

**兴华基金管理有限公司**

**兴华创新医疗 6 个月持有期混合型  
发起式证券投资基金  
招募说明书**

**(2023 年 7 月更新)**

**基金管理人：兴华基金管理有限公司**

**基金托管人：中信证券股份有限公司**

2023 年 7 月

# 目录

|                                |     |
|--------------------------------|-----|
| 重要提示 .....                     | 1   |
| 第一部分 绪言 .....                  | 4   |
| 第二部分 释义 .....                  | 5   |
| 第三部分 基金管理人 .....               | 10  |
| 第四部分 基金托管人 .....               | 16  |
| 第五部分 相关服务机构 .....              | 20  |
| 第六部分 基金的募集 .....               | 24  |
| 第七部分 基金合同的生效 .....             | 25  |
| 第八部分 基金份额的申购和赎回 .....          | 26  |
| 第九部分 基金的投资 .....               | 36  |
| 第十部分 基金的业绩 .....               | 48  |
| 第十一部分 基金的财产 .....              | 50  |
| 第十二部分 基金资产估值 .....             | 51  |
| 第十三部分 基金的收益与分配 .....           | 57  |
| 第十四部分 基金的费用与税收 .....           | 59  |
| 第十五部分 基金的会计与审计 .....           | 61  |
| 第十六部分 基金的信息披露 .....            | 62  |
| 第十七部分 侧袋机制 .....               | 69  |
| 第十八部分 风险揭示 .....               | 71  |
| 第十九部分 基金合同的变更、终止和基金财产的清算 ..... | 78  |
| 第二十部分 基金合同的内容摘要 .....          | 80  |
| 第二十一部分 基金托管协议的内容摘要 .....       | 104 |
| 第二十二部分 基金份额持有人服务 .....         | 122 |
| 第二十三部分 其他应披露事项 .....           | 124 |
| 第二十四部分 招募说明书存放及其查阅方式 .....     | 125 |
| 第二十五部分 备查文件 .....              | 126 |

## 重要提示

本基金经中国证监会 2021 年 9 月 30 日证监许可[2021]3185 号文注册募集。本基金基金合同于 2021 年 11 月 30 日正式生效。

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

投资有风险，投资者认购（或申购）基金份额时应认真阅读本招募说明书，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。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、存托凭证、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许投资的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（包括国债、金融债、地方政府债券、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府支持债券、政府支持机构债券、次级债、证券公司短期公司债券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券等）、资产支持证券、债券回购、货币市场工具、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、金融衍生品（包括股指期货、国债期货、股票期权）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：本基金股票及存托凭证资产占基金资产的比例为60%-95%（其中港股通标的股票占股票资产的比例不超过50%），其中投资于本基金所界定的创新医疗主题相关行业股票的比例不低于非现金基金资产的80%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约、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5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金为混合型基金，一般而言，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。本基金可投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

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

本基金可根据投资策略需要或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。

本基金可投资于资产支持证券（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。

本基金可投资于股指期货，股指期货作为一种金融衍生品，主要存在市场风险、流动性风险、基差风险、保证金风险、杠杆风险、信用风险、操作风险。

本基金可投资于股票期权，投资股票期权的风险包括但不限于市场风险、流动性风险、交易对手信用风险、操作风险、保证金风险等。由此可能增加本基金净值的波动性。

本基金可投资于国债期货，国债期货市场的风险类型较为复杂，涉及面广，具有放大性与可预防性等特征。其风险主要有市场价格风险、系统风险、流动性风险、制度性风险以及技术系统风险等。

基金投资存托凭证在承担境内上市交易股票投资的共同风险外，还将承担与存托凭证、创新企业发行、境外发行人以及交易机制相关的特有风险。

本基金可参与融资交易，融资交易的风险主要包括流动性风险、信用风险等，这些风险可能会给基金净值带来一定的负面影响和损失。

本基金单一投资者持有基金份额数不得超过基金份额总数的50%（基金管理人或其高级管理人员、基金经理等人员作为发起资金提供方除外），但在基金运作过程中因基金份额赎回等基金管理人无法予以控制的情形导致超过50%的除外。法律法规、监管机构另有规定的，从其规定。

本基金对每份基金份额设置6个月持有期。在基金份额的6个月持有期到期日前（不含当日），基金份额持有人不能对该基金份额提出赎回申请；基金份额的6个月持有期到期日起（含当日），基金份额持有人可对该基金份额提出赎回申请。因此基金份额持有人面临在锁定期内不能赎回基金份额的风险。

---

《基金合同》生效满3年之日（指自然日），若基金资产净值低于2亿元，无需召开基金份额持有人大会审议，基金合同应当终止，且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续。若届时适用的法律法规或中国证监会规定发生变化，上述终止规定被取消、更改或补充，则本基金可以参照届时有效的法律法规或中国证监会规定执行。投资者将面临基金合同可能终止的不确定性风险。

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资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。本基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现；基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。

本招募说明书已经本基金托管人复核。本基金有关财务数据和净值表现数据截止日为2023年6月30日，除非另有说明，本招募说明书其他所载内容截止日为2023年7月28日。本招募说明书所载的财务数据未经审计。

---

---

## 第一部分 绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性风险管理规定》”)以及《兴华创新医疗 6 个月持有期混合型发起式证券投资基金基金合同》编写。

本招募说明书阐述了兴华创新医疗 6 个月持有期混合型发起式证券投资基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资者投资决策有关的全部必要事项,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

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

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

本基金按照中国法律法规成立并运作,若基金合同、招募说明书的内容与届时有效的法律法规的强制性规定不一致,应当以届时有效的法律法规的规定为准。

## 第二部分 释义

《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：指兴华创新医疗 6 个月持有期混合型发起式证券投资基金
- 2、基金管理人：指兴华基金管理有限公司
- 3、基金托管人：指中信证券股份有限公司
- 4、基金合同：指《兴华创新医疗 6 个月持有期混合型发起式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《兴华创新医疗 6 个月持有期混合型发起式证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
- 6、招募说明书或本招募说明书：指《兴华创新医疗 6 个月持有期混合型发起式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《兴华创新医疗 6 个月持有期混合型发起式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《兴华创新医疗 6 个月持有期混合型发起式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 日实施的，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》修正的《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、基金合同当事人：指受基金合同约束，根据基金合同享有权利并承担义务的法律主

体,包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人

17、个人投资者:指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

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

19、合格境外投资者: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使用来自境外的资金进行境内证券期货投资的境外机构投资者,包括合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者

20、投资人、投资者:指个人投资者、机构投资者、合格境外投资者、发起资金提供方以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称

21、基金份额持有人:指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人

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

23、销售机构:指兴华基金管理有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件,取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务协议,办理基金销售业务的机构

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

25、登记机构:指办理登记业务的机构。基金的登记机构为兴华基金管理有限公司或接受兴华基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构,本基金的登记机构为兴华基金管理有限公司

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

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

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

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

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

31、存续期:指基金合同生效至终止之间的不定期期限

32、工作日:指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

33、6 个月持有期起始日:对于每份基金份额,6 个月持有期起始日指基金合同生效日



(对认购份额而言) 或该基金份额申购申请确认日 (对申购份额而言)

34、6 个月持有期到期日：对于每份基金份额，6 个月持有期到期日指该基金份额 6 个月持有期起始日 6 个月后的月度对应日。在基金份额的 6 个月持有期到期日前(不含当日)，基金份额持有人不能对该基金份额提出赎回申请；基金份额的 6 个月持有期到期日起(含当日)，基金份额持有人可对该基金份额提出赎回申请；因不可抗力或基金合同约定的其他情形致使基金管理人无法在基金份额的 6 个月持有期到期日按时开放办理该基金份额的赎回业务的，该基金份额的 6 个月持有期到期日顺延至不可抗力或基金合同约定的其他情形的影响因素消除之日起的下一个工作日

35、月度对应日：指某一个特定日期在后续月度中的对应日期，如该对应日为非工作日或无该对应日，则顺延至下一个工作日

36、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

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

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(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，具体以届时依照法律法规发布的公告为准)

39、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

40、《业务规则》：指《兴华基金管理有限公司注册登记业务管理办法》，是规范基金管理人管理的开放式证券投资基金登记方面的业务规则，由基金管理人和投资人共同遵守

41、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

42、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

43、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

44、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

45、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

46、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

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)

---

超过上一开放日基金总份额的 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及票据价值、银行存款本息、基金应收款项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

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、发起式基金：指符合《运作办法》和中国证监会规定的相关条件而募集、运作，由基金管理人、基金管理人股东、基金管理人高级管理人员或基金经理（指基金管理人员中依法具有基金经理资格者，包括但不限于本基金的基金经理，同时也可以包括基金经理之外的投研人员，下同）等人员承诺认购一定金额并持有一定期限的证券投资基金

55、发起资金：指基金管理人股东资金、基金管理人固有资金、基金管理人高级管理人员或者基金经理等人员参与认购的资金。发起资金认购本基金的金额不低于 1000 万元，且发起资金认购的基金份额持有期限不低于三年

56、发起资金提供方：指以发起资金认购本基金且承诺以发起资金认购的基金份额持有期限不少于三年的基金管理人股东、基金管理人、基金管理人高级管理人员或基金经理等人员

57、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

58、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

59、基金份额分类：本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别：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，并分别公布基金份额净值

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

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

62、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

63、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，确保投资人的合法权益不受损害并得到公平对待

64、内地与香港股票市场交易互联互通机制：是指上海证券交易所、深圳证券交易所分别和香港联合交易所有限公司（以下简称“香港联合交易所”）建立技术连接，使内地和香港投资者可以通过当地证券公司或经纪商买卖规定范围内的对方交易所上市的股票。内地与香港股票市场交易互联互通机制包括沪港股票市场交易互联互通机制（“沪港通”）和深港股票市场交易互联互通机制（“深港通”）

65、港股通：指内地投资者委托内地证券公司，经由境内证券交易所在香港设立的证券交易服务公司，向香港联合交易所进行申报，买卖规定范围内的香港联合交易所上市的股票。沪港通下的港股通和深港通下的港股通统称港股通

