资人T日的基金转换业务申请进行有效性确认，办理转出基金的权益扣除以及转入基金的权益登记，在T+2日后(包括该日)投资人可向销售机构查询基金转换的成交情况，并有权转换或赎回该部分基金份额。

### (四) 基金转换的数额限制

基金转换以份额为单位进行申请，申请转换份额精确到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，误差部分归基金财产。

本基金遵循“份额转换”的原则，单笔转换份额不得低于1份。基金持有人可将其全部或部分基金份额转换成其它基金，单笔转换申请不受转入基金最低申购限额限制。

基于各基金关于投资人在单个交易账户最低保留余额的规定，每个工作日投资人在单个交易账户保留的某基金基金份额余额少于该基金的最低保留余额时，若当日该账户同时有该基金的基金份额减少类业务（如赎回、转换出等）被确认，基金管理人有权将投资人在该账户保留的该基金基金份额一次性全部赎回。因此，如果某笔转换申请确认后转出基金的单个交易账户的基金份额余额少于转出基金的最低保留余额，则转出基金在该账户剩余的基金份额将被全部赎回。如果某笔转换申请确认后转入基金的单个交易账户的基金份额余额少于转入基金的最低保留余额且该账户当日有转入基金的基金份额减少类业务被确认，则转入基金在该账户剩余的基金份额（包括该部分转换入确认份额）将随即被强制赎回。

#### （五）基金转换费用

1、每笔基金转换视为一笔赎回和一笔申购，基金转换费用相应由转出基金的赎回费用及转出、转入基金的申购补差费用构成。

##### 2、转出基金的赎回费用

转出基金的赎回费用及归入基金财产的比例按照各基金最新的更新招募说明书及相关公告规定的赎回费率和计费方式收取。

##### 3、前端收费模式下转出与转入基金的申购补差费用

从不收取申购费用的基金或前端申购费用低的基金向前端申购费用高的基金转换，收取前端申购补差费用；从前端申购费用高的基金向前端申购费用低的基金或不收取申购费用的基金转换，不收取前端申购补差费用。申购补差费用原则上按照转出确认金额对应的转入基金前端申购费率减去转出基金前端申购费率差额进行计算补差，若遇固定费用，则按实际产生补差费用收取。

##### 4、后端收费模式下转出与转入基金的申购补差费用

从不收取申购费用的基金或后端申购费用低的基金向后端申购费用高的基金转换，不收取后端申购补差费用，但转入的基金份额赎回的时候需全额收取转入基金的后端申购费；从后端申购费用高的基金向后端申购费用低的基金或不收取申购费



用的基金转换，收取后端申购补差费用，且转入的基金份额赎回的时候需全额收取转入基金的后端申购费。后端申购补差费用按照转出份额持有时间对应分档的转出基金后端申购费率减去转入基金后端申购费率差额进行补差。

#### 5、网上直销的申购补差费率优惠

为更好服务投资者，本基金管理人已开通基金网上直销业务，个人投资者可以通过“网上直销交易平台”办理基金转换业务，其中部分转换业务可享受转换费率优惠，优惠费率只适用于转出与转入基金申购补差费用，转出基金的赎回费用无优惠。可通过网上直销交易平台办理的转换业务范围及转换费率优惠的具体情况请参阅本基金管理人网站。

6、基金管理人可以根据法律法规及基金合同的规定对上述收费方式和费率进行调整，并应于调整后的收费方式和费率在实施前依照《信息披露办法》的有关规定在中国证监会规定媒介上公告。

### (六) 基金转换份额的计算公式

#### 1、前端收费模式下基金转换份额的计算公式及举例

转出确认金额=转出的基金份额×转换申请当日转出基金的基金份额净值

转出基金的赎回费=转出确认金额×对应的转出基金的赎回费率

转入确认金额=转出确认金额-转出基金的赎回费

转出与转入基金的申购补差费=转入确认金额×对应的转出与转入基金的申购补差费率/（1+对应的转出与转入基金的申购补差费率）

（注：若转出基金申购费率不低于转入基金申购费率，转出与转入基金的申购补差费为零）

对于涉及固定费用的，转出与转入基金的申购补差费=MAX（0，转出基金和转入基金申购费用之差）

转入基金确认份额=（转入确认金额-转出与转入基金的申购补差费+A）/转换申请当日转入基金的基金份额净值

其中：

A为货币市场基金转出的基金份额按比例结转的账户当前累计待支付收益（仅限转出基金为货币市场基金的情形，否则A为0）。

转入基金确认份额的计算精确到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，误差部分归基金财产。

例一：某投资者持有交银趋势前端收费模式的A类基金份额100,000份，持有期半年，转换申请当日交银趋势的A类基金份额净值为1.0100元，交银成长的基金份额净值为2.2700元。若该投资者将100,000份交银趋势前端A类基金份额转换为交银成长前端基金份额，则转入交银成长确认的基金份额为：

$$\text{转出确认金额} = 100,000 \times 1.0100 = 101,000 \text{元}$$

$$\text{转出基金的赎回费} = 101,000 \times 0.5\% = 505 \text{元}$$

$$\text{转入确认金额} = 101,000 - 505 = 100,495 \text{元}$$

$$\text{转出与转入基金的申购补差费} = 100,495 \times 0 / (1+0) = 0 \text{元}$$

$$\text{转入基金确认份额} = (100,495 - 0) / 2.2700 = 44,270.93 \text{份}$$

例二：某投资者持有交银增利A类基金份额1,000,000份，持有期一年半，转换申请当日交银增利A类基金份额的基金份额净值为1.0200元，交银趋势的A类基金份额净值为1.0100元。若该投资者将1,000,000份交银增利A类基金份额转换为交银趋势前端A类基金份额，则转入交银趋势确认的A类基金份额为：

$$\text{转出确认金额} = 1,000,000 \times 1.0200 = 1,020,000 \text{元}$$

$$\text{转出基金的赎回费} = 1,020,000 \times 0.05\% = 510 \text{元}$$

$$\text{转入确认金额} = 1,020,000 - 510 = 1,019,490 \text{元}$$

$$\text{转出与转入基金的申购补差费} = 1,019,490 \times 0.5\% / (1+0.5\%) = 5,072.09 \text{元}$$

$$\text{转入基金确认份额} = (1,019,490 - 5,072.09) / 1.0100 = 1,004,374.17 \text{份}$$

例三：某投资者持有交银增利C类基金份额100,000份，持有期一年半，转换申请当日交银增利C类基金份额净值为1.2500元，交银精选的基金份额净值为2.2700元。若该投资者将100,000份交银增利C类基金份额转换为交银精选前端基金份额，则转入交银精选确认的基金份额为：

$$\text{转出确认金额} = 100,000 \times 1.2500 = 125,000 \text{元}$$

$$\text{转出基金的赎回费} = 0 \text{元}$$

$$\text{转入确认金额} = 125,000 - 0 = 125,000 \text{元}$$

$$\text{转出与转入基金的申购补差费} = 125,000 \times 1.5\% / (1+1.5\%) = 1,847.29 \text{元}$$

$$\text{转入基金确认份额} = (125,000 - 1,847.29) / 2.2700 = 54,252.30 \text{份}$$

例四：某投资者持有交银货币A级基金份额100,000份，该100,000份基金份额未结转的待支付收益为61.52元，转换申请当日交银增利A类基金份额净值为1.2700元，交银货币的基金份额净值为1.00元。若该投资者将100,000份交银货币A级基金



份额转换为交银增利A类基金份额，则转入确认的交银增利A类基金份额为：

$$\text{转出确认金额} = 100,000 \times 1.00 = 100,000 \text{元}$$

$$\text{转出基金的赎回费} = 0 \text{元}$$

$$\text{转入确认金额} = 100,000 - 0 = 100,000 \text{元}$$

$$\text{转出与转入基金的申购补差费} = 100,000 \times 0.8\% / (1 + 0.8\%) = 793.65 \text{元}$$

$$\text{转入基金确认份额} = (100,000 - 793.65 + 61.52) / 1.2700 = 78,163.68 \text{份}$$

## 2、后端收费模式下基金转换份额的计算公式及举例

$$\text{转出确认金额} = \text{转出的基金份额} \times \text{转换申请当日转出基金的基金份额净值}$$

$$\text{转出基金的赎回费} = \text{转出确认金额} \times \text{对应的转出基金的赎回费率}$$

$$\text{转入确认金额} = \text{转出确认金额} - \text{转出基金的赎回费}$$

$$\text{转出与转入基金的申购补差费} = \text{转入确认金额} \times \text{对应的转出与转入基金的申购补差费率}$$

$$\text{转入基金确认份额} = (\text{转入确认金额} - \text{转出与转入基金的申购补差费} + A) / \text{转换申请当日转入基金的基金份额净值}$$

其中：

A为货币市场基金转出的基金份额按比例结转的账户当前累计待支付收益（仅限转出基金为货币市场基金的情形，否则A为0）。

转入基金确认份额的计算精确到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，误差部分归基金财产。

例五：某投资者持有交银主题后端收费模式的A类基金份额100,000份，持有期一年半，转换申请当日交银主题的A类基金份额净值为1.2500元，交银稳健的基金份额净值为2.2700元。若该投资者将100,000份交银主题后端A类基金份额转换为交银稳健后端基金份额，则转入交银稳健确认的基金份额为：

$$\text{转出确认金额} = 100,000 \times 1.2500 = 125,000 \text{元}$$

$$\text{转出基金的赎回费} = 125,000 \times 0.2\% = 250 \text{元}$$

$$\text{转入确认金额} = 125,000 - 250 = 124,750 \text{元}$$

$$\text{转出与转入基金的申购补差费} = 124,750 \times 0 = 0 \text{元}$$

$$\text{转入基金确认份额} = (124,750 - 0) / 2.2700 = 54,955.95 \text{份}$$

例六：某投资者持有交银先锋后端收费模式的A类基金份额100,000份，持有期一年半，转换申请当日交银先锋的A类基金份额净值为1.2500元，交银货币的基金

份额净值为1.00元。若该投资者将100,000份交银先锋后端A类基金份额转换为交银货币，则转入交银货币的基金份额为：

$$\text{转出确认金额} = 100,000 \times 1.2500 = 125,000 \text{元}$$

$$\text{转出基金的赎回费} = 125,000 \times 0.2\% = 250 \text{元}$$

$$\text{转入确认金额} = 125,000 - 250 = 124,750 \text{元}$$

$$\text{转出与转入基金的申购补差费} = 124,750 \times 1.2\% = 1,497 \text{元}$$

$$\text{转入基金确认份额} = (124,750 - 1,497) / 1.00 = 123,253.00 \text{份}$$

例七：某投资者持有交银蓝筹后端收费模式的基金份额100,000份，持有期三年半，转换申请当日交银蓝筹的基金份额净值为0.8500元，交银增利B类基金份额的基金份额净值为1.0500。若该投资者将100,000份交银蓝筹后端基金份额转换为交银增利B类基金份额，则转入交银增利B类基金份额的基金份额为：

$$\text{转出确认金额} = 100,000 \times 0.8500 = 85,000 \text{元}$$

$$\text{转出基金的赎回费} = 85,000 \times 0 = 0 \text{元}$$

$$\text{转入确认金额} = 85,000 - 0 = 85,000 \text{元}$$

$$\text{转出与转入基金的申购补差费} = 85,000 \times 0.2\% = 170 \text{元}$$

$$\text{转入基金确认份额} = (85,000 - 170) / 1.0500 = 80,790.48 \text{份}$$

例八：某投资者持有交银货币A级基金份额100,000份，该100,000份基金份额未结转的待支付收益为61.52元，转换申请当日交银增利B类基金份额净值为1.2700元，交银货币的基金份额净值为1.00元。若该投资者将100,000份交银货币A级基金份额转换为交银增利B类基金份额，则转入确认的交银增利B类基金份额为：

$$\text{转出确认金额} = 100,000 \times 1.00 = 100,000 \text{元}$$

$$\text{转出基金的赎回费} = 0 \text{元}$$

$$\text{转入确认金额} = 100,000 - 0 = 100,000 \text{元}$$

$$\text{转出与转入基金的申购补差费} = 100,000 \times 0 = 0 \text{元}$$

$$\text{转入基金确认份额} = (100,000 - 0 + 61.52) / 1.2700 = 78,788.60 \text{份}$$

### (七) 业务规则

1、基金转换只能在同一销售机构进行。转换的两只基金必须都是该销售机构代理的同一基金管理人管理的、在同一注册登记机构处注册登记的基金。投资人办理基金转换业务时，转出方的基金必须处于可赎回状态，转入方的基金必须处于可申购状态。

2、投资人只能在相同收费模式下进行基金转换。前端收费模式的开放式基金只能转换到前端收费模式的其他基金，后端收费模式的基金只能转换到后端收费模式的其他基金。货币市场基金、债券基金C类基金份额与其他基金之间的转换不受上述收费模式的限制。

3、基金转换采取未知价法，即基金的转换价格以申请受理当日各转出、转入基金的基金份额净值为基础进行计算。（货币市场基金的基金份额净值为固定价1.00元）。

4、投资人申请转出其账户内货币市场基金的基金份额时，注册登记机构将自动结转该转出份额对应的待支付收益，该收益将一并计入转出金额并折算为转入基金的基金份额，但收益部分不收取转换费用。

