

# 国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金 基金合同

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

二零二三年七月

## 目 录

一、前言 .....	3
二、释义 .....	4
三、基金的基本情况 .....	8
四、基金的历史沿革 .....	9
五、基金的存续 .....	10
六、基金份额的申购与赎回 .....	11
七、基金合同当事人及权利义务 .....	18
八、基金份额持有人大会 .....	24
九、基金管理人、基金托管人的更换条件和程序 .....	32
十、基金的托管 .....	34
十一、基金份额的登记 .....	34
十二、基金的投资 .....	35
十三、基金的财产 .....	42
十四、基金资产的估值 .....	43
十五、基金的费用与税收 .....	48
十六、基金的收益与分配 .....	50
十七、基金的会计和审计 .....	51
十八、基金的信息披露 .....	52
十九、基金合同的变更、终止与基金财产的清算 .....	57
二十、违约责任 .....	60
二十一、争议的处理 .....	61
二十二、基金合同的效力 .....	61
二十三、其他事项 .....	62
二十四、基金管理人和基金托管人签章 .....	62

## 一、前言

### (一) 订立本基金合同的目的、依据和原则

1. 订立本基金合同的目的是保护投资人合法权益，明确基金合同当事人的权利义务，规范基金运作。

2. 订立本基金合同的依据是《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）和其他有关法律法规。

3. 订立本基金合同的原则是平等自愿、诚实信用、充分保护投资人合法权益。

(二) 基金合同是规定基金合同当事人之间权利义务关系的基本法律文件，其他与基金相关的涉及基金合同当事人之间权利义务关系的任何文件或表述，如与基金合同不一致或有冲突，均以基金合同为准。基金合同当事人按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。

《基金合同》的当事人包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人。基金投资人自依本基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受。

(三) 国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金由基金管理人依照《基金法》、基金合同及其他有关规定募集，并经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）核准。

中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

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

(四) 基金管理人、基金托管人在本基金合同之外披露涉及本基金的信息，其内容涉及界定基金合同当事人之间权利义务关系的，如与基金合同不一致或有冲突，以基金合同为准。

(五) 本基金合同关于基金产品资料概要的编制、披露及更新等内容，将不晚

于 2020 年 9 月 1 日起执行。

## 二、释义

在本基金合同中，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：指国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金
2. 金鼎基金：指金鼎证券投资基金，运作方式为契约型封闭式；
3. 基金管理人或本基金管理人：指国泰基金管理有限公司
4. 基金托管人或本基金托管人：指中国建设银行股份有限公司
5. 基金合同或本基金合同：指《国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充；本基金合同由《金鼎证券投资基金基金合同》修订而成
6. 托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《国泰金鼎价值精选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；本托管协议由《金鼎证券投资基金托管协议》修订而成
7. 招募说明书：指《国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金招募说明书》及其更新
8. 法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等
9. 《基金法》：指 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，自 2004 年 6 月 1 日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
10. 《销售办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 25 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
11. 《信息披露办法》：指中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
12. 《运作办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 29 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

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

14. 中国证监会：指中国证券监督管理委员会

15. 银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会

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

17. 个人投资者：指依据有关法律法规规定或经中国证监会核准可投资于证券投资基金的自然人

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

19. 合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》规定的条件，经中国证监会批准投资于中国证券市场，并取得国家外汇管理局额度批准的中国境外基金管理机构、保险公司、证券公司以及其他资产管理机构

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

21. 基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人

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

23. 销售机构：指直销机构和代销机构

24. 直销机构：指国泰基金管理有限公司

25. 代销机构：指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金代销业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议，代为办理基金销售业务的机构

26. 基金销售网点：指直销机构的直销中心及代销机构的代销网点

27. 登记结算业务：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、基金份额注册登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等

28. 登记结算机构：指办理登记结算业务的机构。本基金的登记结算机构为国泰基金管理有限公司委托代为办理注册登记业务的中国证券登记结算有限责任公司或国泰基金管理有限公司委托代为办理登记结算业务的其他机构

29. 基金账户：指登记结算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

30. 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买卖国泰金鼎价值精选基金份额的变动及结余情况的账户

31. 基金合同生效日：指本《国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金基金合同》生效起始日，本基金合同自金鼎证券投资基金终止上市之日起生效，原《金鼎证券投资基金基金合同》自同一日起失效

32. 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

33. 集中申购期：指本基金合同生效后仅开放申购、不开放赎回的一段时间，最长不超过 1 个月

34. 存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

35. 工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

36. T 日：指本基金在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的工作日

37. T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日(不包含 T 日)

38. 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

39. 交易时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段，具体时间见基金开放日常申购、赎回公告

40. 业务规则：指《国泰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结算方面的业务规则，由基金管理人、销售机构和投资人共同遵守

41. 场内申购、赎回：指通过上海证券交易所开放式基金销售系统办理的基金申购、赎回业务

42. 场外申购、赎回：指不通过上海证券交易所开放式基金销售系统，而通过各销售机构柜台系统办理的基金申购、赎回业务

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规定的条件要求卖出基金份额的行为

45. 基金转换：指基金份额持有人按照本基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的、且由同一登记结算机构办理登记结算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同一基金的不同销售机构之间实施的所持基金份额销售机构变更的操作

47. 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)超过上一日基金总份额的 10%

48. 元：指人民币元

49. 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

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

51. 基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

52. 基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数的数值

53. 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

54. 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

55. 指定媒介：指中国证监会指定的用以进行信息披露的全国性报刊及指定互联网网站（包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介

56. 侧袋机制：指将基金投资组合中的特定资产从原有账户分离至一个专门账户进行处置清算，目的在于有效隔离并化解风险，确保投资者得到公平对待，属

于流动性风险管理工具。侧袋机制实施期间，原有账户称为主袋账户，专门账户称为侧袋账户

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

58. 不可抗力：指本基金合同当事人不能预见、不能避免并不能克服且在本基金合同由基金管理人、基金托管人签署之日后发生的，使本基金合同当事人无法全部或部分履行本基金合同的任何事件，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律法规变化、突发停电或其他突发事件、证券交易所非正常暂停或停止交易

59. 基金产品资料概要：指《国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金基金产品资料概要》及其更新（本基金合同关于基金产品资料概要的编制、披露及更新等内容，将不晚于 2020 年 9 月 1 日起执行）

### 三、基金的基本情况

#### （一）基金的名称

国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金

#### （二）基金的类别

混合型

#### （三）基金的运作方式

契约型开放式

#### （四）基金的投资目标

以量化指标分析为基础，在严密的风险控制前提下，不断谋求超越业绩比较基准的稳定回报。

#### （五）基金份额在集中申购期的申购价格和申购费用

基金份额在集中申购期的申购价格为每份人民币 1.000 元。申购费率在招募说明书中列示。



## (六) 基金存续期限

不定期

## 四、基金的历史沿革

国泰金鼎价值精选混合证券投资基金由金鼎证券投资基金转型而成。

### (一) 金鼎证券投资基金

金鼎证券投资基金是根据《证券投资基金管理暂行办法》、国务院关于原有投资基金清理规范的有关要求及中国证券监督管理委员会证监基金字[2000]14号《关于中国建设银行原有投资基金清理规范方案的批复》的精神，由“建业基金”、“沈阳公众基金”、“陕建基金”三只基金经清理规范后合并而成的契约型封闭式基金。