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

67、特定资产：包括：（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

68、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：兴华基金管理有限公司

住所：山东省青岛市李沧区金水路 187 号 2 号楼 8 层

办公地址：山东省青岛市李沧区金水路 187 号 2 号楼 8 层

法定代表人：张磊

成立时间：2020 年 4 月 28 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会 证监许可【2020】368 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：壹亿元人民币

存续期限：持续经营

联系电话：400-067-8815

联系人：卓维庆

股权结构：张磊 60.61%、韩光华 4.99%、宿迁信仁企业管理合伙企业(有限合伙)4.90%、宿迁信礼企业管理合伙企业(有限合伙)4.90%、宿迁信智企业管理合伙企业(有限合伙)4.90%、宿迁信忠企业管理合伙企业(有限合伙)4.90%、宿迁信良企业管理合伙企业(有限合伙)4.90%、宿迁信勇企业管理合伙企业(有限合伙)4.95%、青岛信爱投资中心(有限合伙)4.95%。

### 二、主要人员情况

#### 1、董事会成员

张磊先生，董事长，工商管理硕士，中国籍。曾任清华兴业投资管理公司证券分析师，嘉实基金管理有限公司基金直销经理，泰信基金管理有限公司北京理财中心经理，华夏基金管理有限公司机构理财部总经理，九鼎投资管理有限公司副总经理和合伙人，北京杰思汉能资产管理公司执行总裁，天弘基金管理有限公司副总经理。现任兴华基金管理有限公司董事长。

韩光华先生，总经理、董事，经济学硕士，中国籍。曾任中央财经大学保险学院讲师，华夏基金管理有限公司机构产品部副总裁，诺安基金管理有限公司产品研发中心副总监，嘉合基金管理有限公司副总经理。现任兴华基金管理有限公司总经理、兴华基金管理有限公司北京分公司负责人、兴华基金管理有限公司济南分公司负责人、兴华基金管理有限公司青岛分公司负责人。

何美劲先生，首席信息官、职工董事，通讯工程学士，中国籍。曾任金证科技股份有限

公司销售产品部软件开发工程师，深圳市佳创视讯技术股份有限公司研发四部开发组组长，诺安基金管理有限公司运营保障部开发主管。现任兴华基金管理有限公司首席信息官。

王步峰先生，独立董事，法律硕士，中国籍。现任北京市法大律师事务所副主任律师，山东理工大学法学院兼职教授，北京律师协会建设工程专业委员会委员，中国政法大学法律应用中心兼职研究员。

王清峰先生，独立董事，工商管理硕士，中国籍。现任天职国际会计师事务所（特殊普通合伙）北京所所长。

周霜杉先生，独立董事，法律硕士，中国籍。现任北京市华泰（重庆）律师事务所律师。

魏克泰先生，独立董事，法学学士，中国籍。现任山东青大泽汇律师事务所主任。

## 2、监事会成员

吴楠女士，监事，管理学学士，中国籍。曾任山东国际海事服务集团有限公司财务主管，郑州东弘船舶管理有限公司财务经理。现任兴华基金管理有限公司综合财务部副总经理、人力资源部副总经理。

## 3、公司高级管理人员

韩光华先生，总经理，简历同上。

韩冰女士，督察长，法学学士，中国籍。曾任北京市浩东律师事务所律师，兴华基金管理有限公司筹备组主管，兴华基金管理有限公司监察稽核部总经理。现任兴华基金管理有限公司督察长。

何美劲先生，首席信息官，简历同上。

## 4、基金经理

### （1）现任基金经理

黄兵先生，微生物学理学博士，具有基金从业资格。曾任中国人民解放军总医院医学博士后，财通证券股份有限公司医药行业研究员，北京远方通达医药技术有限公司技术总监，兴华基金管理有限公司权益研究部研究员。现任兴华创新医疗 6 个月持有期混合型发起式证券投资基金基金经理（自 2023 年 6 月 9 日起任职）。

### （2）历任基金经理

冷文鹏先生，管理时间为 2021 年 11 月 30 日至 2023 年 6 月 9 日。

## 5、投资决策委员会成员

本公司投资决策委员会成员包括：韩光华先生、吕智卓先生、徐迅先生。

韩光华先生，总经理，简历同上。

吕智卓先生，应用金融硕士，具有基金从业资格。曾任天弘基金管理有限公司中央交易室专户交易员，上海久期投资有限公司交易管理部交易主管。现任兴华基金管理有限公司固收公募部副总经理、兴华安盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理（自 2021 年 8 月 4 日起任职）、兴华安恒纯债债券型证券投资基金基金经理（自 2021 年 11 月 10 日

起任职)、兴华安丰纯债债券型证券投资基金基金经理(自 2022 年 4 月 15 日起任职)、兴华安悦纯债债券型证券投资基金基金经理(自 2022 年 10 月 19 日起任职)、兴华安裕利率债债券型证券投资基金基金经理(自 2023 年 3 月 9 日起任职)、兴华安聚纯债债券型证券投资基金基金经理(自 2023 年 4 月 26 日起任职)、兴华安惠纯债债券型证券投资基金基金经理(自 2023 年 6 月 20 日起任职)。

徐迅先生,金融数学硕士,具有基金从业资格。曾任天弘基金管理有限公司定增业务部业务经理,方正证券股份有限公司创新投资部投资经理,兴华基金管理有限公司筹备组成员。现任权益公募部、权益研究部业务主管、兴华永兴混合型发起式证券投资基金基金经理(自 2023 年 2 月 7 日起任职)。

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

### 三、基金管理人的职责

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

(2) 办理基金备案手续;

(3) 对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账,进行证券投资;

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

(5) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;

(6) 编制季度报告、中期报告和年度报告;

(7) 计算并披露基金净值信息,确定基金份额申购、赎回价格;

(8) 办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项;

(9) 按照规定召集基金份额持有人大会;

(10) 保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料;

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

(12) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他职责。

### 四、基金管理人关于遵守法律法规的承诺

1、基金管理人承诺遵守《基金法》及其他相关法律法规的规定,建立健全的内部控制制度,采取有效措施,防止违反《基金法》及其他相关法律法规行为的发生。

2、基金管理人承诺不从事下列行为:

(1) 将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资;

(2) 不公平地对待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。

#### 五、基金管理人关于禁止性行为的承诺

为维护基金份额持有人的合法权益, 本基金禁止从事下列行为:

- (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。

法律法规或监管部门取消或变更上述限制, 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或按变更后的规定执行。

#### 六、基金经理承诺

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

(2) 不利用职务之便为自己、被代理人、被代表人、受雇他人或任何其他第三人谋取不当利益。

(3) 不泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息, 或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动。

(4) 不从事损害基金资产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

## 七、基金管理人的内部控制制度

### 1、内部控制制度概述

内部控制工作是指公司为防范和化解风险,保护资产的安全与完整,促进经营活动的有效展开,通过制定和实施一系列组织机制、管理方法、操作程序与控制措施而形成的系统。内部控制制度是指公司为实现内部控制目标而建立的一系列组织机制、管理方法、操作程序与控制措施的总称。

公司内部控制制度由内部控制大纲、基本管理制度、部门业务规则共同组成。

公司内部控制大纲是对公司章程规定的内控原则的细化和明确,是各项基本管理制度的纲要。

公司基本管理制度包括风险控制管理制度、投资管理制度、基金会计核算管理制度、信息披露制度、监察稽核管理制度、信息技术管理制度、财务制度、资料档案管理制度、业绩评估考核制度以及紧急情况处理制度等。

部门业务规则是在遵守各项基本管理制度基础上,根据本业务部门的实际情况,对本业务部门的岗位职责、岗位设置、岗位责任、流程操作、评估考核及职业操守等所作的具体规定。

### 2、内部控制原则

(1) 首要性原则:公司将内部控制工作作为公司经营中的首要任务,以保障公司业务的持续、稳定发展;

(2) 健全性原则:内部控制工作必须覆盖公司的所有业务部门和岗位,并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各项经营业务流程与环节;

(3) 有效性原则:内部控制科学、合理、有效,公司全体职员必须竭力维护内部控制制度的有效执行,任何职员不得拥有超越制度约束的权力;

(4) 独立性原则:公司必须在精简的基础上设立能充分满足公司经营运作需要的机构、部门和岗位,各机构、部门和岗位职能上保持相对独立性。公司设立专门的监察稽核部对内部控制工作进行监督与检查;

(5) 相互制约性原则:公司内部各部门和岗位的设置清晰、权责分明、相互牵制,并通过切实可行的相互制衡措施来消除内部控制中的盲点;

(6) 防火墙原则:公司基金资产、自有资产和其他资产的运作严格分离,基金投资、决策、执行、清算、评估等部门和岗位物理上适当隔离;

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

### 3、主要内部控制制度

#### (1) 风险控制管理制度



公司风险管理是指应用于公司战略和目标制定、贯穿于公司各项业务运作,由公司的董事会、经营管理层和其他人员实施的,旨在识别影响公司各项业务运作的潜在事件,并将风险或潜在风险控制在公司可承受的范围内,为公司基金管理经营目标的实现提供合理保证的过程。公司通过积极、主动的管理和预防措施,将可能发生的风险以及可能带来的损失控制在公司可以承受的最小范围内。

公司将保持风险管理水平与公司的基金投资业务发展状况相一致,公司的基金投资业务发展以完善的风险管理为基础。

风险控制制度由风险控制的目标和原则、风险管理组织体系、风险管理环节及风险管理措施及风险管理工作的评估及检查等部分组成。

### (2) 监察稽核管理制度

公司股东会下设监事,有权检查公司的财务,对董事会和高级管理人员履行职责时违反法律、法规或者公司章程的行为进行监督,对违反法律、行政法规、公司章程或者股东会决议的董事、高级管理人员提出罢免的建议。

公司董事会下设风险控制委员会负责对公司基金运作与经营管理中的风险控制及合法性进行审议、检查、评价及监督。督察长列席风险控制委员会。风险控制委员会认为必要时可通知公司其他相关人员列席会议。

