

# 博时新能源主题混合型证券投资基金 更新招募说明书

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：杭州银行股份有限公司

## 【重要提示】

1、本基金经中国证监会 2021 年 3 月 25 日证监许可[2021]992 号文准予注册募集。

2、基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值和市场前景作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

3、投资有风险，投资者认购（或申购）基金份额时应认真阅读基金合同、本招募说明书、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，全面认识本基金产品的风险收益特征，应充分考虑投资者自身的风险承受能力，并对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化导致的投资风险，由投资者自行承担。

4、本基金是混合型证券投资基金，其预期收益和预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。本基金如果投资港股通标的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。

5、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，应全面了解本基金的产品特性，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险、本基金的特定风险等等。

6、本基金的投资范围包括国内依法发行或上市的股票（含中小板、创业板、及其他经中国证监会核准上市或准予注册的股票、存托凭证）、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许买卖的香港证券市场股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（国债、金融债、企业债、公司债、政府支持债券、政府支持机构债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、可交换债、次级债等）、资产支持证券、金融衍生品（包括股指期货、国债期货、股票期权、信用衍生品等）、债券回购、同业存单、银行存款（包含协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、现金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相关规定）。本基金可根据相关法律法规和基金合同的约定参与融资业务。

本基金不低于 80% 的非现金基金资产将投资于新能源主题相关的上市公司发行的证券，该类证券的特定风险即成为本基金及投资者主要面对的特定投资风险，其投资收益会受到宏观经济、政府产业政策、市场需求变化、行业波动和公司自身经营状况等因素的影响，可能存在所选投资标的的成长性与市场一致预期不符而造成个股价格表现低于预期的风险。因此，本基金所投资的新能源主题相关证券可能在一定时期内表现与其他未投资的证券不同，造成本基金的收益低于其他基金，或波动率高于其他基金或市场平均水平。此外，由于本基金还可以投资其它品种，这些品种的价格也可能因市场中的各类变化而出现一定幅度的波动，产生特定的风险，并影响到整体基金的投资收益。

本基金基金资产可以投资于港股，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。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。

本基金可投资资产支持证券（ABS）。资产支持证券（ABS）是一种债券性质的金融工具，其向投资者支付的本息来自于基础资产池产生的现金流或剩余权益。与股票和一般债券不同，资产支持证券不是对某一经营实体的利益要求权，而是对基础资产池所产生的现金流和剩余权益的要求权，是一种以资产信用为支持的证券，所面临的风险主要包括交易结构风险、各种原因导致的基础资产池现金流与对应证券现金流不匹配产生的信用风险、市场交易不活跃导致的流动性风险等。

本基金可投资股指期货、国债期货。股指期货、国债期货采用保证金交易制度，由于保证金交易具有杠杆性，当出现不利行情时，股价、指数微小的变动就可能会使投资者权益遭受较大损失。股指期货、国债期货采用每日无负债结算制度，如果没有在规定的时间内补足保证金，按规定将被强制平仓，可能给投资带来重大损失。

本基金可参与股票期权交易，以套期保值为主要目的，若参与股票期权交易，可能面临价格波动风险、市场流动性风险、强制平仓风险、合约到期风险、行权失败风险、交易违约风险等。

为对冲信用风险,本基金可能投资于信用衍生品,信用衍生品投资可能面临流动性风险、偿付风险以及价格波动风险。

本基金的投资范围包括存托凭证,除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外,本基金还将面临存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险,以及与存托凭证发行机制相关的风险,包括存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险;存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险;存托协议自动约束存托凭证持有人的风险;因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。

7、基金的投资组合比例为:本基金股票资产(含存托凭证)占基金资产的比例为60%—95%,港股通标的股票的投资比例为股票资产的0%—50%。其中,投资于本基金界定的新能源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国债期货、股指期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值的5%的现金或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。

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

9、本基金发售面值为人民币1.00元。在市场波动因素影响下,本基金净值可能低于初始面值,本基金投资者有可能出现亏损。

10、基金的过往业绩并不预示其未来表现,基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。

11、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。

本招募说明书(更新)所载内容截止日2023年7月8日,有关财务数据和净值表现截止日为2022年6月30日(财务数据未经审计)。

## 目录

【重要提示】	2
第一部分 绪言	6
第二部分 释义	7
第三部分 基金管理人	12
第四部分 基金托管人	24
第五部分 相关服务机构	27
第六部分 基金的募集与基金合同的生效	50
第七部分 基金份额的申购与赎回	51
第八部分 基金的投资	63
第九部分 基金的业绩	76
第十部分 基金的财产	77
第十一部分 基金资产的估值	78
第十二部分 基金的收益与分配	84
第十三部分 基金的费用与税收	86
第十四部分 基金的会计与审计	89
第十五部分 基金的信息披露	90
第十六部分 侧袋机制	97
第十六部分 风险揭示	101
第十七部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算	110
第十八部分 基金合同的内容摘要	112
第十九部分 基金托管协议的内容摘要	129
第二十部分 对基金份额持有人的服务	148
第二十一部分 其他应披露的事项	151
第二十二部分 招募说明书的存放及查阅方式	153
第二十三部分 备查文件	154

## 第一部分 绪言

《博时新能源主题混合型证券投资基金招募说明书》（以下简称“招募说明书”或“本招募说明书”）依照《中华人民共和国民法典》（以下简称“《民法典》”）、《中华人民共和国证券法》（以下简称“《证券法》”）、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）和其他有关法律法规以及《博时新能源主题混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

本招募说明书阐述了博时新能源主题混合型证券投资基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资人投资决策有关的必要事项，投资人在作出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

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

博时新能源主题混合型证券投资基金（以下简称“基金”或“本基金”）是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写，并经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）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。基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。



## 第二部分 释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

- 1、基金或本基金：指博时新能源主题混合型证券投资基金
- 2、基金管理人：指博时基金管理有限公司
- 3、基金托管人：指杭州银行股份有限公司
- 4、基金合同：指《博时新能源主题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《博时新能源主题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、招募说明书或者本招募说明书：指《博时新能源主题混合型证券投资基金招募说明书》及其更新
- 7、基金产品资料概要：指《博时新能源主题混合型证券投资基金基金产品资料概要》及其更新
- 8、基金份额发售公告：指《博时新能源主题混合型证券投资基金基金份额发售公告》
- 9、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等
- 10、《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，经 2012 年 12 月 28 日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自 2013 年 6 月 1 日起实施，并经 2015 年 4 月 24 日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修正的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 11、《销售办法》：指中国证监会 2020 年 8 月 28 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 12、《信息披露办法》：指中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1 日实施，并经 2020 年 3 月 20 日中国证监会《关于修改部分证券期货规章的决定》修改的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 13、《运作办法》：指中国证监会 2014 年 7 月 7 日颁布、同年 8 月 8 日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

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

15、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

16、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

17、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

18、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

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

20、合格境外机构投资者：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可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者

21、人民币合格境外机构投资者：指按照《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，运用来自境外的人民币资金进行境内证券投资的境外法人

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

23、基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人

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

25、销售机构：指直销机构和代销机构

26、直销机构：指博时基金管理有限公司

27、代销机构：指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金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

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



29、**登记机构**：指办理登记业务的机构。基金的登记机构为博时基金管理有限公司或接受博时基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构

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

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

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

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

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

35、**存续期**：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

36、**工作日**：指上海证券交易所、深圳证券交易所及相关期货交易所的正常交易日

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

38、**T+n日**：指自T日起第n个工作日(不包含T日)

39、**开放日**：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日（若本基金参与港股通交易且该工作日为非港股通交易日时，则基金管理人可根据实际情况决定本基金是否开放申购、赎回及转换业务，具体以届时提前发布的公告为准）

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、**《业务规则》**：指《博时基金管理有限公司开放式基金业务规则》，是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金登记方面的业务规则，由基金管理人 and 投资人共同遵守

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

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

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

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

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

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

48、巨额赎回：指本基金单个开放日，基金净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一工作日基金总份额的 10%

49、元：指人民币元

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

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

52、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

53、基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日该类基金份额总数

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

55、基金份额分类：指本基金分设两类基金份额，即 A 类基金份额和 C 类基金份额。两类基金份额分设不同的基金代码，分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数

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

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

58、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

59、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

60、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

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

62、港股通：是指内地投资者委托内地证券公司，经由上海证券交易所和深圳证券交易所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的交易机制

63、信用衍生品：指符合证券交易所或银行间市场相关业务规则，专门用于管理信用风险的信用衍生工具

64、信用保护买方：亦称信用保护购买方，指接受信用风险保护的一方

65、信用保护卖方：亦称信用保护提供方，指提供信用风险保护的一方

66、名义本金：亦称交易名义本金，是一笔信用衍生产品交易提供信用风险保护的金额，各项支付和结算以此金额为计算基准

67、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

68、特定资产：包括：（1）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；（2）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；（3）其他资产价值存在重大不确定性的资产

69、不可抗力：指基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

## 第三部分 基金管理人

### 一、基金管理人概况

名称：博时基金管理有限公司

住所：深圳市福田区莲花街道福新社区益田路 5999 号基金大厦 21 层

办公地址：广东省深圳市福田区益田路 5999 号基金大厦 21 层

法定代表人：江向阳

成立时间：1998 年 7 月 13 日

注册资本：2.5 亿元人民币

存续期间：持续经营

联系人：王济帆

联系电话：（0755）8316 9999

博时基金管理有限公司（以下简称“公司”）经中国证监会证监基字[1998]26 号文批准设立。目前公司股东为招商证券股份有限公司，持有股份 49%；中国长城资产管理公司，持有股份 25%；天津港（集团）有限公司，持有股份 6%；上海汇华实业有限公司，持有股份 12%；上海盛业股权投资基金有限公司，持有股份 6%；广厦建设集团有限责任公司，持有股份 2%。注册资本为 2.5 亿元人民币。

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

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

### 二、主要成员情况

#### 1、基金管理人董事会成员

江向阳先生，博士。中共党员，南开大学国际金融博士，清华大学金融媒体 EMBA。

1986-1990 年就读于北京师范大学信息与情报学系，获学士学位；1994-1997 年就读于中国政法大学研究生院，获法学硕士学位；2003-2006 年，就读于南开大学国际经济研究所，获国际金融博士学位。1997 年 8 月至 2014 年 12 月就职于中国证监会，历任办公厅、党办副主任兼新闻办（网信办）主任；中国证监会办公厅副巡视员；中国证监会深圳专员办处长、副专员；中国证监会期货监管部副处长、处长。2015 年 1 月至 7 月，任招商局金融集团副

总经理、博时基金管理有限公司党委副书记。2015年7月至2020年10月任博时基金管理有限公司总经理。自2020年1月9日至2020年4月15日代为履行博时基金董事长职务。自2020年4月1日起任博时基金管理有限公司党委书记。自2020年4月15日起，任博时基金管理有限公司董事长。

苏敏女士，分别于1990年7月及2002年12月获得上海财经大学金融专业学士学位和中国科学技术大学工商管理硕士学位。苏女士分别于1998年6月、1999年6月及2008年6月获中国注册会计师协会授予的注册会计师资格、中国资产评估协会授予的注册资产评估师资格及安徽省人力资源和社会保障厅授予的高级会计师职称。苏女士拥有管理金融类公司及上市公司的经验，其经验包括：自2015年9月及2015年12月起任招商局金融集团有限公司总经理及董事；自2016年6月起任招商证券股份有限公司（上海证券交易所上市公司，股票代码：600999；香港联交所上市公司，股票代码：6099）董事；自2014年9月起担任招商银行股份有限公司（上海证券交易所上市公司，股票代码：600036；香港联交所上市公司，股票代码：3968）董事。自2016年1月至2018年8月任招商局资本投资有限责任公司监事；自2015年11月至2018年8月任招商局创新投资管理有限公司董事；自2015年11月至2017年4月任深圳招商启航互联网投资管理有限公司董事长；自2013年5月至2015年8月任中远海运能源运输股份有限公司（上海证券交易所上市公司，股票代码：600026；香港联交所上市公司，股票代码：1138）董事；自2013年6月至2015年12月任中远海运发展股份有限公司（上海证券交易所上市公司，股票代码：601866；香港联交所上市公司，股票代码：2866）董事；自2009年12月至2011年5月担任徽商银行股份有限公司（香港联交所上市公司，股票代码：3698）董事；自2008年3月至2011年9月担任安徽省皖能股份有限公司（深圳证券交易所上市公司，股票代码：000543）董事。苏女士亦拥有会计等相关管理经验，其经验包括：自2011年3月至2015年8月担任中国海运（集团）总公司总会计师；自2007年5月至2011年4月担任安徽省能源集团有限公司总会计师，并于2010年11月至2011年4月担任该公司副总经理。自2018年9月3日起，任博时基金管理有限公司董事。

高阳先生，中共党员，经济学硕士，CFA，总经理。1998年7月至2000年2月在中国国际金融股份有限公司任销售交易部经理。2000年3月至2008年2月在博时基金管理有限公司历任债券组合经理、固定收益部总经理、基金经理、股票投资部总经理。2008年8月至2021年1月在鹏华基金管理有限公司工作，2008年12月至2021年1月任鹏华基金管理



有限公司副总经理。自 2021 年 2 月 5 日起，任博时基金管理有限公司总经理。自 2021 年 4 月 7 日起，任博时基金管理有限公司第八届董事会董事。

姚俊先生，博士。1993 年至 1997 年在华南理工大学学习，获双学士学位。1997 年至 2000 年在华南理工大学工商管理专业学习，获硕士学位。2002 年 9 月至 2005 年 7 月在华南理工大学管理专业学习，获得博士学位。2000 年 6 月至 2002 年 8 月任广东电信广州分公司业务部业务主管。2005 年 9 月至 2007 年 7 月，招商局集团博士后工作站任博士后研究员。2007 年 8 月至 2014 年 5 月，任招商证券研究发展中心分析师。2014 年 6 月至 2015 年 6 月任招商证券研究发展中心二部总经理助理。2015 年 6 月至 2016 年 7 月任招商证券研究发展中心二部副总经理（主持工作）。2016 年 7 月至 2020 年 3 月任招商证券研究发展中心二部总经理。2020 年 3 月至今任招商证券财富管理及机构业务总部财富管理部总经理。自 2020 年 12 月 8 日起，任博时基金管理有限公司董事。

赵文武先生，中共党员，硕士。1991 年 10 月至 2009 年 4 月，于合肥百货大楼股份有限公司任职，历任董事会秘书、董事、总经理助理、副总经理；2009 年 4 月至 2010 年 6 月，任合肥百货大楼集团股份有限公司董事、副董事长、党委副书记、总经理；2010 年 6 月至 2015 年 2 月，任合肥市国有资产控股有限公司董事、总经理、党委副书记，同时兼任安徽国风集团有限公司、安徽国风塑业股份有限公司党委书记、董事长；2015 年 2 月至 2018 年 2 月，任合肥市产业投资控股（集团）有限公司董事、党委副书记、总经理；2019 年 2 月至 2021 年 1 月，任长城国融投资管理有限公司董事、党委委员、副总经理；2021 年 1 月至今，任中国长城资产管理股份有限公司资产经营六部副总经理。

方瓿华先生，复旦大学硕士，中级经济师。2009 年起，加入交通银行，历任交行上海分行市南支行、大客户二部、授信部、宝山支行行长助理等职位，主要负责营运及个人金融业务。2011 年起，调入交通银行投资部，担任高级经理，负责交行对外战略投资及对下属子公司股权管理工作。2015 年，加入上海信利股权投资基金管理有限公司并工作至今，历任高级投资经理、总经理、董事等职，同时兼任上海汇华实业有限公司总经理、上海盛业股权投资基金公司执行董事（法人代表）、上海永泰房地产开发公司总经理等职，负责公司整体运营。2018 年，出任博时基金管理公司第七届董事会董事，2021 年卸任。自 2022 年 8 月起，任博时基金管理有限公司董事。

姜立军先生，1955 年生，会计师，工商管理硕士（MBA）。1974 年 12 月参加工作，历任中国远洋运输总公司财务处科员、中国-坦桑尼亚联合海运服务公司财务部经理、日本中



铃海运服务公司财务部经理、中远(英国)公司财务部经理、香港益丰船务公司财务部经理、香港-佛罗伦租箱公司(香港上市公司)副总经理、中远太平洋有限公司(香港上市公司)副总经理、中远日本公司财务部长和营业副本部长、中远集装箱运输有限公司副总会计师等职。2002年8月至2008年7月,任中远航运股份有限公司(A股上市公司)首席执行官、董事。2008年8月至2011年12月,任中远投资(新加坡)有限公司(新加坡上市公司)总裁、董事会副主席、中远控股(新加坡)有限公司总裁;并任新加坡中资企业协会会长。2011年11月至2015年12月,任中国远洋控股股份有限公司执行(A+H上市公司)执行董事、总经理。2012年2月至2015年12月,兼任中国上市公司协会副监事长、天津上市公司协会副会长;2014年9月至2015年12月,兼任中国上市公司协会监事会专业委员会副主任委员。自2017年11月3日起,任博时基金管理有限公司独立董事。

赵如冰先生,1956年生,教授级高级工程师,国际金融专业经济学硕士研究生。赵如冰先生历任葛洲坝水力发电厂工程师、高级工程师、葛洲坝二江电厂电气分厂主任、书记;1989年月至1991年10月任葛洲坝至上海正负50万伏超高压直流输电换流站书记兼站长,主持参加了我国第一条直流输电工程的安装调试和运行。1991年10月至1995年12月任厂办公室主任兼外事办公室主任。1995年12月至1999年12月,赵如冰先生任华能南方开发公司党组书记、总经理,兼任中国华能集团董事、深圳南山热电股份有限公司(上市公司代码0037)副董事长、长城证券有限责任公司副董事长、深圳华能电讯有限公司董事长。2000年1月至2004年7月,华能南方公司被国家电力公司重组后,任华能房地产开发公司副总经理,长城证券有限责任公司副董事长。2004年7月至2009年3月,赵如冰先生任华能房地产开发公司党组书记、总经理。2009年12月至2016年8月,赵如冰先生任景顺长城基金管理公司董事长、景顺长城资产管理(深圳)公司董事长兼长城证券公司党委副书记。2016年8月至2020年3月,赵如冰先生任阳光资产管理股份有限公司副董事长;2016年8月至今,任西南证券、百隆东方独立董事,2020年3月至今深圳市深粮控股股份有限公司独立董事。自2017年11月3日起,任博时基金管理有限公司独立董事。

宋子洲先生,1960年生,中国保险资产管理业协会金融科技委员会主任委员。历任中国人寿保险公司稽核部制度处处长、资金运用部财会监督处处长、资金运用中心副总经理,中国人寿资产管理有限公司风险管理及合规部总监、首席风险官、副总裁。从事保险资金投资管理工作20余年,在保险资产管理公司的投资、运营、风险管理等方面积累了丰富的经验。自2020年12月8日起,任博时基金管理有限公司独立董事。

## 2、基金管理人监事会成员

王剑平先生，硕士。分别于1998年7月及2013年7月获得江西财经大学会计专业管理学学士及天津大学管理科学与工程专业管理学硕士学位。王剑平先生于2004年5月获会计师职称。自2006年5月开始任职于招商证券。自2011年3月至2015年6月担任招商证券财务部总经理助理，2015年6月至2017年9月担任招商证券财务部副总经理，2017年9月至2021年4月担任招商证券资金管理部副总经理（主持工作），2021年4月至2022年3月担任招商证券资金管理部总经理，自2022年3月至2022年5月任招商期货有限公司董事、招商证券资产管理有限公司董事，自2022年3月至今担任招商证券财务部总经理、招商致远资本投资有限公司董事。