金鼎证券投资基金的基金发起人为国泰基金管理有限公司和国泰君安证券股份有限公司，基金管理人为国泰基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行。基金管理人和基金托管人于2000年3月16日正式接管金鼎证券投资基金，基金规模为232,748,084份基金份额，基金存续期为10年(1992年5月31日至2002年5月30日)。

依据中国证监会《关于同意金鼎证券投资基金上市、扩募和续期的批复》(证监基字[2000]51号)，经上海证券交易所上证上字[2000]59号文批准，金鼎证券投资基金于2000年8月4日在上海证券交易所挂牌交易。金鼎证券投资基金于2000年10月19日完成扩募，基金规模扩募至5亿份基金份额，扩募后基金存续期延长5年(至2007年5月31日)。

2007年3月9日，金鼎证券投资基金基金份额持有人大会以现场方式召开，大会讨论通过了金鼎基金转型议案，内容包括金鼎基金由封闭式基金转为开放式基金、调整存续期限、终止上市、调整投资目标、范围和策略以及修订基金合同等，并形成基金份额持有人大会决议。依据中国证监会2007年3月27日证监基金字[2007]88号文核准，基金份额持有人大会决议生效。依据基金份额持有人大会决议，基金管理人向上海证券交易所申请基金终止上市，自基金终止上市之日起，原《金鼎证券投资基金基金合同》失效，《国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金基金合同》生效，基金正式转型为开放式基金，存续期限调整为不定期，基

金投资目标、范围和策略调整，同时基金更名为“国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金”。

## （二）建业基金、沈阳公众基金和陕建基金等三只基金

建业基金是经中国人民银行（证管办）[1992]36 号文及中国人民银行上海市分行沪银金管[93]5389 号文批准设立，由建设银行原上海市信托投资公司单独发起并管理的存续期为十年的封闭式契约型证券投资基金。该基金于 1993 年 9 月 10 日起向上海市普教系统的教员工定向发行，于 1993 年 12 月 31 日全额募足并开始运作。经中国人民银行复[1996]330 号文、中国人民银行上海市分行沪银非银管[1996]11182 号文和上海市证券交易所上证上[96]字第 107 号文审核同意，建业基金于 1996 年 11 月 29 日在上海证券交易所挂牌交易。建业基金基金规模为一亿基金单位。

沈阳公众基金是经中国人民银行沈阳市分行沈银金[1992]109 号文批准设立，由中国建设银行沈阳市信托投资股份有限公司独立发行并管理的存续期不定的封闭式契约型证券投资基金。该基金于 1992 年 5 月 31 日向社会公众公开发行并投入运作。经中国人民银行沈银金字[1992]267 号文审核同意，沈阳公众基金于 1992 年 10 月 28 日在沈阳证券交易中心挂牌上市。由于经济形势发展需要沈阳证券交易中心于 1994 年 3 月 7 日与上海证券交易所联网，沈阳公众基金成为在上交所挂牌交易的基金。沈阳公众基金基金规模为 5950 万基金单位。

陕建基金是经中国人民银行陕西省分行陕银复[1992]150 号文批准设立，由原建设银行陕西省信托投资公司（现建设银行西安市东大街支行）发起，陕西建银基金管理有限责任公司管理的存续期不定的封闭式契约型证券投资基金。该基金于 1993 年 9 月向社会公众公开发行并投入运作。经中国人民银行陕西省分行审核同意大连证券交易中心大证交字[1993]第 10 号文，陕建基金于 1994 年 1 月 28 日在大连证券交易中心挂牌交易。陕建基金基金规模为 5000 万基金单位。

## 五、基金的存续

### （一）基金份额的变更登记

自金鼎基金终止上市之日起2个工作日内，基金管理人将向中国证券登记结算有限责任公司申请办理基金份额的变更登记。基金管理人向中国证券登记结算有

限责任公司上海分公司取得终止上市权益登记日的基金份额持有人名册之后，将进行基金份额更名以及必要的信息变更，中国证券登记结算有限责任公司将根据基金管理人、中国证券登记结算有限责任公司上海分公司提供的明细数据进行投资者持有基金份额的初始登记。

## (二) 基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

基金合同生效后的存续期内，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，基金管理人应当及时报告中国证监会；基金份额持有人数量连续 20 个工作日达不到 200 人，或连续 20 个工作日基金资产净值低于 5000 万元，基金管理人应当向中国证监会说明出现上述情况的原因并提出解决方案。

## 六、基金份额的申购与赎回

### (一) 申购和赎回场所

本基金的销售机构包括基金管理人和基金管理人委托的代销机构。

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。具体的销售网点将由基金管理人在招募说明书或其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减代销机构，并在管理人网站公示。投资人可通过基金管理人或其指定的代销机构以电话、传真或网上等形式进行申购与赎回，具体办法另行公告。

### (二) 申购和赎回的开放日及时间

#### 1. 开放日及开放时间

投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，场内申购、赎回业务的开放时间为9:30-11:30和13:00-15:00，场外申购、赎回业务的开放时间由基金管理人与销售机构约定，基金管理人根据法律法规或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

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

#### 2. 申购、赎回开始日及业务办理时间

本基金自基金份额变更登记完成后开始办理申购，暂不开放赎回，集中申购

期不超过 1 个月。集中申购期结束后，本基金可暂停办理申购和赎回，暂停期间不超过 1 个月。暂停期间结束后，本基金将开放申购、赎回。

基金管理人应在集中申购期结束后 3 个工作日内聘请合格的验资机构验资，自收到验资报告之日起 10 日内，向中国证监会办理有关备案手续。基金管理人应至少提前 2 个工作日在指定媒介上公告申购与赎回的开始时间。

基金管理人不得在上述公告或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。投资人在上述公告约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请的，其基金份额申购、赎回价格为下一开放日基金份额申购、赎回的价格。

### (三) 申购与赎回的原则

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

2. “金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3. 赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人申(认)购的先后次序进行顺序赎回；

4. 当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；

5. 投资者通过上海证券交易所开放式基金销售系统办理本基金的场内申购、赎回业务时，需遵守上海证券交易所的相关业务规则。基金管理人可根据基金运作的实际情况并不影响基金份额持有人实质利益的前提下调整上述原则。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

### (四) 申购与赎回的程序

#### 1. 申购和赎回的申请方式

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

投资人在提交申购申请时须按销售机构规定的方式备足申购资金，投资人在提交赎回申请时须持有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回申请无效。

#### 2. 申购和赎回申请的确认

登记结算机构应以交易时间结束前受理申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T 日)，并在 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，投资人一般可在 T+ 2 日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。

### 3. 申购和赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式，若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功。若申购不成功或无效，基金管理人或基金管理人指定的代销机构将投资人已缴付的申购款项本金退还给投资人。

投资人赎回申请成功后，基金管理人将在 T+7 日(包括该日)内支付赎回款项。在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照本基金合同有关条款处理。

### (五) 申购和赎回的金额

1. 基金管理人可以规定投资人首次申购和每次申购的最低金额以及每次赎回的最低份额，具体规定请参见招募说明书。

2. 基金管理人可以规定投资人每个基金交易账户的最低基金份额余额，具体规定请参见招募说明书。

3. 基金管理人可以规定单个投资人累计持有的基金份额上限，具体规定请参见招募说明书。

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

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

### (六) 申购和赎回的价格、费用及其用途

1. 本基金份额净值的计算，保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此产生的误差在基金财产中列支。T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

2. 申购份额余额的处理方式：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，保留到小数点后两位，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

3. 赎回金额的处理方式：赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日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，保留到小数点后两位，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