公司设督察长,根据董事会授权及公司监察稽核工作需要管理公司的监察稽核工作。督察长由总经理提名,董事会决议通过且全体独立董事审议通过后聘任。

公司设立监察稽核部负责对公司基金运作、内部管理、系统实施和合法合规等情况进行内部监督,监察稽核人员具备基金从业资格,具备相应的专业知识和技能,熟悉业务并能独立工作。进行监察稽核工作时,应当实行利害关系回避制度,严格遵守监察稽核人员行为规范。

监察稽核管理制度由监察稽核工作权限、监察稽核工作程序和要求、监察稽核报告以及监察稽核工作规范及监督评价等部分组成。

### (3) 投资管理制度

为了保证公司投资管理工作规范、有序、高效进行,防范基金投资风险,保护基金份额持有人的利益,维护基金资产的安全,明确基金投资管理业务流程及相关部门的职责,制定投资管理制度,

投资决策委员会是公司进行基金投资管理的最高投资决策机构,具体成员名单由总经理办公会任命。督察长及监察稽核人员有权列席会议,经投资决策委员会主任委员批准的其他人员可列席参会。投资决策委员会定期召开会议,会议议事程序及方法按照相关委员会议事规则执行。

投资管理制度具体规定了基金投资管理的原则及组织架构、基金投资管理程序(投资管理授权、投资研究、投资决策、投资执行及投资跟踪与总结)、基金投资的风险控制等内容。

---

---

## 第四部分 基金托管人

### 一、基金托管人基本情况

#### 1、基本情况

名称：中信证券股份有限公司（简称：中信证券）

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：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

广东省深圳市福田区中心三路 8 号中信证券大厦

法定代表人：张佑君

成立日期：1995 年 10 月 25 日

基金托管业务批准文号：证监许可[2014]1044 号

组织形式：股份有限公司（上市）

注册资本：14,820,546,829 元人民币

存续期间：持续经营

联系人：吴俊文

联系电话：95548-3

中信证券股份有限公司（以下简称“中信证券”）成立于 1995 年 10 月 25 日，前身是中信证券有限责任公司。中信证券于 2003 年 1 月 6 日在上海证券交易所挂牌上市，并于 2011 年 10 月 6 日在香港联交所上市交易。

根据中国证监会核发的经营业务许可证，公司经营范围包括：证券经纪（限山东省、河南省、浙江省天台县、浙江省苍南县以外区域）；证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问；证券承销与保荐；证券自营；证券资产管理；融资融券；证券投资基金代销；为期货公司提供中间介绍业务；代销金融产品；股票期权做市。

2014 年 7 月中信证券成立托管部，并于当年 10 月收到中国证监会《关于核准中信证券股份有限公司证券投资基金托管资格的批复》（证监许可[2014]1044 号），获得证券投资基金托管资格。开展基金托管业务以来，公司严格切实履行基金托管人职责，维护基金投资人的合法权益。中信证券逐年加大托管业务信息技术系统建设投入，构建智能化客户服务体系，持续研发创新基金托管服务。

#### 2、主要人员情况

中信证券设立托管部，管理并具体承办基金托管业务。托管部下设市场服务、产品设计、估值核算、托管结算、投资监督、跨境服务、客户服务、金融科技、风险管理、综合管理等团队。部门员工均具备证券投资基金从业资格，并具有多年金融从业经历，核心业务岗人员均已具备 5 年及以上相关业务经验。截至 2022 年 12 月 31 日，部门员工共计 166 人，具备

3 年以上托管业务相关从业经验的占 80%以上。

吴俊文女士,现任中信证券托管部行政负责人;西安电子科技大学计算机及应用学学士,2000 年 7 月至 2014 年 7 月,担任中信证券清算部执行总经理,主要负责经纪业务、资产管理业务以及自营投资业务的业务运营管理工作,2014 年 7 月起任中信证券托管部行政负责人。

### 3、基金托管业务经营情况

中信证券于 2014 年 10 月经中国证监会核准获批证券投资基金托管资格。中信证券自取得证券投资基金托管资格以来,秉承“忠于所托,信于所管”的宗旨,严格遵守国家的有关法律法规和监管机构的有关规定,依靠科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的运营系统和专业的服务团队,切实履行资产托管人职责,为基金管理人和投资者提供安全、高效、专业的托管服务。

#### (二) 托管业务的内部控制制度

##### 1、内部控制目标

中信证券托管业务运行严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则,建立守法经营、规范运作的经营思想和经营风格,形成运作流程化、管理科学化、监控制度化的内控体系;防范和化解经营风险,确保托管资产的安全完整,维护基金份额持有人的合法权益,保障托管业务安全、有效、稳健运行。

##### 2、内部控制原则

(1) 合法合规原则:内控制度应当符合国家法律法规及监管机构的监管要求,并贯穿于托管业务经营管理活动的始终;

(2) 完整性原则:托管业务的各项经营管理活动都必须有相应的规范程序和监督制约;监督制约应渗透到托管业务的全过程和各个操作环节,覆盖所有的岗位和人员;

(3) 有效性原则:建立对内控制度及其执行的监督、评价、反馈和完善机制,保证内控制度有效执行;

(4) 审慎性原则:托管业务各项业务活动必须防范风险,审慎经营,保证基金资产的安全与完整;

(5) 预防性原则:必须树立“预防为主”的管理理念,控制风险发生的源头,防患于未然,尽量避免业务操作中各种问题的产生;

(6) 及时性原则:内部控制制度的制定应当具有前瞻性,并且随着托管部经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律法规、政策制度等外部环境的改变进行及时的修改或完善,发现问题,要及时处理,堵塞漏洞;

(7) 独立性原则:托管人托管的基金资产、托管人的自有资产、托管人托管的其他资产应当分离;直接操作人员和控制人员应相对独立,适当分离;内控制度的检查、评价小组必须独立于内控制度的制定和执行小组;

(8) 相互制约原则：托管部的内部机构和岗位设置应当权责分明、相互制衡。

### 3、内部控制制度及措施

根据《基金法》、《证券投资基金托管业务管理办法》等法律法规的规定，中信证券制定了一整套严密、高效的证券投资基金托管业务的规章制度，确保基金托管业务运行的规范、安全以及高效。

主要制度包括《中信证券证券投资基金托管业务管理办法》、《中信证券证券投资基金托管业务内部控制和风险管理办法》、《中信证券公开募集证券投资基金托管业务信息披露管理办法》、《中信证券证券投资基金托管业务保密工作管理办法》、《中信证券股份有限公司证券投资基金托管业务会计核算业务管理办法》、《中信证券股份有限公司证券投资基金托管业务清算管理办法》、《中信证券股份有限公司证券投资基金托管业务投资监督管理办法》、《中信证券股份有限公司证券投资基金托管业务资产保管管理办法》、《中信证券基金托管业务从业人员管理办法》、《中信证券证券投资基金托管业务档案管理办法》等，并根据市场变化和基金业务的发展不断加以完善。通过这些规章制度的建立和实施，做到业务分工合理、业务运行和操作流程化、技术系统完整独立、核心业务相互隔离以及有关信息披露由专人负责，以便勤勉尽责的履行托管义务。

托管业务内部控制的内容主要涉及托管项目、资产保管、资金清算、会计核算和资产估值、投资监督、信息技术系统等重要业务环节的内部控制。基金托管人通过对基金托管业务各环节风险的事前揭示、事中控制和事后稽核的动态管理过程来实施内部风险控制。同时为了保证和验证内部控制的有效性、完整性，中信证券定期聘请具有证券业务资格的专业会计师事务所，针对基金托管业务的内部控制制度建设与实施情况，开展相关审查与评估，出具评估报告。

托管业务内部控制的主要措施包括：不相容职务分离控制、授权审批控制、财产保护控制、会计系统控制、预算控制、运营分析控制和绩效考评控制等。

### (三) 基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

#### 1、监督方法

基金托管人依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

#### 2、监督流程

(1) 每工作日按时通过监控系统，对各基金投资运作比例等控制指标进行例行监控，发现投资比例超标等异常情况，通知基金管理人，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，并根据具体情况及时报告中国证监会。

(2) 收到基金管理人的投资指令后，对涉及各基金的投资范围、投资对象等内容进行

---

合法合规性监督。

(3) 根据基金投资运作情况, 编写托管人年度报告, 对各基金投资运作的合法合规性等方面进行评价。

(4) 通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易, 电话或书面要求管理人进行解释或举证, 并及时报告中国证监会。

## 第五部分 相关服务机构

### 一、销售机构

#### (1) 直销机构

名称：兴华基金管理有限公司

住所及办公地址：山东省青岛市李沧区金水路 187 号 2 号楼 8 层

法定代表人：张磊

电话：400-067-8815

联系人：卓维庆

#### (2) 代销机构

|   |                |  |
|---|----------------|--|
| 1 | 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<br>办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路 18 号黄龙时代广场 B 座 6F<br>法定代表人：祖国明<br>联系人：韩爱彬<br>客户服务电话：4000-766-123<br>网址： <a href="http://www.fund123.cn">www.fund123.cn</a>                               |
| 2 | 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<br>办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号东方财富大厦<br>法定代表人：其实<br>联系人：王维<br>电话：13382896787<br>传真：021-54509953<br>客户服务电话：400-181-8188<br>公司网址： <a href="http://www.eastmoney.com/">http://www.eastmoney.com/</a> |
| 3 | 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<br>办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号<br>法定代表人：戴彦<br>联系人：陈亚男<br>电话：021-23586583<br>客服电话：95357<br>网址： <a href="http://www.18.cn">www.18.cn</a>   |
| 4 | 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<br>办公地址：深圳市福田区福田街道福华一路 111 号   |