5、转换后，转入基金份额的持有时间将重新计算，即转入基金份额的持有期将自转入基金份额被确认日起重新开始计算。

#### **（八）暂停基金转换**

基金转换视同为转出基金的赎回和转入基金的申购，因此有关转出基金和转入基金关于暂停或拒绝申购、暂停赎回的情形和公告的有关规定一般也适用于暂停基金转换，具体暂停或恢复基金转换的相关业务请详见届时本基金管理人发布的相关公告。

本基金单个开放日，基金净赎回申请份额（该基金赎回申请总份额加上基金转换中转出申请总份额后扣除申购申请总份额及基金转换中转入申请总份额后的余额）超过前一工作日基金总份额的10%时，即认为发生了巨额赎回。发生巨额赎回时，基金转出与基金赎回具有相同的优先级，基金管理人可根据基金资产组合情况，决定全额转出或部分转出，并且对于基金转出和基金赎回，将采取相同的比例确认；但在转出申请得到部分确认的情况下，未确认部分的转出申请将自动予以撤销，不再视为下一开放日的基金转换申请。

## 十、基金的投资

### (一) 投资理念

中国传统工业已经发展到一定程度，未来经济发展的动力源自新兴产业和装备升级。在“中国制造”向“中国智造”的战略升级过程中，本基金可以通过专业研究挖掘相关行业的投资机会。

### (二) 投资目标

本基金通过重点投资于与先进制造主题相关的优质企业，把握中国产业结构升级的投资机会，在控制风险并保持基金资产良好的流动性的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。

### (三) 投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含创业板、科创板以及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、港股通标的股票、债券（含国债、央行票据、金融债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、企业债券、公司债券、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、可交换公司债券、次级债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、货币市场工具、债券回购、同业存单、银行存款（含协议存款、定期存款及其他银行存款）、资产支持证券、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）。

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

### (四) 投资对象

基金的投资组合比例为：股票资产（含存托凭证）占基金资产的50%–95%（其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的0%–50%），投资于先进制造主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如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。

## (五) 业绩比较基准

沪深300指数收益率×55%+恒生指数收益率×5%+中证综合债券指数收益率×40%

沪深300指数是沪深证券交易所第一次联合发布的反映A股市场整体走势的指数，由中证指数公司编制和维护，是在上海和深圳证券市场中选取300只A股作为样本编制而成。该指数样本对沪深市场的覆盖度高，具有良好的市场代表性，投资者可以方便地从报纸、互联网等财经媒介中获取。沪深300指数引进国际指数编制和管理的经验，编制方法清晰透明，具有独立性和良好的市场流动性；与市场整体表现具有较高的相关度，且指数历史表现强于市场平均收益水平，适合作为本基金权益类资产投资的业绩比较基准。

恒生指数是由恒生指数服务有限公司编制，以香港股票市场中的50家上市股票为成份股样本，以其发行量为权数的加权平均股价指数，是反映香港股市价幅趋势最有影响的一种股价指数。

中证综合债券指数是综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场国债、金融债、企业债、央行票据及短期融资券整体走势的跨市场债券指数，该指数旨在更全面地反映我国债券市场的整体价格变动趋势，具有较强的市场代表性。根据本基金的投资范围和投资比例，选用上述业绩比较基准能够客观、合理地反映本基金的风险收益特征。

如果上述基准指数停止计算编制或更改名称，或者市场推出更符合本基金投资目标和风险收益特征的指数，又或者今后法律法规发生变化，则本基金将视情况按照监管部门要求履行相关程序后调整本基金的业绩比较基准并公告。

## (六) 投资策略

本基金充分发挥基金管理人的研究优势，将严谨、规范化的选股方法与积极主动的投资风格相结合，自下而上挖掘与先进制造主题相关的上市公司投资机会，以谋求良好收益。

### 1、资产配置

本基金将通过“自上而下”的定性分析和定量分析相结合形成对不同资产市场表现的预测和判断，确定基金资产在沪深A股、港股、债券及货币市场工具等各类别资产间的分配比例，并随着各类证券风险收益特征的相对变化，动态调整组合中各类资产的比例，以规避或控制市场风险，提高基金收益率。



具体操作中，基金管理人采用经济周期理论下的资产配置模型，通过对宏观经济运行指标、利率和货币政策等相关因素的分析，对中国的宏观经济运行情况进行判断和预测，然后利用经济周期理论确定基金资产在各类别资产间的战略配置策略。

## 2、股票投资

### (1) 先进制造主题的范畴

本基金所指的先进制造，是指在中国经济和制造行业转型升级的大背景下，立足我国国情和科技、产业基础，通过信息化与工业化的深度融合，运用先进的科学技术、材料工艺以及生产方式，推进制造行业生产过程智能化、自动化和制造领域的互联网化，全面提升企业研发、生产、管理和服务水平等。

本基金将“先进制造”主题聚焦于以下两方面：

一是聚焦满足国家战略需求的先进制造业：考虑到中国所处的发展阶段和制造行业转型升级过程中的实际情况，基金管理人将在充分结合中国的实际国情的基础上，重点配置符合国家战略需求的先进制造业领域，例如核心基础零部件、先进基础工艺、关键基础材料等制造业基础产业领域，也包括根据战略性新兴产业的特征，持续跟踪国家相关政策，深度挖掘如与新一代信息技术、高端装备、新材料相关的制造业新兴产业领域；

二是聚焦制造行业生产过程智能化、自动化和制造领域的互联网化，包括具备深度感知、智慧决策、自动执行功能的高档数控机床、工业机器人、增材制造装备、农机装备等智能制造装备以及智能化生产线，同时包括基于互联网的个性化定制、众包设计、云制造等新型制造模式和基于消费需求动态感知的研发、制造和产业组织方式所产生的制造应用领域。

未来如果随着先进制造范畴的变化及发展、政策或市场环境变化导致本基金对先进制造界定范围发生变动，本基金在履行适当程序后可调整上述界定标准。本基金由于上述原因调整界定范围应及时告知基金托管人，并在更新的招募说明书中进行公告。若因本基金界定先进制造主题的方法调整或者上市公司经营发生变化等原因导致本基金持有的先进制造主题相关证券的比例低于非现金基金资产的80%，本基金将在十个交易日之内进行调整。

### (2) 股票选择

本基金综合运用交银施罗德股票研究分析方法和其它投资分析工具，充分发挥

研究团队“自下而上”的主动选股能力，精选具有投资潜力的股票构建投资组合。具体分以下两个层次进行股票挑选：

#### 1) 品质筛选

筛选出在公司治理、财务及管理品质上符合基本品质要求的上市公司，构建备选股票池。主要筛选指标包括：

■ 盈利能力指标：如市盈率（P/E）、市现率（P/Cash Flow）、股价与每股自由现金流比率（P/FCF）、市销率（P/S）、股价与每股息税前利润比率（P/EBIT）等；

■ 经营效率指标：如净资产收益率（ROE）、资产收益率（ROA）、经营资产回报率（Return on operating assets）等；

■ 财务状况指标：如资产负债率（D/A）、流动比率等。

#### 2) 价值评估

在公司备选股票池基础上，本基金将进一步通过对备选上市公司详实的案头分析和深入的实地调研，以定性定量相结合的方法对公司价值进行综合评估，构建本基金风格池。具体从三方面进行系统分析：

##### ■ 行业分析

该部分主要通过对公司所处行业的基本面、主题投资机会、行业整合机会、行业市场表现以及行业的估值情况进行综合考察，把握影响公司所在行业的发展前景和整体投资机会。

##### ■ 公司质量评价

本基金对公司质量的评价主要包括企业财务状况、企业的成长动力以及公司治理、管理层评价等方面。

首先，通过深入的财务分析对公司状况及经营能力进行细致考察，探究企业竞争优势和经营绩效间的内在模式，寻找财务状况良好、信用评价高的企业，并为后续的估值判断提供基础（具体指标包括公司ROE和调整后ROE，ROE历史变化率和ROE预测变化率，营业利润/税前利润；利息保障倍数，经营现金流/净利润，折旧/资本支出等）。

其次，本基金通过企业的全球化动力、产业结构优化动力、经济增长方式转变动力、区域协调发展动力和制度变革动力等多个角度的分析，进一步考察企业的可持续增长能力。

此外，本基金在考察上市公司是否具有持续投资价值的重要方面，特别注重公司治理和管理层评价，通过研究员与公司的直接接触和实地调研加强对公司的深入了解，从而确定公司是否有意愿持续为股东创造价值，董事会和管理层是否有良好的战略执行能力等。其中公司治理主要从公司的信息披露、重要股东状况、激励约束机制等方面进行综合考察。管理层评价则注重管理层素质、战略思维、执行能力、过往经营业绩等。

#### ■ 估值水平

股票估值水平的高低将最终决定投资回报率的高低。由于驱动公司价值创造的因素不同，本基金将借鉴市场通用估值理念，针对不同类型公司以及公司发展中所处的不同阶段，采用不同的价值评估指标（如PE、PB、EV/EBITDA、DCF模型等）对公司的内在价值进行评估，筛选出估值具有吸引力的公司作为投资目标。

最后，本基金根据对个股价值的评估和市场机会的判断构建股票组合。

#### （3）存托凭证的投资策略

本基金投资存托凭证的策略依照境内上市交易的股票投资策略执行。

#### （4）港股通标的股票投资策略

本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场。本基金优先将基本面健康、业绩向上弹性较大、具有估值优势的港股纳入本基金的股票投资组合。

本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股，基金资产并非必然投资港股。

### 3、债券投资

本基金的债券投资采取主动的投资管理方式，获得与风险相匹配的投资收益，以实现在一定程度上规避股票市场的系统性风险和保证基金资产的流动性。

在全球经济的框架下，本基金管理人对宏观经济运行趋势及其引致的财政货币政策变化作出判断，运用数量化工具，对未来市场利率趋势及市场信用环境变化作出预测，并综合考虑利率变化对不同债券品种的影响、收益率水平、信用风险的大小、流动性的好坏等因素，构造债券组合。在具体操作中，本基金运用久期控制策略、期限结构配置策略、类属配置策略、骑乘策略、杠杆放大策略和换券等多种策略，以期获取债券市场的长期稳定收益。

#### 4、可转换债券与可交换公司债券投资策略



本基金对于可转换债券与可交换公司债券股性的研究将完全依托于公司投研团队对标的股票的研究，在此基础上利用可转换债券与可交换公司债券定价模型，充分考虑转债发行后目标转债标的股票股价波动率可能出现的变化，对目标转债的股性进行合理定价。通过对标的转债股性与债性的合理定价，力求寻找出被市场低估的品种，构建本基金可转换债券与可交换公司债券的投资组合。

#### 5、资产支持证券投资

本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后的收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

#### 6、股指期货投资

本基金参与股指期货投资将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的。本基金将在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

基金管理人针对股指期货交易制订严格的授权管理制度和投资决策流程，确保研究分析、投资决策、交易执行及风险控制各环节的独立运作，并明确相关岗位职责。此外，基金管理人建立股指期货交易决策部门或小组，并授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项。

### (七) 投资组合限制

本基金的投资组合应遵循以下限制：

(1) 股票资产（含存托凭证）占基金资产的50%-95%（其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的0%-50%），投资于先进制造主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的80%；

(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，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（同一家公司在内地和香港同时上市的A+H股合计计算），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（同一家公司在

内地和香港同时上市的A+H股合计计算),不超过该证券的10%,完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金品种可以不受此条款规定的比例限制;

(5) 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%;完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述比例限制;

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

(7) 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;

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

(9) 本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的20%;

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

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

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

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

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

(15) 当本基金投资股指期货时,则:

1) 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%;

2) 本基金在任何交易日日终,持有的买入股指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)、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等;

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

4) 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;

5) 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%;

(16) 本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的140%;

(17) 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;

(18) 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)项、第(6)项、第(7)项、第(12)项以外,因证券、期货市场波动、证券发行人合并或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约定。在上述期间内,本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

法律法规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。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。

#### (八) 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。

若法律、行政法规或监管部门取消上述禁止性规定，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，本基金投资可不受上述规定限制。

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

如法律、行政法规或监管部门取消上述规定，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，本基金可不受上述规定的限制

#### **(十) 风险收益特征**

本基金是一只混合型基金，其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。

本基金可投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

#### **(十一) 基金管理人代表基金行使股东及债权人权利的处理原则及方法**

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

#### **(十二) 投资决策依据和投资流程**

- 1、投资决策依据
  - (1) 国家有关法律法规和基金合同的有关规定；
  - (2) 公司投资及风险控制政策；

(3) 宏观经济发展态势、证券市场运行环境和走势，以及上市公司的基本  
面；

(4) 投资对象的预期收益和预期风险的匹配关系，本基金将在承担适度风险  
的范围内，选择收益风险配比最佳的品种进行投资。

## 2、投资决策机制

本基金采用投资决策委员会领导下的基金经理负责制。投资决策委员会的主要  
职责是对基金的资产配置提出指导性意见，审批重大单项投资决定，审视投资组合  
风险状况等。投资总监是投资决策委员会的执行代表。