4. 申购费用由投资人承担，并应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

5. 赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。不低于赎回费总额的 25% 应归基金财产，其余用于支付登记结算费和其他必要的手续费。其中，对持续持有期少于 7 日的基金份额持有人收取不低于 1.50% 的赎回费并全额计入基金财产。

6. 本基金的申购费率最高不超过申购金额 3%，赎回费率最高不超过赎回金额的 5%。本基金的申购费率、申购份额具体的计算方法、赎回费率、赎回金额具体的计算方法和收费方式由基金管理人根据基金合同的规定确定，并在招募说明书中列示。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 3 个工作日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

7. 基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对以特定交易方式(如网上交易、电话交易等)等进行基金交易的投资人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申购费率和基金赎回费率。

#### (七) 拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

1. 因不可抗力导致基金无法正常运作。
2. 证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
3. 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况。
4. 当前一估值日基金资产净值 50% 以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金申购申请。
5. 基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害其他基金份额持有人利益时。
6. 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，从而损害现有基金份额持有人利益的情形。

7. 基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资人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。法律法规或中国证监会另有规定的除外。

8. 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、4、5、6、8 项暂停申购情形时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。发生上述第 7 项情形时，基金管理人可以采取比例确认等方式对该投资人的申购申请进行限制，基金管理人有权拒绝该等全部或者部分申购申请。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。

#### (八) 暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

1. 因不可抗力导致基金无法正常运作。

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

3. 连续两个开放日发生巨额赎回。

4. 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况。

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

6. 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已接受的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付，并以后续开放日的基金份额净值为依据计算赎回金额，延期支付最长不得 20 个工作日，并在指定媒介上公告。投资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予以公告。

## (九) 巨额赎回的情形及处理方式

### 1. 巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过前一日的基金总份额的 10%，即认为是发生了巨额赎回。

### 2. 巨额赎回的处理方式

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

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

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

若本基金发生巨额赎回，在单个基金份额持有人超过基金总份额 50%以上的赎回申请的情形下：对于该基金份额持有人当日赎回申请超过上一开放日基金总份额 50%以上的部分，基金管理人可以延期办理赎回申请；对于该基金份额持有人当日赎回申请未超过 50%的部分，可以根据前段“(1) 全额赎回”或“(2) 部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。

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

### 3. 巨额赎回的公告

当发生上述延期赎回时，基金管理人应在 2 日内在指定媒介上刊登公告，说



明有关处理方法。

#### (十) 暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

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

2. 如发生暂停的时间为 1 日，基金管理人应于重新开放日，在至少一种指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近 1 个开放日的基金份额净值。

3. 如发生暂停的时间超过 1 日但少于 2 周，暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 2 日在至少一种指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近 1 个开放日的基金份额净值。

4. 如发生暂停的时间超过 2 周，暂停期间，基金管理人应每 2 周至少刊登暂停公告 1 次。暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 2 日在至少一种指定媒介上连续刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近 1 个开放日的基金份额净值。

#### (十一) 基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及本基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的、且由同一登记结算机构办理登记结算的其他基金之间的转换业务，基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及本基金合同的规定制定并公告，并提前告知基金托管人与相关机构。

#### (十二) 基金的非交易过户

基金的非交易过户是指基金登记结算机构受理继承、捐赠和司法强制执行而产生的非交易过户。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是合格的投资人。

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结算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自申请受理日起 2 个月内办理，并按基金登记结算机构规定的标准收费。

基金的非交易过户规则以登记结算机构发布的规则为准。

### (十三)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标准收取转托管费。

### (十四)实施侧袋机制期间本基金的申购与赎回

本基金实施侧袋机制的，本基金的申购和赎回安排详见招募说明书或相关公告。

## 七、基金合同当事人及权利义务

### (一)基金管理人

名称：国泰基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区浦东大道1200号2层225室

办公地址：上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层-19层

邮政编码：200082

法定代表人：邱军

成立时间：1998年3月5日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监基金字[1998]5号

组织形式：有限责任公司

注册资本：1.1亿元人民币

存续期间：持续经营

### (二)基金托管人

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

邮政编码：100033

法定代表人：田国立

成立时间：2004年9月17日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]12号

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；经中国银行业监督管理委员会等监管部门批准的其他业务

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

### (三) 基金份额持有人

投资人自依基金合同、招募说明书取得基金份额即成为基金份额持有人和基金合同当事人，直至其不再持有本基金的基金份额，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的完全承认和接受。基金份额持有人作为基金合同当事人并不以在基金合同上书面签章或签字为必要条件。

### (四) 基金管理人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的权利为：

1. 自本基金合同生效之日起，依照有关法律法规和本基金合同的规定独立运用基金财产；
2. 依照基金合同获得基金申购费用、基金赎回手续费用和管理费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；
3. 发售基金份额；
4. 依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
5. 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、非交易过户、转托管等业务的规则，决定和调整基金除调高托管费率和管理费之外的相关费率结构和收费方式；
6. 根据本基金合同及有关规定监督基金托管人，对于基金托管人违反了本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；
7. 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回申请；
8. 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、融券；

9. 自行担任或选择、更换登记结算机构，获取基金份额持有人名册，并对登记结算机构的代理行为进行必要的监督和检查；

10. 选择、更换代销机构，并依据销售代理协议和有关法律法规，对其行为进行必要的监督和检查；

11. 选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；

12. 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

13. 依法召集基金份额持有人大会；

14. 法律法规和基金合同规定的其他权利。

#### (五) 基金管理人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的义务为：

1. 依法募集基金，办理或者委托经国务院证券监督管理机构认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购（包括集中申购）、赎回和相关登记事宜；

2. 办理基金备案手续；

3. 自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；

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

5. 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和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，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

7. 依法接受基金托管人的监督；

8. 计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回价格；

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

10. 按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

11. 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

12. 编制季度报告、中期报告和年度报告；

13. 严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义

务；

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

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

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

17. 保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

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

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

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

21. 基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

22. 按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；

23. 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；

24. 执行生效的基金份额持有人大会决议；

25. 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

26. 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利，不谋求对上市公司的控股和直接管理；

27. 法律法规、国务院证券监督管理机构和基金合同规定的其他义务。

#### (六) 基金托管人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的权利为：

1. 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收入；

2. 监督基金管理人对本基金的投资运作；

3. 自本基金合同生效之日起，依法保管基金资产；
4. 在基金管理人更换时，提名新任基金管理人；
5. 根据本基金合同及有关规定监督基金管理人，对于基金管理人违反本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；
6. 依法召集基金份额持有人大会；
7. 按规定取得基金份额持有人名册资料；
8. 法律法规和基金合同规定的其他权利。

#### (七) 基金托管人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的义务为：

1. 安全保管基金财产；
2. 设立专门的基金托管部，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；
3. 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；
4. 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；
5. 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
6. 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；
7. 保守基金商业秘密，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；
8. 对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；
9. 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
10. 按照基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
11. 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
12. 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值和基金份额申购、赎回价格；
13. 按照规定监督基金管理人的投资运作；

14. 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
15. 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；
16. 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；
17. 因违反基金合同导致基金财产损失，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
18. 基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿；
19. 参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
20. 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业监督管理机构，并通知基金管理人；
21. 执行生效的基金份额持有人大会决议；
22. 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；
23. 建立并保存基金份额持有人名册；
24. 法律法规、国务院证券监督管理机构和基金合同规定的其他义务。