|   |                |   |
|---|----------------|---|
|   |                | <p>法定代表人：霍达<br/> 联系人：黄婵君<br/> 电话：0755-82960167<br/> 传真：0755-83734343<br/> 客户服务电话：95565、4008888111<br/> 公司网址：www.newone.com.cn</p>   |
| 5 | 江苏汇林保大基金销售有限公司 | <p>注册地址：江苏省南京市高淳区经济开发区古檀大道 47 号<br/> 办公地址：江苏省南京市鼓楼区中山北路 2 号绿地紫峰大厦 2005 室<br/> 法定代表人：吴言林<br/> 联系人：张竞妍<br/> 客服电话：025-66046166-849<br/> 传真：025-66046166<br/> 网址：http://www.huilinbd.com</p>      |
| 6 | 京东肯特瑞基金销售有限公司  | <p>注册地址：北京市海淀区西三旗建材城中路 12 号 17 号平房 157<br/> 办公地址：北京市亦庄开发区科创 11 街 18 号京东大厦 A 座 15 层<br/> 法定代表人：李骏<br/> 联系人：隋斌<br/> 电话：010-89187658<br/> 客服电话：400-098-8511<br/> 网址：https://kenterui.jd.com/</p> |
| 7 | 华鑫证券有限责任公司     | <p>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<br/> 办公地址：上海市徐汇区宛平南路 8 号<br/> 法定代表人：俞洋<br/> 联系人：刘熠<br/> 客服电话：95323；4001099918<br/> 网址：www.cfsc.com.cn</p>                                 |
| 8 | 浙江同花顺基金销售有限公司  | <p>注册地址：杭州市文二四西路 1 号 903 室<br/> 办公地址：浙江省杭州市余杭区同顺街 18 号同花顺大楼<br/> 法人代表：吴强<br/> 联系人：洪泓<br/> 电话：0571-88911818<br/> 传真：0571-86800423<br/> 客户服务电话：952555<br/> 网址：www.5ifund.com</p>                |
| 9 | 中信证券华南股份有限公司   | <p>注册地址：广州市天河区临江大道 395 号 901 室（部位：自编 01），1001 室<br/> 办公地址：广州市天河区临江大道 395 号 901 室（部位：自编 01），1001 室</p>   |

|    |                |   |
|----|----------------|---|
|    |                | <p>法定代表人：胡伏云<br/> 联系人：郭杏燕<br/> 电话：020-88834787<br/> 传真：020-88836999<br/> 客户服务电话：95548<br/> 网址：<a href="http://www.gzs.com.cn/">http://www.gzs.com.cn/</a></p>   |
| 10 | 中信证券股份有限公司     | <p>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<br/> 办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦<br/> 法定代表人：张佑君<br/> 联系人：杜杰<br/> 电话：010-60834768<br/> 客服电话：95548<br/> 网址：<a href="http://www.cs.ecitic.com">www.cs.ecitic.com</a></p>  |
| 11 | 中信期货有限公司       | <p>注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305、14 层<br/> 办公地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305、14 层<br/> 法定代表人：张皓<br/> 联系人：梁美娜<br/> 联系电话：021-60812919<br/> 客服电话：400-990-8826<br/> 网址：<a href="http://www.citicsf.com">www.citicsf.com</a></p> |
| 12 | 中信证券（山东）有限责任公司 | <p>注册地址：青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001<br/> 办公地址：青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座<br/> 法定代表人：冯恩新<br/> 联系人：董巨川<br/> 电话：0532-68722197<br/> 传真：0532-85022605<br/> 客服电话：95548<br/> 网址：<a href="http://sd.citics.com">sd.citics.com</a></p>  |
| 13 | 光大证券股份有限公司     | <p>注册地址：上海市静安区新闸路 1508 号<br/> 办公地址：上海市静安区南京西路 1266 号恒隆广场一期 49 楼<br/> 法定代表人：刘秋明<br/> 联系人：郁疆<br/> 电话：021-52523545<br/> 客服电话：021-22169999<br/> 网址：<a href="http://www.ebscn.com">www.ebscn.com</a></p>   |



## 二、登记机构

名称：兴华基金管理有限公司

住所及办公地址：山东省青岛市李沧区金水路 187 号 2 号楼 8 层

法定代表人：张磊

电话：0532-80921026

联系人：桑希洋

## 三、出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：韩炯

电话：021-31358666

传真：021-31358600

经办律师：黎明、丁媛

联系人：丁媛

## 四、审计基金财产的会计师事务所

会计师事务所：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：上海市湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼

首席合伙人：李丹

电话：(021) 23238888

传真：(021) 23238800

经办注册会计师：单峰、沈俐

联系人：沈俐

---

---

## 第六部分 基金的募集

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定，并经中国证监会 2021 年 9 月 30 日证监许可[2021]3185 号文注册募集。

本基金为契约型开放式基金。基金存续期为不定期。

本基金对每份基金份额设置 6 个月持有期。每日基金开放申赎，逐笔计算持有满 6 个月之后可以赎回。

对于每份基金份额，6 个月持有期起始日指基金合同生效日（对认购份额而言）或该基金份额申购申请确认日（对申购份额而言）。

对于每份基金份额，6 个月持有期到期日指该基金份额 6 个月持有期起始日 6 个月后的月度对应日。月度对应日，指某一个特定日期在后续月度中的对应日期，如该对应日为非工作日或无该对应日，则顺延至下一个工作日。

在基金份额的 6 个月持有期到期日前（不含当日），基金份额持有人不能对该基金份额提出赎回申请；基金份额的 6 个月持有期到期日起（含当日），基金份额持有人可对该基金份额提出赎回申请；因不可抗力或基金合同约定的其他情形致使基金管理人无法在基金份额的 6 个月持有期到期日按时开放办理该基金份额的赎回业务的，该基金份额的 6 个月持有期到期日顺延至不可抗力或基金合同约定的其他情形的影响因素消除之日起的下一个工作日。

本基金募集期间每份基金份额初始面值为人民币 1.00 元。

本基金自 2021 年 11 月 15 日至 2021 年 11 月 26 日进行公开募集，共募集基金份额 38,694,487.04 份（含利息结转），其中 A 类份额 32,720,797.83 份（含利息结转），C 类份额 5,973,689.21 份（含利息结转），募集有效认购总户数为 492 户。募集结束后基金管理人向中国证监会办理备案手续，经中国证监会书面确认，《兴华创新医疗 6 个月持有期混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2021 年 11 月 30 日生效。

---

---

## 第七部分 基金合同的生效

本基金基金合同自 2021 年 11 月 30 日正式生效。自基金合同生效日起, 本基金管理人正式开始管理本基金。

《基金合同》生效满 3 年之日(指自然日), 若基金资产净值低于 2 亿元, 无需召开基金持有人大会审议, 基金合同应当终止, 且不得通过召开基金持有人大会的方式延续。若届时法律法规或中国证监会规定发生变化, 上述终止规定被取消、更改或补充, 则本基金可以参照届时有效的法律法规或中国证监会规定执行。

《基金合同》生效满 3 年后继续存续的, 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 10 个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案, 解决方案包括持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等, 并在 6 个月内召集基金份额持有人大会进行表决。

法律法规或中国证监会另有规定时, 从其规定。

## 第八部分 基金份额的申购和赎回

### 一、申购和赎回场所

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

### 二、申购和赎回的开放日及时间

#### 1、6 个月持有期

本基金对每份基金份额设置 6 个月持有期。每日基金开放申赎，逐笔计算持有满 6 个月之后可以赎回。

对于每份基金份额，6 个月持有期起始日指基金合同生效日（对认购份额而言）或该基金份额申购申请确认日（对申购份额而言）。

对于每份基金份额，6 个月持有期到期日指该基金份额 6 个月持有期起始日 6 个月后的月度对应日。月度对应日，指某一个特定日期在后续月度中的对应日期，如该对应日为非工作日或无该对应日，则顺延至下一个工作日。

在基金份额的 6 个月持有期到期日前（不含当日），基金份额持有人不能对该基金份额提出赎回申请；基金份额的 6 个月持有期到期日起（含当日），基金份额持有人可对该基金份额提出赎回申请；因不可抗力或基金合同约定的其他情形致使基金管理人无法在基金份额的 6 个月持有期到期日按时开放办理该基金份额的赎回业务的，该基金份额的 6 个月持有期到期日顺延至不可抗力或基金合同约定的其他情形的影响因素消除之日起的下一个工作日。

#### 2、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，但本基金对每份基金份额设置 6 个月持有期，如果投资人多次认购/申购本基金，则其持有的每份基金份额的赎回开放的时间可能不同。申购和赎回的具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间（若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，具体以届时依照法律法规发布的公告为准），但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

基金合同生效后，若出现新的证券/期货市场、证券/期货交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日

前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

### 3、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。

基金管理人自认购份额的 6 个月持有期到期日（即基金合同生效日 6 个月后的月度对应日，含当日）起开始办理赎回。因不可抗力或基金合同约定的其他情形致使基金管理人无法在认购份额的 6 个月持有期到期日按时开放办理赎回业务的，认购份额的 6 个月持有期到期日顺延至不可抗力或基金合同约定的其他情形的影响因素消除之日起的下一个工作日。在确定申购开始时间后，基金管理人应在申购开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告申购的开始时间。基金份额持有人自每笔申购份额的 6 个月持有期到期日起（含当日）可对该基金份额提出赎回申请，因不可抗力或基金合同约定的其他情形致使基金管理人无法在基金份额的 6 个月持有期到期日按时开放办理该基金份额的赎回业务的，该基金份额的 6 个月持有期到期日顺延至不可抗力或基金合同约定的其他情形的影响因素消除之日起的下一个工作日。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的，其基金份额申购、赎回价格为下一开放日基金份额申购、赎回的价格。对于尚未开始办理赎回业务的基金份额，投资人提出的赎回或者转换转出申请不成立。

## 三、申购与赎回的原则

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

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；

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

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且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，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。

投资者在申购基金份额时须按销售机构规定的方式备足申购资金,投资者在提交赎回申请时,必须有足够的基金份额余额,否则所提交的申购、赎回申请无效而不予成交。

投资者办理申购、赎回等业务时应提交的文件和办理手续、办理时间、处理规则等在遵守基金合同和招募说明书规定的前提下,以各销售机构的具体规定为准。

## 2、申购和赎回的款项支付

投资人申购基金份额时,必须在规定时间内全额交付申购款项,投资人交付申购款项,申购成立;基金份额登记机构确认基金份额时,申购生效。

对于每份基金份额,自该基金份额的 6 个月持有期到期日起(含当日),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载明的其他暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形时,款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。