蒋伟先生，硕士。2011年3月至2017年5月就职于中国长城资产管理公司，分别任办公室外事处一级业务员、业务副主管、业务主管。2017年5月至2020年7月职于长城罗斯基金管理有限公司任行政总监/执行董事。2020年7月至今任中国长城资产管理有限公司资产经营三部副高级经理（处室负责人）。

赵兴利先生，硕士。1987年至1995年就职于天津港务局计财处。1995年至2012年5月先后任天津港贸易公司财务科科长、天津港（集团）公司委派货运公司会计主管、华夏人寿保险股份有限公司财务部总经理、天津港财务有限公司常务副总经理。2012年5月至2020年6月就职于天津港（集团）有限公司金融事业部副部长，天津港（集团）有限公司计财部副部长。2020年6月至今任天津港（集团）有限公司专职董监事。自2013年3月起，任博时基金管理有限公司监事。

严斌先生，硕士。1997年7月起先后在华侨城集团公司、博时基金管理有限公司工作。现任博时基金管理有限公司财务部总经理。自2015年5月起，任博时基金管理有限公司监事。

黄健斌先生，工商管理硕士。1995年起先后在广州证券有限公司、广发基金管理有限责任公司投资管理部、中银国际基金管理有限公司基金管理部工作。2005年加入博时基金管理公司，历任固定收益部基金经理、博时平衡配置混合型基金基金经理、固定收益部副总经理、社保组合投资经理、固定收益部总经理、固定收益总部董事总经理、年金投资部总经理、公司总经理助理。现任公司首席资产配置官兼社保组合投资经理。自2016年3月18日起，担任博时基金管理有限公司监事。

车宏原先生，工学硕士。1985年至1989年在四川大学计算机系学习，获得学士学位。1989年至1992年在清华大学计算机系学习，获得硕士学位。1992年至1995年深圳市天元金融电子有限公司任技术部负责人，1995年至2000年在中国农业银行总行南方软件开发中心担任副总工程师，2001年至2003年在太极华清信息系统有限公司担任副总经理，2003年至2014年在景顺长城基金管理有限公司担任信息技术总监，2014年至2015年任中财国信（深圳）有限公司总经理，2015年至今担任博时基金管理有限公司信息技术部总经理。

### 3、高级管理人员

江向阳先生，简历同上。

高阳先生，简历同上。

吴慧峰先生，硕士，副总经理、财务负责人、董事会秘书。1996年至2023年先后在中国南山开发集团股份有限公司、上海诚南房地产开发有限公司、招商局金融集团有限公司、招商证券股份有限公司从事财务、公司管理等工作。2023年加入博时基金管理有限公司，现任公司副总经理、财务负责人、董事会秘书。

王德英先生，硕士，副总经理。1995年起先后在北京清华计算机公司任开发部经理、清华紫光股份公司CAD与信息事业部任总工程师。2000年加入博时基金管理有限公司，历任行政管理部副经理，电脑部副经理、信息技术部总经理。现任公司副总经理、首席信息官，主管IT、指数与量化投资、养老金、基金零售等工作，兼任博时财富基金销售有限公司董事长、博时资本管理有限公司董事。

徐卫先生，硕士，副总经理。1993年起先后在深圳市证券管理办公室、中国证监会、摩根士丹利华鑫基金工作。2015年6月加入博时基金管理有限公司，现任公司副总经理，兼博时资本管理有限公司董事、博时财富基金销售有限公司董事。

孙麒清女士，商法学硕士，督察长。曾供职于广东深港律师事务所。2002年加入博时基金管理有限公司，历任监察法律部法律顾问、监察法律部总经理。现任公司督察长，兼任博时资本管理有限公司副董事长、博时财富基金销售有限公司董事。

### 4、本基金基金经理

郭晓林先生，硕士。2012年从清华大学硕士研究生毕业后加入博时基金管理有限公司。历任研究员、高级研究员、高级研究员兼基金经理助理、资深研究员兼基金经理助理、资深研究员兼投资经理。现任权益投资四部投资总监助理兼博时互联网主题灵活配置混合型证券投资基金(2016年7月20日一至今)、博时汇悦回报混合型证券投资基金(2020年2月20

日一至今)、博时创业板两年定期开放混合型证券投资基金(2020年9月3日一至今)、博时新能源汽车主题混合型证券投资基金(2021年6月2日一至今)、博时新能源主题混合型证券投资基金(2021年8月24日一至今)、博时移动互联主题混合型证券投资基金(2021年9月29日一至今)、博时专精特新主题混合型证券投资基金(2021年12月6日一至今)、博时凤凰领航混合型证券投资基金(2022年4月6日一至今)、博时优享回报混合型证券投资基金(2022年8月2日一至今)的基金经理。

#### 5、投资决策委员会成员

公司总经理高阳先生。

公司首席资产配置官黄健斌先生。

首席基金经理过钧先生。

公司董事总经理兼权益投研一体化总监、权益投资四部总经理、权益投资四部投资总监、境外投资部总经理曾鹏先生。

权益投资三部投资总监蔡滨先生。

公司董事总经理兼年金投资部总经理、投资总监杨帆先生。

指数与量化投资部投资总监赵云阳先生。

行业研究部研究总监兼副总经理金晟哲先生。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

### 三、基金管理人的职责

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

2、办理基金备案手续；

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

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

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

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

- 7、依法接受基金托管人的监督；
- 8、采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回的价格；
- 9、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- 10、编制季度报告、中期报告和年度报告；
- 11、严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
- 12、保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露，但向审计、法律等外部专业顾问提供的除外；
- 13、按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；
- 14、按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
- 15、依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
- 16、按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料，保存期限不低于法律法规规定的最低期限；
- 17、确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件；
- 18、组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- 19、面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；
- 20、因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- 21、监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；
- 22、当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；



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

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

25、执行生效的基金份额持有人大会的决议；

26、建立并保存基金份额持有人名册；

27、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

#### **四、基金管理人的承诺**

1、基金管理人承诺不从事违反《中华人民共和国证券法》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《中华人民共和国证券法》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) 利用基金财产或者职务之便为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；

(4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；

(5) 侵占、挪用基金财产；

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

(7) 玩忽职守，不按照规定履行职责；

(8) 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牟取利益；
- 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

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

#### (3) 相互制约原则

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

#### (4) 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，监察部负责监察公司的风险管理措施的执行。具体而言，包括如下组成部分：

#### (1) 董事会

负责制定公司的风险管理政策，对风险管理负完全的和最终的责任。

#### (2) 风险管理委员会

作为董事会下的专业委员会之一，风险管理委员会负责批准公司风险管理系统文件，即负责确保每一个部门都有合适的系统来识别、评定和监控该部门的风险，负责批准每一个部门的风险级别。负责解决重大的突发的风险。

#### (3) 督察长

独立行使督察权利；直接对董事会负责；按季向风险管理委员会提交独立的风险管理报告和风险管理建议。

#### （4）监察法律部

监察法律部负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理系统的发展提供协助，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标。

#### （5）风险管理部

风险管理部负责建立和完善公司投资风险管理制度与流程，组织实施公司投资风险管理及绩效分析工作，确保公司各类投资风险得到良好监督与控制。

#### （6）业务部门

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

### 3、风险管理和内部风险控制措施

#### （1）建立内控结构，完善内控制度

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

#### （2）建立相互分离、相互制衡的内控机制

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

#### （3）建立、健全岗位责任制

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

#### （4）建立风险分类、识别、评估、报告、提示程序

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

#### （5）建立有效的内部监控系统

建立了足够、有效的内部监控系统，如电脑预警系统、投资监控系统，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。

## 第四部分 基金托管人

### （一）基金托管人情况

名称：杭州银行股份有限公司（简称：杭州银行）

住所：杭州市庆春路 46 号

办公地址：杭州市庆春路 46 号杭州银行大厦

邮政编码：310000

法定代表人：陈震山

成立时间：1996 年 9 月 25 日

基金托管业务批准文号：证监许可[2014]337 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：伍拾玖亿叁仟零贰拾万零肆佰叁拾贰人民币元

存续期间：持续经营

### （二）基金托管人开展资产托管业务的情况

杭州银行自 2014 年 3 月获得中国证券监督管理委员会和中国银行业监督管理委员会的核准，取得证券投资基金托管资格。目前，杭州银行已全面开展了包括证券投资基金、基金公司资管产品、证券公司资管产品、信托计划、商业银行理财产品、保险资管产品、期货公司资管产品、私募投资基金等各类资产托管业务，业务覆盖市场上所有类型的资管机构和主流业务品种。截至 2022 年 8 月末，资产托管业务余额 1.27 万亿元，合作客户超 1200 家。已成功托管货币型、混合型、债券型和指数型等各类公募基金 76 只，规模达 1692 亿元。

### （三）基金托管业务情况介绍

#### 1、资产托管业务的机构设置及人员配备

杭州银行于 2012 年 12 月成立了证券投资基金托管项目组，并于 2013 年 3 月由董事会同意在总行正式设立资产托管部，专门负责全行包括证券投资基金在内的各类资产托管业务的业务运行和管理工作，并与其他业务部门保持独立。

我行高度重视托管业务发展，组建了精通资产管理行业的“专家团队”服务客户，目前配备从业人员 57 人，其中：总经理 1 人，负责全面组织和协调资产托管部的相关工作；副总经理 1 人，分管托管营销工作；总经理助理 1 人，分管风控和运营工作；其他人员 54 人，根据岗位职责分成 4 个二级部和 5 个团队：营销管理部、托管运营部、风险合规部和业务支

持部。资产托管团队人员具有丰富的从业经验，人员来自于托管银行、外资银行、基金、证券、投行等各类型机构，具有扎实的专业理论知识和实战经验。部门从事资金清算、估值核算、投资监督、信息披露、内部稽核监控业务的执业人员 34 人，均具有基金从业资格。

## 2、托管业务技术系统

杭州银行采购了业内广泛使用的深圳赢时胜公司开发的托管业务系统，具有完善的估值核算、资金清算、投资监督和信息披露等功能，具备良好的安全性、稳定性、开放性和可扩展性。

## 3、杭州银行资产托管业务内部控制与风险管理情况

杭州银行建立了较为完善的法人治理结构，形成了从董事会、经营层到操作层，覆盖信用风险、市场风险、操作风险在内的全面风险管理体系，资产托管部也牢固树立风险意识，采取各种必要措施防范和化解风险。

### （1）建立科学、严格的岗位分离制度

杭州银行明确划分各岗位职责，系统运维、估值核算、资金清算、投资监督和内部稽核监控等重要岗位、人员严格分开，估值核算、资金清算、投资监督等能接触到基金交易数据的岗位人员进行物理分离。

### （2）建立健全授权管理体系

杭州银行制定了《杭州银行证券投资基金托管业务授权管理办法》，将授权管理贯穿于资产托管业务的始终，各岗位业务人员均在规定授权范围内行使相应职责。

### （3）建立完备的备份机制

杭州银行资产托管的业务数据及其他重要数据每日进行安全备份，定期将数据完整、真实、准确地转储到不可更改的介质上，并要求集中和异地保存，保存期限至少 20 年。资产托管部关键岗位人员也采用双人备份制度。

### （4）建立完备有效的应急措施

杭州银行制定了《杭州银行证券投资基金托管业务应急处理管理办法》，并针对托管业务备份、信息系统及资金清算等业务制定了专门的应急预案，对于各类突发事件、紧急事件或故障，定期开展应急演练，检验应急预案的有效性和可靠性。

### （5）建立严格的保密机制

杭州银行制定了《杭州银行证券投资基金托管保密管理办法》，资产托管部配备独立的门禁系统，严格禁止无关人员进入资产托管部办公区域，能接触到基金交易数据的岗位人员进行物理分离，并采用电话录音、监控录像、信息加密传递技术等手段来实现风险控制。

(6) 建立有效的内部稽核机制

杭州银行资产托管部设立稽核监控岗，直接对资产托管部总经理负责，独立对各岗位、各项业务实施全面的监督反馈，以确保杭州银行资产托管各项业务合法合规、安全有效，切实履行托管人职责。

(四)、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

基金托管人负有对基金管理人的投资运作行使监督权的职责。根据《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定，托管人对基金的投资对象和范围、投资组合比例、投资限制、费用的计提和支付方式、基金会计核算、基金资产估值和基金净值的计算、收益分配、申购赎回以及其他有关基金投资和运作的事项，对基金管理人进行业务监督、核查。

基金托管人发现基金管理人违反法律法规和基金合同的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人违反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重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时，通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

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

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



## 第五部分 相关服务机构

### 一、基金份额销售机构

#### 1、直销机构

名称：博时基金管理有限公司北京直销中心

地址：北京市建国门内大街 18 号恒基中心 1 座 23 层

电话：010-65187055

传真：010-65187032

联系人：韩明亮

博时一线通：95105568（免长途话费）

#### 2、代销机构

##### (1) 招商银行股份有限公司

注册地址：	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址：	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦
法定代表人：	缪建民
联系人：	季平伟
电话：	0755-83198888
传真：	0755-83195049
客户服务电话：	95555
网址：	<a href="http://www.cmbchina.com/">http://www.cmbchina.com/</a>

##### (2) 中信银行股份有限公司

注册地址：	北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座
办公地址：	北京市东城区朝阳门北大街 9 号文化大厦
法定代表人：	朱鹤新
联系人：	王晓琳
电话：	010-89937325
客户服务电话：	95558
网址：	<a href="http://bank.ecitic.com/">http://bank.ecitic.com/</a>

##### (3) 杭州银行股份有限公司

注册地址：	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
联系人：	严峻
电话：	0571-85108195
传真：	0571-85106576
客户服务电话：	95398

网址:	<a href="http://www.hzbank.com.cn">http://www.hzbank.com.cn</a>
-----	---

**(4) 渤海银行股份有限公司**

注册地址:	天津市河东区海河东路 218 号
办公地址:	天津市河东区海河东路 218 号
法定代表人:	李伏安
联系人:	王宏
电话:	022-58316666
传真:	022-58316569
客户服务电话:	95541
网址:	<a href="http://www.cbhb.com.cn">http://www.cbhb.com.cn</a>

**(5) 东莞农村商业银行股份有限公司**

注册地址:	广东省东莞市东城区鸿福东路 2 号
办公地址:	广东省东莞市东城区鸿福东路 2 号东莞农商银行大厦
法定代表人:	王耀球
联系人:	杨亢
电话:	0769-22866270
传真:	0769-22866282
客户服务电话:	961122
网址:	<a href="http://www.drcbank.com/">http://www.drcbank.com/</a>

**(6) 江苏苏州农村商业银行股份有限公司**

注册地址:	江苏省苏州市吴江区中山南路 1777 号
办公地址:	江苏省苏州市吴江区中山南路 1777 号
法定代表人:	徐晓军
联系人:	葛晓亮
电话:	0512-63969209
传真:	0512-63969209
客户服务电话:	956111
网址:	<a href="http://www.szrcb.com">www.szrcb.com</a>

**(7) 西安银行股份有限公司**

注册地址:	西安市高新路 60 号
办公地址:	西安市高新路 60 号
法定代表人:	郭军
联系人:	白智
电话:	029-88992881
传真:	029-88992881
客户服务电话:	4008696779
网址:	<a href="http://www.xacbank.com">www.xacbank.com</a>

**(8) 鼎信汇金（北京）投资管理有限公司**

注册地址:	北京市朝阳区霄云路 40 号院 1 号楼 3 层 306 室
办公地址:	北京市朝阳区霄云路 40 号院 1 号楼 3 层 306 室

法定代表人:	齐凌峰
联系人:	陈臣
电话:	010-84489488-8702
传真:	010-82086110
客户服务电话:	400-158-5050
网址:	www.9ifund.com

**(9) 厦门市鑫鼎盛控股有限公司**

注册地址:	厦门市思明区鹭江道2号厦门第一广场1501-1504
办公地址:	厦门市思明区鹭江道2号厦门第一广场1501-1504
法定代表人:	陈洪生
联系人:	徐明静
电话:	0592-3122716
传真:	0592-8060771
客户服务电话:	400-918-0808
网址:	www.xds.com.cn

**(10) 腾安基金销售(深圳)有限公司**

注册地址:	深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)
办公地址:	深圳市南山区海天二路33号腾讯滨海大厦15层
法定代表人:	刘明军
联系人:	谭广锋
传真:	0755-86013399
客户服务电话:	95017(拨通后转1再转8)
网址:	https://www.txfund.com/

**(11) 北京度小满基金销售有限公司**

注册地址:	北京市海淀区西北旺东路10号院西区4号楼1层103室
办公地址:	北京市海淀区西北旺东路10号院西区4号楼
法定代表人:	葛新
联系人:	孙博超
电话:	010-59403028
传真:	010-59403027
客户服务电话:	95055-4
网址:	www.duxiaomanfund.com

**(12) 博时财富基金销售有限公司**

注册地址:	广东省深圳市福田区莲花街道福新社区益田路5999号基金大厦19层
办公地址:	广东省深圳市福田区莲花街道福新社区益田路5999号基金大厦19层
法定代表人:	王德英
联系人:	崔丹

电话:	0755-83169999
传真:	0755-83195220
客户服务电话:	400-610-5568
网址:	www.boserawealth.com

**(13) 诺亚正行基金销售有限公司**

注册地址:	上海市金山区廊下镇漕廊公路 7650 号 205 室
办公地址:	上海浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 8 楼 801 室
法定代表人:	汪静波
联系人:	方成
电话:	021-38602377
传真:	021-38509777
客户服务电话:	400-821-5399
网址:	http://www.noah-fund.com

**(14) 上海天天基金销售有限公司**

注册地址:	上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层
办公地址:	上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 9 楼
法定代表人:	其实
联系人:	潘世友
电话:	021-54509998
传真:	021-64385308
客户服务电话:	400-181-8188
网址:	http://www.1234567.com.cn

**(15) 上海好买基金销售有限公司**

注册地址:	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
联系人:	张茹
电话:	021-20613610
客户服务电话:	400-700-9665
网址:	http://www.howbuy.com

**(16) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司**

注册地址:	浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路 969 号 3 幢 5 层 599 室
办公地址:	浙江省杭州市西湖区西溪路 556 号
法定代表人:	王珺
联系人:	韩爱彬
电话:	021-60897840
传真:	0571-26697013
客户服务电话:	95188-8

网址:	<a href="http://www.fund123.cn">http://www.fund123.cn</a>
-----	---

**(17) 上海长量基金销售有限公司**

注册地址:	上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室
办公地址:	上海市浦东新区东方路 1267 号 11 层
法定代表人:	张跃伟
联系人:	敖玲
电话:	021-58788678-8201
传真:	021-58787698
客户服务电话:	400-820-2899
网址:	<a href="http://www.erichfund.com">http://www.erichfund.com</a>

**(18) 浙江同花顺基金销售有限公司**

注册地址:	杭州市西湖区文二西路 1 号元茂大厦 903 室
办公地址:	浙江省杭州市余杭区五常街道同顺街 18 号同花顺大楼
法定代表人:	凌顺平
联系人:	吴杰
电话:	0571-88911818
传真:	0571-86800423
客户服务电话:	952555
网址:	<a href="http://www.5ifund.com">www.5ifund.com</a>

**(19) 上海利得基金销售有限公司**

注册地址:	上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室
办公地址:	上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼
法定代表人:	李兴春
联系人:	徐鹏
电话:	021-50583533
传真:	021-50583633
客户服务电话:	400-921-7755
网址:	<a href="http://a.leadfund.com.cn/">http://a.leadfund.com.cn/</a>