#### (八) 基金份额持有人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的权利为：

1. 分享基金财产收益；
  2. 参与分配清算后的剩余基金财产；
  3. 依法申请赎回其持有的基金份额；
  4. 按照规定要求召开基金份额持有人大会；
  5. 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、基金份额发售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；
  9. 法律法规和基金合同规定的其他权利。
- 每份基金份额具有同等的合法权益。

### (九) 基金份额持有人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的义务为：

1. 遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；
2. 缴纳基金认购、申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用；
3. 在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；
4. 不从事任何有损基金及其他基金份额持有人合法权益的活动；
5. 执行生效的基金份额持有人大会决议；
6. 返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人及基金管理人的代理人、基金托管人、代销机构、其他基金份额持有人处获得的不当得利；
7. 法律法规和基金合同规定的其他义务。

(十) 本基金合同当事各方的权利义务以本基金合同为依据，不因基金财产账户名称而有所改变。

## 八、基金份额持有人大会

(一) 基金份额持有人大会由基金份额持有人共同组成。基金份额持有人持有的每一基金份额具有同等的投票权。

### (二) 召开事由

1. 当出现或需要决定下列事由之一的，经基金管理人、基金托管人或持有基金份额 10%以上(含 10%，下同)的基金份额持有人(以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同)提议时，应当召开基金份额持有人大会：

- (1) 终止基金合同；
- (2) 转换基金运作方式；
- (3) 变更基金类别；
- (4) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略；
- (5) 变更基金份额持有人大会程序；
- (6) 更换基金管理人、基金托管人；
- (7) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据适用的相关规定提高该等报酬标准的除外；



- (8) 本基金与其他基金的合并；
- (9) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；
- (10) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

2. 出现以下情形之一的，可由基金管理人和基金托管人协商后修改基金合同，不需召开基金份额持有人大会：

- (1) 调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；
- (2) 在法律法规和本基金合同规定的范围内变更基金的申购费率、赎回费率或收费方式；
- (3) 因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；
- (4) 对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化；
- (5) 基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；
- (6) 按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

### (三) 召集人和召集方式

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

2. 基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当自行召集并确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

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

4. 代表基金份额 10% 以上的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持

有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，代表基金份额 10%以上的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会，但应当至少提前 30 日向中国证监会备案。

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

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

(1) 会议召开的时间、地点和出席方式；

(2) 会议拟审议的主要事项；

(3) 会议形式；

(4) 议事程序；

(5) 有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人权益登记日；

(6) 代理投票的授权委托书的内容要求(包括但不限于代理人身份、代理权限和代理有效期限等)、送达时间和地点；

(7) 表决方式；

(8) 会务常设联系人姓名、电话；

(9) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；

(10) 召集人需要通知的其他事项。

2. 采用通讯方式开会并进行表决的情况下，由召集人决定通讯方式和书面表决方式，并在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见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书面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书面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书面表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

## (五) 基金份额持有人出席会议的方式

### 1. 会议方式

(1) 基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会。

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

(3) 通讯方式开会指按照本基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。

(4) 会议的召开方式由召集人确定，但决定转换基金运作方式、基金管理人更换或基金托管人更换、终止基金合同的事宜必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

### 2. 召开基金份额持有人大会的条件

#### (1) 现场开会方式

在同时符合以下条件时，现场会议方可举行：

1) 对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示，全部有效凭证所对应的基金份额应占权益登记日基金总份额的 50%以上(含 50%，下同)；

2) 到会的基金份额持有人身份证明及持有基金份额的凭证、代理人身份证明、委托人持有基金份额的凭证及授权委托书代理手续完备，到会者出具的相关文件符合有关法律法规和基金合同及会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的注册登记资料相符。

#### (2) 通讯开会方式

在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

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

2) 召集人按基金合同规定通知基金托管人或/和基金管理人(分别或共同称为“监督人”)到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；

3) 召集人在监督人和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的书面表决意见，如基金管理人或基金托管人经通知拒不到场监督的，不影响表决效力；

4) 本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的 50%以上；

5)直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证、授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与登记结算机构记录相符。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入基金份额持有人所代表的基金份额总数。

#### (六)议事内容与程序

##### 1. 议事内容及提案权

(1)议事内容为本基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容。

(2)基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日本基金总份额 10%以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前就召开事由向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案。

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

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

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

(4)单独或合并持有权利登记日基金总份额 10%以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于 6 个月。法律法规另有规定的

除外。

(5) 基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后，如果需要对原有提案进行修改，应当在基金份额持有人大会召开前及时公告。

## 2. 议事程序

### (1) 现场开会

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

大会由召集人授权代表主持。基金管理人为召集人的，其授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权代表主持；如果基金管理人和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人以所代表的基金份额 50%以上多数选举产生一名代表作为该次基金份额持有人大会的主持人。

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

### (2) 通讯方式开会

在通讯表决开会的方式下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后第 2 个工作日统计全部有效表决，在公证机关及监督人的监督下形成决议。如监督人经通知但拒绝到场监督，则在公正机关监督下形成的决议有效。

## 3. 基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

### (七) 决议形成的条件、表决方式、程序

#### 1. 基金份额持有人所持每一基金份额享有平等的表决权。

#### 2. 基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

##### (1) 一般决议

一般决议须经出席会议的基金份额持有人(或其代理人)所持表决权的 50%以上通过方为有效，除下列(2)所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过；

##### (2) 特别决议

特别决议须经出席会议的基金份额持有人(或其代理人)所持表决权的三分之二以上(含三分之二)通过方为有效；涉及更换基金管理人、更换基金托管人、转

换基金运作方式、终止基金合同必须以特别决议通过方为有效。

3. 基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会核准或者备案，并予以公告。

4. 基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

5. 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。

#### (八) 计票

##### 1. 现场开会

(1) 如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，则基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举两名基金份额持有人代表与基金管理人、基金托管人授权的一名监督员共同担任监票人；但如果基金管理人和基金托管人的授权代表未出席，则大会主持人可自行选举三名基金份额持有人代表担任监票人。

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

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

##### 2. 通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监票人在监督人派出的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；如监督人经通知但拒绝到场监督，则大会召集人可自行授权 3 名监票人进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

#### (九) 基金份额持有人大会决议报中国证监会核准或备案后的公告时间、方式

1. 基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决议自中国证监会依

法核准或者出具无异议的意见之日起生效。

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

3. 基金份额持有人大会决议应自生效之日起2日内在至少一种指定媒介公告。

(十) 实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定

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

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

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

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

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

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

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

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

同一主侧袋账户内的每份基金份额具有平等的表决权。

(十一) 法律法规或监管部门对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

## 九、基金管理人、基金托管人的更换条件和程序

### (一)基金管理人的更换

#### 1. 基金管理人的更换条件

有下列情形之一的，经基金份额持有人大会决议并经中国证监会核准，基金管理人职责终止：

- (1) 基金管理人被依法取消基金管理资格；
- (2) 基金管理人依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产；
- (3) 基金管理人被基金份额持有人大会解任；
- (4) 法律法规和基金合同规定的其他情形。

#### 2. 基金管理人的更换程序

更换基金管理人必须依照如下程序进行：

(1) 提名：新任基金管理人由基金托管人提名；

(2) 决议：基金份额持有人大会在原基金管理人职责终止后 6 个月内对被提名的新任基金管理人形成决议，新任基金管理人应当符合法律法规及中国证监会规定的资格条件；

(3) 核准：新任基金管理人产生之前，由中国证监会指定临时基金管理人；更换基金管理人的基金份额持有人大会决议应经中国证监会核准生效后方可执行；

(4) 交接：原基金管理人职责终止的，应当妥善保管基金管理业务资料，及时办理基金管理业务的移交手续，新任基金管理人或临时基金管理人应当及时接收，并与基金托管人核对基金资产总值；