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它非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程,则赎回款顺延至上述情形消除后的下一个工作日划出。

## 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购、赎回申请。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,投资人应及时查询并妥善行使合法权利。否则,由此产生的投资人任何损失由投资人自行承担。

基金管理人可以在法律法规和基金合同允许的范围内、在不对基金份额持有人利益造成损害的前提下,对上述业务办理规则进行调整,并在调整实施前按照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

## 五、申购和赎回的数量限制

1、本基金首次申购和追加申购的最低金额均为 1 元,各销售机构在符合上述规定的前提下,可根据情况调高首次申购和追加申购的最低金额,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。本基金单笔赎回申请不低于 1 份,投资人全额赎回时不受上述限制。各销售机构在符合上述规定的前提下,可根据情况调高单笔最低赎回份额要求,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；

2、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；

3、本基金不对投资人每个交易账户的最低基金份额余额进行限制；

4、本基金不对单个投资人累计持有的基金份额上限进行限制，但法律法规或监管要求另有规定的除外；

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

## 六、申购和赎回的价格、费用及其用途

### 1、申购费

本基金 A 类基金份额在申购时收取申购费用。本基金 C 类基金份额不收取申购费。

本基金 A 类基金份额的申购费率如下：

| 费用种类 | A 类基金份额           |                | C 类基金份额 |
|------|-------------------|----------------|---------|
|      | 申购金额 (M)          | 费率             | 费率      |
| 申购费用 | M < 100 万         | 1.50%          | 0%      |
|      | 100 万 ≤ M < 200 万 | 1.20%          |         |
|      | 200 万 ≤ M < 500 万 | 0.80%          |         |
|      | M ≥ 500 万         | 按笔收取，1,000 元/笔 |         |

投资人多次申购，须按每次申购所对应的费率档次分别计费。

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

### 2、赎回费

本基金基金份额持有期为 6 个月，本基金对持有期超过 6 个月的基金份额不收取赎回费。

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

4、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。

5、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门

要求履行必要手续后,基金管理人可以适当调低基金申购费率、基金赎回费率和基金销售费率。

## 七、申购份额与赎回金额的计算

### 1、基金申购份额的计算方法如下:

#### (1) A 类基金份额

##### a. 申购费用适用比例费率时:

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

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

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

##### b. 申购费用适用于固定费用

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

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

#### (2) C 类基金份额

如果投资人选择申购 C 类基金份额,则申购份额的计算方法如下:

$$\text{申购份额} = \text{申购金额} / \text{申购当日 C 类基金份额净值}$$

例:某投资人投资 10 万元申购本基金 A 类基金份额,对应申购费率为 1.50%,假设申购当日 A 类基金份额净值为 1.0160 元,则其可得到的 A 类基金份额为:

$$\text{净申购金额} = 100,000.00 / (1 + 1.50\%) = 98,522.17 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 100,000.00 - 98,522.17 = 1,477.83 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 98,522.17 / 1.0160 = 96,970.64 \text{ 份}$$

即:投资者投资 10 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 1.0160 元,可得到 96,970.64 份 A 类基金份额。

例:假设某投资者投资 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,则可得到的 C 类基金份额为:

$$\text{申购费用} = 0.00 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 100,000.00 / 1.0600 = 94,339.62 \text{ 份}$$

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、基金赎回金额的计算

在本基金的赎回金额的计算公式为:

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

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

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



例：某投资者赎回本基金 1 万份 A 类基金份额，持有时间为 200 天，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=10,000.00×1.2500=12,500.00 元

赎回费用=12,500.00×0%=0.00 元

净赎回金额=12,500.00-0.00=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 200 天，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。

例：某投资者赎回本基金 2 万份 C 类基金份额，持有时间为一年，对应的赎回费率为 0%，假设赎回当日 C 类基金份额净值是 1.1500 元，则其可得到的赎回金额为：

赎回总金额=20,000.00×1.1500=23,000.00 元

赎回费用=23,000.00×0%=0.00 元

净赎回金额=23,000.00-0.00=23,000.00 元

即：投资者赎回本基金 2 万份 C 类基金份额，持有时间为一年，假设赎回当日 C 类基金份额净值是 1.1500 元，则其可得到的赎回金额为 23,000.00 元。

### 3、基金份额净值的计算

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 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内披露。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、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。

## 八、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转。
- 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时。
- 3、证券/期货交易所交易时间非正常停市或者港股通临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
- 4、接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。

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

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

7、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者（基金管理人或其高级管理人员、基金经理等人员作为发起资金提供方除外）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。

8、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。

9、港股通交易每日额度不足。

10、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第 1、2、3、5、6、8、9、10 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。

#### 九、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时。

3、证券/期货交易所交易时间非正常停市或者港股通临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

5、发生继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时。

6、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当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，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。若出现上述第 4 项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人

应及时恢复赎回业务的办理并公告。

## 十、巨额赎回的情形及处理方式

### 1、巨额赎回的认定

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

### 2、巨额赎回的处理方式

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

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

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

(3) 如发生单个开放日内单个基金份额持有人申请赎回的基金份额超过前一开放日的基金总份额的 30%时，本基金管理人对该单个基金份额持有人持有的赎回申请实施延期办理。对于其超过基金总份额 30%以上部分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。对于其不超过基金总份额 30%部分作为当日有效赎回申请，基金管理人可以根据前述“(1) 全额赎回”或“(2) 部分延期赎回”的约定方式对该部分有效赎回申请与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。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；延期部分如选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。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。

(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、公告或者通过销售机构告知等方式在 3 个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，并在两日内在规定的规定媒介上刊登公告。

#### 十一、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

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

2、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在规定媒介公布最近 1 个工作日各类基金份额的基金份额净值。

3、基金管理人可以根据暂停申购或赎回的时间，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。

#### 十二、基金转换

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

#### 十三、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。

#### 十四、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。

#### 十五、定期定额投资计划

基金管理人可以为投资人办理定期定额投资计划，具体规则由基金管理人另行规定。投

---

资人在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额,每期扣款金额必须不低于基金管理人相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。

#### 十六、基金份额的冻结、解冻和质押

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。法律法规或监管部门另有规定的除外。

如相关法律法规允许基金管理人办理基金份额的质押业务或其他基金业务,在对基金份额持有人无实质性不利影响的情况下,履行相关程序后,基金管理人将制定和实施相应的业务规则。

#### 十七、基金份额的转让

在法律法规允许且条件具备的情况下,基金管理人可受理基金份额持有人通过中国证监会认可的交易场所或者通过其他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。

#### 十八、实施侧袋机制期间本基金的申购与赎回

本基金实施侧袋机制的,本基金的申购和赎回安排详见招募说明书“侧袋机制”部分的规定。

---

---

## 第九部分 基金的投资

### 一、投资目标

在严格控制风险和保持资产流动性的前提下,把握创新医疗相关的行业投资机会,通过积极主动的投资管理,力争实现基金资产的长期稳健增值。

### 二、投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、存托凭证、港股通标的股票、债券(包括国债、金融债、地方政府债券、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府支持债券、政府支持机构债券、次级债、证券公司短期公司债券、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券等)、资产支持证券、债券回购、货币市场工具、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、金融衍生品(包括股指期货、国债期货、股票期权)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:本基金股票及存托凭证资产占基金资产的比例为 60%-95%(其中港股通标的股票占股票资产的比例不超过 50%),其中投资于本基金所界定的创新医疗主题相关行业股票的比例不低于非现金基金资产的 80%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约、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 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或中国证监会变更上述投资品种的比例限制,以变更后的比例为准,本基金的投资比例会做相应调整。

### 三、投资策略

#### (一) 大类资产配置策略

本基金通过定性与定量相结合的方法分析证券市场发展趋势,对证券市场当期的风险收益特征以及未来可预见的时期内股票、债券等大类资产的预期风险和预期收益率进行分析评估,并据此制定本基金在股票、债券、现金等资产之间的配置比例、调整原则和调整范围,在保持总体风险水平相对稳定的基础上,力争实现投资组合的稳定增值。此外,本基金将持

续地进行定期与不定期的资产配置风险监控，并适时地做出相应的调整。

## (二) 股票投资策略

### 1、创新医疗主题的界定

创新是医疗行业最核心的推动力，持续引领医疗行业的变革与发展，本基金主要投资于医疗行业中创新医疗主题相关的上市公司，其中医疗行业是指从事医药产品研发、生产和销售的行业，涵盖预防、保健、诊断、治疗、康复领域的医疗全产业链条，包括化学制药行业、生物制药行业、中药行业、医疗器械行业、医疗诊断行业、医疗服务行业；创新医疗主题是指医疗行业中的创新领域，主要包括创新医疗药物、创新医疗器械、创新医疗技术、创新医疗服务。

(1) 创新医疗药物：是指具有自主知识产权专利，且在化学结构、药品组分和药理作用不同于现有药品的药物，包括但不限于境内外均未上市的创新药及改良型新药。

(2) 创新医疗器械：是指制造工艺、技术水平以及科技含量较高的高端医疗器械，包括 CT、核磁、超声、放疗为代表的大型设备，以手术机器人、诊断仪器为代表的中型设备，以及以植入式装置、内窥镜、骨科材料、可穿戴设备为代表的小型器械。

(3) 创新医疗技术：是指新型诊疗技术，包括免疫诊断、干细胞诊疗、精准医疗。

(4) 创新医疗服务：是指新型医疗服务，包括创新药研发服务、高端医疗服务、医疗信息化、移动医疗、医药电商。

未来随着科技进步、医疗需求演变、政策或市场环境发生变化导致本基金对创新医疗主题的界定范围发生变动，本基金在审慎研究的基础上，并履行适当必要的程序后，可根据实际情况调整创新医疗主题的界定标准。