基金经理的主要职责是在投资决策委员会确定的资产配置范围内构建和调整投  
资组合，并向中央交易室下达投资指令。

中央交易室负责交易执行和一线监控。通过严格的交易制度和实时的一线监控  
功能，保证基金经理的投资指令在合法、合规的前提下得到高效的执行。

## 3、投资管理流程

投资决策委员会是本基金的最高决策机构，投资决策委员会定期就投资管理业  
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  
的投资管理程序如下：

(1) 研究部宏观分析师、策略分析师、行业分析师、信用分析师、数量分析  
师各自独立完成相应的研究报告，为投资决策提供依据；

(2) 投资决策委员会每月召开投资决策会议，对资产配置比例提出指导性意  
见，并讨论股票、债券的投资重点等；

(3) 基金经理根据投资决策委员会决议，依据宏观分析师、策略分析师的宏  
观经济分析和策略建议、行业分析师的行业分析和个股研究、信用分析师的债券市  
场研究和券种选择、数量分析师的定量投资策略研究，结合本基金产品定位及风险  
控制的要求，在权限范围内制定具体的投资组合方案；

(4) 基金经理根据基金投资组合方案，向中央交易室下达交易指令；

(5) 交易指令通过风控系统的自动合规核查后，由中央交易室执行，中央交  
易室对交易情况及时反馈；

(6) 基金经理对每日交易执行情况进行回顾，并审视基金投资组合的变动情  
况；



(7) 风险管理部定期完成有关投资风险监控报告, 量化投资部定期完成基金业绩评估报告。

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作出调整。

### (十三) 侧袋机制的实施和投资运作安排

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

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

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

### (十四) 基金投资组合报告

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。

本基金托管人中国农业银行根据本基金合同规定, 于2023年04月20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。

本报告期为2023年01月01日起至03月31日止。本报告财务资料未经审计师审计。

#### 1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	8,050,312,512.05	87.67
	其中: 股票	8,050,312,512.05	87.67
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	493,759,982.84	5.38
	其中: 债券	493,759,982.84	5.38
	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	605,896,675.54	6.60
8	其他资产	32,242,152.38	0.35
9	合计	9,182,211,322.81	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通机制投资香港股票的公允价值为448,192,018.75元，占基金资产净值比例为4.94%。

## 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	-	-
C	制造业	5,686,894,441.42	62.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,624,722.80	0.11
E	建筑业	18,207,549.12	0.20
F	批发和零售业	444,832.76	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	552,423,993.16	6.09
H	住宿和餐饮业	259,679,066.16	2.86
I	信息传输、软件和信息技术服务业	335,288,499.57	3.69
J	金融业	-	-
K	房地产业	739,349,940.33	8.15
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	30,449.85	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	103,469.59	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	73,528.54	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	7,602,120,493.30	83.76

### 2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
房地产	192,155,856.58	2.12
通信服务	166,468,683.44	1.83
工业	88,470,804.48	0.97
可选消费	1,096,674.25	0.01
合计	448,192,018.75	4.94

注：本报告采用中证CICS一级分类标准编制。

### 3、期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002049	紫光国微	7,842,628	871,551,249.64	9.60
2	000733	振华科技	9,048,959	814,949,247.54	8.98
3	300408	三环集团	13,709,802	412,665,040.20	4.55
4	002928	华夏航空	33,186,412	386,289,835.68	4.26
5	300750	宁德时代	882,226	358,227,867.30	3.95
6	600048	保利发展	25,328,445	357,890,927.85	3.94
7	688033	天宜上佳	15,893,284	323,829,307.74	3.57
8	600875	东方电气	9,983,366	189,284,619.36	2.09
8	01072 HK	东方电气	7,970,200	88,470,804.48	0.97
9	688639	华恒生物	1,565,005	264,970,996.55	2.92
10	600258	首旅酒店	11,125,924	259,679,066.16	2.86

### 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	493,759,982.84	5.44
	其中：政策性金融债	493,759,982.84	5.44
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-



10	合计	493,759,982.84	5.44
----	----	----------------	------

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	230201	23国开01	1,400,000	140,260,262.30	1.55
2	220308	22进出08	1,000,000	100,458,356.16	1.11
3	220206	22国开06	900,000	91,376,358.90	1.01
4	220404	22农发04	900,000	91,264,068.49	1.01
5	220411	22农发11	700,000	70,400,936.99	0.78

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

无。

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

无。

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

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

无。

9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

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

无。

10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

10.3 本期国债期货投资评价

无。

11、投资组合报告附注

11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期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被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

#### 11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规定的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	1,796,344.75
2	应收证券清算款	22,396,519.28
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	8,049,288.35
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	32,242,152.38

11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细  
无。

#### 11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	688033	天宜上佳	23,966,832.75	0.26	限售股

#### 11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## 十一、基金的业绩

基金业绩截止日为2023年03月31日，所载财务数据未经审计师审计。

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，投资人在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

下述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 1、基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

#### (1) 交银先进制造混合A

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	-4.33%	0.84%	3.13%	0.52%	-7.46%	0.32%
2022年度	-14.70%	1.36%	-12.04%	0.78%	-2.66%	0.58%
2021年度	37.48%	1.28%	-0.76%	0.70%	38.24%	0.58%
2020年度	75.57%	1.53%	17.63%	0.85%	57.94%	0.68%
2019年度	60.01%	1.25%	23.09%	0.74%	36.92%	0.51%
2018年度	-20.09%	1.37%	-15.15%	0.88%	-4.94%	0.49%
2017年度	15.69%	0.85%	-4.28%	0.70%	19.97%	0.15%
2016年度	2.59%	1.71%	-12.87%	1.46%	15.46%	0.25%
2015年度	100.68%	2.77%	46.73%	2.13%	53.95%	0.64%
2014年度	14.05%	1.08%	28.79%	0.97%	-14.74%	0.11%
2013年度	33.76%	1.31%	20.83%	1.15%	12.93%	0.16%
2012年度	3.11%	1.11%	-2.54%	1.13%	5.65%	-0.02%
2011年度 (自基金合 同生效日起 至2011年 12月31 日)	-16.40%	0.71%	-17.21%	1.20%	0.81%	-0.49%

#### (2) 交银先进制造混合C

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	-4.42%	0.84%	3.13%	0.52%	-7.55%	0.32%

2022年度 (2022年1月25日至 2022年12月31日)	-8.18%	1.36%	-10.63%	0.80%	2.45%	0.56%
--	--------	-------	---------	-------	-------	-------

注：1、本基金业绩比较基准自2015年10月1日起，由“75%×申银万国装备制造指数收益率+25%×中信标普全债指数收益率”变更为“75%×申银万国装备制造指数收益率+25%×中证综合债券指数收益率”。详情见本基金管理人于2015年9月28日发布的《交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金业绩比较基准变更并修改基金合同相关内容的公告》。 2、本基金业绩比较基准自2018年3月21日起，由“75%×申银万国装备制造指数收益率+25%×中证综合债券指数收益率”变更为“60%×沪深300指数收益率+40%×中证综合债券指数收益率”。详情见本基金管理人于2018年3月21日发布的《交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德先进制造混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。 3、本基金业绩比较基准自2022年1月24日起，由“60%×沪深300指数收益率+40%×中证综合债券指数收益率”变更为“沪深300指数收益率×55%+恒生指数收益率×5%+中证综合债券指数收益率×40%”。详情见本基金管理人于2022年1月24日发布的《交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德先进制造混合型证券投资基金基金份额持有人大会（二次召开）表决结果暨决议生效的公告》。

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

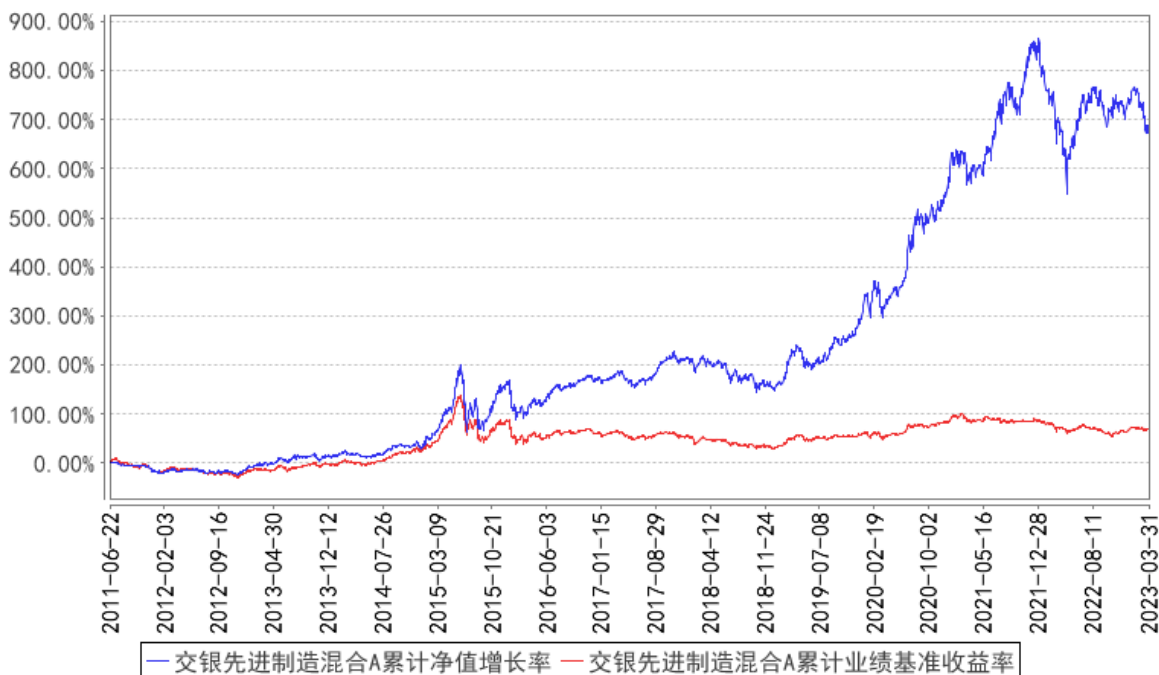
### 交银施罗德先进制造混合型证券投资基金

#### 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2011年6月22日至2023年03月31日)

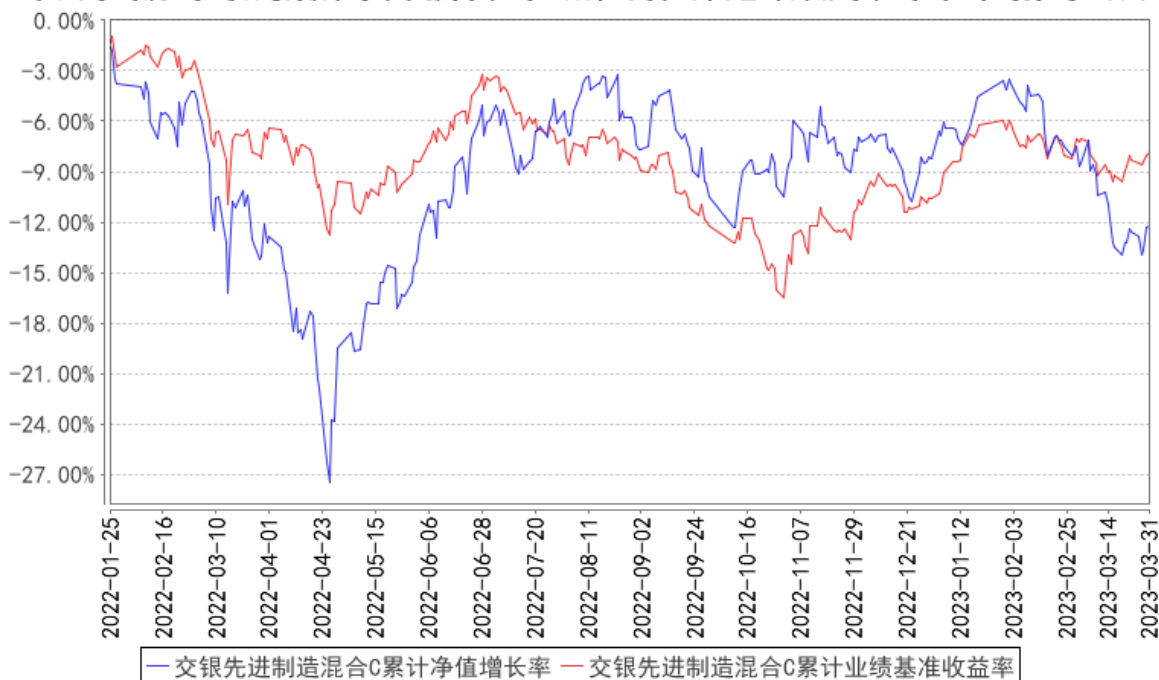
(1) 交银先进制造混合A

交银先进制造混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



(2) 交银先进制造混合C

交银先进制造混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

2、本基金自2022年1月24日起，开始销售C类份额，投资者提交的申购申请于2022年1月25日被确认并将有效份额登记在册。

## 十二、基金的财产

### (一) 基金资产总值

基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券、股指期货合约、银行存款本息、基金应收款项以及其他资产的价值总和。