(5) 审计：原基金管理人职责终止的，应当按照法律法规规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报国务院证券监督管理机构备案，审计费用在基金财产中列支；

(6) 公告：基金管理人更换后，由基金托管人在获得中国证监会核准后 2 日内公告；

(7) 基金名称变更：基金管理人更换后，如果原任或新任基金管理人要求，应按其要求替换或删除基金名称中与原任基金管理人有关的名称字样。



## (二) 基金托管人的更换

### 1. 基金托管人的更换条件

有下列情形之一的，经基金份额持有人大会决议并经中国证监会核准，基金托管人职责终止：

- (1) 基金托管人被依法取消基金托管资格；
- (2) 基金托管人依法解散、被依法撤销或者被依法宣布破产；
- (3) 基金托管人被基金份额持有人大会解任；
- (4) 法律法规和基金合同规定的其他情形。

### 2. 基金托管人的更换程序

(1) 提名：新任基金托管人由基金管理人提名；

(2) 决议：基金份额持有人大会在原基金托管人职责终止后 6 个月内对被提名的新任基金托管人形成决议，新任基金托管人应当符合法律法规及中国证监会规定的资格条件；

(3) 核准：新任基金托管人产生之前，由中国证监会指定临时基金托管人，更换基金托管人的基金份额持有人大会决议应经中国证监会核准生效后方可执行；

(4) 交接：原基金托管人职责终止的，应当妥善保管基金财产和基金托管业务资料，及时办理基金财产和托管业务移交手续，新任基金托管人或临时基金托管人应当及时接收，并与基金管理人核对基金资产总值；

(5) 审计：原基金托管人职责终止的，应当按照法律法规规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报国务院证券监督管理机构备案，审计费用从基金财产中列支；

(6) 公告：基金托管人更换后，由基金管理人在获得中国证监会核准后 2 日内公告。

## (三) 基金管理人与基金托管人同时更换

1. 提名：如果基金管理人和基金托管人同时更换，由单独或合计持有基金总份额 10% 以上的基金份额持有人提名新的基金管理人和基金托管人；

2. 基金管理人和基金托管人的更换分别按上述程序进行；

3. 公告：新任基金管理人和新任基金托管人应在更换基金管理人和基金托管人的基金份额持有人大会决议获得中国证监会核准后 2 日内在指定媒介上联合公告。

(四)新基金管理人接收基金管理业务或新基金托管人接收基金财产和基金托管业务前，原基金管理人或原基金托管人应继续履行相关职责。

## 十、基金的托管

基金财产由基金托管人保管。基金管理人应与基金托管人按照《基金法》、基金合同及有关规定订立《国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金托管协议》。订立托管协议的目的是明确基金托管人与基金管理人之间在基金份额持有人名册登记、基金财产的保管、基金财产的管理和运作及相互监督等相关事宜中的权利义务及职责，确保基金财产的安全，保护基金份额持有人的合法权益。

## 十一、基金份额的登记

(一)本基金的登记结算业务指基金登记、存管、清算和结算业务，具体内容  
包括投资人基金账户建立和管理、基金份额注册登记、基金销售业务的确认、清  
算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等。

(二)本基金的登记结算业务由基金管理人委托的中国证券登记结算有限责任  
公司负责办理。基金管理人应与中国证券登记结算有限责任公司签订委托代理协  
议，以明确基金管理人和代理机构在登记结算业务中的权利义务，保护基金份额  
持有人的合法权益。

(三)登记结算机构享有如下权利：

1. 建立和管理投资人基金账户；
2. 取得登记结算费；
3. 保管基金份额持有人开户资料、交易资料、基金份额持有人名册等；
4. 在法律法规允许的范围内，制定和调整登记结算业务的相关规则；
5. 法律法规规定的其他权利。

(四)登记结算机构承担如下义务：

1. 配备足够的专业人员办理本基金的登记结算业务；
2. 严格按照法律法规和基金合同规定的条件办理基金的登记结算业务；

3. 保存基金份额持有人名册及相关的申购、赎回业务记录 15 年以上；
4. 对基金份额持有人的基金账户信息负有保密义务，因违反该保密义务对投资人或基金带来的损失，须承担相应的赔偿责任，但司法强制检查情形除外；
5. 按基金合同和招募说明书规定为投资人办理非交易过户、转托管等业务，并提供其他必要服务；
6. 法律法规规定的其他义务。

## 十二、基金的投资

### (一) 投资目标

本基金为价值精选混合型股票基金，以量化指标分析为基础，在严密的风险控制前提下，不断谋求超越业绩比较基准的稳定回报。

### (二) 投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含存托凭证）、债券、短期金融工具、权证、资产支持证券及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中债券投资的主要品种包括交易所和银行间两个市场的国债、金融债、企业债与可转换债。如果法律法规或监管机构以后允许基金投资其它品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金股票资产的投资比例占基金资产的 35%-95%，权证投资比例占基金资产净值的 0-3%；债券资产的投资比例占基金资产的 0-60%，其中资产支持证券类资产的投资比例占基金资产净值的 0%-10%；现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

### (三) 投资策略

#### 1. 大类资产配置

本基金的大类资产配置主要通过对宏观经济运行状况、国家财政和货币政策、国家产业政策以及资本市场资金环境、证券市场走势的分析，预测宏观经济的发展趋势，并据此评价未来一段时间股票、债券市场相对收益率，主动调整股票、

债券及现金类资产的配置比例。

本基金资产配置主要包括战略性资产配置和战术性资产配置：战略性资产配置首先分析较长时间段内所关注的各类资产的预期回报率和风险，然后确定最能满足各类基金风险-回报率目标的资产组合；战术性资产配置根据各类资产长短期平均回报率不同，预测短期性回报率，调整资产配置，获取市场时机选择的超额收益。本基金的资产配置主要采用定量分析与定性分析相结合的方法。

在定量分析方面，主要采用均衡市盈率预测模型，并参考其他相关指标。均衡市盈率模型的思路是通过测算 A 股市场理论上均衡的市盈率水平，然后将其与 A 股市场整体、基金股票池的实际市盈率水平进行比较，来判定股票市场系统性风险的高低，最后则根据理论值与实际值的差异程度来决定资产配置中股票资产的配置比例。另外，本基金还参照股息率、收益率差距表（ $1/PE$ -银行利率）等指标，来判断股市是否处于合理水平。

在定性分析方面，主要对可能影响市场走势的相关因素进行定性分析，并根据定量模型作出的资产配置方案进行修正。定性因素涉及很多方面，主要包括国家宏观经济和证券市场政策、利率和汇率政策、国家政治环境、资本项目外汇管理政策、市场参与主体的诚信程度等。

## 2. 股票资产投资策略

本基金以量化分析为基础，从上市公司的基本面分析入手，建立基金的一、二级股票池。根据股票池中个股的估值水平和  $\alpha$  值，运用组合优化模型，积极创建并持续优化基金的股票组合，在有效控制组合总体风险的前提下，谋求超额收益。

### 基金股票池的建立

本基金采取自下而上的方法，从个股选择入手，根据个股的基本面信息，运用多因子模型，选取各行业中具有内在价值的个股组成基金的一级股票池；在一级股票池的基础上，运用现金流折价模型和个股超额收益分析，筛选个股组建基金的二级股票池。