### 2、行业配置策略

本基金将综合考虑创新医疗主题下各细分子行业的使用寿命、行业景气、竞争格局、创新变革等因素，全方位评估各细分子行业的中长期投资价值，在此基础上确定细分子行业的配置比例，并根据基本面和估值水平变化进行动态调整。

### 3、个股投资策略

本基金股票投资采用定量和定性分析相结合的策略。

#### (1) 定性分析

在定性分析方面，本基金主要挑选全部或部分具备以下特征的上市公司：

A、公司受益于国家新发展格局下的不断改革创新，并且可分享改革创新过程中的政策红利；

B、公司所处的行业符合国家的战略发展方向，并且公司在行业中具有明显的竞争优势；

C、公司具有良好的治理结构，从大股东、管理层到中层业务骨干有良好的激励机制，并且信息披露公开透明；

D、公司具有良好的自主创新能力，包括科技、商业模式、管理、产品等方面，并且拥

有持续创新的战略思维。

## (2) 定量分析

本基金将对反映上市公司质量和增长潜力的成长性指标、财务指标和估值指标等进行定量分析，以挑选具有成长优势、财务优势和估值优势的个股。

A、成长性指标：收入增长率、营业利润增长率和净利润增长率等；

B、财务指标：净资产收益率、毛利率、净利率等；

C、估值指标：市盈率（PE）、市盈率相对盈利增长比率（PEG）、市销率（PS）和总市值等。

## (三) 港股通标的股票投资策略

本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场。

受到内地、香港市场行情和整体估值水平影响，部分创新医疗主题港股与行业内同类型 A 股相比估值较低，形成价值洼地。本基金将重点关注这类与 A 股相比有明显估值优势的行业和公司，通过定量与定性相结合的分析方法，考察上市公司的盈利能力、盈利质量、成长能力、运营能力以及负债水平等方面的数据，综合分析上市公司的业绩质量、成长性和估值水平等，筛选出财务健康、成长性良好的优质股票，挖掘香港市场创新医疗主题相关产业资本增值机会。

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。

## (四) 存托凭证投资策略

对于存托凭证的投资，本基金将依照上述境内上市交易的股票投资策略在深入研究的基础上，通过定性与定量相结合的方式，筛选出具有比较优势的存托凭证作为投资标的。

## (五) 债券投资策略

在选择债券品种时，首先根据宏观经济、资金面动向、投资人行为、市场成交量和活跃度等方面的分析判断未来利率期限结构变化，并充分考虑组合的流动性管理的实际情况，配置债券组合的久期；其次，结合信用分析、流动性分析、税收分析等确定债券组合的类属配置；再次，在上述基础上利用债券定价技术，进行个券选择，在深度信用分析后，选择被低估的债券进行投资。在具体投资操作中，采用杠杆操作、利率波段操作、骑乘操作、换券操作等灵活多样的操作方式，获取超额的投资收益。

### 1、久期配置策略

久期配置是根据对宏观经济数据、金融市场运行特点等方面的分析来确定组合的整体久期，结合本基金的流动性需求及投资比例规定，动态调整组合的久期，有效地控制整体资产风险。当预测利率上升时，适当缩短投资组合的目标久期，预测利率水平降低时，适当延长投资组合的目标久期。



## 2、收益率曲线策略

在确定了组合的整体久期后,组合将基于宏观经济研究和债券市场跟踪,结合收益率曲线的拟合和波动模拟模型,对未来的收益率曲线移动进行情景分析,从而根据不同期限的收益率变动情况,在期限结构配置上适时采取子弹型、哑铃型或者阶梯型等策略,进一步优化组合的期限结构,增强基金的收益。

### (六) 金融衍生品投资策略

为更好的实现投资目标,本基金可投资股指期货、国债期货、股票期权和其他经中国证监会允许的衍生金融产品,本基金将根据风险管理的原则,主要选择流动性好、交易活跃的衍生品合约进行交易。

#### 1、股指期货投资策略

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位频繁调整的交易成本,以达到降低投资组合整体风险的目的。

#### 2、国债期货投资策略

本基金在进行国债期货投资时,将根据风险管理原则,以套期保值为主要目的,采用流动性好、交易活跃的国债期货合约,通过对债券现货市场和期货市场运行趋势的研究,结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平,与现货资产进行匹配,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

#### 3、股票期权投资策略

本基金投资股票期权以套期保值为主要目的,将根据风险管理的原则,充分考虑股票期权的流动性和风险收益特征,在风险可控的前提下,采取备兑开仓、delta 中性等策略适度参与股票期权投资。

本基金将关注其他金融衍生产品的推出情况,如法律法规或监管机构允许基金投资前述衍生工具,本基金将按届时有有效的法律法规和监管机构的规定,制定与本基金投资目标相适应的投资策略和估值政策,在充分评估衍生产品的风险和收益的基础上,谨慎地进行投资。

### (七) 资产支持证券投资策略

本基金将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析,并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型,评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。

### (八) 可转换债券和可交换债券投资策略

本基金在分析宏观经济运行特征和证券市场趋势判断的前提下,在综合分析可转换债券的固定收益类证券特征、权益类证券特征等因素的基础上,选择其中安全边际较高、股性活跃并具有较高上涨潜力的品种进行投资。可交换债券同样兼具权益类证券特性和固定收益类证券特性,其中固定收益类证券特性与可转换债券相同,而对于权益类证券特性的分析则需

关注目标公司的股票价值以及发行人作为股东的换股意愿等。

#### (九) 融资业务的投资策略

本基金参与融资业务,将在保障基金投资组合充足流动性以及有效控制融资杠杆风险的前提下,确定融资比例。根据风险管理的原则,在法律法规允许的范围和比例内、风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与融资业务。

#### (十) 证券公司短期公司债券投资策略

本基金将通过对证券行业分析、证券公司资产负债分析、公司现金流分析等调查研究,分析证券公司短期公司债券的违约风险及合理的利差水平,对证券公司短期公司债券进行独立、客观的价值评估。

基金投资证券公司短期公司债券,基金管理人将根据审慎原则,制定严格的投资决策流程、风险控制制度,并经董事会批准,以防范信用风险、流动性风险等各种风险。

今后,随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等,基金还将积极寻求其他投资机会,如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,本基金将在履行适当程序后,将其纳入投资范围以丰富组合投资策略。

### 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) 本基金股票及存托凭证资产占基金资产的比例为 60%-95% (其中港股通标的股票占股票资产的比例不超过 50%), 其中投资于本基金所界定的创新医疗主题相关行业股票的比例不低于非现金基金资产的 80%。

(2) 本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约、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 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;

(3) 本基金持有一家公司发行的证券(同一家公司在内地和香港同时上市的 A+H 股合并计算), 其市值不超过基金资产净值的 10%;

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

(5) 本基金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) 本基金债券正回购资金余额或逆回购资金余额不得超过其上一日基金资产净值的 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%; 完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述比例限制;

(13) 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;

(14) 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;

(15) 本基金参与股指期货、国债期货交易依据下列标准建构组合:

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

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

3. 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%; 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%; 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; 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%;

(16) 本基金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%; 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；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；

(17) 本基金资产总值不超过基金资产净值的 140%；

(18) 本基金参与融资业务后，在任何交易日日终，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%；

(19) 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；

(20) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述第(2)、(9)、(13)和(14)项另有约定外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 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。

## 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。

法律法规或监管部门取消或变更上述限制,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或按变更后的规定执行。

## 五、业绩比较基准

中证医药卫生指数收益率\*60%+恒生医疗保健指数收益率(使用估值汇率折算)\*20%+中债综合全价(总值)指数收益率\*20%

中证医药卫生指数由中证指数有限公司编制,成份股包括中证 800 指数全部样本股(含沪深 300 指数和中证 500 指数的成份股)中属于医药卫生行业的上市公司;恒生医疗保健指数反映恒生综合指数里主要经营医疗保健业务成份股公司的表现,与中证医药卫生指数结合,可以较好地反应沪港深三地医药领域上市公司股票的整体表现,适合作为本基金权益投资部分的业绩比较基准;中债综合全价(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),能够反映我国债券市场价格总水平、波动幅度和变动趋势,为判断债券供求动向提供了很好的依据,适合作为本基金债券投资部分的业绩比较基准。

本基金是混合型基金,在综合考虑了上述指数的权威性和代表性、指数的编制方法和本基金的投资范围和投资理念,选用上述业绩比较基准能够使本基金投资人理性判断本基金产品的风险收益特征,合理地衡量比较本基金的业绩表现。

如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时,本基金可以在与基金托管人协商一致的情况下,按相关监管部门要求履行相关手续后,依据维护基金份额持有人合法权益的原则,变更业绩比较基准并及时公告,无需召开基金份额持有人大会。如果本基金业绩比较基准所参照的指数在未来不再发布时,基金管理人可以在与基金托管人协商一致的情况下,按相关监管部门要求履行相关手续后,依据维护基金份额持有人合法权益的原则,选取相似的或可替代的指数作为业绩比较基准的参照指数,而无需召开基金份额持有人大会。

## 六、风险收益特征

本基金为混合型基金,一般而言,其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金,高于债券型基金、货币市场基金。本基金可投资港股通标的股票,会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

## 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。

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

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

#### 九、投资组合报告

基金管理人的董事会、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的法律责任。

基金托管人根据基金合同规定，复核了本报告中的财务指标、净值表现、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取自本基金 2023 年第 2 季度报告，所载数据截至 2023 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              | 20,398,310.28 | 93.87        |
|    | 其中：股票             | 20,398,310.28 | 93.87        |
| 2  | 基金投资              | -             | -            |
| 3  | 固定收益投资            | -             | -            |
|    | 其中：债券             | -             | -            |
|    | 资产支持证券            | -             | -            |
| 4  | 贵金属投资             | -             | -            |
| 5  | 金融衍生品投资           | -             | -            |
| 6  | 买入返售金融资产          | -             | -            |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -             | -            |
| 7  | 银行存款和结算备付金合计      | 1,325,096.19  | 6.10         |
| 8  | 其他资产              | 7,749.84      | 0.04         |
| 9  | 合计                | 21,731,156.31 | 100.00       |