**(20) 嘉实财富管理有限公司**

注册地址:	上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心办公楼二期 46 层 4609-10 单元
办公地址:	北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 11 层
法定代表人:	赵学军
联系人:	余永健
电话:	010-85097570
传真:	010-65215433
客户服务电话:	400-021-8850
网址:	<a href="http://www.harvestwm.cn">www.harvestwm.cn</a>

**(21) 宜信普泽（北京）基金销售有限公司**

注册地址:	北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809
办公地址:	北京市朝阳区建国路 88 号 SOHO 现代城 C 座 18 层 1809
法定代表人:	戎兵
联系人:	程刚
电话:	010-52855713
传真:	010-85894285
客户服务电话:	400-609-9200
网址:	<a href="http://www.yixinfund.com">http://www.yixinfund.com</a>

**(22) 南京苏宁基金销售有限公司**

注册地址:	南京市玄武区苏宁大道 1-5 号
办公地址:	南京市玄武区苏宁大道 1-5 号
法定代表人:	钱燕飞
联系人:	喻明明
电话:	025-66996699-884131
传真:	025-66996699-884131
客户服务电话:	95177
网址:	<a href="http://www.snjijin.com">www.snjijin.com</a>

**(23) 浦领基金销售有限公司**

注册地址:	北京市朝阳区望京东园四区 2 号楼 10 层 1001 号 04 室
办公地址:	北京市朝阳区望京中航资本大厦 10 层
法定代表人:	聂婉君
联系人:	李艳
电话:	010-59497361
传真:	010-64788016
客户服务电话:	400-012-5899
网址:	<a href="http://www.zscffund.com">www.zscffund.com</a>

**(24) 北京中植基金销售有限公司**

注册地址:	北京市北京经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室
办公地址:	北京市朝阳区大望路金地中心 A 座 28 层
法定代表人:	武建华
联系人:	丛瑞丰
电话:	010-59313555
传真:	010-56642623
客户服务电话:	400-8180-888
网址:	<a href="http://www.zzfund.com">http://www.zzfund.com</a>

**(25) 北京汇成基金销售有限公司**

注册地址:	北京市西城区西直门外大街 1 号院 2 号楼(西环广场 T2) 19 层 19C13
办公地址:	北京市西城区西直门外大街 1 号院 2 号楼(西环广场 T2) 19 层 19C13



法定代表人:	王伟刚
联系人:	丁向坤
电话:	010-56282140
传真:	010-62680827
客户服务电话:	400-619-9059
网址:	www.hcjijin.com

**(26)海银基金销售有限公司**

注册地址:	中国（上海）自由贸易试验区银城中路8号402室
办公地址:	上海市浦东新区银城中路8号4楼
法定代表人:	巩巧丽
联系人:	毛林
电话:	021-80133597
传真:	021-80133413
客户服务电话:	400-808-1016
网址:	www.fundhaiyin.com

**(27)北京新浪仓石基金销售有限公司**

注册地址:	北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期（西扩）N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层518室
办公地址:	北京市海淀区西北旺东路10号院东区3号楼为明大厦C座
法定代表人:	赵芯蕊
联系人:	赵芯蕊
电话:	010-62675768
传真:	010-62676582
客户服务电话:	010-62675369
网址:	www.xincai.com

**(28)上海万得基金销售有限公司**

注册地址:	中国（上海）自由贸易试验区福山路33号11楼B座
办公地址:	上海市浦东新区浦明路1500号万得大厦11楼
法定代表人:	王廷富
联系人:	姜吉灵
电话:	021-5132 7185
传真:	021-6888 2281
客户服务电话:	400-821-0203
网址:	www.520fund.com.cn

**(29)北京坤元基金销售有限公司**

注册地址:	北京市延庆县延庆经济开发区百泉街10号2栋871室
办公地址:	北京市东城区建国门内大街8号B座501
法定代表人:	李雪松
联系人:	马镜

电话:	010-85264505
传真:	010-85264522
客户服务电话:	010-85264528
网址:	<a href="http://www.kunyuangfund.com">http://www.kunyuangfund.com</a>

**(30) 上海基煜基金销售有限公司**

注册地址:	上海市崇明县长兴镇路潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室 (上海泰和经济展展区)
办公地址:	上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 1503 室
法定代表人:	王翔
联系人:	蓝杰
电话:	021-65370077
传真:	021-55085991
客户服务电话:	400-820-5369
网址:	<a href="http://www.jiyufund.com.cn">www.jiyufund.com.cn</a>

**(31) 上海陆金所基金销售有限公司**

注册地址:	上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元
办公地址:	上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼
法定代表人:	郭坚
联系人:	宁博宇
电话:	021-20665952
传真:	021-22066653
客户服务电话:	400-821-9031
网址:	<a href="http://www.lufunds.com">www.lufunds.com</a>

**(32) 珠海盈米基金销售有限公司**

注册地址:	珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491
办公地址:	广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼 B1201-1203
法定代表人:	肖雯
联系人:	吴煜浩
电话:	020-89629099
传真:	020-89629011
客户服务电话:	020-89629066
网址:	<a href="http://www.yingmi.cn">www.yingmi.cn</a>

**(33) 和耕传承基金销售有限公司**

注册地址:	郑州市郑东新区东风南路康宁街互联网金融大厦 602
办公地址:	郑州市郑东新区东风南路康宁街互联网金融大厦 602
法定代表人:	李淑慧
联系人:	董亚芳
电话:	0371-85518391
传真:	0371-85518397

客户服务电话:	400-360-0000
网址:	www.nicaifu.com

**(34) 中证金牛（北京）基金销售有限公司**

注册地址:	北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室
办公地址:	北京市西城区宣武门外大街甲1号环球财讯中心A座5层
法定代表人:	钱昊旻
联系人:	孙雯
电话:	010-59336519
传真:	010-59336500
客户服务电话:	400-890-9998
网址:	www.jnlc.com

**(35) 京东肯特瑞基金销售有限公司**

注册地址:	北京市海淀区海淀东三街2号4层401-15
办公地址:	北京市经济开发区科创十一街18号院京东总部A座4层A428室
法定代表人:	江卉
联系人:	徐伯宇
电话:	400-098-8511
传真:	010-89188000
客户服务电话:	400-088-8816
网址:	http://jr.jd.com/

**(36) 北京雪球基金销售有限公司**

注册地址:	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:	北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507
法定代表人:	李楠
联系人:	戚晓强
电话:	15810005516
传真:	010-85659484
客户服务电话:	400-061-8518
网址:	danjuanapp.com

**(37) 中信期货有限公司**

注册地址:	深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层
办公地址:	深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层
法定代表人:	张皓
联系人:	梁美娜

电话:	021-80365243
传真:	021-60819988
客户服务电话:	400-990-8826
网址:	www.citicsf.com

**(38) 弘业期货股份有限公司**

注册地址:	南京市中华路 50 号
办公地址:	南京市中华路 50 号
法定代表人:	周剑秋
联系人:	孙朝旺
电话:	025-52278870
传真:	025-52313068
客户服务电话:	400-828-1288
网址:	www.ftol.com.cn

**(39) 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:	上海市静安区新闻路 669 号博华广场 21 层
法定代表人:	贺青
联系人:	钟伟镇
电话:	021-38676666
传真:	021-38670666
客户服务电话:	95521/4008888666
网址:	https://www.gtja.com

**(40) 中信建投证券股份有限公司**

注册地址:	北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼
办公地址:	北京市朝阳区门内大街 188 号
法定代表人:	王常青
联系人:	陈海静
电话:	010-65608231
传真:	010-65182261
客户服务电话:	4008888108/95587
网址:	http://www.csc108.com/

**(41) 国信证券股份有限公司**

注册地址:	深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层
办公地址:	深圳市福田区福华一路 125 号国信金融大厦 37 楼
法定代表人:	张纳沙
联系人:	李颖
电话:	0755-82130833
传真:	0755-82133952
客户服务电话:	95536

网址:	<a href="http://www.guosen.com.cn/">http://www.guosen.com.cn/</a>
-----	---

**(42)招商证券股份有限公司**

注册地址:	深圳市福田区福田街道福华一路 111 号
办公地址:	深圳市福田区福华一路 111 号招商证券大厦 23 楼
法定代表人:	霍达
联系人:	黄婵君
电话:	0755-82943666
传真:	0755-83734343
客户服务电话:	4008888111; 95565
网址:	<a href="http://www.newone.com.cn/">http://www.newone.com.cn/</a>

**(43)中信证券股份有限公司**

注册地址:	广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座
办公地址:	北京朝阳区新源南路 6 号京城大厦
法定代表人:	张佑君
联系人:	杜杰
电话:	010-60833889
传真:	010-84865560
客户服务电话:	400-889-5548/95548
网址:	<a href="http://www.cs.ecitic.com/">http://www.cs.ecitic.com/</a>

**(44)中国银河证券股份有限公司**

注册地址:	北京市丰台区西营街 8 号院 1 号楼 7 至 18 层 101
办公地址:	北京市丰台区西营街 8 号院 1 号楼青海金融大厦
法定代表人:	陈亮
联系人:	辛国政
电话:	010-80928123
客户服务电话:	4008-888-888 或 95551
网址:	<a href="http://www.chinastock.com.cn/">http:// www.chinastock.com.cn/</a>

**(45)海通证券股份有限公司**

注册地址:	上海市淮海中路 98 号
办公地址:	上海市广东路 689 号海通证券大厦
法定代表人:	周杰
联系人:	李笑鸣
电话:	021-23219275
传真:	021-63602722
客户服务电话:	95553
网址:	<a href="http://www.htsec.com/">http://www.htsec.com/</a>

**(46)申万宏源证券有限公司**

注册地址:	上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层
办公地址:	上海市徐汇区长乐路 989 号世纪商贸广场 45 层

法定代表人:	杨玉成
联系人:	陈宇
电话:	021-33388999
传真:	021-33388224
客户服务电话:	95523 或 4008895523
网址:	www.swhysc.com

**(47)长江证券股份有限公司**

注册地址:	武汉市新华路特 8 号长江证券大厦
办公地址:	武汉市新华路特 8 号长江证券大厦
法定代表人:	李新华
联系人:	奚博宇
电话:	027-65799999
传真:	027-85481900
客户服务电话:	95579;4008-888-999
网址:	http://www.95579.com/

**(48)安信证券股份有限公司**

注册地址:	深圳市福田区福田街道福华一路 119 号安信金融大厦
办公地址:	深圳市福田区福田街道福华一路 119 号安信金融大厦
法定代表人:	黄炎勋
联系人:	刘志斌
电话:	0755-82558266
客户服务电话:	95517
网址:	http://www.essence.com.cn/

**(49)西南证券股份有限公司**

注册地址:	重庆市江北区桥北苑 8 号
办公地址:	重庆市江北区桥北苑 8 号西南证券大厦
法定代表人:	廖庆轩
联系人:	周青
电话:	023-67616310
传真:	023-63786212
客户服务电话:	4008096096
网址:	http://www.swsc.com.cn

**(50)湘财证券股份有限公司**

注册地址:	湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼
办公地址:	湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼
法定代表人:	林俊波
联系人:	孙越
电话:	021-38784580-8920



客户服务电话:	95351
网址:	<a href="http://www.xcsc.com">http://www.xcsc.com</a>

**(51) 万联证券股份有限公司**

注册地址:	广州市天河区珠江东路 11 号 18、19 楼全层
办公地址:	广东省广州市天河区珠江东路 13 号高德置地广场 E 座 12 层
法定代表人:	袁笑一
联系人:	丁思
电话:	020-83988334
传真:	020-22373718-1013
客户服务电话:	95322
网址:	<a href="http://www.wlzq.cn">http://www.wlzq.cn</a>

**(52) 渤海证券股份有限公司**

注册地址:	天津经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室
办公地址:	天津市南开区宾水西道 8 号
法定代表人:	安志勇
联系人:	王星
电话:	022-23861692
传真:	022-28451892
客户服务电话:	4006515988
网址:	<a href="http://www.ewww.com.cn">http://www.ewww.com.cn</a>

**(53) 华泰证券股份有限公司**

注册地址:	南京市江东中路 228 号
办公地址:	办公地址 南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场、 深圳市福田区深南大道 4011 号港中旅大厦 18 楼
法定代表人:	张伟
联系人:	陈森
电话:	0755-22660831
传真:	0755-82492962 (深圳)
客户服务电话:	95597
网址:	<a href="http://www.htsc.com.cn/">http://www.htsc.com.cn/</a>

**(54) 山西证券股份有限公司**

注册地址:	太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼
办公地址:	太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼
法定代表人:	侯巍
联系人:	郭熠
电话:	0351-8686659
传真:	0351-8686619
客户服务电话:	4006661618
网址:	<a href="http://www.i618.com.cn/">http://www.i618.com.cn/</a>

**(55) 中信证券（山东）有限责任公司**

注册地址：	青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼 20 层
办公地址：	青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东 2、5 层
法定代表人：	冯恩新
联系人：	赵如意
电话：	0532-85022026
传真：	0532-85022605
客户服务电话：	95548
网址：	<a href="http://www.cs.ecitic.com/newsite/">http://www.cs.ecitic.com/newsite/</a>

**(56) 东吴证券股份有限公司**

注册地址：	江苏省苏州市翠园路 181 号
办公地址：	江苏省苏州市星阳街 5 号
法定代表人：	范力
联系人：	陆晓
电话：	0512-62938521
传真：	0512-65588021
客户服务电话：	4008601555
网址：	<a href="http://www.dwjq.com.cn">http://www.dwjq.com.cn</a>

**(57) 信达证券股份有限公司**

注册地址：	北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼
办公地址：	北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼
法定代表人：	张志刚
联系人：	王薇安
电话：	010-83252170
传真：	010-63081344
客户服务电话：	95321
网址：	<a href="http://www.cindasc.com">http://www.cindasc.com</a>

**(58) 光大证券股份有限公司**

注册地址：	上海市静安区新闻路 1508 号
办公地址：	上海市静安区新闻路 1508 号
法定代表人：	刘秋明
联系人：	李芳芳
电话：	021-22169089
传真：	021-22169134
客户服务电话：	4008888788；95525
网址：	<a href="http://www.ebscn.com/">http://www.ebscn.com/</a>

**(59) 中信证券华南股份有限公司**

注册地址：	广州市天河区珠江西路 5 号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
联系人:	郭杏燕
电话:	020-88836999
传真:	020-88836984
客户服务电话:	95548
网址:	<a href="http://www.gzs.com.cn">http://www.gzs.com.cn</a>

**(60) 东北证券股份有限公司**

注册地址:	长春市生态大街 6666 号
办公地址:	长春市生态大街 6666 号
法定代表人:	李福春
联系人:	安岩岩
电话:	0431-85096517
传真:	0431-85096795
客户服务电话:	95360
网址:	<a href="http://www.nesc.cn">http://www.nesc.cn</a>

**(61) 南京证券股份有限公司**

注册地址:	江苏省南京市玄武区大钟亭 8 号
办公地址:	江苏省南京市玄武区大钟亭 8 号
法定代表人:	李剑锋
联系人:	潘月
电话:	025-52310569
传真:	025-52310586
客户服务电话:	4008285888
网址:	<a href="http://www.njzq.com.cn">http://www.njzq.com.cn</a>

**(62) 大同证券有限责任公司**

注册地址:	山西省大同市平城区迎宾街 15 号桐城中央 21 层
办公地址:	山西省太原市小店区长治路 111 号山西世贸中心 A 座 F12、F13
法定代表人:	董祥
联系人:	薛津
电话:	0351-4130322
传真:	0351-7219891
客户服务电话:	4007121212
网址:	<a href="http://www.dtsbc.com.cn">www.dtsbc.com.cn</a>

**(63) 平安证券股份有限公司**

注册地址:	广东省深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层
办公地址:	广东省深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

	层
法定代表人:	何之江
联系人:	王阳
电话:	021-38632136
传真:	0755-82400862
客户服务电话:	0755-22628888/95511-8
网址:	<a href="http://www.stock.pingan.com">http://www.stock.pingan.com</a>

**(64) 华安证券股份有限公司**

注册地址:	安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号
办公地址:	安徽省合肥市南二环 959 号财智中心 B1 座
法定代表人:	章宏韬
联系人:	孙懿
电话:	0551-65161821
传真:	0551-65161672
客户服务电话:	95318
网址:	<a href="http://www.hazq.com/">http://www.hazq.com/</a>

**(65) 东莞证券有限责任公司**

注册地址:	东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼
办公地址:	东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼
法定代表人:	陈照星
联系人:	叶玉琪
电话:	0769-22119351
传真:	0769-22115712
客户服务电话:	95328
网址:	<a href="http://www.dgzq.com.cn">http://www.dgzq.com.cn</a>

**(66) 东海证券股份有限公司**

注册地址:	江苏省常州延陵西路 23 号投资广场 18 层
办公地址:	上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦
法定代表人:	钱俊文
联系人:	王一彦
电话:	021-20333333
传真:	021-50498825
客户服务电话:	95531; 4008888588
网址:	<a href="http://www.longone.com.cn">http://www.longone.com.cn</a>

**(67) 恒泰证券股份有限公司**

注册地址:	内蒙古呼和浩特市赛罕区敕勒川大街东方君座 D 座光大银行办公楼 14-18 楼
办公地址:	内蒙古呼和浩特市赛罕区敕勒川大街东方君座 D 座光大银行办公楼 14-18 楼
法定代表人:	庞介民

联系人:	熊丽
电话:	0471-4972675
客户服务电话:	956088
网址:	<a href="http://www.cnht.com.cn/">http://www.cnht.com.cn/</a>

**(68) 国盛证券有限责任公司**

注册地址:	江西省南昌市新建区子实路 1589 号
办公地址:	江西省南昌市红谷滩新区凤凰中大道 1115 号北京银行大厦
法定代表人:	周军
联系人:	占文驰
电话:	0791-86283372
传真:	0791-6289395
客户服务电话:	956080
网址:	<a href="https://www.gszq.com/">https://www.gszq.com/</a>

**(69) 华西证券股份有限公司**

注册地址:	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
联系人:	赵静静
电话:	010-58124967
传真:	028-86150040
客户服务电话:	95584
网址:	<a href="http://www.hxl68.com.cn">http://www.hxl68.com.cn</a>

**(70) 申万宏源西部证券有限公司**

注册地址:	新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室
办公地址:	新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室
法定代表人:	王献军
联系人:	梁丽
电话:	0991-2307105
传真:	010-88085195
客户服务电话:	95523 或 4008895523
网址:	<a href="http://www.swhysc.com">www.swhysc.com</a>

**(71) 中泰证券股份有限公司**

注册地址:	山东省济南市经十路 20518 号
办公地址:	山东省济南市经七路 86 号 23 层
法定代表人:	李玮
联系人:	朱琴
电话:	021-20315161

传真:	0531-68889357
客户服务电话:	95538
网址:	www.zts.com.cn

**(72)西部证券股份有限公司**

注册地址:	陕西省西安市新城东大街319号8幢10000室
办公地址:	西安市新城东大街319号
法定代表人:	徐朝晖
联系人:	张吉安
电话:	029-87211668
传真:	029-87406117
客户服务电话:	95582
网址:	http://www.west95582.com/

**(73)华龙证券股份有限公司**

注册地址:	兰州市城关区东岗西路638号兰州财富中心21楼
办公地址:	甘肃省兰州市城关区东岗西路638号财富大厦19楼
法定代表人:	祁建邦
联系人:	周鑫
电话:	0931-4890208
传真:	0931-4890628
客户服务电话:	95368/400689888
网址:	http://www.hlzq.com/