#### 1) 一级股票池个股筛选

本基金在建立一级股票池时，是以行业为单位，按照不同行业各自的特点，选取不同的估值因子构建多因子估值模型，对行业内的个股进行估值。本基金的行业分类以天相行业分类标准为依据。

本基金在运用估值模型对行业内个股内在价值估值的基础上，选取各行业内价值排名前 1/3 的个股组成基金的一级股票池。

#### 2) 二级股票池个股筛选

本基金二级股票池是以现金流折价模型和个股超额收益分析（个股的  $\alpha$  值）做为筛选标准对基金一级股票池中的个股进行二次筛选。

本基金在运用现金流折现模型时，通过对上市公司未来业绩的预测和场景模拟等方法，估算个股的未来现金流；在折现因子的确定上，本基金运用加权平均资本成本模型（WACC），充分考虑到股权成本和债券成本的差异和税务盾牌的作用，精确估算个股的折现值。对于周期性行业等现金流波动较大的行业，本基金在现金流折现的基础上，依据这类个股的市场表现，估算个股的  $\alpha$  值，以  $\alpha$  值作为二次选股的优先考虑因素。

本基金在一级股票池中选取折现值靠前的 300 个左右个股组成基金的二级股票池。

#### 3) 股票组合构建和调整

本基金在充分考虑个股内在价值和风险收益水平的基础上，在二级股票池中选取个股构建基金的股票组合，运用组合优化模型不断优化股票组合，以达到单位风险下的收益最大化。

### 3. 存托凭证投资策略

本基金将根据投资目标，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。

### 4. 债券资产投资策略

本基金的债券资产投资主要以长期利率趋势分析为基础，结合中短期的经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析，通过债券置换和收益率曲线配置等方法，实施积极的债券投资管理。

#### 1) 收益率曲线配置具体策略

当预测收益率曲线平行上移或是陡峭化时，适当地降低债券组合的平均久期；当预测收益率曲线平行下移或是平坦化时，适当地增加债券组合的平均久期；当预测收益率曲线剧烈平行上移时，同时降低债券组合的平均久期和债券组合的持仓量；当预测收益率曲线剧烈平行下移时，同时增加债券组合的平均久期和债券组合的持仓量；当预测收益率曲线（正向或是反向）蝴蝶型变化时，适当地将债

券组合进行子弹型或是哑铃型配置。

## 2) 债券置换策略

本基金以利差分析为基础，当债券利差增大时，适当增加企业债和金融债的数量、减少国债的数量，当债券利差减小时，适当增加国债的数量、减少企业债和金融债的数量；债券组合的平均信用等级保持在投资级（A+级）以上。

在通过上述配置方法构建债券组合之后，本基金在出现以下情况时对债券投资组合进行动态调整：

(1) 短期经济运行指标，如短期通货膨胀率、短期名义利率、汇率等发生变动，引起的市场实际利率的变动；

(2) 中长期国内通货膨胀预期的变动引起中长期利率走势变动，导致整个投资组合重新估价；

(3) 央行通过公开市场操作引导市场收益率水平的走向，从而引起债券市场结构性调整；

(4) 债券一级市场上的发行方式创新及新债定价与认购情况发生变化，导致二级市场收益率产生波动；

(5) 由于市场交易规则改变等因素引起的流动风险溢价的重新估价；

(6) 市场平均风险偏好的变化引起信用风险溢价的变动；

(7) 单个券种或某一类别债券的定价偏差，也就是市场失衡导致的投资机会等。

## (四) 业绩比较基准

业绩比较基准： $65\%$  上证综合指数收益率 +  $35\%$  上证国债指数收益率

上证综合指数和上证国债指数市场代表性较强，适合作为本基金的业绩比较基准。

在本基金的运作过程中，如果由于外部投资环境或法律法规的变化而使得调整业绩比较基准更符合基金份额持有人的利益，则基金管理人在经过基金托管人同意后可以业绩比较基准进行适当调整，并在报中国证监会核准后，公告并予以实施。

## (五) 风险收益特征

本基金属于具有较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种。

## （六）选券标准

### 1. 债券资产选择标准

- （1）个券信用等级在 AA 级或其同等级别以上；
- （2）相同剩余期限中到期收益率较高的；
- （3）有较好流动性（日成交量大、买卖价差小）；
- （4）通过二叉树模型估算所含期权被市场低估的可转债；
- （5）可转债具有不可撤销的连带责任担保或者资产抵押。

### 2. 股票资产选择标准

- （1）利用多因子估值模型筛选出的各行业股值前 1/3 的个股；
- （2）根据现金流折现模型和个股  $\alpha$  值，对个股进行二次估值；
- （3）通过内在价值分析，对内在价值被低估的个股进行重点投资。

### 3. 权证选择标准：

对权证的投资建立在对标的证券和组合收益进行分析的基础之上，主要用于锁定收益和控制风险。

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

（2）计算权证合理价值与其市场价格间的差幅以及权证合理价值对定价参数的敏感性，为权证的具体操作提供依据。

## （七）投资限制

### 1. 组合限制

本基金在投资策略上兼顾投资原则以及开放式基金的固有特点，通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。基金的投资组合将遵循以下限制：

（1）本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%；

（2）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

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

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

股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；

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

(6) 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%；

(7) 本基金股票资产的投资比例占基金资产的 35%-95%，权证投资占基金资产净值的 0-3%，债券资产的投资比例占基金资产的 0-60%，其中资产支持证券类资产占基金资产净值的 0-10%；

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

(9) 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%；

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

(11) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。本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；

(12) 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%；

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

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

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

(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) 本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行，与境内



上市交易的股票合并计算；

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

除上述第(8)、(11)、(15)、(16)项另有约定外，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价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。

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。

## 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) 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，但是国务院另有规定的除外；

(5) 向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；

(6) 买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；

(7) 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；

(8) 依照法律法规有关规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

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

(七) 基金的融资、融券

本基金可以按照国家的有关规定进行融资、融券。

(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。

侧袋机制实施期间，本部分约定的投资组合比例、投资策略、组合限制、业

绩比较基准、风险收益特征等约定仅适用于主袋账户。

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

### 十三、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、基金应收申购款以及其他资产的价值总和。

#### (二) 基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

#### (三) 基金财产的账户

本基金财产以基金名义开立银行存款账户，以基金托管人的名义开立证券交易清算资金的结算备付金账户，以基金托管人和本基金联名的方式开立基金证券账户，以本基金的名义开立银行间债券托管账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和登记结算机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

#### (四) 基金财产的处分

基金财产独立于基金管理人、基金托管人和代销机构的固有财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益归入基金财产。基金管理人、基金托管人可以按基金合同的约定收取管理费、托管费以及其他基金合同约定的费用。基金财产的债权、不得与基金管理人、基金托管人固有财产的财产的债务相抵销，不同基金财产的债权债务，不得相互抵销。基金管理人、基金托管人以其自有资产承担法律责任，其债权人不得对基金财产行使请求冻结、扣押和其他权利。

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

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

## 十四、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正常营业日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非营业日。

### 二、估值方法

#### 1. 股票估值方法：

(1) 上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。

(2) 未上市股票的估值：

1) 首次发行未上市的股票，按成本计量；

2) 送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价估值；

3) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的市价估值；

4) 非公开发行有明确锁定期的流通受限股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值；

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

(4) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

#### 2. 债券估值方法：

(1) 证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，按最近交易日的收盘价估值；

(2) 证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的应收利息(自债券计息起始日或上一起息日至估值当日的利息)得到的净