### (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金额。

### (三) 基金财产的账户

本基金财产以基金名义开立银行存款账户，以基金托管人的名义开立证券交易清算资金的结算备付金账户，以基金托管人和本基金联名的方式开立基金证券账户，以本基金的名义开立银行间债券托管账户，基金托管人协助开立股指期货业务相关账户及交易编码。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和注册登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

### (四) 基金财产的处分

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固有财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益归入基金财产。基金管理人、基金托管人可以按基金合同的约定收取管理费、托管费以及基金合同约定的其他费用。基金管理人、基金托管人以其自有财产承担法律责任，其债权人不得对基金财产行使请求冻结、扣押和其他权利。

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

基金财产的债权，不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债务相抵销；不同基金财产的债权债务，不得相互抵销。

除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定处分外，基金财产不得被处分。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。



## 十三、基金资产的估值

### (一) 估值目的

基金资产的估值目的是客观、准确地反映基金资产是否保值、增值，并为基金份额提供计价依据。

### (二) 估值日

本基金的估值日为相关的证券/期货交易场所的正常交易日，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。

### (三) 估值对象

基金所拥有的股票、债券、衍生工具和其它投资等持续以公允价值计量的金融资产及负债。

### (四) 估值原则

基金管理人在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，应符合《企业会计准则》、监管部门有关规定。

1、对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会计准则规定的例外情况外，应将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

2、对不存在活跃市场的投资品种，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

3、如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上的，应对估值进行



调整并确定公允价值。

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

(2) 交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(另有规定的除外), 选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值;

(3) 交易所上市交易的可转换债券, 按估值日收盘价减去可转换债券收盘价中所含债券(税后)应收利息后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可转换债券收盘价中所含债券(税后)应收利息后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) 交易所上市实行全价交易的债券(可转债除外), 选取第三方估值机构提供的估值全价减去估值全价中所含的债券(税后)应收利息得到的净价进行估值;

(5) 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。交易所市场挂牌转让的资产支持证券, 采用估值技术确定公允价值;

(6) 对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券, 对存在活跃市场的情况下, 应以活跃市场上未经调整的报价作为估值日的公允价值; 对于活跃市场报价未能代表估值日公允价值的情况下, 应对市场报价进行调整以确认估值日的公允价值; 对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下, 应采用估值技术确定其公允价值。

### 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和债券, 采用估值技术确定公允价值, 在估

值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

(3) 在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3、对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种，回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异，未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。

4、本基金投资股指期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

5、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。

估值计算中涉及港币对人民币汇率的，将依据下列信息提供机构所提供的汇率为基准：当日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价。

税收：对于按照中国法律法规和基金投资境内外股票市场交易互联互通机制涉及的境外交易场所所在地的法律法规规定应交纳的各项税金，本基金将按权责发生制原则进行估值；对于因税收规定调整或其他原因导致基金实际交纳税金与估算的应交税金有差异的，基金将在相关税金调整日或实际支付日进行相应的估值调整。

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。

7、本基金投资存托凭证的估值核算依照境内上市交易的股票执行。

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、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。

#### （六）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。基金管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制，具体可参见相关公告。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基金份额净值，并按规定公告。如遇特殊情况，经履行适当程序，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，由基金管理人依据基金合同和相关法律法规的规定对外公布。

#### （七）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。

对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平无法预见、无法避免、无法抗拒，则属不可抗力，按照下述规定执行。

由于不可抗力原因造成投资人的交易资料灭失或被错误处理或造成其他错误等，因不可抗力原因出现估值错误的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该估值错误取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

## 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。

(5) 按法律法规规定的其他原则处理估值错误。

## 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

(3) 根据估值错误处理原则或当事人协商的方法由估值错误的责任方进行更

正和赔偿损失;

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

4、基金份额净值估值错误处理的方法如下:

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

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

(3) 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。

#### (八) 暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;

2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时;

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

4、法律法规、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

#### (九) 基金净值的确认

基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算, 基金托管人负责进行复核。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, 由基金管理人依据基金合同和相关法律法规的规定对基金净值予以公布。

#### (十) 特殊情形的处理

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, 所造成的误差不得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、期货交易所、证券经纪机构、期货公司及登记结算公司发送的数据错误, 或国家会计政策变更、市场规则变更等, 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而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、基金托管人应积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

### (十一) 实施侧袋机制期间的基金资产估值

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



## 十四、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

本基金收益分配应遵循下列原则：

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

2、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

3、基金收益分配后任一类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的任一类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，基金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，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金份额持有人可对其持有的A类基金份额和C类基金份额分别选择不同的收益分配方式；

5、法律法规或监管机构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基金收益分配基准日可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

### (五) 收益分配方案的确定、公告与实施

1、本基金收益分配方案由基金管理人拟定、由基金托管人核实后确定，依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

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（依据具体方案的规定），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）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，注册登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为相应类别的基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。

#### **（七）收益分配方式的修改**

投资者可至销售机构办理收益分配方式的修改，投资者对不同的交易账户可设置不同的收益分配方式。

投资者同一日多次申报分红方式变更的，按照《业务规则》执行，最终确认的分红方式以基金注册登记机构记录为准。

#### **（八）实施侧袋机制期间的收益分配**

本基金实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配。

## 十五、基金的费用与税收

### (一) 基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金合同生效后的信息披露费用；
- 4、基金份额持有人大会费用；
- 5、基金合同生效后与基金有关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；
- 6、基金的证券/期货交易费用；
- 7、基金财产划拨支付的银行费用；
- 8、基金财产投资运营过程中的增值税；
- 9、基金的开户费用、账户维护费用；
- 10、因投资港股通标的股票而产生的各项合理费用；
- 11、本基金从C类基金份额的基金财产中计提的销售服务费；
- 12、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、与基金运作有关的费用

##### (1) 基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$ ，本基金年管理费率为1.5%

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

##### (2) 基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$ ，本基金年托管费率为0.25%

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起3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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

### (3) C类基金份额的销售服务费

本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金资产净值的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

C类基金份额销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起3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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

C类基金份额的销售服务费将专门用于本基金的市场推广、销售与基金份额持有人服务。

(4) 上述“（一）基金费用的种类”中3到10项、第12项费用由基金托管人根据其他有关法律法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

## 2、与基金销售有关的费用

### (1) 申购费

本基金申购费的费率水平、计算公式和收取方式详见“基金份额的申购与赎回”一章。

### (2) 赎回费

本基金赎回费的费率水平、计算公式和收取方式详见“基金份额的申购与赎回”一章。

### (3) 转换费

本基金转换费的费率水平、计算公式和收取方式详见“基金的转换”一章。

### **(三) 不列入基金费用的项目**

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金募集期间所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

### **(四) 实施侧袋机制期间的基金费用**

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

### **(五) 基金税收**

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。基金需缴纳的增值税，以基金管理人为纳税人，按照税务机关的要求进行核算，从基金财产中支付。

## 十六、基金的会计与审计

### (一) 基金会计政策

- 1、基金管理人为本基金的会计责任方；
- 2、本基金的会计年度为公历每年的1月1日至12月31日；
- 3、本基金的会计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的会计制度；
- 5、本基金独立建账、独立核算；
- 6、基金管理人及基金托管人分别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、基金托管人定期与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并书面确认。

### (二) 基金的审计

- 1、基金管理人聘请符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所及其注册会计师对本基金年度财务报表及其他规定事项进行审计。会计师事务所及其注册会计师与基金管理人、基金托管人相互独立。
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师时，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》的有关规定在规定媒介公告。

## 十七、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符合中国证监会规定条件的全国性报刊(以下简称“规定报刊”)及《信息披露办法》规定的互联网网站(以下简称“规定网站”)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在承诺公开披露的基金信息时,不得有下列行为:

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

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

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字;除特别说明外,货币单位为人民币元。

(五) 公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括:

- 1、招募说明书、基金合同、托管协议、基金产品资料概要

基金经中国证监会准予变更注册后,基金管理人根据《信息披露办法》的规定将招募说明书、基金合同登载在规定网站上;基金管理人、基金托管人应当将基金合同、托管协议登载在网站上。

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

## 2、基金份额申购、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。

## 3、基金净值信息

《基金合同》生效后,在开始办理基金份额申购或者赎回前,基金管理人应当至少每周在规定网站分别披露一次A类基金份额和C类基金份额所对应的基金份额净值和基金份额累计净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回后,基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日,通过规定网站、销售机构网站或者营业网点分别披露开放日的A类基金份额



和C类基金份额所对应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，在规定网站披露半年度和年度最后一日A类基金份额和C类基金份额所对应的基金份额净值和基金份额累计净值。

#### 4、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，将年度报告登载在规定网站上，并将年度报告提示性公告登载在规定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过符合《中华人民共和国证券法》规定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，将中期报告登载在规定网站上，并将中期报告提示性公告登载在规定报刊上。

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，将季度报告登载在规定网站上，并将季度报告提示性公告登载在规定报刊上。

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有风险，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。

#### 5、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，并登载在规定报刊和规定网站上。

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

- (1) 基金份额持有人大会的召开及决定的事项；
- (2) 《基金合同》终止、基金清算；
- (3) 转换基金运作方式、基金合并；
- (4) 更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；
- (5) 基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等

事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；

(6) 基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；

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

(8) 基金募集期延长或提前结束募集；

(9) 基金管理人的高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；

(10) 基金管理人的董事在最近12个月内变更超过百分之五十，基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近12个月内变动超过百分之三十；

(11) 涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁；

(12) 基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；

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

(14) 基金收益分配事项；

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

(16) 任一类基金份额净值计价错误达该类基金份额净值百分之零点五；

(17) 本基金开始办理申购、赎回；

(18) 本基金发生巨额赎回并延期办理；

(19) 本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；

(20) 本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；

(21) 本基金采用摆动定价机制进行估值；

(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时；

(23) 基金推出新业务或服务

(24) 本基金连续30个工作日、40个工作日、45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;

(25) 基金信息披露义务人认为可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的其他事项或中国证监会规定的其他事项。

#### 6、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。

#### 7、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。

基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会,基金管理人、基金托管人对基金份额持有人大会决定的事项不依法履行信息披露义务的,召集人应当履行相关信息披露义务。

#### 8、实施侧袋机制期间的信息披露

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

#### 9、清算报告

基金合同终止的,基金管理人应当依法组织清算小组对基金财产进行清算并作出清算报告。清算报告应当经过符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计,并由律师事务所出具法律意见书。清算小组应当将清算报告登载在规定网站上,并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

#### 10、基金投资股指期货情况

本基金可投资股指期货,基金管理人需按照法规要求在季度报告、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。

#### 11、基金投资资产支持证券情况

本基金可投资资产支持证券,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末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。

#### 12、基金投资流通受限证券情况

本基金可投资流通受限证券，基金管理人应在基金投资非公开发行股票后两个交易日内，在中国证监会规定媒介披露所投资非公开发行股票的名称、数量、总成本、账面价值，以及总成本和账面价值占基金资产净值的比例、锁定期等信息。

#### 13、基金投资港股通标的股票情况

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）等文件中披露港股通标的股票的投资情况。法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定。

#### 14、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规规定。

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

基金管理人、基金托管人应当在规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规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规定媒介披露信息，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办公场所，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。

## 十八、侧袋机制

### (一) 侧袋机制的实施条件

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

基金管理人应当在启用侧袋机制后及时发布临时公告，并在五个工作日内聘请侧袋机制启用日发表意见且符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所进行审计并披露专项审计意见。

### (二) 实施侧袋机制期间基金份额的申购与赎回

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

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

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

### (三) 实施侧袋机制期间的基金投资

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

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

基金管理人不得在侧袋账户中进行除特定资产处置变现以外的其他投资操作。

### (四) 实施侧袋机制期间的基金估值

本基金实施侧袋机制的，基金管理人和基金托管人应对主袋账户资产进行估值



并披露主袋账户的基金净值信息，暂停披露侧袋账户份额净值。侧袋账户的会计核算应符合《企业会计准则》的相关要求。

#### **(五) 实施侧袋账户期间的基金费用**

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

2、与侧袋账户有关的费用可从侧袋账户中列支，但应待侧袋账户资产变现后方可列支，有关费用可酌情收取或减免，但不得收取管理费。

#### **(六) 侧袋账户中特定资产的处置变现和支付**

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

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

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

#### **(七) 侧袋机制的信息披露**

##### **1、临时公告**

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

##### **2、基金净值信息**

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

##### **3、定期报告**

侧袋机制实施期间，基金管理人应当在基金定期报告中披露报告期内侧袋账户相关信息，基金定期报告中的基金会计报表仅需针对主袋账户进行编制。会计师事务所对基金年度报告进行审计时，应对报告期内基金侧袋机制运行相关的会计核算和年度报告披露等发表审计意见。





## 十九、风险揭示

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

基金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，即当单个开放日基金的净赎回申请（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百分之十时，投资者将可能无法及时赎回持有的全部基金份额。

基金分为股票型基金、混合型基金、债券型基金、货币市场基金等不同类型，投资者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，投资者承担的风险也越大。

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

投资者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者进行长期投资、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，不能保证投资者获得收益，也不是替代储蓄的等效理财方式。