**(74)华鑫证券有限责任公司**

注册地址:	深圳市福田区莲花街道福中社区深南大道2008号中国凤凰大厦1栋20C-1房
办公地址:	上海市徐汇区宛平南路8号
法定代表人:	俞洋
联系人:	刘熠
电话:	021-54967656
传真:	021-64333051
客户服务电话:	95323, 021-32109999, 029-68918888
网址:	http://www.cfsc.com.cn

**(75)中山证券有限责任公司**

注册地址:	深圳市南山区创业路1777号海信南方大厦21、22层
办公地址:	深圳市南山区创业路1777号海信南方大厦21、22层
法定代表人:	吴小静
联系人:	罗艺琳
电话:	0755-82943755
传真:	0755-82960582
客户服务电话:	95329
网址:	http://www.zszq.com



**(76) 东方财富证券股份有限公司**

注册地址:	西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城 10 栋楼
办公地址:	上海市徐汇区宛平南路 88 号金座东方财富大厦
法定代表人:	戴彦
联系人:	付佳
电话:	021-23586603
传真:	021-23586860
客户服务电话:	95357
网址:	<a href="http://www.18.cn">http://www.18.cn</a>

**(77) 粤开证券股份有限公司**

注册地址:	广州经济技术开发区科学大道 60 号开发区控股中心 21、22、23 层
办公地址:	深圳市福田区深南中路 2002 号中广核大厦北楼 10 层
法定代表人:	严亦斌
联系人:	彭莲
电话:	0755-83331195
客户服务电话:	95564
网址:	<a href="http://www.ykzq.com">http://www.ykzq.com</a>

**(78) 九州证券股份有限公司**

注册地址:	青海省西宁市城中区西大街 11 号
办公地址:	北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 D 座 5 层
法定代表人:	魏先锋
联系人:	张晓黎
电话:	010-57672186
传真:	-
客户服务电话:	4006543218
网址:	<a href="http://www.tyzq.com.cn">http://www.tyzq.com.cn</a>

**(79) 国金证券股份有限公司**

注册地址:	四川省成都市东城根上街 95 号
办公地址:	四川省成都市东城根上街 95 号
法定代表人:	冉云
联系人:	贾鹏
电话:	028-86690057、028-86690058
传真:	028-86690126
客户服务电话:	4006-600109/95310
网址:	<a href="http://www.gjzq.com.cn">http://www.gjzq.com.cn</a>

**(80) 长城国瑞证券有限公司**

注册地址:	厦门市思明区深田路 46 号深田国际大厦 20 楼
办公地址:	厦门市思明区深田路 46 号深田国际大厦 20 楼
法定代表人:	李鹏

联系人:	布前
电话:	010-68080680
传真:	0592-2079228
客户服务电话:	0592-5163588
网址:	<a href="http://www.xmzq.cn">http://www.xmzq.cn</a>

**(81) 爱建证券有限责任公司**

注册地址:	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1600 号 1 幢 32 楼
办公地址:	上海市浦东新区世纪大道 1600 号 32 楼
法定代表人:	祝健
联系人:	姚盛盛
电话:	021-32229888
传真:	021- 68728703
客户服务电话:	4001-962-502
网址:	<a href="http://www.ajzq.com">http://www.ajzq.com</a>

**(82) 国新证券股份有限公司**

注册地址:	北京市西城区车公庄大街 4 号 2 幢 1 层 A2112 室
办公地址:	北京市朝阳区朝阳门北大街 18 号中国人保寿险大厦 12 层
法定代表人:	张海文
联系人:	孙燕波
电话:	010-85556048
客户服务电话:	95390
网址:	<a href="http://www.crsec.com.cn">http://www.crsec.com.cn</a>

**(83) 天风证券股份有限公司**

注册地址:	湖北省武汉市武昌区中南路 99 号保利广场 A 座 37 楼
办公地址:	湖北省武汉市武昌区中南路 99 号保利广场 A 座 37 楼
法定代表人:	余磊
联系人:	王雅薇
电话:	027-87107535
客户服务电话:	400-800-5000/ 95391
网址:	<a href="http://www.tfzq.com/">http://www.tfzq.com/</a>

**(84) 首创证券股份有限公司**

注册地址:	北京市西城区德胜门外大街 115 号德胜尚城 E 座
办公地址:	北京市朝阳区安定路 5 号院北投投资大厦 A 座 18 层
法定代表人:	毕劲松
联系人:	刘宇
电话:	010-81152418
传真:	010-81152982
客户服务电话:	95381

网址:	www.sczq.com.cn
-----	-----------------

**(85) 开源证券股份有限公司**

注册地址:	陕西省西安市高新区锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层
办公地址:	陕西省西安市高新区锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层
法定代表人:	李刚
联系人:	张蕊
电话:	029-88365809
传真:	86-29-88365835
客户服务电话:	95325 /400-860-8866
网址:	http://www.kysec.cn/

**(86) 阳光人寿保险股份有限公司**

注册地址:	海南省三亚市迎宾路 360-1 号三亚阳光金融广场 16 层
办公地址:	北京市朝阳区朝外大街 20 号联合大厦 701A 室
法定代表人:	李科
联系人:	王超
电话:	010-59053660
传真:	010-85632773
客户服务电话:	95510
网址:	http://fund.sinosig.com/

**(87) 长城华西银行股份有限公司**

注册地址:	四川省德阳市蒙山街 14 号
办公地址:	四川省德阳市蒙山街 14 号
法定代表人:	谭运财
联系人:	鄢露林
电话:	0838-6821177
传真:	0838-2371812
客户服务电话:	0838-96836
网址:	www.gwbank.com.cn

**(88) 龙江银行股份有限公司**

注册地址:	黑龙江省哈尔滨市道里区友谊路 436 号
办公地址:	黑龙江省哈尔滨市道里区友谊路 436 号
法定代表人:	张建辉
联系人:	闫勇
电话:	0451-85706107
传真:	0451-85706107
客户服务电话:	4006458888
网址:	www.lj-bank.com

**(89) 兰州银行股份有限公司**

注册地址:	甘肃省兰州市城关区酒泉路 211 号
办公地址:	甘肃省兰州市城关区酒泉路 211 号

法定代表人：	许建平
联系人：	鱼倩
电话：	0931-4600239
传真：	0931-4600239
客户服务电话：	0931-96799
网址：	www.lzbank.com

## 二、登记机构

名称：博时基金管理有限公司

住所：深圳市福田区莲花街道福新社区益田路 5999 号基金大厦 21 层

办公地址：北京市东城区建国门内大街 8 号中粮广场 C 座 6 层 609

法定代表人：江向阳

电话：010-65171166

传真：010-65187068

联系人：何京京

## 三、出具法律意见书的律师事务所

名称：上海源泰律师事务所

注册地址：上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼

负责人：廖海

电话：021- 51150298

传真：021- 51150398

联系人：刘佳

经办律师：刘佳、刘翠

## 四、审计基金财产的会计师事务所

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室

办公地址：北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室

执行事务合伙人：毛鞍宁

联系电话：（010）58153000

传真电话：（010）85188298

经办注册会计师： 王珊珊、朱燕

联系人：朱燕

## 第六部分 基金的募集与基金合同的生效

### 一、基金的募集

基金管理人按照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定募集本基金，并经中国证监会 2021 年 3 月 25 日证监许可[2021]992 号文准予募集注册。

本基金募集期自 2021 年 7 月 20 日至 2021 年 8 月 20 日期间，基金份额共募集 670,155,140.81 份（含利息结转的份额），募集有效认购总户数为 53,188 户。

本基金的运作方式为契约型开放式，存续期间为不定期。

### 二、基金合同的生效

本基金的基金合同已于 2021 年 8 月 24 日正式生效。

### 三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

基金合同生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当在十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并在六个月内召集基金份额持有人大会进行表决。

法律法规或监管机构另有规定时，从其规定。



## 第七部分 基金份额的申购与赎回

### 一、申购与赎回的场所

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

### 二、申购与赎回办理的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

本基金已于 2021 年 11 月 24 日开放日常申购、赎回业务。

#### 2、申购、赎回开始日及业务办理时间

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

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

在确定申购开始与赎回开始时间后,基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告申购与赎回的开始时间。

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

### 三、申购与赎回的原则

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

2、“金额申购、份额赎回”原则,即申购以金额申请,赎回以份额申请;

3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销;

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

5、办理申购、赎回业务时,应当遵循基金份额持有人利益优先原则,确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待。

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

#### 四、申购与赎回的数额限制

1、首次申购基金份额的单笔最低金额为 10 元（含申购费），追加申购的单笔最低金额  
为 10 元（含申购费）；详情请见当地销售机构公告；

2、每个交易账户最低持有基金份额余额为 10 份，若某笔赎回导致单个交易账户的基金  
份额余额少于 10 份时，余额部分基金份额必须一同赎回；

3、投资人通过销售机构赎回基金份额时，本基金单笔某一类基金份额赎回申请不得低  
于 10 份，若投资者单个交易账户持有的某类基金份额余额不足 10 份，将不受此限制，但投  
资者在提交赎回申请时须将该类基金份额全部赎回。各销售机构在符合上述规定的前提下，  
可根据自己的情况调整单笔赎回申请限制，具体以销售机构公布的为准，投资人需遵循销售  
机构的相关规定；

4、本基金目前对单个投资人累计持有份额不设上限限制，但法律法规或监管机构另有  
规定或基金合同另有约定的除外。将来，基金管理人可以规定单个投资者累计持有的基金份  
额数量限制，具体规定见更新的招募说明书或相关公告；

5、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。具体见基金管理人相关公告；

6、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量  
限制。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

#### 五、申购与赎回的程序

##### 1、申购和赎回的申请方式

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

##### 2、申购和赎回的款项支付

投资人申购基金份额时，必须全额交付申购款项，投资人全额交付申购款项，申购成立；  
基金份额登记机构确认基金份额时，申购生效。

基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；基金份额登记机构确认赎回时，赎回生效。投资者赎回申请生效后，基金管理人将在 T+7 日(包括该日)内支付赎回款项。在发生巨额赎回或基金合同约定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。

如遇交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障、港股通交易系统或港股通资金交收规则限制或其他非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响了业务流程，则赎回款项划付时间相应顺延至该因素消除的最近一个工作日。

### 3、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T 日)，在正常情况下，本基金登记机构在 T+1 日内对该交易的有效性进行确认。T 日提交的有效申请，投资人应在 T+2 日后(包括该日)及时到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成立或无效，则申购款项本金退还给投资人。

基金销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购、赎回申请的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资者应及时查询。

基金管理人可以在法律法规和基金合同允许的范围内，对上述业务办理时间进行调整，并在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

## 六、申购费率、赎回费率

1、投资者可以多次申购本基金，A 类基金份额申购费率按每笔申购申请单独计算。

本基金 A 类基金份额收取申购费用，C 类基金份额不收取申购费用。投资者的申购费用如下：

表 2：本基金的申购费率

金额 (M)	A 类基金份额申购费率	C 类基金份额申购费率
M < 100 万元	1.50%	0%
100 万元 ≤ M < 300 万元	1.00%	
300 万元 ≤ M < 500 万元	0.60%	
M ≥ 500 万元	1,000 元/笔	

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

基金管理人可以针对特定投资人(如养老金客户等)开展费率优惠活动，具体见基金管理人相关公告。

## 2、本基金赎回费率

表 3：本基金 A、C 类基金份额的赎回费率表

持有期限 (N)	A 类基金份额赎回费率	C 类基金份额赎回费率
N<7 日	1.50%	1.50%
7 日≤N<30 日	0.75%	0.50%
30 日≤N<6 个月	0.50%	0.00%
N≥6 个月	0.00%	

注：1 个月指 30 日

本基金的赎回费用在投资者赎回本基金份额时收取，扣除用于市场推广、登记费和其他手续费后的余额归基金财产。对于 A 类基金份额，本基金对持续持有期少于 30 日的投资人收取的赎回费，全额计入基金资产；对持续持有期不少于 30 日但少于 3 个月的投资人收取的赎回费，75%计入基金资产；对持续持有期不少于 3 个月但少于 6 个月的投资人收取的赎回费，50%计入基金资产。对于 C 类基金份额，对持续持有期少于 30 日的投资人收取的赎回费全额计入基金财产。

基金管理人可以针对特定投资人（如养老金客户等）开展费率优惠活动，具体见基金管理人相关公告。

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。

## 七、申购份额与赎回金额的计算方式

### 1、申购金额的计算方式：

#### (1) A 类基金份额

申购费用适用比例费率的情形下：

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

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

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

申购费用适用固定金额的情形下：

$$\text{申购费用} = \text{固定金额}$$

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

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

例 1：假定 T 日 A 类基金份额净值为 1.0560 元，某投资人申购本基金 A 类基金份额 40 万元，对应的申购费率为 1.50%，该投资人可得到的 A 类基金份额为：

净申购金额=400,000/(1+1.50%)=394,088.67 元

申购费用=400,000-394,088.67=5,911.33 元

申购份额=394,088.67/1.0560=373,190.03 份

即：该投资人投资 40 万元申购本基金 A 类基金份额，假定申购当日 A 类基金份额净值为 1.0560 元，可得到 373,190.03 份 A 类基金份额。

例 2：假定 T 日 A 类基金份额净值为 1.0560 元，某投资人投资 1,000 万元申购本基金 A 类基金份额，其对应的申购费用为 1,000 元，则其可得到的申购份额为：

申购费用=1,000 元

净申购金额=10,000,000-1,000=9,999,000 元

申购份额=9,999,000/1.0560=9,468,750.00 份

即，该投资人投资 1,000 万元申购本基金 A 类基金份额，假定申购当日 A 类基金份额净值为 1.0560 元，可得到 9,468,750.00 份 A 类基金份额。

## (2) C 类基金份额

申购份额=申购金额/申购当日 C 类基金份额净值

例：假设某投资者投资 10 万元申购本基金 C 类基金份额，申购当日本基金 C 类基金份额净值为 1.0600 元，则可得到的申购份额为：

申购份额=100,000/1.0600=94,339.62 份

即：投资者投资 10 万元申购本基金 C 类基金份额，假设申购当日本基金 C 类基金份额净值为 1.0600 元，则其可得到 94,339.62 份 C 类基金份额。

## 2、赎回金额的计算方式：

赎回总金额=赎回份额×T 日该类基金份额净值

赎回费用=赎回总金额×赎回费率

净赎回金额=赎回总金额-赎回费用

例：某投资者赎回本基金 1 万份 A 类基金份额，持有时间为三年，对应的赎回费率为 0%，假设赎回当日 A 类基金份额净值是 1.2500 元，则其可得到的赎回金额为：

赎回总金额=10,000×1.2500=12,500.00 元

赎回费用=12,500×0%=0.00 元

净赎回金额=12,500-0=12,500.00 元

即：投资者赎回本基金 1 万份 A 类基金份额，持有时间为三年，假设赎回当日 A 类基金份额净值是 1.2500 元，则其可得到的赎回金额为 12,500.00 元。

3、本基金各类基金份额净值的计算，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。T 日的各类基金份额净值在当天收市后计算，并按照基金合同约定公告。遇特殊情况，经履行适当程序，可以适当延迟计算或公告。

4、申购份额的计算及余额的处理方式：申购的有效份额为净申购金额除以当日的该类基金份额净值，有效份额单位为份，上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

5、赎回金额的计算及处理方式：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。上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

6、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定情形下，且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，根据市场情况制定基金促销计划，定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金的申购费率、赎回费率和销售服务费率。

7、当本基金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。

## 八、申购与赎回的登记

1、经基金销售机构同意，基金投资者提出的申购和赎回申请，在基金管理人规定的时间之前可以撤销。

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

3、投资人赎回基金成功后，登记机构在 T+1 日为投资者办理扣除权益的登记手续。

4、基金管理人可以在法律法规允许的范围内，对上述登记办理时间进行调整，但不得实质影响投资者的合法权益，并最迟于开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定进行公告。

## 九、拒绝或暂停申购的情形及处理

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：



- 1、因不可抗力导致基金无法正常运作。
- 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况。
- 3、证券、期货交易所或外汇市场交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
- 4、接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益或对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响。
- 5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或发生其他损害现有基金份额持有人利益的情形。
- 6、基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术故障等异常情况导致基金销售系统、基金登记系统或基金会计系统无法正常运行。
- 7、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接受基金申购申请。
- 8、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过 50%，或者变相规避 50%集中度的情形。
- 9、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第 1、2、3、5、6、7、9 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人申购申请时，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。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项本金将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

#### **十、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形**

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

- 1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。
- 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况。
- 3、证券、期货交易所或外汇市场交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
- 4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。
- 5、发生继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形。
- 6、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，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请。



7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形（第4项除外）之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时，基金管理人应按规定报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，未支付部分可延期支付。若出现上述第4项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

## 十一、巨额赎回的情形及处理方式

### 1、巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过前一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

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

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

（2）部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一工作日基金总份额的10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的该类基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。部分延期赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

（3）本基金发生巨额赎回时，对于单个基金份额持有人当日赎回申请超过上一工作日基金总份额10%以上的部分，基金管理人可以对其进行延期办理（被延期赎回的赎回申请，将自动转入下一个开放日继续赎回，延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优

先权并以下一开放日的该类基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止)；对于该基金份额持有人申请赎回的份额中未超过上一工作日基金总份额 10% 的部分，基金管理人应在评估是否有能力支付投资人的全部赎回申请后，按照全额赎回或部分延期赎回的方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。但是，如该持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。

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

### 3、巨额赎回的公告

当发生上述巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，并于两日内在规定媒介上刊登公告。

## 十二、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

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

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

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

## 十三、基金转换

本基金已于 2021 年 11 月 24 日开放基金转换业务。

### 5.1 转换费率

基金转换费用由转出基金赎回费和申购费补差两部分构成，其中：申购费补差具体收取情况，视每次转换时的两只基金的申购费率的差异情况而定。基金转换费用由基金持有人承担。

### 5.2 其他与转换相关的事项

#### 1) 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。

②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它基金(申购费为零的基金视同为前端收费模式)，后端收费模式的基金可以转换到前端或后端收费模式的其它基金，非 QDII 基金不能与 QDII 基金进行互转。

③基金转换的目标基金份额按新交易计算持有时间。基金转出视为赎回，转入视为申购。基金转换后可赎回的时间为 T+2 日。

④基金分红时再投资的份额可在权益登记日的 T+2 日提交基金转换申请。

⑤基金转换以申请当日基金份额净值为基础计算。投资者采用“份额转换”的原则提交申请。转出基金份额必须是可用份额，并遵循“先进先出”的原则。

## 2) 暂停基金转换的情形及处理

基金转换视同为转出基金的赎回和转入基金的申购,因此暂停基金转换适用有关转出基金和转入基金关于暂停或拒绝申购、暂停赎回的有关规定。

出现法律、法规、规章规定的其它情形或其它在《基金合同》、《招募说明书》已载明并获中国证监会批准的特殊情形时，基金管理人可以暂停基金转换业务。

## 3) 重要提示

①本基金转换业务适用于可以销售包括本基金在内的两只以上(含两只)，且基金注册登记机构为同一机构的博时旗下基金的销售机构。

②转换业务的收费计算公式及举例参见 2010 年 3 月 16 日刊登于本公司网站的《博时基金管理有限公司关于旗下开放式基金转换业务的公告》。

③本公司管理基金的转换业务的解释权归本公司。

## 十四、基金份额的转让

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

## 十五、基金的非交易过户

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

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

## 十六、基金的转托管

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

## 十七、定期定额投资计划

本基金已于 2021 年 11 月 24 日开放日常定期定额投资计划业务。

### （1）适用投资者范围

个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会规定允许购买证券投资基金的其他投资者。

### （2）申购费率

本基金定期定额投资的申购费率与普通申购业务的费率相同，见上文。

### （3）扣款日期和扣款金额

投资者须遵循各销售机构有关扣款日期的规定，定投金额 A 类基金份额每次不少于人民币 10 元（含 10 元），定投金额 C 类基金份额每次不少于人民币 10 元（含 10 元）。