注：本基金报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 8,438,016.28 元，占期末基金资产净值的比例为 38.93%。

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|---------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -             | -            |
| B  | 采矿业              | -             | -            |
| C  | 制造业              | 7,028,640.00  | 32.42        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -             | -            |
| E  | 建筑业              | -             | -            |
| F  | 批发和零售业           | 1,387,620.00  | 6.40         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | -             | -            |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | -             | -            |
| J  | 金融业              | -             | -            |
| K  | 房地产业             | -             | -            |
| L  | 租赁和商务服务业         | -             | -            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 1,023,834.00  | 4.72         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | -             | -            |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -             | -            |
| P  | 教育               | -             | -            |
| Q  | 卫生和社会工作          | 2,520,200.00  | 11.63        |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | -             | -            |
| S  | 综合               | -             | -            |
|    | 合计               | 11,960,294.00 | 55.17        |

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（%） |
|-----------|--------------|--------------|
| A 基础材料    | -            | -            |
| B 消费者非必需品 | -            | -            |
| C 消费者常用品  | -            | -            |
| D 能源      | -            | -            |
| E 金融      | -            | -            |
| F 医疗保健    | 8,438,016.28 | 38.93        |
| G 工业      | -            | -            |
| H 信息技术    | -            | -            |
| I 电信服务    | -            | -            |
| J 公用事业    | -            | -            |

|       |              |       |
|-------|--------------|-------|
| K 房地产 | -            | -     |
| 合计    | 8,438,016.28 | 38.93 |

注：以上行业分类采用全球行业分类标准(GICS)。

3、期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称  | 数量（股）   | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|-------|---------|--------------|--------------|
| 1  | 600976 | 健民集团  | 18,000  | 1,387,620.00 | 6.40         |
| 2  | 603882 | 金域医学  | 17,000  | 1,283,500.00 | 5.92         |
| 3  | 000999 | 华润三九  | 20,000  | 1,213,200.00 | 5.60         |
| 4  | 06618  | 京东健康  | 23,000  | 1,048,613.95 | 4.84         |
| 5  | 600085 | 同仁堂   | 17,000  | 978,520.00   | 4.51         |
| 6  | 00241  | 阿里健康  | 220,000 | 955,355.68   | 4.41         |
| 7  | 01951  | 锦欣生殖  | 240,000 | 916,079.33   | 4.23         |
| 8  | 00853  | 微创医疗  | 66,000  | 861,645.63   | 3.97         |
| 9  | 06078  | 海吉亚医疗 | 22,000  | 860,022.94   | 3.97         |
| 10 | 600557 | 康缘药业  | 31,000  | 851,260.00   | 3.93         |

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本报告期内，本基金未参与股指期货投资。

9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期内，本基金未参与股指期货投资。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1 本期国债期货投资政策

本报告期内，本基金未参与国债期货投资。

10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细



本基金本报告期内未参与国债期货投资。

### 10.3 本期国债期货投资评价

本报告期内，本基金未参与国债期货投资。

### 11、投资组合报告附注

#### 11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

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

#### 11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

#### 11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）    |
|----|---------|----------|
| 1  | 存出保证金   | -        |
| 2  | 应收证券清算款 | -        |
| 3  | 应收股利    | 2,640.00 |
| 4  | 应收利息    | -        |
| 5  | 应收申购款   | 5,109.84 |
| 6  | 其他应收款   | -        |
| 7  | 待摊费用    | -        |
| 8  | 其他      | -        |
| 9  | 合计      | 7,749.84 |

#### 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，各比例的分项之和与合计可能有尾差。

## 第十部分 基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责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。基金有风险，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。

1、自基金合同生效 2021 年 11 月 30 日至 2023 年 6 月 30 日，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

兴华创新医疗 6 个月持有混合发起 A

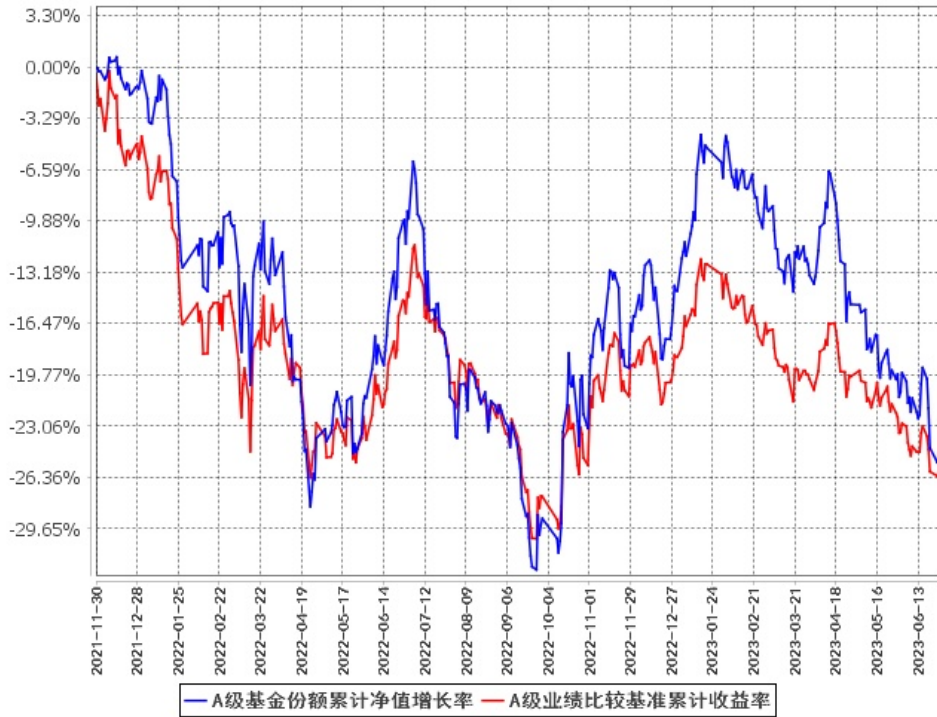
| 阶段             | 净值增长率①  | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基准<br>收益率③ | 业绩比较基准收<br>益率标准差④ | ①-③    | ②-④   |
|----------------|---------|---------------|----------------|-------------------|--------|-------|
| 过去三个月          | -13.45% | 1.38%         | -7.08%         | 0.86%             | -6.37% | 0.52% |
| 过去六个月          | -12.45% | 1.33%         | -8.71%         | 0.90%             | -3.74% | 0.43% |
| 过去一年           | -17.37% | 1.65%         | -13.11%        | 1.22%             | -4.26% | 0.43% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | -25.04% | 1.70%         | -25.73%        | 1.36%             | 0.69%  | 0.34% |

兴华创新医疗 6 个月持有混合发起 C

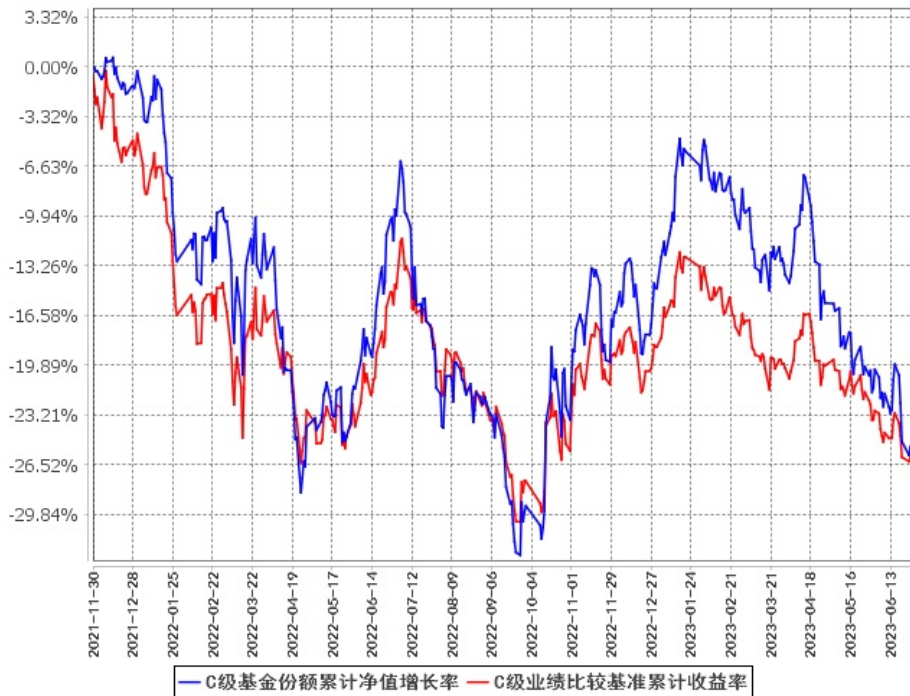
| 阶段             | 净值增长率①  | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基准<br>收益率③ | 业绩比较基准收<br>益率标准差④ | ①-③    | ②-④   |
|----------------|---------|---------------|----------------|-------------------|--------|-------|
| 过去三个月          | -13.53% | 1.37%         | -7.08%         | 0.86%             | -6.45% | 0.51% |
| 过去六个月          | -12.62% | 1.33%         | -8.71%         | 0.90%             | -3.91% | 0.43% |
| 过去一年           | -17.70% | 1.65%         | -13.11%        | 1.22%             | -4.59% | 0.43% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | -25.51% | 1.70%         | -25.73%        | 1.36%             | 0.22%  | 0.34% |

2、自基金合同生效 2021 年 11 月 30 日至 2023 年 6 月 30 日，基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

**A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图**  
(2021年11月30日至2023年6月30日)



**C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图**  
(2021年11月30日至2023年6月30日)



注：（1）本基金合同于 2021 年 11 月 30 日生效，截至报告期末基金合同生效已满一年。

（2）按基金合同规定，本基金的建仓期为自基金合同生效之日起 6 个月。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合本基金合同的有关规定。

---

---

## 第十一部分 基金的财产

### 一、基金资产总值

基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券及票据价值、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。