因拆分、分红等行为导致基金份额净值变化，不会改变基金的风险收益特征，不会降低基金投资风险或提高基金投资收益。以1元初始面值开展基金募集或因拆分、分红等行为导致基金份额净值调整至1元初始面值或1元附近，在市场波动等因素的影响下，基金投资仍有可能出现亏损或基金净值仍有可能低于初始面值。

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者基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负

担。

基金份额持有人须了解并承受以下风险：

### （一）市场风险

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引起的波动，将对基金收益水平产生潜在风险，主要包括：

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

2、经济周期风险。证券市场受宏观经济运行的影响，而经济运行具有周期性的特点，宏观经济运行状况将对证券市场的收益水平产生影响，从而对基金收益造成影响。

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。基金投资于债券和债券回购，其收益水平会受到利率变化和货币市场供求状况的影响。

4、上市公司经营风险。上市公司的经营状况受多种因素影响，如管理能力、财务状况、市场前景、行业竞争、人员素质等，这些都会导致企业的盈利发生变化。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。虽然基金可以通过投资多样化来分散这种非系统风险，但不能完全规避。

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，从而使基金的实际收益下降，影响基金资产的保值增值。

### （二）管理风险

在基金管理运作过程中基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的占有和对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平。因此，本基金的收益水平与基金管理人的管理水平、管理手段和管理技术等相关性较大，本基金可能因为基金管理人的因素而影响基金收益水平。

### （三）流动性风险

本基金属于开放式基金，在基金的所有开放日，基金管理人都有义务接受投资者的赎回。如果基金资产不能迅速转变成现金，或者变现为现金时使资金净值产生不利的影响，都会影响基金运作和收益水平。尤其是在发生巨额赎回时，如果基金

资产变现能力差,可能会产生基金仓位调整的困难,导致流动性风险,可能影响基金份额净值。

### 1、本基金的申购、赎回安排

本基金采用开放方式运作,基金管理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(若该工作日为非港股通交易日,则本基金可不开放),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。

### 2、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、港股通标的股票、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。

### 3、巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过前一工作日的基金总份额的10%,即认为是发生了巨额赎回。

#### (1) 巨额赎回的场外处理方式

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基金投资者的赎回申请时,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基金投资者的赎回申请有困难或认为支付投资者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工作日基金总份额的10%的前提下,对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请,应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例,确定当日受理的赎回份额;基金投资者未能赎回部分,投资者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,当日未获赎回的部分申请将被撤销。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

开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，并以此类推，直到全部赎回为止。如基金投资者在提交赎回申请时未作明确选择，投资者未能赎回部分作自动延期赎回处理。

本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一日基金总份额20%的情形下，基金管理人有权采取如下措施：对于基金份额持有人当日超过20%的赎回申请，可以对其赎回申请延期办理；对于基金份额持有人未超过上述比例的部分，基金管理人可以根据前段“1) 全额赎回”或“2) 部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。但是，如该类基金份额持有人在当日选择取消赎回，则其当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。

#### (2) 巨额赎回的场内处理方式

巨额赎回业务的场内处理，按照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规定办理。

(3) 暂停赎回：连续2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；已经确认成功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，并应当在规定媒介上进行公告。

#### 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、摆动定价、暂停基金估值、实施侧袋机制等，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。

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



大幅低于启用侧袋机制时的特定资产的估值，基金份额持有人可能因此面临损失。

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

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

启用侧袋机制后，基金管理人计算各项投资运作指标和基金业绩指标时仅需考虑主袋账户资产，基金业绩指标应当以主袋账户资产为基准，因此本基金披露的业绩指标不能反映特定资产的真实价值及变化情况。

#### （四）信用风险

基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，都可能导致基金资产损失和收益变化，从而产生风险。

#### （五）本基金投资策略所特有的风险

1、本基金属于混合型基金，将维持较高的股票持仓比例。如果股票市场出现整体下跌，本基金的净值表现将受到影响。

2、本基金以先进制造相关行业的上市公司为重点投资对象。在选股策略上本基金特有的风险主要来自两个方面：一是先进制造有关行业板块的表现可能与市场整体表现出现偏差，从而直接影响本基金的业绩表现；二是对上市公司的基本面研究是否准确、深入，对股票的优选和判断是否科学、准确。基本面研究及上市企业分析的错误均可能导致所选择的证券不能完全符合本基金的预期目标。

3、本基金可投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，具体如下：

##### （1）港股交易失败风险

港股通业务目前存在每日额度。在香港联合交易所开市前阶段，当日额度使用完毕的，新增的买单申报将面临失败的风险；在香港联合交易所持续交易时段，当日额度使用完毕的，当日本基金将面临不能通过港股通进行买入交易的风险。

##### （2）汇率风险

本基金将投资港股通标的股票，在交易时间内提交订单依据的港币买入参考汇率和卖出参考汇率，并不等于最终结算汇率。港股通交易日日终，中国证券登记结

算有限责任公司进行净额换汇，将换汇成本按成交金额分摊至每笔交易，确定交易实际适用的结算汇率。

本基金以人民币募集和计价，港币相对于人民币的汇率变化将会影响本基金以人民币计价的基金资产价值，从而导致基金资产面临潜在风险。人民币对港币的汇率的波动也可能加大基金净值的波动，从而对基金业绩产生影响。故本基金投资面临汇率风险，汇率波动可能对基金的投资收益造成损失。

### (3) 境外市场的风险

1) 本基金将通过港股通投资于香港市场，在市场进入、投资额度、可投资对象、税务政策等方面都有一定的限制，而且此类限制可能会不断调整，这些限制因素的变化可能对本基金进入或退出当地市场造成障碍，从而对投资收益以及正常的申购赎回产生直接或间接的影响。

2) 香港市场交易规则有别于内地A股市场规则，此外，在“内地与香港股票市场交易互联互通机制”下参与香港股票投资还将面临包括但不限于如下特殊风险：

a) 香港市场实行T+0 回转交易机制（即当日买入的股票，在交收前可以于当日卖出），且证券交易价格并无涨跌幅上下限的规定，因此每日涨跌幅空间相对较大，可能表现出比A股更为剧烈的股价波动；

b) 只有沪港深三地均为交易日且能够满足结算安排的交易日才为港股通交易日，存在港股通交易日不连贯的情形（如内地市场因放假等原因休市而香港市场照常交易或内地市场开市香港市场休市但港股通不能如常进行交易），而导致港股不能及时卖出带来一定的流动性风险；以及基金所持的港股组合在后续港股通交易日开市交易中集中体现市场反应而造成其价格波动骤然增大，进而导致本基金所持港股组合在资产估值上出现波动增大的风险；

c) 香港出现台风、黑色暴雨或者香港联合交易所规定的其他情形时，香港联合交易所将可能停市，投资者将面临在停市期间无法进行港股通交易的风险；出现上海证券交易所及深圳证券交易所证券交易服务公司认定的交易异常情况时，上海证券交易所及深圳证券交易所证券交易服务公司可能暂停提供部分或者全部港股通服务，投资者将面临在暂停服务期间无法进行港股通交易的风险；

d) 投资者因港股通股票权益分派、转换、上市公司被收购等情形或者异常情况，所取得的港股通股票以外的香港联合交易所上市证券，只能通过港股通卖出，



但不得买入，上海证券交易所及深圳证券交易所另有规定的除外；因港股通股票发行人供股、港股通股票权益分派或者转换等情形取得的香港联合交易所上市股票的认购权利凭证在香港联合交易所上市的，可以通过港股通卖出，但不得买入，其行权等事宜按照中国证监会、中国证券登记结算有限责任公司的相关规定处理；因港股通股票权益分派、转换或者上市公司被收购等所取得的非香港联合交易所上市证券，不得通过港股通买入或卖出；

e) 代理投票。由于中国证券登记结算有限责任公司是在汇总投资者意愿后再向香港中央结算有限公司提交投票意愿，中国证券登记结算有限责任公司对投资者设定的意愿征集期比香港中央结算有限公司的征集期稍早结束；投票没有权益登记日的，以投票截止日的持有作为计算基准；投票数量超出持有数量的，按照比例分配持有基数。

(4) 本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股，基金资产并非必然投资港股。

以上所述因素可能会给本基金投资带来特殊交易风险。

4、基金合同提前终止风险。连续50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，基金合同终止，不需召开基金份额持有人大会。

5、本基金可投资创业板股票，创业板个股上市后的前五个交易日不设价格涨跌幅限制，第六个交易日开始涨跌幅限制比例为20%。

#### **(六) 投资资产支持证券的特定风险**

资产支持证券具有一定的价格波动风险、流动性风险、信用风险等风险，基金管理人将本着谨慎和控制风险的原则进行资产支持证券投资，请基金份额持有人关注包括投资资产支持证券可能导致的基金净值波动在内的各项风险。

#### **(七) 投资股指期货的特定风险**

本基金可投资于股指期货，股指期货作为一种金融衍生品，其价值取决于一种或多种基础资产或指数，其评价主要源自于对挂钩资产的价格与价格波动的预期。投资股指期货所面临的风险主要是市场风险、流动性风险、基差风险、保证金风险、信用风险和操作风险。具体为：

(1) 市场风险是指由于股指期货价格变动而给投资者带来的风险。市场风险

是股指期货投资中最主要的风险。

(2) 流动性风险是指由于股指期货合约无法及时变现所带来的风险。

(3) 基差风险是指股指期货合约价格和指数价格之间的价格差的波动所造成的风险,以及不同股指期货合约价格之间价格差的波动所造成的期现价差风险。

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

(5) 信用风险是指期货经纪公司违约而产生损失的风险。

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

此外,由于衍生品通常具有杠杆效应,价格波动比标的工具更为剧烈,并且其定价相当复杂,不适当的估值也有可能使基金资产面临损失风险。

#### **(八) 投资流通受限证券的特定风险**

基金投资流动受限证券将面临证券市场流动性风险,主要表现在几个方面:基金建仓困难,或建仓成本很高;基金资产不能迅速转变成现金,或变现成本很高;不能应付可能出现的投资者大额赎回的风险;证券投资中个券和个股的流动性风险等。

#### **(九) 投资科创板股票的特定风险**

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。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、退市风险、集中度风险、系统性风险、政策风险等。

##### **(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) 退市风险

科创板退市制度较主板更为严格，退市时间更短，退市速度更快；退市情形更多，新增市值低于规定标准、上市公司信息披露或者规范运作存在重大缺陷导致退市的情形；执行标准更严，明显丧失持续经营能力，仅依赖与主业无关的贸易或者不具备商业实质的关联交易维持收入的上市公司可能会被退市；且不再设置暂停上市、恢复上市和重新上市环节，上市公司退市风险更大。

### (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。

## (十) 投资存托凭证的特定风险

本基金可投资国内依法发行上市的存托凭证，基金净值可能受到存托凭证的境外基础证券价格波动影响，与存托凭证的境外基础证券、境外基础证券的发行人及境内外交易机制相关的风险可能直接或间接成为本基金风险。

具体风险包括：存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险；存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险；存托协议自动约束存托凭证持有人的风险；因多地上市造成存托凭证价格差异以及波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；存托凭证退市的风险；已在境外上市的基础证券发行人，在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险；境内外法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险。

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存

托凭证或选择不将基金资产投资于存托凭证，基金资产并非必然投资存托凭证。

### (十一) 其他风险

- 1、因技术因素而产生的风险，如电脑系统不可靠产生的风险；
- 2、因基金业务快速发展，在制度建设、人员配备、内控制度建立等方面的不完善产生的风险；
- 3、因人为因素而产生的风险、如内幕交易、欺诈行为等产生的风险；
- 4、对主要业务人员如基金经理的依赖而可能产生的风险；
- 5、因业务竞争压力可能产生的风险；
- 6、战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金财产的损失，影响基金收益水平，从而带来风险；
- 7、其他意外导致的风险。

## 二十、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. 按照法律法规或基金合同的规定，对基金合同的变更应当召开基金份额持有人大会的，基金合同变更的内容经基金份额持有人大会决议通过后生效，并依法报中国证监会备案，并自决议生效之日起2日内在规定媒介公告。

2. 但出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会决议，由基金管理人和基金托管人同意变更后公布经修订的基金合同，并报中国证监会备案：

(1) 在法律法规和基金合同规定的范围内调整基金的申购费率、调低赎回费率及销售服务费率、变更或增加收费方式；

(2) 因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；

(3) 基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生重大变化；

(4) 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；

(5) 按照法律法规或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) 基金合同的终止

有下列情形之一的，基金合同应当终止：

1、基金份额持有人大会决定终止的；

2、基金管理人职责终止，而在6个月内没有新的基金管理人承接的；

3、基金托管人职责终止，而在6个月内没有新的基金托管人承接的；

4、连续50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，基金合同终止，不需召开基金份额持有人大会；

5、基金合同、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

(1) 自出现《基金合同》终止事由之日起30个工作日内，成立基金清算小组，基金清算小组在中国证监会的监督下进行基金清算。

(2) 基金清算小组成员由基金管理人、基金托管人、符合《中华人民共和国证券法》规定的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金清算小组可以聘用必要的工作人员。