### （4）重要提示

1) 凡申请办理本基金“定期定额投资计划”的投资者须首先开立本公司开放式基金基金账户。

2) 本基金定期定额投资计划的每月实际扣款日即为基金申购申请日，并以该日（T 日）的基金份额净值为基准计算申购份额。投资者可以从 T+2 日起通过本定期定额投资计划办理网点、致电本公司客服电话或登录本公司网站查询其每次申购申请的确认情况。申购份额将在确认成功后直接计入投资者的基金账户。

## 十八、基金份额的冻结、解冻与质押

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。基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益一并冻结，被冻结部分份额仍然参与收益分配与支付。法律法规或基金合同另有规定的除外。

对基金份额持有人无实质不利影响的前提下，如相关法律法规允许，基金管理人履行相关程序后可办理基金份额的质押业务或其他基金业务，基金管理人将制定和实施相应的业务规则。

#### **十九、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本招募说明书“侧袋机制”章节或相关公告。

## 第八部分 基金的投资

### 一、投资目标

本基金主要投资于新能源主题的上市公司股票。在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。

### 二、投资范围

本基金的投资范围包括国内依法发行或上市的股票（含中小板、创业板、及其他经中国证监会核准上市或准予注册的股票、存托凭证）、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许买卖的香港证券市场股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（国债、金融债、企业债、公司债、政府支持债券、政府支持机构债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、可交换债、次级债等）、资产支持证券、金融衍生品（包括股指期货、国债期货、股票期权、信用衍生品等）、债券回购、同业存单、银行存款（包含协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、现金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相关规定）。

本基金可根据相关法律法规和基金合同的约定参与融资业务。

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

基金的投资组合比例为：本基金股票资产（含存托凭证）占基金资产的比例为 60%—95%，港股通标的股票的投资比例为股票资产的 0%—50%。其中，投资于本基金界定的新能源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国债期货、股指期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值的 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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

### 三、投资策略

本基金投资策略分三个层次：首先是大类资产配置，即根据经济周期决定权益类证券和固定收益类证券的投资比例；其次是行业配置，即根据行业发展规律和内在逻辑，在不同行业之间进行动态配置；最后是个股选择策略和债券投资策略等。

#### （一）大类资产配置策略



本基金通过跟踪考量宏观经济变量（包括 GDP 增长率、CPI 走势、M2 的绝对水平和增长率、利率水平与走势、外汇占款等）及国家财政、税收、货币、汇率各项政策，判断经济周期当前所处的位置及未来发展方向，并通过监测重要行业的产能利用与经济景气轮动研究，调整股票资产和固定收益资产的配置比例。

## （二）股票投资策略

### 1、新能源主题界定与行业选择

本基金所指的新能源主题主要关注以下产业的投资机会：

（1）新能源生产和利用相关行业（包括太阳能、风能、核能、生物质能、地热能、海洋能和氢能等的生产和利用）；

（2）新能源相关的工程建设、能源传输和运营行业（包括新能源电站的建设、智能电网、电站运营、分布式能源管理、合同能源管理等）；

（3）储能和交互设备的生产和研发行业（包括电池、电容器、充电桩、电缆等的研发生产制造，及与其相关的部分有色和化工行业）；

（4）能源互联网相关行业（利用现代电力技术和信息技术，将分布式的电力网络节点互联，以实现能量智能交换与共享的相关行业）；

（5）新能源汽车相关行业（包括纯电动汽车、混合动力汽车和燃料电池汽车生产及配套行业）；

（6）新能源设备和节能设备制造相关行业；

未来随着技术进步创新，从事或受益于新能源领域的外延可能会逐步扩大，本基金将在履行适当程序后，视实际情况调整上述对该主题股票的识别及认定。

### 2、个股选择策略

本基金采用定性和定量相结合的方法深入分析挖掘新能源主题股票的投资价值，甄选流动性良好的优质个股进行投资。

#### （1）定性分析

深入考察相关企业的产业环境、政策环境、市场格局、技术优势、销售渠道、治理结构、激励机制等方面，选择基本面良好且具有持续发展潜力的优质个股。

#### （2）定量分析

具体考量以下三类指标，以识别具备潜在盈利弹性或持续成长能力、估值合理的个股进行投资。



成长性指标：行业增速和潜在市场空间，产业潜在空间/公司市值比，收入增长率，息税折旧前利润（EBITDA）增长率，经营性活动现金流入增长率，自由现金流增长率；

财务指标：毛利率、营业利润率、净资产收益率、投入资本回报率、经营性活动现金净流量、自由现金流净额、研发费用/收入比，息税折旧前利润/收入比，

估值指标：市销率（P/S），市净率（P/B）、市现率（P/CF）和总市值；

### 3、港股通标的股票投资策略

本基金基金资产通过港股通投资，将重点关注以下几类港股通标的股票：1）在港股市场上市，属于新能源产业，掌握核心技术优势、市场竞争力强的代表性企业；2）港股市场在行业竞争结构、估值、AH股折溢价、股息率等方面具有吸引力的投资标的。

### 4、存托凭证投资策略

本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。

## （三）债券投资策略

本基金采用的债券投资策略包括：期限结构策略、信用策略、互换策略、息差策略、可转换债券及可交换债券投资策略等。

### 1、期限结构策略

通过预测收益率曲线的形状和变化趋势，对各类型债券进行久期配置。具体策略又分为跟踪收益率曲线的骑乘策略和基于收益率曲线变化的子弹策略、杠铃策略及梯式策略。

### 2、信用策略

信用债收益率等于基准收益率加信用利差，信用利差收益主要受两个方面的影响，一是该信用债对应信用水平的市场平均信用利差曲线走势；二是该信用债本身的信用变化。基于这两方面的因素，本基金管理人分别采用基于信用利差曲线变化策略和基于信用债信用变化策略。

### 3、互换策略

不同券种在利息、违约风险、久期、流动性、税收和衍生条款等方面存在差别，基金管理人可以同时买入和卖出具有相近特性的两个或两个以上券种，赚取收益级差。

### 4、息差策略

通过正回购，融资买入收益率高于回购成本的债券，从而获得杠杆放大收益。

### 5、可转换债券及可交换债券投资策略

本基金利用宏观经济变化和上市公司的盈利变化，判断市场的变化趋势，选择不同的行业，再根据可转换债券的特性选择各行业不同的转债券种。本基金利用可转换债券的债券底价和到期收益率来判断转债的债性，增强本金投资的相对安全性；利用可转换债券溢价率来判断转债的股性，在市场出现投资机会时，优先选择股性强的品种，获取超额收益。

可交换债券在换股期间用于交换的股票是发行人持有的其他上市公司(以下简称“目标公司”)的股票。可交换债券同样兼具股票和债券的特性。其中,债券特性与可转换债券相同,指持有至到期获取的票面利息和票面价值。股票特性则指目标公司的成长能力、盈利能力及目标公司股票价格的成长性等。本基金将通过对可交换债券的纯债价值和目标公司的股票价值进行研究分析,综合开展投资决策。

#### (四) 衍生品投资策略

##### 1、股指期货、国债期货投资策略

本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与股指期货、国债期货的投资,以管理投资组合的系统性风险,改善组合的风险收益特性。

##### 2、股票期权投资策略

本基金将按照风险管理的原则,以套期保值为主要目的参与股票期权交易。本基金将结合投资目标、比例限制、风险收益特征以及法律法规的相关限定和要求,确定参与股票期权交易的投资时机和投资比例。

本基金投资股票期权,基金管理人将根据审慎原则,建立股票期权交易决策部门或小组,授权特定的管理人员负责股票期权的投资审批事项,以防范股票期权投资的风险。

##### 3、信用衍生品投资策略

依托于基金管理人整体的信用研究团队,当预期某只债券有较高的违约风险时,可以购买对应债券的信用衍生品来控制标的债券的信用风险冲击。本基金按风险管理的原则,以风险对冲为目的参与信用衍生品交易,同时会根据实际情况尽量保持信用衍生品的名义本金与对应标的债券的面值相一致。

#### (五) 资产支持证券投资策略

本基金将通过对资产支持证券基础资产及结构设计的研究,结合多种定价模型,根据基金资产组合情况适度进行资产支持证券的投资。

#### (六) 流通受限证券投资策略

本基金将根据基金管理人的净资本规模，以及本基金的投资风格和流动性特点，兼顾基金投资的安全性、流动性和收益性，合理控制基金投资流通受限证券的比例。

#### （七）参与融资业务的投资策略

为了更好地实现投资目标，在综合考虑预期风险、收益、流动性等因素的基础上，本基金可参与融资业务。

未来随着证券市场投资工具的发展和丰富，在符合有关法律法规规定的前提下，本基金可在履行适当程序后，相应调整和更新相关投资策略。

### 四、投资限制

#### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）股票资产（含存托凭证）占基金资产的比例为 60%—95%，港股通标的股票的投资比例为股票资产的 0%—50%。其中，投资于本基金界定的新能源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国债期货、股指期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值的 5% 的现金或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（含存托凭证），其市值（若同时持有一家公司发行的 A 股和 H 股，则为 A 股与 H 股合计市值）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（含存托凭证），不超过该证券（若同时持有一家公司发行的 A 股和 H 股，则为 A 股与 H 股合计）的 10%；

（5）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%；

（6）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%；

（7）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%；

（8）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%；

(9) 本基金应投资于信用评级评级为 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;

(10) 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;

(11) 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%, 进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为 1 年, 债券回购到期后不得展期;

(12) 本基金参与股指期货、国债期货投资的, 应遵循下列限制:

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) 每个交易日日终, 本基金持有的买入股指期货和国债期货合约价值和有价证券市值之和, 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%;

5) 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规定;

6) 本基金在任何交易日日终, 持有的买入国债期货合约价值, 不得超过基金资产净值的 15%;

7) 本基金在任何交易日日终, 持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%;

8) 本基金在任何交易日内交易(不包括平仓)的国债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 30%;

9) 本基金所持有的债券(不含到期日在一年以内的政府债券)市值和买入、卖出国债期货合约价值, 合计(轧差计算)应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定;

(13) 本基金参与股票期权交易的, 需遵守下列规定:

- 1) 因未平仓的股票期权合约支付和收取的权利金总额不得超过基金资产净值的 10%;
  - 2) 开仓卖出认购股票期权的, 应持有足额标的证券; 开仓卖出认沽股票期权的, 应持有合约行权所需的全额现金或交易所规则认可的可冲抵股票期权保证金的现金等价物;
  - 3) 未平仓的股票期权合约面值不得超过基金资产净值的 20%。其中, 合约面值按照行权价乘以合约乘数计算;
    - (14) 本基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%;
    - (15) 本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票, 不得超过该上市公司可流通股票的 15%; 本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票, 不得超过该上市公司可流通股票的 30%;
    - (16) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的 15%; 因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合该比例限制的, 基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;
    - (17) 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;
    - (18) 本基金不持有具有信用保护卖方属性的信用衍生品, 不持有合约类信用衍生品, 本基金持有的信用衍生品名义本金不得超过本基金中所对应受保护债券面值的 100%;
    - (19) 本基金投资于同一信用保护卖方各类信用衍生品名义本金合计不得超过基金资产净值的 10%; 因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前述所规定比例限制的, 基金管理人应在 3 个月之内进行调整;
    - (20) 本基金参与融资的, 每个交易日日终, 本基金持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和, 不得超过基金资产净值的 95%;
    - (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 (2)、(9)、(16)、(17)、(19) 情形之外, 因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的, 基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整, 但法律法规或中国证监会规定的特殊情形除外。
- 基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内, 本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。



如果法律法规或监管部门对上述投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制，自动遵守届时有效的法律法规或监管规定。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

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

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，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，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。

法律、行政法规或监管部门取消或变更上述限制规定，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准。

## 五、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为： $\text{中证新能源指数收益率} \times 70\% + \text{中证港股通综合指数(人民币)} \text{收益率} \times 10\% + \text{中债综合财富(总值)指数收益率} \times 20\%$

中证新能源指数以中证全指为样本空间，选取涉及可再生能源生产、新能源应用、新能源存储以及新能源交互设备等业务的上市公司股票作为成份股，以反映新能源产业相关上市公司的整体表现，为市场提供多样化的投资标的。中证港股通综合指数(人民币)选取符合港股通资格的普通股作为样本股，采用自由流通市值加权计算，以反映港股通范围内上市公司的整体状况和走势。中债综合财富(总值)指数由中央国债登记结算有限责任公司编制，

样本债券涵盖的范围全面，具有广泛的市场代表性，涵盖主要交易市场（银行间市场、交易所市场等）、不同发行主体（政府、企业等）和期限（长期、中期、短期等），能够很好地反映中国债券市场总体价格水平和变动趋势。

如果指数编制单位停止计算编制以上指数或更改指数名称、或今后法律法规发生变化、或有更适当的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，本基金管理人可以根据本基金的投资范围和投资策略，在取得基金托管人同意且按照监管部门要求履行适当程序后调整基金的业绩比较基准并及时公告，无须召开基金份额持有人大会审议。

## 六、风险收益特征

本基金是混合型基金，其预期收益和预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。本基金如果投资港股通标的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。

## 七、基金管理人代表基金行使股东或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或债权人权利，保护基金份额持有人的利益；

2、不谋求对上市公司的控股；

3、有利于基金财产的安全与增值；

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

## 八、侧袋机制的实施和投资运作安排

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

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

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

## 九、基金投资组合报告

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



基金托管人根据本基金合同规定，复核了本报告中的净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至 2022 年 6 月 30 日，本报告中所列财务数据未经审计。

#### 1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	454,110,626.29	81.00
	其中：股票	454,110,626.29	81.00
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	804,218.95	0.14
	其中：债券	804,218.95	0.14
	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	102,900,513.40	18.35
8	其他各项资产	2,818,663.34	0.50
9	合计	560,634,021.98	100.00

注：权益投资中通过港股通机制投资香港股票金额 417,366.93 元，净值占比 0.08%。

#### 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	7,917,505.22	1.44
C	制造业	422,376,815.23	77.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	18,393.44	0.00
F	批发和零售业	309,304.08	0.06
G	交通运输、仓储和邮政业	9,336,167.40	1.70
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,503,882.52	2.28
J	金融业	38,710.56	0.01
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	188,670.50	0.03

M	科学研究和技术服务业	716,389.38	0.13
N	水利、环境和公共设施管理业	273,147.12	0.05
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	14,273.91	0.00
S	综合	-	-
	合计	453,693,259.36	82.72

## 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（%）
公用事业	417,366.93	0.08
合计	417,366.93	0.08

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

## 3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002466	天齐锂业	297,000	37,065,600.00	6.76
2	002709	天赐材料	553,700	34,362,622.00	6.26
3	603799	华友钴业	353,959	33,845,559.58	6.17
4	300014	亿纬锂能	306,800	29,913,000.00	5.45
5	300750	宁德时代	44,400	23,709,600.00	4.32
6	601012	隆基绿能	308,000	20,522,040.00	3.74
7	002756	永兴材料	112,400	17,108,404.00	3.12
8	002460	赣锋锂业	103,000	15,316,100.00	2.79
9	002594	比亚迪	39,300	13,106,157.00	2.39
10	002176	江特电机	497,500	12,457,400.00	2.27

## 4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-

2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	804,218.95	0.15
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	804,218.95	0.15

## 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	113059	福莱转债	3,760	478,639.04	0.09
2	113053	隆22转债	2,360	325,579.91	0.06

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

## 10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 11 投资组合报告附注

11.1 基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的投资决策程序说明

本基金投资的前十名证券的发行主体中,江西赣锋锂业股份有限公司在本期报告编制期间被中国证券监督管理委员会立案调查。本基金对上述证券的投资决策程序符合相关法规及公司制度的要求。

除上述主体外,基金管理人未发现本基金投资的前十名证券发行主体出现本期被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

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

### 11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	447,231.44
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	25,023.28
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,346,408.62
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,818,663.34

### 11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## 第九部分 基金的业绩

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

自基金合同生效开始，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

博时新能源主题混合 A

期间	①净值增长率	②净值增长率标准差	③业绩比较基准收益率	④业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
2021.08.24-2021.12.31	-2.53%	1.12%	1.42%	1.50%	-3.95%	-0.38%
2022.01.01-2022.06.30	-3.27%	2.15%	-1.38%	1.83%	-1.89%	0.32%
2021.08.24-2022.06.30	-5.72%	1.78%	0.02%	1.69%	-5.74%	0.09%

博时新能源主题混合 C

期间	①净值增长率	②净值增长率标准差	③业绩比较基准收益率	④业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
2021.08.24-2021.12.31	-2.74%	1.12%	1.42%	1.50%	-4.16%	-0.38%
2022.01.01-2022.06.30	-3.56%	2.15%	-1.38%	1.83%	-2.18%	0.32%
2021.08.24-2022.06.30	-6.20%	1.78%	0.02%	1.69%	-6.22%	0.09%

## 第十部分 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、银行存款本息、基金应收款项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价值。

### 三、基金财产的账户

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

### 四、基金财产的保管和处分

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

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

## 第十一部分 基金资产的估值

### 一、估值日

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

### 二、估值对象

基金所拥有的股票、股指期货合约、国债期货合约、股票期权合约、债券和银行存款本息、应收款项、资产支持证券、信用衍生品、其它投资等资产及负债。

### 三、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。

(一)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。

(二)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。

(三)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。

### 四、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，最近交易日后经济环境未发生重大变化且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（基金合同另有规定的除外），选取估值日第三方估值机构提供的相应品种对应的估值净价估值，具体估值机构由基金管理人与基金托管人另行协商约定；

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

交易所上市实行全价交易的固定收益品种（可转换债券除外），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固定收益品种（税后）应收利息得到的净价进行估值；

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

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

(2) 首次公开发行未上市或未挂牌转让的股票和债券，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) 流通受限的股票，指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、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。

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

5、同一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。

6、本基金投资股指期货合约、国债期货合约，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。

7、本基金投资股票期权，根据相关法律法规以及监管部门的规定估值。

8、本基金投资信用衍生品，信用衍生品按照第三方机构提供的当日估值价进行估值，但基金管理人依法应当承担的估值责任不因委托而免除。选定的第三方机构未提供估值价格的，依照有关法律法规及企业会计准则要求，采用合理估值技术确定公允价值。

9、汇率  
本基金外币资产价值计算中，涉及主要货币对人民币汇率的，应当以基金估值日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价为准；涉及到其它币种与人民币之间的汇率，参照数据服务商提供的当日各种货币兑美元折算率采用套算的方法进行折算。

10、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。

11、本基金参与融资业务，按照相关法律法规和行业协会的相关规定进行估值。

12、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。

13、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净值的计算结果对外予以公布。

## 五、估值程序

1、各类基金份额净值是按照每个估值日，该类基金资产净值除以当日该类基金份额的余额数量计算，均精确到 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。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人于每个估值日计算基金资产净值及各类基金份额净值，并按规定公告。