价进行估值，估值日没有交易的，以最近交易日的收盘净价估值；

(3) 发行未上市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，按成本进行后续计量；

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

(5) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值；

(6) 在任何情况下，基金管理人如采用本项第(1)－(5)小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第(1)－(5)小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上形成的债券估值，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值；

(7) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

### 3. 权证估值方法：

(1) 基金持有的权证，从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的权证按估值日在证券交易所挂牌的该权证的收盘价估值；估值日没有交易的，按最近交易日的收盘价估值；

未上市交易的权证采用估值技术确定公允价值；在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量；

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

(3) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

4. 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，国家有最新规定的，按其规定进行估值。

5. 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。

6. 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見，按照基金管理人對基金资产净值的计算结果对外予以公布。

### 三、估值对象

基金所拥有的股票、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产。

### 四、估值程序

1. 基金份额净值是按照每个开放日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到 0.001 元，小数点后第四位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

2. 基金管理人应每个工作日对基金资产估值。基金管理人每个开放日对基金资产估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

### 五、估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后 3 位以内(含第 3 位)发生差错时，视为基金份额净值错误。

本基金合同的当事人应按照以下约定处理：

#### 1. 差错类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或登记结算机构、或代销机构、或投资人自身的过错造成差错，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该差错遭受损失的当事人(“受损方”)按下述“差错处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

上述差错的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等；对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平不能预见、不能避免、不能克服，则属不可抗力，按照下述规定执行。

由于不可抗力原因造成投资人的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，

因不可抗力原因出现错误的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该错误取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

## 2. 差错处理原则

(1) 差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已产生的差错，给当事人造成损失的，由差错责任方承担赔偿责任；若差错责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责任。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正。

(2) 差错的责任方对可能导致有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对差错的有关直接当事人负责，不对第三方负责。

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

(4) 差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式。

(5) 差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人过错造成基金财产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人过错造成基金财产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。基金管理人和托管人之外的第三方造成基金财产的损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错方追偿；追偿过程中产生的有关费用，应列入基金费用，从基金资产中支付。

(6) 如果出现错误的当事人未按规定对受损方进行赔偿，并且依据法律法规、基金合同或其他规定，基金管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任，则基金管理人有权向出现过错的当事人进行追索，并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失。

(7) 按法律法规规定的其他原则处理差错。

## 3. 差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

(1) 查明差错发生的原因，列明所有的当事人，并根据差错发生的原因确定差错的责任方；

(2) 根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；

(3) 根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失；

(4) 根据差错处理的方法，需要修改基金登记结算机构交易数据的，由基金登记结算机构进行更正，并就差错的更正向有关当事人进行确认。

4. 基金份额净值差错处理的原则和方法如下：

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

(3) 因基金份额净值计算错误，给基金或基金份额持有人造成损失的，应由基金管理人先行赔付，基金管理人按差错情形，有权向其他当事人追偿。

(4) 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。

(5) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

六、暂停估值的情形

1. 基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2. 因不可抗力或其它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；

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. 如出现基金管理人认为属于紧急事故的任何情况，会导致基金管理人不能出售或评估基金资产的；

5. 中国证监会认定的其它情形。

七、基金净值的确认

用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，

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

#### 八、特殊情况的处理

1. 基金管理人或基金托管人按股票估值方法的第(3)项、债券估值方法的第(6)项或权证估值方法的第(2)项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

2. 由于不可抗力原因，或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，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。但基金管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

#### 九、实施侧袋机制期间的基金资产估值

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

## 十五、基金的费用与税收

### (一) 基金费用的种类

1. 基金管理人的管理费；
2. 基金托管人的托管费；
3. 基金财产拨划支付的银行费用；
4. 基金合同生效后的信息披露费用；
5. 基金份额持有人大会费用；
6. 基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
7. 基金的证券交易费用；
8. 在中国证监会规定允许的前提下，本基金可以从基金财产中计提销售服务费，具体计提方法、计提标准在招募说明书或相关公告中载明；
9. 依法可以在基金财产中列支的其他费用。



(二)上述基金费用由基金管理人、基金托管人在法律规定的范围内按照公允的市场价格按实列支，法律法规另有规定时从其规定。

(三)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

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 1.2%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

2. 基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.20%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

3. 除管理费和托管费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

(四)不列入基金费用的项目

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

(五)基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日 2 日前在指定媒介上刊登公告。

#### (六) 实施侧袋机制期间的基金费用

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

#### (七) 基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

## 十六、基金的收益与分配

### (一) 基金收益的构成

1. 买卖证券差价；
2. 基金投资所得红利、股息、债券利息；
3. 银行存款利息；
4. 已实现的其他合法收入；
5. 持有期间产生的公允价值变动。

因运用基金财产带来的成本或费用的节约应计入收益。

### (二) 基金净收益

基金净收益为基金收益扣除按国家有关规定应在基金收益中扣除的费用后的余额。

### (三) 收益分配原则

本基金收益分配应遵循下列原则：

1. 本基金的每份基金份额享有同等分配权；
2. 基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值；
3. 收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人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，基金注册登记机构可将投资人的现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额。
4. 在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益可进行分配，本基金收益每年最多分配 6 次，每年基金收益分配比例不低于当年可分配收益的 90%；
5. 本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现

金红利或将现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

6. 基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；
7. 基金当年收益应先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配；
8. 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

#### (四) 收益分配方案

基金收益分配方案中应载明基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式、支付方式等内容。

#### (五) 收益分配的时间和程序

1. 基金收益分配方案由基金管理人拟订，由基金托管人复核，依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告；

2. 在收益分配方案公布后，基金管理人依据具体方案的规定就支付的现金红利向基金托管人发送划款指令，基金托管人按照基金管理人的指令及时进行分红资金的划付。

#### (六) 实施侧袋机制期间的收益分配

本基金实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配，详见招募说明书的规定。

## 十七、基金的会计和审计

### (一) 基金的会计政策

1. 基金管理人为本基金的会计责任方；
2. 本基金的会计年度为公历每年的1月1日至12月31日；
3. 本基金的会计核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
4. 会计制度执行国家有关的会计制度；
5. 本基金独立建账、独立核算；
6. 基金管理人保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；
7. 基金托管人定期与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并书面确认。

## (二) 基金的审计

1. 基金管理人聘请具有从事证券、期货相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金年度财务报表及其他规定事项进行审计。会计师事务所及其注册会计师与基金管理人、基金托管人相互独立。

2. 会计师事务所更换经办注册会计师时，应事先征得基金管理人同意。

3. 基金管理人(或基金托管人)认为有充足理由更换会计师事务所，经基金托管人(或基金管理人)同意后可以更换。更换会计师事务所需按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

## 十八、基金的信息披露

基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同及其他有关规定。基金管理人、基金托管人和其他基金信息披露义务人应当依法披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性、完整性、及时性、简明性和易得性。

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

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

本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

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

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

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

公开披露的基金信息包括：

#### (一) 招募说明书、基金产品资料概要

招募说明书是基金向社会公开发售时对基金情况进行说明的法律文件。

基金管理人按照《基金法》、《信息披露办法》、基金合同编制并在基金份额集中申购的 3 日前，将基金招募说明书登载在指定报刊和网站上。基金合同生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在指定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。