(3) 基金清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金清

算小组可以依法进行必要的民事活动。

## 2、基金财产清算程序

- (1) 基金合同终止时，由基金清算小组统一接管基金财产；
- (2) 对基金财产进行清理和确认；
- (3) 对基金财产进行估价和变现；
- (4) 制作清算报告；
- (5) 聘请会计师事务所对清算报告进行审计；
- (6) 聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- (7) 将基金清算结果报告中国证监会；
- (8) 公布基金清算报告；
- (9) 对基金剩余财产进行分配。

## 3、清算费用

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

## 4、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，不分配给基金份额持有人。

## 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；基金财产清算结果经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，由基金财产清算小组报中国证监会备案并公告。

## 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不低于法律法规规定的最低期限。



## 二十一、基金合同的内容摘要

### (一) 基金合同当事人的权利与义务

#### 1、基金管理人的权利与义务

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) 自本基金合同生效之日起，依照有关法律法规和本基金合同的规定独立运用基金财产；

(2) 依照本基金合同获得基金管理人报酬以及法律法规规定或中国证监会批准的其他收入；

(3) 依照有关规定为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

(4) 在符合有关法律法规和本基金合同的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、转托管等业务的规则，决定基金的除调高托管费和管理费之外的费率结构和收费方式；

(5) 根据本基金合同及有关规定监督基金托管人，对于基金托管人违反了本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金财产、其他基金当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会和银行业监督管理机构，并采取必要措施保护基金及相关基金当事人的利益；

(6) 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购、赎回和转换申请；

(7) 自行担任注册登记机构或选择、更换注册登记机构，并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查；

(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) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

(10) 依法召集基金份额持有人大会；

(11) 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；

(12) 根据国家有关规定，在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金融资、融券；

(13) 法律法规规定的其他权利。



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，办理或者委托经由证监会认定的其他机构办理基金份额的发售、申购、赎回和注册登记事宜；

(2) 办理基金备案手续；

(3) 自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；

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

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

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

(7) 依法接受基金托管人的监督；

(8) 计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回价格；

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

(10) 按规定受理基金份额的申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

(11) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(12) 编制季度报告、中期报告和年度报告；

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

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

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

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

- (17) 保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料;
- (18) 以基金管理人名义, 代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为;
- (19) 组织并参加基金财产清算小组, 参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;
- (20) 因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益, 应当承担赔偿责任, 其赔偿责任不因其退任而免除;
- (21) 基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时, 应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿;
- (22) 按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料;
- (23) 建立并保存基金份额持有人名册;
- (24) 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;
- (25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议;
- (26) 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;
- (27) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利, 为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利, 不谋求对上市公司的控股和直接管理;
- (28) 法律法规、基金合同规定的以及中国证监会要求的其他义务。

## 2、基金托管人的权利与义务

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) 获得基金托管费;
- (2) 监督基金管理人对本基金的投资运作;
- (3) 自本基金合同生效之日起, 依法保管基金财产;
- (4) 在基金管理人更换时, 提名新任基金管理人;
- (5) 根据本基金合同及有关规定监督基金管理人, 对于基金管理人违反本基金合同或有关法律法规规定的行为, 对基金财产、其他基金合同当事人的利益造成重大损失的情形, 应及时呈报中国证监会, 并采取必要措施保护基金及相关基金合同当事人的利益;
- (6) 依法召集基金份额持有人大会;

- (7) 按规定取得基金份额持有人名册;
- (8) 法律法规规定的其他权利。

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,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;对所托管的不同基金财产分别设置账户,独立核算,分账管理,保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立;
- (4) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外,不得为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三人托管基金财产;
- (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和证券账户,协助开立股指期货业务相关账户及交易编码、为基金办理证券、期货交易资金清算;
- (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应予保密,不得向他人泄露;
- (8) 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;
- (9) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料不低于法律法规规定的最低期限;
- (10) 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;
- (11) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项;
- (12) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值和基金份额申购、赎回价格;
- (13) 按照规定监督基金管理人的投资运作;
- (14) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对;

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

(16) 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会;

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

(18) 按规定监督基金管理人按照法律法规规定和基金合同履行其义务, 基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时, 应为基金向基金管理人追偿;

(19) 根据本基金合同和托管协议规定建立并保存基金份额持有人名册;

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

(21) 面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时, 及时报告中国证监会和银行业监督管理机构, 并通知基金管理人;

(22) 执行生效的基金份额持有人大会的决议;

(23) 法律法规、基金合同规定的以及中国证监会要求的其他义务。

### 3、基金份额持有人的权利与义务

基金投资者自依招募说明书、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当事人, 直至其不再持有本基金的基金份额, 其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的完全承认和接受。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。

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关法律法规的规定, 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) 依法转让或者申请赎回其持有的基金份额;

(4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会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;

(9) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关法律法规的规定,基金份额持有人的义务包括但不限于:

(1) 遵守法律法规、基金合同及其他有关规定;

(2) 缴纳基金认购、申购款项及法律法规、基金合同和招募说明书规定的费用;

(3) 在持有的基金份额范围内,承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任;

(4) 不从事任何有损基金及其他基金份额持有人合法权益的活动;

(5) 执行生效的基金份额持有人大会决议;

(6) 返还在基金交易过程中因任何原因,自基金管理人、基金托管人、基金销售机构或其他基金份额持有人处获得的不当得利;

(7) 法律法规和基金合同规定的其他义务。

4、本基金合同当事人各方的权利义务以本基金合同为依据,不因基金账户名称而有所改变。

## (二) 基金份额持有人大会

1、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。

2、当出现或需要决定下列事由之一的,经基金管理人、基金托管人或单独或合计持有基金份额10%以上(“以上”含本数,下同)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)提议时,应当召开基金份额持有人大会,法律法规和中国证监会另有规定的除外:

(1) 终止基金合同,基金合同另有规定的除外;

(2) 转换基金运作方式;

(3) 变更基金类别;

- (4) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略;
- (5) 变更基金份额持有人大会议事程序;
- (6) 更换基金管理人、基金托管人;
- (7) 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率;
- (8) 本基金与其他基金的合并;
- (9) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响,需召开基金份额持有人大会的变更基金合同等其他事项;
- (10) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

在法律法规和本基金合同规定的范围内且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下,出现以下情形之一的,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) 调整基金的申购费率、调低赎回费率及销售服务费率、变更或增加收费方式;
- (2) 调整基金份额类别设置、对基金份额分类办法及规则进行调整;
- (3) 因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改;
- (4) 基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生重大变化;
- (5) 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;
- (6) 按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

### 3、召集人和召集方式

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

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

(3) 代表基金份额10%以上的基金份额持有人认为有必要召开基金份额持有人大会的,应当向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。

(4) 代表基金份额10%以上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%以上的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会，但应当至少提前30日向中国证监会备案。

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

#### 4、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

基金份额持有人大会的召集人（以下简称“召集人”）负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。召开基金份额持有人大会，召集人必须于会议召开日前30日在规定媒介公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容：

- (1) 会议召开的时间、地点和出席方式；
- (2) 会议拟审议的主要事项；
- (3) 会议形式；
- (4) 议事程序；
- (5) 有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
- (6) 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；
- (7) 表决方式；
- (8) 会务常设联系人姓名、电话；
- (9) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- (10) 召集人需要通知的其他事项。

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



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，不影响计票和表决结果。

#### 5、基金份额持有人出席会议的方式

##### (1) 会议方式

1) 基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会、通讯方式开会或法律法规和监管机关允许的其他方式。

2) 会议的召开方式由会议召集人确定。

3) 现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席，基金管理人或基金托管人拒不派代表出席的，不影响表决效力。

4) 通讯方式开会指按照本基金合同的相关规定以通讯方式开会的表决方式进行表决。

##### (2) 召开基金份额持有人大会的条件

###### 1) 现场开会方式

在同时符合以下条件时，现场会议方可举行：

①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，全部有效凭证所对应的基金份额应占权益登记日基金总份额的50%以上（含50%，下同）；

②亲自出席会议者持有基金份额持有人凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及授权委托书等文件符合有关法律法规和基金合同及会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符。

③若到会者在权益登记日代表的有效的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3个月以后、6个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效基金份额应不少于在权益登记日基金总份额的三分之一（含三分之一）。

###### 2) 通讯开会方式

在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

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

②召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人；以下称为“监督人”）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的表决意见，监督人经通知拒不参加收取和统计表决意见的，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代表的基金份额应占权益登记日基金总份额的50%以上；

④直接出具表决意见的基金份额持有人或受托代表他人出具表决意见的代表，同时提交的持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与注册登记机构记录相符；

⑤若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3个月以后、6个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表基金总份额三分之一以上（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。

3) 在法律法规或监管机构允许的情况下，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。

## 6、议事内容与程序

### (1) 议事内容及提案权

1) 议事内容为本基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容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。

2) 基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日本基金总份额10%以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前就召开事由向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案；也可以在会议通知发出后向大会召集人提交临时提案。召集人对于临时提案应当在大会召开日前30日公告。否则，会议

的召开日期应当顺延并保证至少与临时提案公告日期有30日的间隔期。

3) 对于基金份额持有人提交的提案(包括临时提案),大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核:

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

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

4) 基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后,如果需要对原有提案进行修改,应当最迟在基金份额持有人大会召开日前30日公告。否则,会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有30日的间隔期。

## (2) 议事程序

### 1) 现场开会

在现场开会的方式下,首先由大会主持人按照规定程序宣布会议议事程序及注意事项,确定和公布监票人,然后由大会主持人宣读提案,经讨论后进行表决,经合法执业的律师见证后形成大会决议。

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

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

### 2) 通讯方式开会

在通讯表决开会的方式下，首先由召集人提前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构监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。如监督人经通知但拒绝到场监督，则在公正机关监督下形成的决议有效。

(3) 基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

## 7、决议形成的条件、表决方式、程序

(1) 基金份额持有人所持每一基金份额享有平等的表决权。

(2) 基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

### 1) 一般决议

一般决议须经出席会议的基金份额持有人及其代理人所持表决权的50%以上通过方为有效，除下列2)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

特别决议须经出席会议的基金份额持有人及代理人所持表决权的三分之二以上通过方为有效；更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式、终止基金合同、本基金与其他基金合并（就上述情形，法律法规、《基金合同》和中国证监会另有规定的除外）必须以特别决议通过方为有效。

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

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

(5) 基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

(6) 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。

## 8、计票

### (1) 现场开会

1) 如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，则基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推

举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举3名基金份额持有人担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力及表决结果。

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

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

4) 计票过程应由公证机关予以公证。

#### (2) 通讯方式开会

在通讯方式开会的条件下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在监督人的监督下进行计票，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不派代表监督计票的，不影响计票效力及表决结果。

### 9、基金份额持有人大会决议的生效与公告

(1) 基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效，召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会备案。

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

(3) 基金份额持有人大会决议应自生效之日起2日内在规定媒介上公告。

(4) 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、公证机关、公证员姓名等一同公告。

### 10、实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定

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



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

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

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

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

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

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

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

同一主侧袋账户内的每份基金份额具有平等的表决权。

11、本部分对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的部分,如将来法律法规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) 基金合同的变更与终止

#### 1、基金合同的变更

(1) 按照法律法规或本基金合同的规定,对基金合同的变更应当召开基金份额持有人大会的,基金合同变更的内容经基金份额持有人大会决议通过后生效,并应依法报中国证监会备案,并自决议生效之日起2日内在规定媒介公告。

(2) 但出现下列情况时,可不经基金份额持有人大会决议,由基金管理人和



基金托管人同意变更后公布经修订的基金合同，并报中国证监会备案：

1) 在法律法规和本基金合同规定的范围内调整基金的申购费率、调低赎回费率及销售服务费率、变更或增加收费方式；

2) 因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；

3) 基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生重大变化；

4) 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；

5) 按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

## 2、本基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同应当终止：

(1) 基金份额持有人大会决定终止的；

(2) 基金管理人职责终止，而在6个月内没有新的基金管理人承接的；

(3) 基金托管人职责终止，而在6个月内没有新的基金托管人承接的；

(4) 连续50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，基金合同终止，不需召开基金份额持有人大会；

(5) 基金合同、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### (四) 争议的处理

对于因本基金合同产生或与本基金合同有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，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，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。除非仲裁裁决另有规定，仲裁费由败诉方承担。

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

本基金合同适用中华人民共和国法律（不含港澳台地区法律）并从其解释。

### (五) 基金合同存放及投资者取得基金合同的方式

本基金合同正本一式六份，除上报相关监管部门两份外，基金管理人和基金托管人各持有两份。每份均具有同等的法律效力。

本基金合同可印制成册，供基金投资者在基金管理人、基金托管人、销售机构和注册登记机构办公场所查阅。基金合同条款及内容应以基金合同正本为准。



## 二十二、托管协议的内容摘要

### (一) 托管协议当事人

#### 1、基金管理人

名称：交银施罗德基金管理有限公司

注册地址：中国(上海)自由贸易试验区银城中路188号交通银行大楼二层

(裙)

办公地址：上海浦东新区世纪大道8号国金中心二期21-22楼

邮政编码：200120

法定代表人：阮红

成立日期：2005年8月4日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2005]128号

组织形式：有限责任公司

注册资本：2亿元人民币

存续期间：持续经营

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其它业务。

#### 2、基金托管人

名称：中国农业银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街69号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座