2、基金管理人应每个估值日对基金资产估值。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。基金管理人每个估值日对基金资产估值后，将各类基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人按规定对外公布。

## 六、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。当任一类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，视为该类基金份额净值错误。

基金合同的当事人应按照以下约定处理：

### 1、估值错误类型

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

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

### 2、估值错误处理原则

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

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

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

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

### 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后,有关的当事人应当及时进行处理,处理的程序如下:

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

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

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

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

### 4、基金份额净值估值错误处理的方法如下:

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

(2) 错误偏差达到该类基金份额净值的 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;错误偏差达到该类基金份额净值的 0.5%时,基金管理人应当公告,并报中国证监会备案。

(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。如果行业另有通行做法,基金管理人、基金托管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。

## 七、暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场或外汇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、法律法规规定、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

#### **八、基金净值的确认**

基金资产净值和各类基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个估值日计算当日的基金资产净值和各类基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金净值按约定予以公布。

#### **九、特殊情况的处理**

1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 12 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

2、由于有关会计制度变化或不可抗力原因，或由于证券、期货交易所或登记结算公司及存款银行等第三方机构发送的数据错误、遗漏等非基金管理人与基金托管人原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

#### **十、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，暂停披露侧袋账户各类份额净值。

## 第十二部分 基金的收益与分配

### 一、基金利润的构成

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

### 二、基金可供分配利润

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

### 三、基金收益分配原则

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

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资，且基金份额持有人可对 A 类、C 类基金份额分别选择不同的分红方式；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各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、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在符合法律法规及基金合同约定，并对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人与基金托管人协商一致后可对基金收益分配原则和支付方式进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

### 四、收益分配方案

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

### 五、收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，按规定在规定媒介公告。

### 六、基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持

有人的现金红利自动转为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、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，详见本招募说明书“侧袋机制”章节的规定。



## 第十三部分 基金的费用与税收

### 一、基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、C类基金份额的销售服务费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用，法律法规、中国证监会另有规定的除外；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、公证费、诉讼费和仲裁费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券、期货、股票期权交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、账户开户费用、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、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

### 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.20%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，按照协商一致的方式于次月前3个工作日内从基金财产中一次性进行支付。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，支付日期顺延。

#### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.20%年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，按照协商一致的方式于次月前3个工作日内从基金财产中一次性进行支付。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，支付日期顺延。

### 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0.60%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，按照协商一致的方式于次月前3个工作日内从基金财产中一次性进行支付。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类”中第4—11项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

### 三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

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

### 四、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，详见本招募说明书“侧袋机制”章节的规定。

### 五、基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。基金财产投资的相关税收，由基金份额持有人承担，基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。



## 第十四部分 基金的会计与审计

### 一、基金会计政策

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

### 二、基金的年度审计

- 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的符合《证券法》规定的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意。
- 3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所需按规定在规定媒介公告。

## 第十五部分 基金的信息披露

一、本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《流动性风险管理规定》、《基金合同》及其他有关规定。相关法律法规关于信息披露的规定发生变化时，本基金从其最新规定。

### 二、信息披露义务人

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

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

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

### 三、本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

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

- （一）基金招募说明书、基金产品资料概要、《基金合同》、基金托管协议

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

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

基金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。基金管理人应当依照法律法规和中国证监会的规定编制、披露与更新基金产品资料概要。

基金合同生效后，基金招募说明书、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，更新基金招募说明书和基金产品资料概要，并登载在规定网站上，其中基金产品资料概要还应当登载在基金销售机构网站或营业网点。除此之外，基金招募说明书、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，除基金合同另有约定外，基金管理人可以不再更新基金招募说明书和基金产品资料概要。

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。

基金募集申请经中国证监会注册后，基金管理人在基金份额发售的3日前，将基金份额发售公告、基金招募说明书提示性公告和基金合同提示性公告登载在规定报刊上，将基金份额发售公告、基金招募说明书、基金产品资料概要、基金合同和基金托管协议登载在规定网站上，其中基金产品资料概要还应当登载在基金销售机构网站或营业网点；基金托管人应当同时将《基金合同》、基金托管协议登载在规定网站上。

#### （二）基金份额发售公告

基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告。

#### （三）《基金合同》生效公告

基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日在规定报刊和规定网站上登载《基金合同》生效公告。

#### （四）基金净值信息

《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周在规定网站公告一次各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。

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

基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在规定网站公告半年度和年度最后一日各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。

#### （五）基金份额申购、赎回价格

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

（六）基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告（含资产组合季度报告）

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，将年度报告登载于规定网站上，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《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。

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

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

#### （七）临时报告

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当按规定编制临时报告书，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;
- 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、变更基金管理人的实际控制人;
- 8、基金募集期延长或提前结束募集;
- 9、基金管理人的高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动;
- 10、基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十;
- 11、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;
- 12、涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼或仲裁;
- 13、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;
- 14、基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券,或者从事其他重大关联交易事项,中国证监会另有规定的情形除外;
- 15、基金收益分配事项;
- 16、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;
- 17、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;
- 18、基金改聘会计师事务所;
- 19、更换基金登记机构;

- 20、本基金开始办理申购、赎回；
- 21、本基金发生巨额赎回并延期办理；
- 22、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；
- 23、本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；
- 24、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；
- 25、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；
- 26、调整基金份额类别的设置；
- 27、基金推出新业务或服务；
- 28、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和基金合同约定的其他事项。

#### （八）澄清公告

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

#### （九）清算报告

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

#### （十）基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

#### （十一）投资股指期货、国债期货、股票期权的信息披露

基金管理人应当在基金季度报告、基金中期报告、基金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、国债期货、股票期权交易情况，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、国债期货、股票期权交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标等。

#### （十二）投资资产支持证券的信息披露

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

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

#### （十三）投资港股通标的股票的信息披露

基金管理人应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中按届时有有效的法律法规或监管机构的要求披露本基金参与港股通标的股票交易的相关情况。若中国证监会对公开募集证券投资基金投资港股通标的股票的信息披露另有规定的，从其规定。

#### （十四）投资流通受限证券的信息披露

基金管理人应在基金年度报告及中期报告中披露其持有的流通受限证券总额、流通受限证券市值占基金净资产的比例和报告期内所有的流通受限证券明细。基金管理人应在基金季度报告中披露其持有的流通受限证券总额、流通受限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 名流通受限证券明细。

#### （十五）参与融资业务的信息披露

本基金参与融资业务，基金管理人应在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露参与融资交易情况，包括投资策略、业务开展情况、损益情况、风险及其管理情况等。

#### （十六）投资信用衍生品的信息披露

基金管理人应当在定期报告及招募说明书（更新）等文件中详细披露信用衍生品的投资情况，包括投资策略、持仓情况等，并充分揭示投资信用衍生品对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资目标及策略。

#### （十七）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，详见本招募说明书“侧袋机制”章节的规定。

#### （十八）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的规定。

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

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。

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。

## 七、信息披露文件的存放与查阅

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

## 八、暂停或延迟信息披露的情形

- 1、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；
- 2、基金投资所涉及的证券、期货交易所或外汇市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 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，发生暂停估值的情形；
- 4、法律法规规定、中国证监会或基金合同认定的其他情形。

## 第十六部分 侧袋机制

### 一、侧袋机制的实施条件、实施程序和特定资产范围

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

特定资产包括：（1）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；（2）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；（3）其他资产价值存在重大不确定性的资产。

### 二、侧袋机制实施期间的基金运作安排

#### （一）基金份额的申购与赎回

1、侧袋机制实施期间，基金管理人不得办理侧袋账户份额的申购、赎回和转换。基金份额持有人申请申购、赎回或转换侧袋账户份额的，该申购、赎回或转换申请将被拒绝。

2、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基金估值，并暂停接受基金申购赎回申请或延缓支付赎回款项。

3、基金管理人依法保障主袋账户份额持有人享有基金合同约定的赎回权利，并根据主袋账户运作情况合理确定申购事项，具体事项届时由基金管理人在相关公告中规定。

对于启用侧袋机制当日收到的赎回申请，基金管理人仅办理主袋账户的赎回申请并支付赎回款项。在启用侧袋机制当日收到的申购申请，视为投资者对侧袋机制启用后的主袋账户提交的申购申请。

#### （二）基金份额的登记

侧袋机制实施期间，基金管理人对侧袋账户份额实行独立管理，主袋账户沿用原基金代码，侧袋账户使用独立的基金代码。侧袋账户份额的名称以“基金简称+侧袋标识 S+侧袋账户建立日期”格式设定，同时主袋账户份额的名称增加大写字母 M 标识作为后缀。基金所有侧袋账户注销后，将取消主袋账户份额名称中的 M 标识。

启用侧袋机制当日，基金管理人和基金服务机构将以基金份额持有人的原有账户份额为基础，确认相应侧袋账户持有人名册和份额。

侧袋账户资产完全清算后，基金管理人将注销侧袋账户。

### （三）基金的投资及业绩

侧袋机制实施期间，本基金的各项投资运作指标和基金业绩指标应当以主袋账户资产为基准。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。

基金管理人、基金服务机构在展示基金业绩时，将就前述情况进行充分的解释说明，避免引起投资者误解。

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，但因资产流动性受限等中国证监会规定的情形除外。

### （四）基金的估值

侧袋机制启用当日，基金管理人以完成日终估值后的基金净资产为基数对主袋账户和侧袋账户的资产进行分割，与特定资产可明确对应的资产类科目余额、除应交税费外的负债类科目余额一并纳入侧袋账户。基金管理人应将特定资产作为一个整体，不能仅分割其公允价值无法确定的部分。

侧袋机制实施期间，基金管理人将对侧袋账户单独设置账套，实行独立核算。如果本基金同时存在多个侧袋账户，不同侧袋账户将分开进行核算。侧袋账户的会计核算应符合《企业会计准则》的相关要求。

### （五）基金的费用

侧袋机制实施期间，侧袋账户资产不收取管理费。如法律法规对于侧袋账户资产托管费的收取另有规定的，以法律法规最新要求为准。因启用侧袋机制产生的咨询、审计费用等由基金管理人承担。

基金管理人可以将与侧袋账户有关的费用从侧袋账户资产中列支，但应待特定资产变现后方可列支。

### （六）基金的收益分配

侧袋机制实施期间，在主袋账户份额满足基金合同收益分配条件的情形下，基金管理人可对主袋账户份额进行收益分配。侧袋账户份额不再适用基金合同的收益与分配条款。

### （七）基金的信息披露

#### 1、基金净值信息

侧袋机制实施期间，基金管理人应当暂停披露侧袋账户的各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。

#### 2、定期报告



侧袋机制实施期间，基金定期报告中的基金会计报表仅需针对主袋账户进行编制。侧袋账户相关信息在定期报告中单独进行披露，包括但不限于：

- (1) 侧袋账户的基金代码、基金名称、侧袋账户成立日期等基本信息；
- (2) 侧袋账户的初始资产、初始负债；
- (3) 特定资产的名称、代码、发行人等基本信息；
- (4) 报告期内的特定资产处置进展情况、与处置特定资产相关的费用情况及其他与特定资产状况相关的信息；
- (5) 可根据特定资产处置进展情况披露特定资产的可变现净值或净值参考区间，该净值或净值区间并不代表特定资产最终的变现价格，不作为基金管理人对特定资产最终变现价格的承诺；
- (6) 可能对投资者利益存在重大影响的其他情况及相关风险提示。

### 3、临时报告

基金管理人在启用侧袋机制、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应及时发布临时公告。

启用侧袋机制的临时公告内容应当包括启用原因及程序、特定资产流动性和估值情况、对投资者申购赎回的影响、风险提示等重要信息。

处置特定资产的临时公告内容应当包括特定资产处置价格和时间、向侧袋账户份额持有人支付的款项、相关费用发生情况等重要信息。侧袋机制实施期间，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将按规定及时发布临时公告。

#### (八) 特定资产处置清算

基金管理人将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款项。无论侧袋账户资产是否全部完成变现，基金管理人都将及时向侧袋账户份额持有人支付已变现部分对应的款项。

#### (九) 侧袋的审计

基金管理人应当在启用侧袋机制和终止侧袋机制后，及时聘请符合《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，具体如下：

基金管理人应当在启用侧袋机制时，就特定资产认定的相关事宜取得符合《证券法》规定的会计师事务所的专业意见。



基金管理人应当在启用侧袋机制后五个工作日内，聘请于侧袋机制启用日发表意见的会计师事务所针对侧袋机制启用日本基金持有的特定资产情况出具专项审计意见，内容应包含侧袋账户的初始资产、份额、净资产等信息。

会计师事务所对基金年度报告进行审计时，应对报告期间基金侧袋机制运行相关的会计核算和年报披露，执行适当程序并发表审计意见。

当侧袋账户资产全部完成变现后，基金管理人应参照基金清算报告的相关要求，聘请符合《证券法》规定的会计师事务所对侧袋账户进行审计并披露专项审计意见。

三、本部分关于侧袋机制的相关规定，凡是直接引用法律法规或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，或将来法律法规或监管规则针对侧袋机制的内容有进一步规定的，基金管理人经与基金托管人协商一致并履行适当程序后，在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，可直接对本部分内容进行修改、调整或补充，无需召开基金份额持有人大会审议。

## 第十六部分 风险揭示

### 一、投资于本基金的主要风险

投资于本基金的主要风险有：

#### 1、市场风险

证券市场价格受到各种因素的影响，导致基金收益水平变化而产生风险，主要包括：

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

（2）经济周期风险。随着经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化。

（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。

（4）通货膨胀风险。如果发生通货膨胀，基金投资于证券所获得的收益可能会被通货膨胀抵消，从而影响基金资产的保值增值。

（5）再投资风险。再投资风险反映了利率下降对固定收益证券利息收入再投资收益的影响，这与利率上升所带来的价格风险（即利率风险）互为消长。

#### （6）波动性风险

波动性风险主要存在于可转债的投资中，具体表现为可转债的价格受到其相对应股票价格波动的影响，同时可转债还有信用风险与转股风险。转股风险指相对应股票价格跌破转股价，不能获得转股收益，从而无法弥补当初付出的转股期权价值。

#### 2、信用风险

信用风险主要指债券、资产支持证券等信用证券发行主体信用状况恶化，导致信用评级下降甚至到期不能履行合约进行兑付的风险，另外，信用风险也包括证券交易对手因违约而产生的证券交割风险。

#### 3、流动性风险

流动性风险是指因证券市场交易量不足，导致证券不能迅速、低成本地变现的风险。流动性风险还包括基金出现巨额赎回，致使没有足够的现金应付赎回支付所引致的风险。

#### （1）基金申购、赎回安排

本基金基于客户集中度控制、巨额赎回监测及应对在投资者申购赎回方面均明确了管理机制，在接受申购申请对存量客户利益构成潜在重大不利影响，或基金的净赎回申请超过7

个工作日可变现资产的可变现价值，以及市场大幅波动、流动性枯竭等极端情况下发生无法应对投资者巨额赎回的情形时，基金管理人在保障投资者合法权益的前提下可按照法律法规及基金合同的规定，审慎确认申购赎回申请并综合运用各类流动性风险管理工具作为辅助措施，全面应对流动性风险。

#### （2）拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

本基金的投资市场主要为证券交易所、期货交易所、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（包括国内依法发行或上市 的股票、港股通标的股票、债券、股指期货、国债期货、股票期权、信用衍生品和货币市场工具等），同时本基金基于分散投资的原则在行业 and 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

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

#### （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

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

#### （5）启用侧袋机制的风险

当本基金启用侧袋机制时，实施侧袋机制期间，侧袋账户份额将停止披露各类基金份额净值，并不得办理申购、赎回和转换。因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。

#### 4、操作风险

操作风险是指基金运作过程中,因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险,例如,越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误、IT 系统故障等风险。

#### 5、管理风险

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

#### 6、合规风险

合规风险指基金管理或运作过程中,违反国家法律、法规的规定,或者违反《基金合同》有关规定的风险。

#### 7、本基金的特有风险

(1) 本基金为混合型基金,存在大类资产配置风险,有可能因为受到经济周期、市场环境或管理人能力等因素的影响,导致基金的大类资产配置比例偏离最优化水平,给基金投资组合的绩效带来风险。本基金管理人将发挥专业研究优势,加强对市场、上市公司基本面和固定收益类产品的深入研究,持续优化组合配置,以控制特定风险。

本基金不低于 80%的非现金基金资产将投资于新能源主题相关的上市公司发行的证券,该类证券的特定风险即成为本基金及投资者主要面对的特定投资风险,其投资收益会受到宏观经济、政府产业政策、市场需求变化、行业波动和公司自身经营状况等因素的影响,可能存在所选投资标的的成长性与市场一致预期不符而造成个股价格表现低于预期的风险。因此,本基金所投资的新能源主题相关证券可能在一定时期内表现与其他未投资的证券不同,造成本基金的收益低于其他基金,或波动率高于其他基金或市场平均水平。此外,由于本基金还可以投资其它品种,这些品种的价格也可能因市场中的各类变化而出现一定幅度的波动,产生特定的风险,并影响到整体基金的投资收益。

#### (2) 港股通机制下,港股投资风险

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许投资的香港联合交易所(以下简称:“香港联交所”或“联交所”)上市的股票,除与其他投资于内地市场股票的基金所面临的共同风险外,本基金还面临港股通机制下因投

资环境、投资者结构、投资标的构成、市场制度以及交易规则等差异所带来的特有风险，包括但不限于：

1) 市场联动的风险

与内地 A 股市场相比，港股市场上外汇资金流动更为自由，海外资金的流动对港股价格的影响巨大，港股价格与海外资金流动表现出高度相关性，本基金在参与港股市场投资时受到全球宏观经济和货币政策变动等因素所导致的系统风险相对更大。

2) 股价波动的风险

港股市场实行 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），同时对个股不设涨跌幅限制，加之香港市场结构性产品和衍生品种类相对丰富以及做空机制的存在，港股股价受到意外事件影响可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动，本基金持仓的波动风险可能相对较大。

3) 汇率风险

在现行港股通机制下，港股的买卖是以港币报价，以人民币进行支付，并且资金不留港（港股交易后结算的净资金余额头寸以换汇的方式兑换为人民币），故本基金每日的港股买卖结算将进行相应的港币兑人民币的换汇操作，本基金承担港元对人民币汇率波动的风险，以及因汇率大幅波动引起账户透支的风险。

另外本基金对港股买卖每日结算中所采用的报价汇率可能存在报价差异，本基金可能需额外承担买卖结算汇率报价点差所带来的损失；同时根据港股通的规则设定，本基金在每日买卖港股申请时将参考汇率买入/卖出价冻结相应的资金，该参考汇率买入价和卖出价设定上存在比例差异，以抵御该日汇率波动而带来的结算风险，本基金将因此而遭遇资金被额外占用进而降低基金投资效率的风险。

4) 港股通额度限制

现行的港股通规则，对港股通设有总额度以及每日额度上限的限制；本基金可能因为港股通市场总额度或每日额度不足，而不能买入看好之投资标的进而错失投资机会的风险。

5) 港股通可投资标的范围调整带来的风险

现行的港股通规则，对港股通下可投资的港股范围进行了限制，并定期或不定期根据范围限制规则对具体的可投资标的进行调整，对于调出在投资范围的港股，只能卖出不能买入；本基金可能因为港股通可投资标的范围的调整而不能及时买入看好的投资标的，而错失投资机会的风险。

#### 6) 港股通交易日设定的风险

根据现行的港股通规则，只有沪/深港两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但港股通不能如常进行交易），而导致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。