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

#### (二) 基金合同、托管协议

基金管理人应在基金份额集中申购的 3 日前，将基金合同摘要登载在指定报刊和网站上；基金管理人、基金托管人应将基金合同、托管协议登载在各自网站上。

#### (三) 集中申购公告

基金管理人应当就集中申购的具体事宜编制集中申购公告，并在披露招募说明书的当日登载于指定报刊和网站上。

#### (四) 基金净值信息公告

1. 本基金的基金合同生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人将至少每周在指定网站披露一次基金份额净值和基金份额累计净值；

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

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

#### (五) 基金份额申购、赎回价格公告

基金管理人应当在本基金的基金合同、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，并保证投资人能够在基金销售机构网站或营业网点查阅或者复制前述信息资料。

#### (六) 基金年度报告、基金中期报告、基金季度报告

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

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

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

4. 《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；

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

6. 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) 临时报告与公告

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

前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产

生重大影响的下列事件：

1. 基金份额持有人大会的召开及决定的事项；
2. 《基金合同》终止、基金清算；
3. 转换基金运作方式、基金合并；
4. 更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；
5. 基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；
6. 基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
7. 基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人的实际控制人变更；
8. 基金集中申购期延长；
9. 基金管理人的高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；
10. 基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十，基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十；
11. 涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁；
12. 基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；
13. 基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易事项，但中国证监会另有规定的除外；
14. 基金收益分配事项；
15. 管理费、托管费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
16. 基金份额净值计价错误达基金份额净值 0.5%；
17. 本基金开始办理申购、赎回；
18. 本基金发生巨额赎回并延期办理；

19. 本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；
20. 本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；
21. 基金推出新业务或服务；
22. 发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；
23. 基金信息披露义务人认为可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的其他事项或中国证监会规定的其他事项。

#### (八) 澄清公告

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

#### (九) 基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当公告并依法报中国证监会备案。

#### (十) 清算报告

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

#### (十一) 实施侧袋机制期间的信息披露

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

#### (十二) 信息披露事务管理

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

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

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

基金管理人、基金托管人应当在指定报刊中选择一家报刊披露本基金信息。



基金管理人、基金托管人应当向中国证监会基金电子披露网站报送拟披露的基金信息，并保证相关报送信息的真实、准确、完整、及时。

基金管理人、基金托管人除依法在指定媒介上披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒介披露信息，但是其他公共媒介不得早于指定媒介披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

为基金信息披露义务人公开披露的基金信息出具审计报告、法律意见书的专业机构，应当制作工作底稿，并将相关档案至少保存到《基金合同》终止后 10 年，法律法规另有规定的从其规定。

基金管理人、基金托管人除按法律法规要求披露信息外，也可着眼于为投资者决策提供有用信息的角度，在保证公平对待投资者、不误导投资者、不影响基金正常投资操作的前提下，自主提升信息披露服务的质量。具体要求应当符合中国证监会及自律规则的相关规定。前述自主披露如产生信息披露费用，该费用不得从基金财产中列支。

(十三) 中国证监会规定的其他信息

(十四) 信息披露文件的存放与查阅

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

(十五) 本基金信息披露事项以法律法规规定及本章节约定的内容为准。

## 十九、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. 基金合同变更内容对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的，应召开基金份额持有人大会，基金合同变更的内容应经基金份额持有人大会决议同意。

(1) 终止基金合同；

(2) 转换基金运作方式；

(3) 变更基金类别；

(4) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略；

(5) 变更基金份额持有人大会程序；

(6) 更换基金管理人、基金托管人；

(7) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准。但根据适用的相关规定提高该等报酬标准的除外；

(8) 本基金与其他基金的合并；

(9) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；

(10) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

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

(1) 调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；

(2) 在法律法规和本基金合同规定的范围内变更基金的申购费率、赎回费率或收费方式；

(3) 因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；

(4) 对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化；

(5) 基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；

(6) 按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

2. 关于变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案，并于中国证监会核准或出具无异议意见后生效执行，并自生效之日起 2 日内在至少一种指定媒介公告。

## (二) 本基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同经中国证监会核准后将终止：

1. 基金份额持有人大会决定终止的；

2. 基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在 6 个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务；

3. 基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而在 6 个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务；

4. 中国证监会允许的其他情况。

## (三) 基金财产的清算

### 1. 基金财产清算组

(1) 基金合同终止时，成立基金财产清算组，基金财产清算组在中国证监会的

监督下进行基金清算。

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

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

## 2. 基金财产清算程序

基金合同终止，应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。基金合同终止后，发布基金财产清算公告。基金财产清算程序主要包括：

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

## 3. 清算费用

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

## 4. 基金财产按下列顺序清偿：

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

基金财产未按前款(1)－(3)项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

## 5. 基金财产清算的公告

基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算组公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算结果

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

#### 6. 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 二十、违约责任

(一)基金管理人、基金托管人在履行各自职责的过程中，违反《基金法》规定或者本基金合同约定，给基金财产或者基金份额持有人造成损害的，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任；因共同行为给基金财产或者基金份额持有人造成损害的，应当承担连带赔偿责任。但是发生下列情况的，当事人可以免责：

1. 不可抗力；

2. 基金管理人和/或基金托管人按照当时有效的法律法规或中国证监会的规定作为或不作为而造成的损失等；

3. 基金管理人由于按照基金合同规定的投资原则行使或不行使其投资权而造成的损失等。

4. 在基金运作过程中，基金管理人及基金托管人按照《基金法》的规定以及本基金合同的约定履行了相关职责，但由于第三方的原因而造成运作不畅、出现差错和损失的。

(二)基金合同当事人违反基金合同，给其他当事人造成经济损失的，应当承担赔偿责任。在发生一方或多方违约的情况下，基金合同能继续履行的，应当继续履行。

(三)本基金合同一方当事人造成违约后，其他当事人应当采取适当措施防止损失的扩大；没有采取适当措施致使损失扩大的，不得就扩大的损失要求赔偿。守约方因防止损失扩大而支出的合理费用由违约方承担。

(四)因一方当事人违约而导致其他当事人损失的，基金份额持有人应先于其他受损方获得赔偿。

(五)由于基金管理人、基金托管人不可控制的因素导致业务出现差错，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

发现错误的，由此造成基金财产或投资人损失，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但是基金管理人和基金托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

## 二十一、争议的处理

对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

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

本基金合同受中国法律管辖。

## 二十二、基金合同的效力

基金合同是约定基金当事人之间、基金与基金当事人之间权利义务关系的法律文件。

(一) 本基金合同由《金鼎证券投资基金基金合同》修订而成。本基金合同经金鼎基金份额持有人大会决议授权，由基金管理人和基金托管人盖章以及双方法定代表人或其授权代表签字，报中国证监会核准后，自金鼎基金终止上市之日起生效，原《金鼎证券投资基金基金合同》自同日起失效。

(二) 本基金合同自生效之日起对包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人在内的基金合同各方当事人具有同等的法律约束力。

(三) 本基金合同正本一式八份，除中国证监会和银行业监督管理机构各持两份外，基金管理人和基金托管人各持有两份。每份均具有同等的法律效力。

(四) 本基金合同可印制成册，供投资人在基金管理人、基金托管人、代销机构和注册登记机构办公场所查阅，但其效力应以基金合同正本为准。

### 二十三、其他事项

本基金合同如有未尽事宜，由本基金合同当事人各方按有关法律法规和规定协商解决。

### 二十四、基金管理人和基金托管人签章

（见下页）

本页无正文，为《国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金基金合同》签字页。

基金合同当事人盖章及其法定代表人或授权代表签字、签订地、签订日

基金管理人：国泰基金管理有限公司

（法定代表人或授权代表签字）

基金托管人：中国建设银行