邮政编码：100031

法定代表人：谷澍

成立时间：2009年1月15日

基金托管资格批准文号：中国证监会证监基字[1998]23号

注册资本：34,998,303.4万元人民币

存续期间：持续经营

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、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；结汇、售汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服

务；代理资金清算；各类汇兑业务；代理政策性银行、外国政府和国际金融机构贷款业务；贷款承诺；组织或参加银团贷款；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇借款；发行、代理发行、买卖或代理买卖股票以外的外币有价证券；外汇票据承兑和贴现；自营、代客外汇买卖；外币兑换；外汇担保；资信调查、咨询、见证业务；企业、个人财务顾问服务；证券公司客户交易结算资金存管业务；证券投资基金托管业务；企业年金托管业务；产业投资基金托管业务；合格境外机构投资者境内证券投资托管业务；代理开放式基金业务；电话银行、手机银行、网上银行业务；金融衍生产品交易业务；经国务院银行业监督管理机构等监管部门批准的其他业务。

## （二）基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

1、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种池和交易对手库，以便基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。

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（含创业板、科创板以及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、港股通标的股票、债券（含国债、央行票据、金融债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、企业债券、公司债券、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、可交换公司债券、次级债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、货币市场工具、债券回购、同业存单、银行存款（含协议存款、定期存款及其他银行存款）、资产支持证券、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）。

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

本基金的配置比例为股票资产（含存托凭证）占基金资产的50%-95%（其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的0%-50%），投资于先进制造主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收

申购款等。

如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。

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

(1) 股票资产（含存托凭证）占基金资产的50%-95%（其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的0%-50%），投资于先进制造主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的80%；

(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，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（同一家公司在内地和香港同时上市的A+H 股合计计算），其市值不超过基金资产净值的10%；

(4) 本基金管理人管理的、且由本基金托管人托管的全部基金持有一家公司发行的证券（同一家公司在内地和香港同时上市的A+H 股合计计算），不超过该证券的10%，完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金品种可以不受此条款规定的比例限制；

(5) 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（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股股票，不得超过该上市公司可流通股股票的15%；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股票，不得超过该上市公司可流通股股票的30%；完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述比例限制；

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

(7) 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；

(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、且由本基金托管人托管的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%;

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

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

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

(15) 当本基金投资股指期货时,则:

1) 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%;

2) 本基金在任何交易日日终,持有的买入股指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)、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等;

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

4) 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;

5) 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%;

(19) 本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的140%;

(20) 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;



(21) 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)项、第(6)项、第(7)项、第(12)项以外,因证券、期货市场波动、证券发行人合并或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。基金托管人对基金投资的监督和检查自基金合同生效之日起开始。

法律法规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。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。基金托管人对基金投资的监督和检查自基金合同生效之日起开始。

3、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对本协议第十五条第(九)项基金投资禁止行为进行监督。根据法律法规有关基金从事关联交易的规定,基金管理人和基金托管人应事先相互提供与本机构有控股关系的股东或与本机构有其他重大利害关系的公司名单及其更新,并以双方约定的方式提交,确保所提供的关联交易名单的真实性、完整性、全面性。基金管理人有责任保管真实、完整、全面的关联交易名单,并负责及时更新该名单。名单变更后基金管理人应及时发送基金托管人,基金托管人应及时确认已知名单的变更。如果基金托管人在运作中严格遵循了监督流程,基金管理人仍违规进行关联交易,并造成基金资产损失的,由基金管理人承担责任,基金托管人有权向中国证监会报告。

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

如法律、行政法规或监管部门取消上述规定,如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后,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的约定,对基金管理人参

与银行间债券市场进行监督。基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供经慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手名单。基金托管人监督基金管理人是否按事前提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易。基金管理人可以每半年对银行间债券市场交易对手名单进行更新,如基金管理人根据市场情况需要临时调整银行间债券市场交易对手名单,应向基金托管人说明理由,在与交易对手发生交易前2个工作日内与基金托管人协商解决。基金管理人与基金托管人完成确认后,被确认调整的名单开始生效,新名单生效前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易,仍应按照协议进行结算。基金管理人负责对交易对手的资信控制,按银行间债券市场的交易规则进行交易,基金托管人则根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督,但不承担交易对手不履行合同造成的损失。如基金托管人事后发现基金管理人没有按照事先约定的交易对手进行交易时,基金托管人应及时提醒基金管理人,基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任。

5、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对基金管理人投资银行存款进行监督。

基金投资银行存款的,基金管理人应根据法律法规的规定及基金合同的约定,建立投资制度、审慎选择存款银行,做好风险控制;并按照基金托管人的要求配合基金托管人完成相关业务办理。

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

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,并将在发现后立即报告中国证监会。

7、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对基金投资流通受限证券进行监督。

(1) 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) 流通受限证券,包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券,

不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。

(3) 在首次投资流通受限证券之前,基金管理人应当制定相关投资决策流程、风险控制制度、流动性风险控制预案等规章制度。基金管理人应当根据基金流动性的需要合理安排流通受限证券的投资比例,并在风险控制制度中明确具体比例,避免基金出现流动性风险。上述规章制度须经基金管理人董事会批准。上述规章制度经董事会通过之后,基金管理人应当将上述规章制度以及董事会批准上述规章制度的决议提交给基金托管人。

(4) 在投资流通受限证券之前,基金管理人应至少提前一个交易日向基金托管人提供有关流通受限证券的相关信息,具体应当包括但不限于如下文件(如有):

拟发行数量、定价依据、监管机构的批准证明文件复印件、基金管理人与承销商签订的销售协议复印件、缴款通知书、基金拟认购的数量、价格、总成本、划款账号、划款金额、划款时间文件等。基金管理人应保证上述信息的真实、完整。

(5) 基金托管人在监督基金管理人投资流通受限证券的过程中,如认为因市场出现剧烈变化导致基金管理人的具体投资行为可能对基金财产造成较大风险,基金托管人有权要求基金管理人对该风险的消除或防范措施进行补充和整改,并做出书面说明。否则,基金托管人经事先书面告知基金管理人,有权拒绝执行其有关指令。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。

(6) 基金管理人应保证基金投资的流通受限证券登记存管在本基金名下,并确保基金托管人能够正常查询。因基金管理人原因产生的流通受限证券登记存管问题,造成基金财产的损失或基金托管人无法安全保管基金财产的责任与损失,由基金管理人承担。

(7) 如果基金管理人未按照本协议的约定向基金托管人报送相关数据或者报送了虚假的数据,导致基金托管人不能履行托管人职责的,基金管理人应依法承担相应法律后果。除基金托管人未能依据法律法规、基金合同及本协议履行职责外,因投资流通受限证券产生的损失,基金托管人在履行其监督职责后不承担上述损失。

8、基金托管人发现基金管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作中违反

法律法规和基金合同的规定,应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到通知后应在下一工作日及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函,就基金托管人的疑义进行解释或举证,说明违规原因及纠正期限,并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内,基金托管人有权随时对通知事项进行复查,督促基金管理人改正。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的,基金托管人应报告中国证监会。基金托管人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,应当立即通知基金管理人,并报告中国证监会。

9、基金管理人应配合和协助基金托管人依照法律法规、基金合同和本托管协议对基金业务执行核查。对基金托管人发出的书面提示,基金管理人应在规定时间内答复并改正,或就基金托管人的疑义进行解释或举证;对基金托管人按照法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项,基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

10、基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为,应及时报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正,并将纠正结果报告中国证监会。基金管理人无正当理由,拒绝、阻挠对方根据本协议规定行使监督权,或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督,情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的,基金托管人应报告中国证监会。

### (三) 基金管理人对于基金托管人的业务核查

1、基金管理人对于基金托管人履行托管职责情况进行核查,核查事项包括基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户等投资所需账户、协助开立股指期货业务相关账户及交易编码、复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、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、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在下一工作日及时核对并以书面形式给基金管理人发出回函,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



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

3、基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金托管人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。基金托管人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经基金管理人提出警告仍不改正的，基金管理人应报告中国证监会。

#### （四）基金财产保管

##### 1、基金财产保管的原则

（1）基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。

（2）基金托管人应安全保管基金财产。未经基金管理人依据合法程序作出的合法合规指令，基金托管人不得自行运用、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和证券账户，协助开立股指期货业务相关账户及交易编码。

（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）基金托管人根据基金管理人的指令，按照基金合同和本协议的约定保管基金财产，如有特殊情况双方可另行协商解决。

（6）对于因为基金投资产生的应收资产，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，到账日基金财产没有到达基金账户的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金财产造成损失的，基金托管人对此不承担任何责任。

（7）除依据法律法规和基金合同的规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

##### 2、基金募集期间及募集资金的验资

交银施罗德先进制造股票证券投资基金经中国证监会证监许可[2011]639号核准募集，基金管理人为交银施罗德基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

交银施罗德先进制造股票证券投资基金自2011年5月23日至2011年6月17日进行公开募集，并于2011年6月22日获得中国证监会的书面确认，《交银施罗德先进制造股票证券投资基金基金合同》自该日起生效。具体募集情况如下：

经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）验资，本次募集的有效净认购金额为1,917,255,974.38元人民币，折合基金份额1,917,255,974.38份；认购款项在基金验资确认日之前产生的银行利息共计430,117.38元人民币，折合基金份额430,117.38份。本次募集所有资金已于2011年6月22日全额划入该基金在基金托管人中国农业银行股份有限公司开立的交银施罗德先进制造股票证券投资基金托管专户。该基金按照每份基金份额面值1.00元人民币计算，募集期间募集资金及其利息结转的基金份额共计1,917,686,091.76份。

### 3、基金的银行账户的开立和管理

(1) 基金托管人应负责本基金的资金账户的开设和管理。

(2) 基金托管人可以本基金的名义在其营业机构开设本基金的资金账户，并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。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，均需通过本基金的资金账户进行。

(3) 基金托管资金账户的开立和使用，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任何其他银行账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

(4) 基金托管资金账户的开立和管理应符合相关法律法规的有关规定。

(5) 在符合法律法规规定的条件下，基金托管人可以通过基金托管人专用账户办理基金资产的支付。

### 4、基金证券账户的开立和管理

(1) 基金托管人在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司为基金开立基金托管人与基金联名的证券账户。

(2) 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。

(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，并代表所托管的基金完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级法



人清算工作，基金管理人应予以积极协助。结算备付金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) 基金证券账户的开立和证券账户卡的保管由基金托管人负责，账户资产的管理和运用由基金管理人负责。

(5) 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，涉及相关账户的开设、使用的，按有关规定开设、使用并管理；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。

#### 5、债券托管专户的开设和管理

基金合同生效后，基金托管人根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司、银行间市场清算所股份有限公司的有关规定，以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司、银行间市场清算所股份有限公司开立债券托管与结算账户，并代表基金进行银行间市场债券的结算。基金管理人和基金托管人同时代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议。

#### 6、其他账户的开立和管理

(1) 因业务发展需要而开立的其他账户，可以根据法律法规和基金合同的规定，在基金管理人和基金托管人商议后由基金托管人负责开立。新账户按有关规则使用并管理。

(2) 法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

#### 7、基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的有关实物证券、银行存款存单等有价凭证由基金托管人负责妥善保管，保管凭证由基金托管人持有。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。属于基金托管人实际有效控制下的实物证券在基金托管人保管期间的损坏、灭失，由此产生的责任应由基金托管人承担。基金托管人对基金托管人以外机构实际有效控制的证券不承担保管责任。

#### 8、与基金财产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的、与基金有关的重大合同的原件分别由基金管理人、基金托管人保管。除协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时，应保证基金一方持有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。重大合同的保管期限不低于法律法规规定的最低期

限。

## (五) 基金资产净值计算和会计复核

### 1、基金资产净值的计算及复核程序

#### (1) 基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的金额。

各类基金份额的基金份额净值是按照每个工作日闭市后，该类基金份额的基金资产净值除以当日该类基金份额的余额数量计算。基金份额净值的计算，精确到0.0001元，小数点后第五位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。基金管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制，具体可参见相关公告。国家另有规定的，从其规定。

每工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

#### (2) 复核程序

基金管理人每工作日对基金资产进行估值后，将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，由基金管理人依据基金合同和有关法律法规的规定对外公布。

### 2、基金资产估值方法和特殊情形的处理

#### (1) 估值对象

基金所拥有的股票、债券、衍生工具和其它投资等持续以公允价值计量的金融资产及负债。

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

②交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（另有规定的除外），选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；

③交易所上市交易的可转换债券，按估值日收盘价减去可转换债券收盘价中所

含债券（税后）应收利息后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可转换债券收盘价中所含债券（税后）应收利息后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交易所上市实行全价交易的债券（可转债除外），选取第三方估值机构提供的估值全价减去估值全价中所含的债券（税后）应收利息得到的净价进行估值；

⑤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。交易所市场挂牌转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值；

⑥对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为估值日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表估值日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认估值日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，应采用估值技术确定其公允价值。

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和债券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

③在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3) 对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种，回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异，未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。