#### 7) 交收制度带来的基金流动性风险

由于香港市场实行 T+2 日（T 日买卖股票，资金和股票在 T+2 日才进行交收）的交收安排，本基金在 T 日（港股通交易日）卖出股票，T+2 日（港股通交易日，即为卖出当日之后第二个港股通交易日）才能在香港市场完成清算交收，卖出的资金在 T+3 日才能回到人民币资金账户。因此交收制度的不同以及港股通交易日的设定原因，本基金可能面临卖出港股后资金不能及时到账，而造成支付赎回款日期比正常情况延后而给投资者带来流动性风险，同时也存在不能及时调整基金资产组合中 A 股和港股投资比例，造成比例超标的风险。

#### 8) 港股通下对公司行为的处理规则带来的风险

根据现行的港股通规则，本基金因所持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交所上市证券，只能通过港股通卖出，但不得买入；因港股通股票权益分派或者转换等情形取得的香港联交所上市股票的认购权利在联交所上市的，可以通过港股通卖出，但不得行权；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联交所上市证券，可以享有相关权益，但不得通过港股通买入或卖出。

本基金存在因上述规则，利益得不到最大化甚至受损的风险。

#### 9) 香港联合交易所停牌、退市等制度性差异带来的风险

香港联交所规定，在交易所认为所要求的停牌合理而且必要时，上市公司方可采取停牌措施。此外，不同于内地 A 股市场的停牌制度，联交所对停牌的具体时长并没有量化规定，只是确定了“尽量缩短停牌时间”的原则；同时与 A 股市场存在退市可能的上市公司根据其财务状况在证券简称前加入相应标记（例如，ST 及\*ST 等标记）以警示投资者风险的做法不同，在香港联交所市场没有风险警示板，联交所采用非量化的退市标准且在上市公司退市过程中拥有相对较大的主导权，使得联交所上市公司的退市情形较 A 股市场相对复杂。



因该等制度性差异,本基金可能存在因所持个股遭遇非预期性的停牌甚至退市而给基金带来损失的风险。

#### 10) 港股通规则变动带来的风险

本基金是在港股通机制和规则下参与香港联交所证券的投资,受港股通规则的限制和影响;本基金存在因港股通规则变动而带来基金投资受阻或所持资产组合价值发生波动的风险。

#### 11) 其他可能的风险

除上述显著风险外,本基金参与港股通投资,还可能面临的其他风险,包括但不限于:

①除因股票交易而发生的佣金、交易征费、交易费、交易系统费、印花税、过户费等税费外,在不进行交易时也可能要继续缴纳证券组合费等项费用,本基金存在因费用估算不准而导致账户透支的风险;

②在香港市场,部分中小市值港股成交量则相对较少,流动较为缺乏,本基金投资此类股票可能因缺乏交易对手而面临个股流动性风险;

③在本基金参与港股通交易中若香港联交所与内地交易所的证券交易服务公司之间的报盘系统或者通信链路出现故障,可能导致 15 分钟以上不能申报和撤销申报的交易中断风险;

④存在港股通香港结算机构因极端情况下无法交付证券和资金的结算风险;另外港股通境内结算实施分级结算原则,本基金可能面临以下风险:(一)因结算参与者未完成与中国结算的集中交收,导致本基金应收资金或证券被暂不交付或处置;(二)结算参与人对本基金出现交收违约导致本基金未能取得应收证券或资金;(三)结算参与者向中国结算发送的有关本基金的证券划付指令有误的导致本基金权益受损;(四)其他因结算参与者未遵守相关业务规则导致本基金利益受到损害的情况。

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) 股指期货、国债期货、股票期权等金融衍生品投资风险

金融衍生品是一种金融合约,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。投资于衍生品需承受市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险和法律风险等。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,有时候比投资标的资产要承担更高的风险。并且由于衍生品定价相当复杂,不适当的估值有可能使基金资产面临损失风险。



本基金将股指期货纳入到投资范围中，股指期货采用保证金交易制度，由于保证金交易具有杠杆性，当出现不利行情时，微小的变动就可能会使投资人权益遭受较大损失。同时，股指期货采用每日无负债结算制度，如果没有在规定的时间内补足保证金，按规定将被强制平仓，可能给基金净值带来重大损失。

本基金投资国债期货，国债期货市场的风险类型较为复杂，涉及面广，具有放大性与不可预防性等特征。其风险主要有由利率波动原因造成的市场价格风险、由宏观因素和政策因素变化而引起的系统风险、由市场和资金流动性原因引起的流动性风险、由交易制度不完善而引发的制度性风险以及由技术系统故障及操作失误造成的技术系统风险等。

本基金参与股票期权交易以套期保值为主要目的，投资股票期权的主要风险包括价格波动风险、市场流动性风险、强制平仓风险、合约到期风险、行权失败风险、交易违约风险等。影响期权价格的因素较多，有时会出现价格较大波动，而且期权有到期日，不同的期权合约又有不同的到期日，若到期日当天没有做好行权准备，期权合约就会作废，不再有任何价值。此外，行权失败和交收违约也是股票期权交易可能出现的风险，期权义务方无法在较首日备齐足额资金或证券用于交收履约，会被判为交收违约并受罚，相应地，行权投资者就会面临行权失败而失去交易机会。

#### （4）资产支持证券（ABS）的投资风险

资产支持证券（ABS）是一种债券性质的金融工具，其向投资者支付的本息来自于基础资产池产生的现金流或剩余权益。与股票和一般债券不同，资产支持证券不是对某一经营实体的利益要求权，而是对基础资产池所产生的现金流和剩余权益的要求权，是一种以资产信用为支持的证券，所面临的风险主要包括交易结构风险、各种原因导致的基础资产池现金流与对应证券现金流不匹配产生的信用风险、市场交易不活跃导致的流动性风险等。

#### （5）投资信用衍生品的风险

为对冲信用风险，本基金可能投资信用衍生品，信用衍生品的投资可能面临流动性风险、偿付风险以及价格波动风险。

##### 1）流动性风险

信用衍生品在交易转让过程中因无法找到交易对手或交易对手较少，导致难以将信用衍生品以合理价格变现的风险。

##### 2）偿付风险

在信用衍生品存续期间，由于不可控制的市场及环境变化，创设机构可能出现经营状况不佳或创设机构的现金流与预期发生一定偏差，从而影响信用衍生品结算的风险。

### 3) 价格波动风险

由于创设机构或所受保护的债券主体经营状况或利率环境发生变化，引起信用衍生品价格出现波动的风险。

### (6) 投资于存托凭证的风险

本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与存托凭证发行机制相关的风险，包括存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险；存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险；存托协议自动约束存托凭证持有人的风险；因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。

## 8、操作或技术风险

(1) 技术风险：在定向资产管理业务的日常交易中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致投资者的利益受到影响。这种技术风险可能来自管理人、托管人、证券交易所、期货交易所、证券登记结算机构等。

(2) 操作风险：证券交易所、期货交易所、证券登记结算机构等在业务操作过程中，因操作失误或违反操作规程而引起的风险。

## 9、其它风险

(1) 战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致委托财产的损失；

(2) 金融市场危机、行业竞争、代理商违约等超出基金管理人自身直接控制能力之外的风险，也可能导致资产委托人利益受损。

## 二、声明

1、投资者投资于本基金，须自行承担投资风险；

2、除基金管理人直接办理本基金的销售外，本基金还通过基金销售机构销售，基金管理人及其他销售机构都不能保证其收益或本金安全。



## 第十七部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### 一、《基金合同》的变更

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

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，自决议生效后按规定在规定媒介公告。

### 二、《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：

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

### 三、基金财产的清算

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

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

3、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、符合《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。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

5、在基金财产清算过程中，基金管理人和基金托管人应各自履行职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

6、基金财产清算程序：

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

7、基金财产清算的期限为6个月，但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的，清算期限可相应顺延。

#### **四、清算费用**

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

#### **五、基金财产清算剩余资产的分配**

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

#### **六、基金财产清算的公告**

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经符合《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后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算小组进行公告，基金财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

#### **七、基金财产清算账册及文件的保存**

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存20年以上，法律法规或监管规则另有规定的从其规定。

#### **八、基金合并**

本基金与其他基金的合并应当按照法律法规规定的程序进行。

## 第十八部分 基金合同的内容摘要

### 一、基金管理人、基金托管人及基金份额持有人的权利与义务

#### （一）基金管理人的权利与义务

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

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

(16) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、定期定额投资和非交易过户等业务规则；

(17) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

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

(2) 办理基金备案手续；

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

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

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

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

(7) 依法接受基金托管人的监督；

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

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(10) 编制季度报告、中期报告和年度报告；

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

(12) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露，但向审计、法律等外部专业顾问提供的除外；

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

(14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；



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

(16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料，保存期限不低于法律法规规定的最低期限；

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

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

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

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

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

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

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

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

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(26) 建立并保存基金份额持有人名册；

(27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## (二) 基金托管人的权利与义务

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

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

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

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

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

(5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

(6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

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

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

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

(5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

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

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

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

(9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

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

(11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 20 年以上，法律法规或监管规则另有规定的从其规定；

(12) 从基金管理人或其委托的登记机构处接收并保存基金份额持有人名册；

(13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

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

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

(16) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；

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

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

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

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

(21) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

### (三) 基金份额持有人

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

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

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

- (1) 分享基金财产收益；
- (2) 参与分配清算后的剩余基金财产；
- (3) 依法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或仲裁；
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

- (1) 认真阅读并遵守《基金合同》、招募说明书等信息披露文件；
- (2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；
- (3) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；
- (4) 交纳基金认购、申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；
- (5) 在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；
- (6) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；
- (7) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- (8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## 二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。除法律法规另有规定或本基金合同另有约定外，基金份额持有人持有的同一类别每一基金份额拥有平等的投票权。

本基金份额持有人大会不设日常机构。

### (一) 召开事由

1、除法律法规和中国证监会另有规定或《基金合同》另有约定外，当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

- (1) 终止《基金合同》；
- (2) 更换基金管理人；
- (3) 更换基金托管人；
- (4) 转换基金运作方式；
- (5) 调整基金管理人、基金托管人的报酬标准或提高销售服务费率；
- (6) 变更基金类别；
- (7) 本基金与其他基金的合并；
- (8) 变更基金投资目标、范围或策略；
- (9) 变更基金份额持有人大会程序；
- (10) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- (11) 单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；
- (12) 对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；
- (13) 法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

2、在法律法规规定和《基金合同》约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前提下，以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

- (1) 法律法规要求增加的基金费用的收取；
- (2) 调整本基金的申购费率、调低赎回费率、调低销售服务费率或变更收费方式，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而应当对《基金合同》进行修改；
- (4) 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生重大变化；
- (5) 基金管理人、登记机构、基金销售机构调整有关认购、申购、赎回、转换、基金交易、非交易过户、转托管等业务规则；

(6) 履行相关程序后，基金推出新业务或服务；

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

## (二) 会议召集人及召集方式

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

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。

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

4、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

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

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

## (三) 召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

(1) 会议召开的时间、地点和会议形式；



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

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

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

#### （四）基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式或法律法规、监管机构允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

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

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

（2）经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）；若到会者在权益登记日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的基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之一（含三分之一）。

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式或大会公告载明的其他方式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式或大会公告载明的其他方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

（1）会议召集人按《基金合同》约定公布会议通知后，在2个工作日内连续公布相关提示性公告；

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

（3）本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）；若本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的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三分之一以上（含三分之一）基金份额的持有人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见；

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

3、在法律法规和监管机关允许的情况下，本基金的基金份额持有人亦可采用其他非书面方式授权其代理人出席基金份额持有人大会，授权方式可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

4、在会议召开方式上，本基金亦可采用其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开基金份额持有人大会，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。

基金份额持有人可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式进行表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

#### （五）议事内容与程序

##### 1、议事内容及提案权

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

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

##### 2、议事程序

###### （1）现场开会

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

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

###### （2）通讯开会

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

#### （六）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

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

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

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时监督员及公证机关均认为有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

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

#### （七）计票

##### 1、现场开会

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

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

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

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

## 2、通讯开会

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

### （八）生效与公告

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

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

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

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

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

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

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

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

侧袋机制实施期间，基金份额持有人大会审议事项涉及主袋账户和侧袋账户的，应分别由主袋账户、侧袋账户的基金份额持有人进行表决，同一主侧袋账户内同一类别的每份基金份额具有平等的表决权。表决事项未涉及侧袋账户的，侧袋账户份额无表决权。

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

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

### 三、基金收益分配原则

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

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资，且基金份额持有人可对 A 类、C 类基金份额分别选择不同的分红方式；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各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、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在符合法律法规及基金合同约定，并对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人与基金托管人协商一致后可对基金收益分配原则和支付方式进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

### 四、基金合同的变更、终止与基金财产的清算



### （一）《基金合同》的变更

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

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，自决议生效后按规定在规定媒介公告。

### （二）《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：

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

### （三）基金财产的清算

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

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

3、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、符合《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。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

5、在基金财产清算过程中，基金管理人和基金托管人应各自履行职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

#### 6、基金财产清算程序：

- （1）《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；
- （2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；

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

7、基金财产清算的期限为 6 个月，但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的，清算期限可相应顺延。

#### （四）清算费用

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

#### （五）基金财产清算剩余资产的分配

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

#### （六）基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经符合《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后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告，基金财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

#### （七）基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 20 年以上，法律法规或监管规则另有规定的从其规定。

#### （八）基金合并

本基金与其他基金的合并应当按照法律法规规定的程序进行。

### 五、争议的处理和适用的法律

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如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深圳国际仲裁院（深圳仲裁委员会），按照深圳国际仲裁院（深圳仲裁委员会）届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点



为深圳市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力。除非仲裁裁决另有规定，仲裁费用、律师费用由败诉方承担。

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

《基金合同》受中国法律（为本基金合同之目的，在此不包括香港、澳门特别行政区和台湾地区法律）管辖。

#### **六、基金合同的存放地和投资者取得基金合同的方式**

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

## 第十九部分 基金托管协议的内容摘要

### 一、托管协议当事人

#### （一）基金管理人

名称：博时基金管理有限公司

住所：深圳市福田区莲花街道福新社区益田路 5999 号基金大厦 21 层

法定代表人：江向阳

设立日期：1998 年 7 月 13 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字【1998】26 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：2.5 亿元人民币

存续期限：持续经营

联系电话：0755-83169999

#### （二）基金托管人

名称：杭州银行股份有限公司

住所：杭州市下城区庆春路 46 号

法定代表人：陈震山

成立时间：1996 年 9 月 25 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：伍拾玖亿叁仟零贰拾万零肆佰叁拾贰元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监许可【2014】337 号

### 二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

（一）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、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，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。

本基金的投资范围包括国内依法发行或上市的股票（含中小板、创业板、及其他经中国证监会核准上市或准予注册的股票、存托凭证）、内地与香港股票市场交易互联互通机制下

允许买卖的香港证券市场股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（国债、金融债、企业债、公司债、政府支持债券、政府支持机构债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、可交换债、次级债等）、资产支持证券、金融衍生品（包括股指期货、国债期货、股票期权、信用衍生品等）、债券回购、同业存单、银行存款（包含协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、现金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相关规定）。

本基金可根据相关法律法规和基金合同的约定参与融资业务。

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

基金的投资组合比例为：本基金股票资产（含存托凭证）占基金资产的比例为60%—95%，港股通标的股票的投资比例为股票资产的0%—50%。其中，投资于本基金界定的新能源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国债期货、股指期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值的5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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

（二）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）占基金资产的比例为60%—95%，港股通标的股票的投资比例为股票资产的0%—50%。其中，投资于本基金界定的新能源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国债期货、股指期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值的5%的现金或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（含存托凭证），其市值（若同时持有一家公司发行的A股和H股，则为A股与H股合计市值）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（含存托凭证），不超过该证券（若同时持有一家公司发行的A股和H股，则为A股与H股合计）的10%；

(5) 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%；

(6) 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%；

(7) 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%；

(8) 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%；

(9) 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；

(10) 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；

(11) 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%，进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

(12) 本基金参与股指期货、国债期货投资的，应遵循下列限制：

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) 每个交易日日终，本基金持有的买入股指期货和国债期货合约价值和有价证券市值之和，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%；

5) 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规定；

6) 本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的 15%；

7) 本基金在任何交易日日终, 持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%;

8) 本基金在任何交易日内交易(不包括平仓)的国债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 30%;

9) 本基金所持有的债券(不含到期日在一年以内的政府债券)市值和买入、卖出国债期货合约价值, 合计(轧差计算)应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定;

(13) 本基金参与股票期权交易的, 需遵守下列规定:

1) 因未平仓的股票期权合约支付和收取的权利金总额不得超过基金资产净值的 10%;

2) 开仓卖出认购股票期权的, 应持有足额标的证券; 开仓卖出认沽股票期权的, 应持有合约行权所需的全额现金或交易所规则认可的可冲抵股票期权保证金的现金等价物;

3) 未平仓的股票期权合约面值不得超过基金资产净值的 20%。其中, 合约面值按照行权价乘以合约乘数计算;

(14) 本基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%;

(15) 本基金管理人管理的且由本基金托管人托管的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票, 不得超过该上市公司可流通股票的 15%; 本基金管理人管理的且由本基金托管人托管的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票, 不得超过该上市公司可流通股票的 30%;

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

(17) 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;

(18) 本基金不持有具有信用保护卖方属性的信用衍生品, 不持有合约类信用衍生品, 本基金持有的信用衍生品名义本金不得超过本基金中所对应受保护债券面值的 100%;

(19) 本基金投资于同一信用保护卖方各类信用衍生品名义本金合计不得超过基金资产净值的 10%; 因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前述所规定比例限制的, 基金管理人应在 3 个月之内进行调整;

(20) 本基金参与融资的, 每个交易日日终, 本基金持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和, 不得超过基金资产净值的 95%;

(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(2)、(9)、(16)、(17)、(19)情形之外,因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的,基金管理人应当在10个交易日内进行调整,但法律法规或中国证监会规定的特殊情形除外。

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

如果法律法规或监管部门对上述投资组合比例限制进行变更的,以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制,自动遵守届时有效的法律法规或监管规定。

(三)基金托管人通过事后监督方式进行监督。对于基金管理人开展基金投资禁止行为,基金托管人对此无法提前知晓或阻止的,基金托管人不承担任何责任并有权向中国证监会报告。

(四)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,遵循基金份额持有人利益优先的原则,防范利益冲突,建立健全内部审批机制和评估机制,按照市场公平合理价格执行。相关交易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。

法律、行政法规或监管部门取消或变更上述限制规定,如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制或按变更后的规定执行。

(五)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符合法律法规及行业标准的、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,并约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金管理人应严格按照交易对手名单的范围在银行间债券市场选择交易对手。基金托管人监督基金管理人是否按事前提提供的银行间债券市场交易对手名单和交易结算方式进行交易,如基金管理人在基金投资运作之前未向基金托管人提供银行间债券



市场交易对手名单和交易结算方式的，视为基金管理人认可全市场交易对手和全部结算方式。基金管理人可以每半年或定期对银行间债券市场交易对手名单及结算方式进行更新，新名单确定前已与本次剔除的交易对手进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。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及结算方式的，应向基金托管人说明理由，并在与交易对手发生交易前3个工作日内与基金托管人协商解决。如基金管理人在基金投资运作之前未向基金托管人提供银行间债券市场交易对手名单及结算方式的，视为基金管理人认可全市场交易对手和全部结算方式。

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，并负责解决因交易对手不履行合同而造成的纠纷及损失，基金托管人不承担由此造成的任何法律责任及损失。基金托管人仅根据银行间债券市场成交单对本基金银行间债券交易的交易对手及其结算方式进行监督。若未履约的交易对手在基金托管人与基金管理人确定的时间前仍未承担违约责任及其他相关法律责任的，基金管理人可以对相应损失先行予以承担，然后再向相关交易对手追偿。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。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或交易结算方式进行交易时，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。

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

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

本基金投资银行存款应符合如下规定：

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

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

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

(七) 基金托管人对基金投资中期票据的监督

1. 基金管理人在投资中期票据前，须根据法律、法规、监管部门的规定，制定严格的关于投资中期票据的风险控制制度和流动性风险处置预案，并书面提供给基金托管人，基金托管人依据上述文件对基金管理人投资中期票据的比例进行监督。如基金管理人未向基金托管人提供相关文件，基金托管人有权不对基金投资中期票据进行监督。

2. 如未来有关监管部门发布的法律法规对基金投资中期票据另有规定的，从其约定，基金管理人应及时书面通知基金托管人。

3. 基金托管人有权监督基金管理人在相关基金投资中期票据时的法律法规遵守情况，有关制度、信用风险、流动性风险处置预案的完善情况，有关比例限制的执行情况。基金托管人发现基金管理人的上述事项违反法律法规和基金合同以及本协议的规定，有权及时以书面形式通知基金管理人纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人应按相关托管协议要求向基金托管人及时发出回函，并及时改正。基金托管人有权随时对所通知事项进行复查，督促基金管理人改正。如果基金管理人违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人有权报告中国证监会。

(八) 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，并有权在发现后报告中国证监会。

(九) 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违反法律法规、基金合同和本托管协议的规定，应及时以电话提醒或书面提示等方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。基金管理人收到书面通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函，就基金托管人的合理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。

(十) 基金管理人 有义务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，或就基金托管人的合理疑义进行解释或举证；对基金托管人按照法律法规、基金合同和本托管协议的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。

(十一) 若基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当立即通知基金管理人，由此造成的损失由基金管理人承担。

(十二) 基金托管人发现基金管理人 有重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本托管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。

(十三) 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。

基金托管人依照相关法律法规的规定和基金合同的约定，对侧袋机制启用、特定资产处置和信息披露等方面进行复核和监督。侧袋机制实施期间的具体规则依照相关法律法规的规定和基金合同的约定执行。

### 三、基金管理人 对基金托管人的业务核查

(一) 基金管理人 对基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的托管资金专门账户和证券账户等投资所需账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和各类基金份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

(二) 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、本托管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。

（三）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、阻挠对方根据本托管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

##### （一）基金财产保管的原则

1. 基金财产应独立于基金管理人、基金托管人、证券经纪机构的固有财产；
2. 基金托管人应安全保管基金财产；
3. 基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户、证券账户等投资所需账户；
4. 基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立；
5. 基金托管人按照基金合同和本托管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。基金托管人未经基金管理人的指令，不得自行运用、处分、分配本基金的任何资产（不包含基金托管人依据中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中登公司”）托管资产开户银行扣收结算费和账户维护费等费用）；
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，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金财产的损失，基金托管人应予以必要的协助与配合，但对此不承担相应责任；
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。

##### （二）募集资金的验资

1. 基金募集期间募集的资金应存于开立的“基金募集专户”。该账户由基金管理人开立并管理。
2. 基金募集期满或基金停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，基金管理人应将属于基金财产的全部资金划入基金托管人开立的基金资金账户，同时在规定时间内，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验资，出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的2名或2名以上中国注册会计师签字方为有效。

3. 若基金募集期限届满，未能达到基金备案的条件，由基金管理人按规定办理退款等事宜，基金托管人应予以必要的协助与配合。

### （三）基金资金账户的开立和管理

1. 基金托管人应以本基金的名义在具有基金托管资格的商业银行开立基金的资金账户（托管账户），并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。本基金的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回额、支付基金收益、收取申购款，均需通过本基金资金账户进行。

2. 基金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。基金托管专户不办理通存通兑，不得透支取现。不得开通手机银行、电话银行、网上银行专业版。基金管理人不得在基金托管人柜台办理资金划拨、查询、购买支票等支付结算凭证。

3. 基金资金账户的开立和管理应符合有关法律法规及银行业监督管理机构的有关规定。

4. 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。

### （四）基金证券账户、证券资金账户和期货结算账户的开立和管理

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（户名以实际开立为准）。

2. 基金证券账户的开立和使用，仅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。

4. 基金管理人以基金名义在基金管理人选择的证券经营机构营业网点开立证券资金账户。证券经营机构根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立相关资金账户，并按照该证券经营机构开户的流程和要求与基金管理人签订相关协议。

5. 交易所证券交易资金采用第三方存管模式，即用于证券交易结算资金全额存放在基金管理人为基金开立的证券资金账户中，场内的证券交易资金清算由基金管理人选择的证券



公司负责。基金托管人不负责办理场内的证券交易资金清算，也不负责保管证券资金账户内存放的资金。

6. 基金托管人与基金管理人应依据相关期货交易所或期货公司的相关规定开立和管理期货结算账户。

7. 若中国证监会或其他监管机构在本托管协议订立日之后允许基金从事其他投资品种的投资业务，涉及相关账户的开立、使用的，若无相关规定，则基金托管人比照上述关于账户开立、使用的规定执行。

#### （五）债券托管账户的开立和管理

基金合同生效后，基金托管人根据中国人民银行、银行间市场登记结算机构的有关规定，以本基金的名义在银行间市场登记结算机构开立债券托管账户、持有人账户和资金结算账户，并代表本基金进行银行间市场债券的后台确认及资金结算。基金管理人代表本基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议。

#### （六）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，由基金托管人负责开立。新账户按有关规定使用并管理。

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。

#### （七）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、银行存款开户证实书等有价凭证由基金托管人存放于基金托管人的保管库，其中，实物证券也可存入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、中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司或票据营业中心的代保管库，保管凭证由基金托管人持有。有价凭证的购买和转让，由基金管理人和基金托管人共同办理。基金托管人对由基金托管人以外机构实际有效控制的资产不承担保管责任。

#### （八）与基金财产有关的重大合同的保管

与基金财产有关的重大合同的签署，由基金管理人负责。由基金管理人代表基金签署的、与基金财产有关的重大合同的原件分别由基金管理人、基金托管人保管。除本托管协议另有规定外，基金管理人代表本基金签署的与基金财产有关的重大合同包括但不限于基金年度审计合同、基金信息披露协议及基金投资业务中产生的重大合同，基金管理人应保证基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人应在重大合同签署后及时传真给基



金托管人，并在 30 个工作日内将正本送达基金托管人处。重大合同的保管期限不低于法律法规规定的最低期限。

对于无法取得二份以上的正本的，基金管理人应向基金托管人提供加盖授权业务章的合同传真件并保证其真实性及其与原件的完全一致性，未经双方协商或未在合同约定范围内，合同原件不得转移。

## 五、基金资产净值计算和会计核算

### （一）基金资产净值的计算、复核与完成的时间及程序

1. 基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。各类基金份额净值是按照每个估值日，该类基金资产净值除以当日该类基金份额的余额数量计算，均精确到 0.0001 元，小数点后第五位四舍五入。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。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人应每个估值日计算基金资产净值及各类基金份额净值，并按规定公告。

2. 基金管理人应每个估值日对基金资产估值。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。基金管理人每个估值日对基金资产估值后，将各类基金份额净值结果以双方约定的方式发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，并以双方约定的方式将复核结果传送给基金管理人，由基金管理人依据基金合同和相关法律法规的规定对外公布。

### （二）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、股指期货合约、国债期货合约、股票期权合约、债券和银行存款本息、应收款项、资产支持证券、信用衍生品、其它投资等资产及负债。

#### 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，最近交易日后经济环境未发生重大变化且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(基金合同另有规定的除外), 选取估值日第三方估值机构提供的相应品种对应的估值净价估值, 具体估值机构由基金管理人与基金托管人另行协商约定;

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

交易所上市实行全价交易的固定收益品种(可转换债券除外), 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固定收益品种(税后) 应收利息得到的净价进行估值;

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

(2) 处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理:

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

2) 首次公开发行未上市或未挂牌转让的股票和债券, 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) 流通受限的股票, 指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) 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。

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

(5) 同一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。

(6) 本基金投资股指期货合约、国债期货合约, 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。

(7) 本基金投资股票期权，根据相关法律法规以及监管部门的规定估值。

(8) 本基金投资信用衍生品，信用衍生品按照第三方机构提供的当日估值价进行估值，但基金管理人依法应当承担的估值责任不因委托而免除。选定的第三方机构未提供估值价格的，依照有关法律法规及企业会计准则要求，采用合理估值技术确定公允价值。(9) 汇率

本基金外币资产价值计算中，涉及主要货币对人民币汇率的，应当以基金估值日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价为准；涉及到其它币种与人民币之间的汇率，参照数据服务商提供的当日各种货币兑美元折算率采用套算的方法进行折算。

(10) 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。

(11) 本基金参与融资业务，按照相关法律法规和行业协会的相关规定进行估值。

(12) 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。

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

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

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

### 3. 特殊情形的处理

基金管理人、基金托管人按估值方法的第(12)项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

由于有关会计制度变化或不可抗力原因，或由于证券、期货交易所或登记结算公司及存款银行等第三方机构发送的数据错误、遗漏等非基金管理人与基金托管人原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

### （三）基金份额净值错误的处理方式

#### 1. 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）错误偏差达到该类基金份额净值的 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；错误偏差达到该类基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应当公告，并报中国证监会备案。

（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。

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，按基金管理人的建议执行，由此给基金份额持有人和基金财产造成的损失，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，而且基金托管人未对计算过程提出疑义或要求基金管理人书面说明，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投资者或基金支付赔偿金，就实际向投资者或基金支付的赔偿金额，基金管理人与基金托管人按照管理费和托管费的比例各自承担相应的责任。

（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或对基金管理人采用的估值方法，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，如果由此给基金份额持有人和基金造成了损失，由基金管理人负责赔付。

（4）由于一方提供的信息错误，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，由提供错误信息的当事人一方负责赔付。

4. 前述内容如法律法规或者监管机关另有规定的，从其规定处理。如果行业另有通行做法，基金管理人、基金托管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。

### （四）暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场或外汇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、法律法规规定、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

#### （五）基金会计制度

按国家有关部门规定的会计制度执行。

#### （六）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、基金托管人分别独立地设置、记录和保管本基金的全套账册。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净值的计算和公告的，以基金管理人的账册为准。

#### （七）基金财务报表与报告的编制和复核

##### 1. 财务报表的编制

基金财务报表由基金管理人编制，基金托管人复核。

##### 2. 报表复核

基金托管人在收到基金管理人编制的基金财务报表后，进行独立的复核。核对不符时，应及时通知基金管理人共同查出原因，进行调整，直至双方数据完全一致。

##### 3. 财务报表的编制与复核时间安排

###### （1）报表的编制

基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内完成基金季度报告的编制；在上半年结束之日起两个月内完成基金中期报告的编制；在每年结束之日起三个月内完成基金年度报告的编制。基金年度报告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。基金合同生效不足 2 个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。

###### （2）报表的复核

基金管理人应及时完成报表编制，将有关报表提供基金托管人复核；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，调整以国家有关规定为准。

基金管理人应留足充分的时间，便于基金托管人复核相关报表及报告。



## 六、基金份额持有人名册的保管

基金份额持有人名册至少应包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。基金份额持有人名册由登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，基金管理人和基金托管人应分别保管基金份额持有人名册，保存期不低于法律法规规定的最低期限。如不能妥善保管，则按相关法规承担责任。

在基金托管人要求或《基金合同》生效日、《基金合同》终止日、基金份额持有人大会权益登记日、编制中期报告和年度报告前，基金管理人应将有关资料送交基金托管人，不得无故拒绝或延误提供，并保证其真实性、准确性和完整性。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，除非法律、法规、规章另有规定，有权机关另有要求。

## 七、争议解决方式

因本托管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深圳国际仲裁院（深圳仲裁委员会），按照深圳国际仲裁院（深圳仲裁委员会）届时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点在深圳市，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，仲裁费用、律师费用由败诉方承担。

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。

本托管协议适用于中华人民共和国法律（为本协议之目的，在此不包括香港、澳门特别行政区和台湾地区法律）并从其解释。

## 八、基金托管协议的变更、终止与基金财产的清算

### （一）托管协议的变更程序

本托管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中国证监会备案。

### （二）基金托管协议终止出现的情形

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、中国证监会或基金合同规定的终止事项。



### （三）基金财产的清算

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

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

3. 基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、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。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

4. 在基金财产清算过程中，基金管理人和基金托管人应各自履行职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

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

#### 6. 基金财产清算程序：

（1）基金合同终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；

（2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；

（3）对基金财产进行估值和变现；

（4）制作清算报告；

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

（6）将清算报告报中国证监会备案并公告；

（7）对基金剩余财产进行分配。

基金财产清算的期限为 6 个月，但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的，清算期限可相应顺延。

#### 7. 清算费用

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

#### 8. 基金财产清算剩余资产的分配

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

#### 9. 基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经符合《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后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告，基金财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上，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 20 年以上，法律法规或监管规则另有规定的从其规定。

## 第二十章 对基金份额持有人的服务

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

### 一、基金份额持有人交易资料的寄送服务

#### 1、交易确认单

基金合同生效后正常开放期，每次交易结束后，投资者可在 T+2 个工作日后通过销售机构的网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询和打印交易确认单，或在 T+1 个工作日后通过博时一线通电话、博时网站查询交易确认情况。基金管理人向投资者寄电子对账单

每月结束后，基金管理人向所有订阅电子邮件对账单的投资者发送电子邮件对账单。

投资者可以登录基金管理人网站（<http://www.bosera.com>）自助订阅；或发送“订阅电子对账单”邮件到客服邮箱 [service@bosera.com](mailto:service@bosera.com)；也可直接拨打博时一线通 95105568（免长途话费）订阅。

2、由于投资者提供的电子邮箱不详、错误、未及时变更或通讯故障、延误等原因有可能造成对账单无法按时或准确送达。因上述原因无法正常收取对账单的投资者，敬请及时通过本基金管理人网站，或拨打博时一线通客服电话查询、核对、变更您的预留联系方式。

### 二、网上理财服务

通过基金管理人网站，投资者可获得如下服务：

#### 1、自助开户交易

投资者可登录基金管理人网站网上交易系统，与基金管理人达成电子交易的相关协议，接受基金管理人有关服务条款并办理相关手续后，即可自助开户并进行网上交易，如基金认/申购、定投、转换、赎回、赎回转申购及分红方式变更等。具体业务办理情况及业务规则请登录基金管理人网站查询。

#### 2、查询服务

投资者可以通过基金管理人网站查询所持有基金的基金份额、交易记录等信息，同时可以修改基金账户信息等基本资料。

#### 3、信息资讯服务

投资者可以利用基金管理人网站获取基金和基金管理人各类信息，包括基金法律文件、基金管理人最新动态、热点问题等。

#### 4、在线客服

投资者可以通过基金管理人网站首页“在线客服”功能进行在线咨询。也可以在“您问我答”栏目中，直接提出有关本基金的问题和建议。

### 三、短信服务

基金管理人向订制短信服务的基金份额持有人提供相应短信服务。

### 四、电子邮件服务

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

### 五、手机理财服务

投资者通过手机博时移动版直销网上交易系统（<http://m.bosera.com>）和博时 App 版直销网上交易系统，可以使用基金理财所需的基金交易、理财查询、账户管理、信息资讯等功能和服务。

### 六、信息订阅服务

投资者可以通过基金管理人网站、客服中心提交信息订制的申请，基金管理人将以电子邮件、手机短信的形式定期为投资者发送所订制的信息。

### 七、电话理财服务

投资者拨打博时一线通：95105568（免长途话费）可享有投资理财交易的一站式综合服务：

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

2、电话交易服务：基金管理人直销投资者可通过博时一线通电话交易平台在线办理基金的赎回、变更分红方式、撤单等直销交易业务。

3、人工电话服务：投资者可以获得业务咨询、信息查询、资料修改、投诉受理、信息订制、账户诊断等服务。

4、电话留言服务：非人工服务时间或线路繁忙时，投资者可进行电话留言。

### 八、基金管理人联系方式

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

电子信箱: [service@bosera.com](mailto:service@bosera.com)

博时一线通客服电话: 95105568 (免长途话费)

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

## 第二十一部分 其他应披露的事项

(一)、 2022年08月31日, 我公司公告了《博时新能源主题混合型证券投资基金托管协议》、《博时基金管理有限公司关于博时新能源主题混合型证券投资基金证券交易结算模式转换完成的公告》、《博时新能源主题混合型证券投资基金2022年中期报告》;

(二)、 2022年08月29日, 我公司公告了《博时基金管理有限公司关于直销网上交易开通广发银行快捷开户和支付服务及费率优惠的公告》;

(三)、 2022年08月25日, 我公司公告了《博时新能源主题混合型证券投资基金(博时新能源主题混合A)基金产品资料概要更新》、《博时新能源主题混合型证券投资基金(博时新能源主题混合C)基金产品资料概要更新》;

(四)、 2022年08月22日, 我公司公告了《博时基金管理有限公司旗下基金在兴业银行钱大掌柜开展费率优惠活动的公告》;

(五)、 2022年07月21日, 我公司公告了《博时新能源主题混合型证券投资基金2022年第2季度报告》;

(六)、 2022年07月18日, 我公司公告了《博时基金管理有限公司关于旗下所有前端收费模式基金在直销柜台实施费率优惠的公告》;

(七)、 2022年07月16日, 我公司公告了《博时基金管理有限公司关于暂停北京微动利基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告》、《博时基金管理有限公司关于暂停喜鹊财富基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告》;

(八)、 2022年07月05日, 我公司公告了《博时基金管理有限公司关于部分基金在招赢通平台开展费率优惠活动的公告》;

(九)、 2022年06月28日, 我公司公告了《博时基金管理有限公司关于博时新能源主题混合型证券投资基金调整为证券公司交易结算模式有关事项的公告》;

(十)、 2022年06月18日, 我公司公告了《博时基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告》;

(十一)、 2022年05月31日, 我公司公告了《博时新能源主题混合型证券投资基金更新招募说明书》;

(十二)、 2022年05月14日, 我公司公告了《关于博时基金管理有限公司旗下部分基金投资非公开发行的公告20220514》;



(十三)、 2022年05月10日，我公司公告了《博时新能源主题混合型证券投资基金（博时新能源主题混合A）基金产品资料概要更新》、《博时新能源主题混合型证券投资基金（博时新能源主题混合C）基金产品资料概要更新》。

## 第二十二部分 招募说明书的存放及查阅方式

招募说明书公布后，应当分别置备于基金管理人、基金托管人的住所，投资人可在办公时间查阅；投资人在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。对投资人按此种方式所获得的文件及其复印件，基金管理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.bosera.com](http://www.bosera.com)）查阅和下载招募说明书。

## 第二十三部分 备查文件

以下备查文件存放在基金管理人的办公场所，在办公时间可供免费查阅。

- (一) 中国证监会准予博时新能源主题混合型证券投资基金注册的文件
- (二) 《博时新能源主题混合型证券投资基金基金合同》
- (三) 《博时新能源主题混合型证券投资基金托管协议》
- (四) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (五) 基金托管人业务资格批件、营业执照
- (六) 关于申请募集博时新能源主题混合型证券投资基金之法律意见
- (七) 中国证监会要求的其他文件

查阅方式：投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

博时基金管理有限公司

2023年7月10日