4) 本基金投资股指期货合约, 一般以估值当日结算价进行估值, 估值当日无结算价的, 且最近交易日后经济环境未发生重大变化的, 采用最近交易日结算价估值。

5) 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。

估值计算中涉及港币对人民币汇率的, 将依据下列信息提供机构所提供的汇率为基准: 当日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价。

税收: 对于按照中国法律法规和基金投资境内外股票市场交易互联互通机制涉及的境外交易场所所在地的法律法规规定应交纳的各项税金, 本基金将按权责发生制原则进行估值; 对于因税收规定调整或其他原因导致基金实际交纳税金与估算的应交税金有差异的, 基金将在相关税金调整日或实际支付日进行相应的估值调整。

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。

7) 本基金投资存托凭证的估值核算依照境内上市交易的股票执行。

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) 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。

### (3) 特殊情形的处理

1) 基金管理人、基金托管人按估值方法的第8)项进行估值时, 所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

2) 由于不可抗力原因, 或由于证券、期货交易所、证券经纪机构、期货公司及登记结算公司发送的数据错误, 或国家会计政策变更、市场规则变更等, 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而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、基金托管人应积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

### 3、基金份额净值错误的处理方式

(1) 当基金份额净值小数点后4位以内（含第4位）发生差错时，视为基金份额净值错误；基金份额净值出现错误时，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；错误偏差达到或超过基金份额净值的0.25%时，基金管理人应当及时通知基金托管人并报中国证监会；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、通报基金托管人并报中国证监会备案；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，应由基金管理人先行赔付，基金管理人按差错情形，有权向其他当事人追偿。

(2) 当基金份额净值计算差错给基金和基金份额持有人造成损失需要进行赔偿时，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) 本基金的基金会计责任方由基金管理人担任。与本基金有关的会计问题，如经双方在平等基础上充分讨论后，尚不能达成一致时，按基金会计责任方的建议执行，由此给基金份额持有人和基金造成的损失，由基金管理人负责赔付。

2) 若基金管理人计算的基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告，基金份额净值出错且造成基金份额持有人损失的，应根据法律法规的规定对基金份额持有人或基金支付赔偿金，就实际向基金份额持有人或基金支付的赔偿金额，其中基金管理人承担50%，基金托管人承担50%。

3) 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，由基金管理人负责赔付。

4) 由于基金管理人提供的信息错误（包括但不限于基金申购或赎回金额等），基金托管人在履行了正常的复核程序后仍不能发现该错误，进而导致基金份额净值计算错误而引起的基金份额持有人和基金财产的损失，由基金管理人负责赔付。

(3) 基金管理人和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾



差，以基金管理人计算结果为准。

(4) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。如果行业有通行做法，双方当事人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商。

#### 4、暂停估值与公告基金份额净值的情形

(1) 基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

(2) 因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

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

(4) 法律法规、中国证监会和基金合同认定的其他情形。

#### 5、基金会计制度

按国家有关部门规定的会计制度执行。

#### 6、基金账册的建立

基金管理人进行基金会计核算并编制基金财务会计报告。基金管理人独立地设置、记录和保管本基金的全套账册。基金托管人按规定制作相关账册并与基金管理人核对。若基金管理人和基金托管人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。若当日核对不符，暂时无法查找到错账的原因而影响基金资产净值的计算和公告的，以基金管理人的账册为准。

#### 7、基金财务报表与报告的编制和复核

##### (1) 财务报表的编制

基金管理人应当及时编制并对外提供真实、完整的基金财务会计报告。月度报表的编制，基金管理人应于每月终了后5个工作日内完成；季度报告应在季度结束之日起15个工作日内编制完毕并予以公告；中期报告在会计年度半年终了后两个月内编制完毕并予以公告；年度报告在会计年度结束后三个月内编制完毕并予以公告。

##### (2) 报表复核

基金管理人在报表或定期报告完成当日，对报表盖章后，以加密传真方式或双方书面商定的其他方式将有关报表提供基金托管人复核。

基金管理人在月度报表完成当日，将报表盖章后提供给基金托管人复核；基金



托管人在收到后应在3日内进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在季度报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后7个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在中期报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后30日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在年度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人应在收到后45日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人和基金托管人之间的上述文件往来均以加密传真的方式或双方商定的其他方式进行。

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；若双方无法达成一致，以基金管理人的账务处理为准。核对无误后，基金托管人在基金管理人提供的报告上加盖托管业务部门公章或者出具加盖托管业务专用章的复核意见书，双方各自留存一份。如果基金管理人与基金托管人不能于应当发布公告之日之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中国证监会备案。

#### （六）基金份额持有人名册的保管

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

基金管理人应及时向基金托管人提交基金份额持有人名册。每年6月30日和12月31日的基金份额持有人名册应于下月前十个工作日内提交；基金合同生效日、基金合同终止日等涉及到基金重要事项日期的基金份额持有人名册应于发生日后十个工作日内提交。

基金管理人和基金托管人应妥善保管基金份额持有人名册，保存期限不低于法律法规规定的最低期限。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

因本协议产生或与之相关的争议，双方当事人应通过协商、调解解决，协商、调解不能解决的，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，仲裁地点为北京市，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。除非仲裁裁决另有规定，仲裁费由败诉方承担。

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

本协议适用中华人民共和国法律（不含港澳台地区法律）并从其解释。

#### （八）托管协议的变更与终止

##### 1、托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行修改。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。基金托管协议的变更报应报中国证监会备案。

##### 2、基金托管协议终止的情形

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

## 二十三、对基金份额持有人的服务

本基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务。本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) 持有人交易资料的寄送服务

1、每次交易结束后,投资人可在T+2个工作日后通过销售机构的网点查询和打印确认单。

2、本基金管理人将向持有人提供电子或纸质对账单,需要订阅或取消的客户可与本基金管理人客户服务中心(400-700-5000,021-61055000)联系。

### (二) 网上直销服务

本基金管理人已开通基金网上直销业务,个人投资者可以直接通过本基金管理人网站的网上直销交易平台办理开户和本基金的申购、赎回、定期定额投资和转换等业务。本公司暂不开展网上直销后端A类基金份额的申购业务,通过转托管转入网上直销账户的后端收费模式的A类基金份额只能办理赎回业务。通过网上直销交易平台办理本基金前端A类基金份额申购和定期定额投资业务的个人投资者将享受前端申购费率的优惠,通过网上直销交易平台进行基金转换,从各基金招募说明书所载的零申购费率的基金转换入非零申购费率的基金,转出与转入基金的前端申购补差费率将享受优惠,其他费率标准不变。具体优惠费率请参见公司网站列示的网上直销申购、定期定额投资及转换费率表或相关公告。

本公司基金网上直销业务已开通的银行卡及各银行卡交易金额限额请参阅本公司网站。

在条件成熟的时候,本基金管理人将根据基金网上直销业务的发展状况,适时调整可用于网上直销交易平台的银行卡种类,敬请投资者留意相关公告。

### (三) 信息咨询、查询服务

投资者如果想查询申购、赎回等交易情况、分红方式状态、基金账户余额、基金产品与服务等信息,请拨打本基金管理人客户服务电话(400-700-5000,021-61055000)或登录本基金管理人网站(www.fund001.com)进行咨询、查询。

本基金管理人为投资者预设基金查询密码,预设的基金查询密码为投资者开户证件号码的后6位数字,不足6位数字的,前面加“0”补足。基金查询密码用于投

投资者通过客户服务电话查询基金账户下的账户和交易信息。投资者请在其知晓基金账号后，及时拨打本基金管理人客户服务电话修改基金查询密码。

投资者可以拨打本基金管理人客户服务电话投诉直销机构的人员和服务。

#### **(四) 基金红利再投资**

本基金收益分配时，基金份额持有人持有的基金份额可选择现金红利或选择红利再投将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资，若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。再投资红利按红利再投日（即除息日）除息后的基金份额净值自动转为基金份额，并免收申购费用。

#### **(五) 定期定额投资计划**

本基金可开通定期定额投资计划，具体实施方法请参见相关公告。

服务联系方式：

基金管理人的互联网地址及电子信箱

网址：[www.fund001.com](http://www.fund001.com)

电子信箱：[services@jysld.com](mailto:services@jysld.com)

投资者也可登录本基金管理人网站，直接提出有关本基金的问题和建议。

**(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。

## 二十四、其他应披露事项

基金合同如有未尽事宜，由基金合同当事人各方按有关法律法规协商解决。

本招募说明书更新期间基金披露的其他重要事项

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	交银施罗德先进制造混合型证券投资基金(更新)招募说明书(2022年第2号)	中国证监会规定媒体及公司网站	2022-06-24
2	交银施罗德先进制造混合型证券投资基金(A类份额)基金产品资料概要更新(2022年第2号)	中国证监会规定媒体及公司网站	2022-06-24
3	交银施罗德先进制造混合型证券投资基金(C类份额)基金产品资料概要更新(2022年第2号)	中国证监会规定媒体及公司网站	2022-06-24
4	交银施罗德先进制造混合型证券投资基金2022年第2季度报告	中国证监会规定媒体及公司网站	2022-07-20
5	交银施罗德基金管理有限公司关于增加宁波银行股份有限公司为旗下基金的销售机构的公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2022-07-29
6	交银施罗德基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2022-07-30
7	交银施罗德基金管理有限公司关于增加中信建投证券股份有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2022-08-04
8	交银施罗德基金管理有限公司关于增加东兴证券股份有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2022-08-25
9	交银施罗德先进制造混合型证券投资基金2022年中期报告	中国证监会规定媒体及公司网站	2022-08-30
10	交银施罗德基金管理有限公司关于调整直销中心柜台投资者最低认申购金额限制的公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2022-09-03

11	交银施罗德基金管理有限公司关于增加华泰证券股份有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2022-09-22
12	交银施罗德基金管理有限公司关于增加国新证券股份有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2022-09-22
13	交银施罗德基金管理有限公司关于固有资金拟购买旗下偏股型基金的公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2022-10-19
14	交银施罗德先进制造混合型证券投资基金 2022 年第 3 季度报告	中国证监会规定媒体及公司网站	2022-10-25
15	交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金投资非公开发行的公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2022-11-01
16	交银施罗德基金管理有限公司关于增加浙商证券股份有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2022-11-10
17	交银施罗德基金管理有限公司关于增加广发证券股份有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2022-11-15
18	交银施罗德基金管理有限公司关于增加西部证券股份有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2022-11-17
19	交银施罗德基金管理有限公司关于增加兴业证券股份有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2022-11-23
20	交银施罗德基金管理有限公司关于增加中国中金财富证券有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2022-12-15
21	交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金投资非公开发行的公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2022-12-26



22	交银施罗德基金管理有限公司关于增加海通证券股份有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2023-01-13
23	交银施罗德先进制造混合型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒体及公司网站	2023-01-19
24	交银施罗德基金管理有限公司关于增加东莞农村商业银行股份有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2023-01-19
25	交银施罗德基金管理有限公司关于增加兴业银行股份有限公司银银平台销售旗下部分基金的公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2023-02-10
26	交银施罗德基金管理有限公司关于增加济安财富（北京）基金销售有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2023-02-10
27	交银施罗德基金管理有限公司关于增加南京银行股份有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2023-03-03
28	交银施罗德基金管理有限公司关于增加方正证券股份有限公司为旗下基金的销售机构的公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2023-03-16
29	交银施罗德基金管理有限公司关于增加第一创业证券股份有限公司为旗下基金的销售机构的公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2023-03-17
30	交银施罗德先进制造混合型证券投资基金 2022 年年度报告	中国证监会规定媒体及公司网站	2023-03-30
31	交银施罗德先进制造混合型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒体及公司网站	2023-04-21
32	交银施罗德基金管理有限公司关于增加平安银行股份有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2023-04-27

33	交银施罗德基金管理有限公司关于增加中原证券股份有限公司为旗下基金的销售机构的公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2023-05-12
34	交银施罗德基金管理有限公司关于增加中国工商银行股份有限公司为旗下基金的销售机构的公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2023-05-18
35	交银施罗德基金管理有限公司关于增加华宝证券股份有限公司为旗下基金的销售机构的公告	中国证监会规定媒体及公司网站	2023-05-19

## 二十五、招募说明书的存放及查阅方式

招募说明书存放在基金管理人、基金托管人和基金销售机构的办公场所，投资者可在办公时间查阅；投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件或复印件。对投资者按此种方式所获得的文件及其复印件，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。

投资人还可以直接登录基金管理人的网站([www.fund001.com](http://www.fund001.com))查阅和下载招募说明书。

## 二十六、备查文件

以下备查文件存放在基金管理人的办公场所，在办公时间可供免费查阅。

- (一) 中国证监会核准交银施罗德先进制造股票证券投资基金募集的文件
- (二) 中国证监会准予交银施罗德先进制造混合型证券投资基金变更注册的文件
- (三) 《交银施罗德先进制造混合型证券投资基金基金合同》
- (四) 《交银施罗德先进制造混合型证券投资基金托管协议》
- (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) 关于申请募集交银施罗德先进制造股票证券投资基金之法律意见书
- (八) 关于申请变更注册交银施罗德先进制造混合型证券投资基金的法律意见书