---

---

## 第十二部分 基金资产估值

### 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、资产支持证券、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、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, 且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的, 以最近交易日的市价(收盘价) 估值; 如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的, 可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素, 调整最近交易市价, 确定公允价格;

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

(3) 交易所上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种, 选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价进行估值;

(4) 交易所上市交易的可转换债券以每日收盘价作为估值全价;

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

(6) 对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券, 对存在活跃市场的情况下, 应以活跃市场上未经调整的报价作为估值日的公允价值; 对于活跃市场报价未能代表估值日公允价值的情况下, 应对市场报价进行调整以确认估值日的公允价值; 对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下, 应采用估值技术确定其公允价值, 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、配股和公开增发的股票, 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) 在发行时明确一定期限限售期的股票, 包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等, 不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票, 按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

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

4、同一证券同时在两个或两个以上市场交易的, 按证券所处的市场分别估值。

5、本基金投资股指期货合约、国债期货合约、股票期权合约, 按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。

6、基金投资同业存单，按估值日第三方估值机构提供的估值净价估值；选定的第三方估值机构未提供估值价格的，按成本估值。

7、本基金投资存托凭证的估值核算依照境内上市交易的股票执行。

8、持有的银行定期存款或通知存款以本金列示，根据存款协议列示的利息总额或约定利率每自然日计提利息。

9、本基金持有的回购以成本列示，按合同利率在回购期间内逐日计提应收或应付利息。

10、本基金参与融资业务的，按照相关法律法规和行业协会的相关规定进行估值。

11、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。

12、估值计算中涉及中国人民银行或其授权机构公布人民币汇率中间价的货币，其对人民币汇率以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。

13、如有确凿证据表明按原有方法进行估值不能客观反映上述资产或负债其公允价值的，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方法估值。

14、相关法律法规以及监管部门、自律规则另有规定的，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信息的计算结果对外予以公布。

## 五、估值程序

1、某一类别基金份额净值是按照每个工作日闭市后，该类别基金资产净值除以当日该类别基金份额的余额数量计算，精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入。基金管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的，从其规定。

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

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

## 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) 各类基金份额净值计算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) 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。

### 七、暂停估值的情形

- 1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;
- 2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时;
- 3、当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上的, 经与基金托管人协商确认后, 基金管理人应当暂停估值;
- 4、法律法规、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

### 八、基金净值的确认

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

### 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 13 项进行估值时, 所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

2、由于证券、期货交易所及其登记结算公司、证券经营机构、第三方估值机构发送的数据错误, 有关会计制度变化或由于其他不可抗力原因, 基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查, 但是未能发现该错误的, 由此造成的基金资产估值错误, 基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

---

---

#### 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，暂停披露侧袋账户份额净值。

---

---

## 第十三部分 基金的收益与分配

### 一、基金利润的构成

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

### 二、基金可供分配利润

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

### 三、基金收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案详见届时基金管理人发布的公告，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；通过红利再投资所得基金份额的最短持有期起始日与该认/申购份额最短持有期起始日相同；

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

4、由于本基金 A 类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；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规、基金合同的约定以及对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可在与基金托管人协商一致，并按照监管部门要求履行适当程序后对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日在规定媒介公告。

### 四、收益分配方案

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

### 五、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,在 2 日内在规定媒介公告。

#### 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。

## 第十四部分 基金的费用与税收

### 一、基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、从 C 类基金份额的基金财产中计提的销售服务费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用，但法律法规、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、仲裁费和诉讼费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券/期货交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、基金相关账户的开户及维护费用；
- 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 1.2% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延至最近可支付日支付。

#### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.2% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，日期顺延至最近可支付日支付。

### 3、C 类基金份额的销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.4%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务，基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。

销售服务费计提的计算公式如下：

$$H=E \times 0.4\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月起第 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构，由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等，日期顺延至最近可支付日支付。

销售服务费主要用于本基金持续销售以及基金份额持有人服务等各项费用。

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，详见招募说明书“侧袋机制”部分的规定。

### 五、基金税收

本基金运作过程中涉及各纳税主体，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。

---

---

## 第十五部分 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《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意。
- 3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所需在 2 日内在规定媒介公告。

## 第十六部分 基金的信息披露

一、本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《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”）及《信息披露办法》规定的互联网网站（以下简称“规定网站”）等媒介披露，并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

三、本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

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

四、本基金公开披露的信息应采用中文文本。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、《基金合同》、基金托管协议、基金产品资料概要

1、《基金合同》是界定《基金合同》当事人的各项权利、义务关系，明确基金份额持有



人大会召开的规则及具体程序,说明基金产品的特性等涉及基金投资者重大利益的事项的法律文件。

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

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

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

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,并将基金产品资料概要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网站上。

#### (二) 基金份额发售公告

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

#### (三) 《基金合同》生效公告

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

#### (四) 基金净值信息

《基金合同》生效后,在开始办理基金份额申购或者赎回前,基金管理人应当至少每周在规定网站披露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,通过其规定网站、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。

基金管理人应在不晚于半年度和年度最后一日的次日,在规定网站披露半年度和年度最

后一日的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各类基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率,并保证投资者能够在基金销售机构网站或营业网点查阅或者复制前述信息资料。

#### (六) 基金定期报告,包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告

基金管理人应当在每年结束之日起三个月内,编制完成基金年度报告,将年度报告登载在规定网站上,并将年度报告提示性公告登载在规定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计。

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

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

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

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

基金管理人应当在基金年度报告和中期报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。

#### (七) 临时报告

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

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

- 1、基金份额持有人大会的召开及决定的事项;
- 2、《基金合同》终止、基金清算;
- 3、转换基金运作方式、基金合并;
- 4、更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构,基金改聘会计师事务所;
- 5、基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项,基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项;
- 6、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更;
- 7、基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人的实际控制人变更;

- 
- 8、基金募集期延长或提前结束募集；
  - 9、基金管理人的高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；
  - 10、基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十，基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十；
  - 11、涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁；
  - 12、基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；
  - 13、基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易事项，但中国证监会另有规定的除外；
  - 14、基金收益分配事项；
  - 15、管理费、托管费、销售服务费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
  - 16、任一类基金份额净值计价错误达该类基金份额净值百分之零点五；
  - 17、本基金开始办理申购、赎回；
  - 18、本基金发生巨额赎回并延期办理；
  - 19、本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；
  - 20、本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；
  - 21、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；
  - 22、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；
  - 23、调整基金份额类别设置；
  - 24、基金信息披露义务人认为可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的其他事项或中国证监会规定的其它事项。

#### （八）澄清公告

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

#### （九）清算报告

基金合同出现终止情形的，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) 实施侧袋机制期间的信息披露

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

#### (十二) 发起资金认购份额报告

基金管理人应当按照相关法律法规的规定，在基金合同生效公告、基金年报、中期报告、季报中分别披露基金管理人固有资金、基金管理人高级管理人员、基金经理等人员以及基金管理人股东持有基金的份额、期限及期间的变动情况。

#### (十三) 投资于流通受限证券的信息披露

本基金在基金年报及中报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。

#### (十四) 投资于资产支持证券的信息披露

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

#### (十五) 基金投资国债期货的信息披露

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

#### (十六) 基金投资股指期货的信息披露

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

#### (十七) 基金投资股票期权的信息披露

基金管理人应在本基金季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书(更新)等文件中披露参与股票期权交易的有关情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标、估值方法等，并充分揭示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。

#### (十八) 投资于证券公司短期公司债的信息披露

本基金投资证券公司短期公司债后两个交易日内，基金管理人应在中国证监会规定媒介披露所投资证券公司短期公司债的名称、数量等信息，并在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书(更新)等文件中披露证券公司短期公司债的投资情况。

#### (十九) 基金参与融资业务的信息披露

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的情况,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。

#### (二十) 基金投资港股通标的股票相关信息

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)等文件中披露参与港股通标的股票交易的相关情况。

#### (二十一) 中国证监会规定的其他信息。

### 六、信息披露事务管理

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

基金管理人、基金托管人及相关从业人员不得泄露未公开披露的基金信息。

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、各类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。

为强化投资者保护,提升信息披露服务质量,基金管理人应当自中国证监会规定之日起,按照中国证监会规定向投资者及时提供对其投资决策有重大影响的信息。

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。

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。

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，供社会公众查阅、复制。

### 八、暂停或延迟披露基金信息的情形

当出现下述情况时，基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金相关信息：

- (1) 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、期货市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- (3) 基金合同约定的暂停估值的情形；
- (4) 法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的情况。

---

---

## 第十七部分 侧袋机制

### 一、侧袋机制的实施条件

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

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

### 二、实施侧袋机制期间基金份额的申购与赎回

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

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

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

### 三、实施侧袋机制期间的基金投资

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

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

基金管理人不得在侧袋账户中进行除特定资产处置变现以外的其他投资操作。

### 四、实施侧袋机制期间的基金估值

本基金实施侧袋机制的,基金管理人和基金托管人应对主袋账户资产进行估值并披露主袋账户的基金净值信息,暂停披露侧袋账户份额净值。侧袋账户的会计核算应符合《企业会计准则》的相关要求。

## 五、实施侧袋账户期间的基金费用

1、本基金实施侧袋机制的，主袋账户的管理费、托管费按主袋账户基金资产净值作为基数计提；侧袋账户的托管费根据法律法规按侧袋账户基金资产净值为基数计提，法律法规对侧袋账户的计提基数等另有规定的，从其规定。

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

## 六、侧袋账户中特定资产的处置变现和支付

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

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

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

## 七、侧袋机制的信息披露

### 1、临时公告

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

### 2、基金净值信息

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

### 3、定期报告

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



## 第十八部分 风险揭示

### 一、本基金的特有风险

1、本基金为混合型基金，股票及存托凭证资产占基金资产的比例为 60%-95%（其中港股通标的股票占股票资产的比例不超过 50%），其中投资于本基金所界定的创新医疗主题相关行业股票的比例不低于非现金基金资产的 80%。境内股票市场和债券市场的变化均会影响到基金业绩表现，基金净值表现因此可能受到影响。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。

2、本基金对每份基金份额设置 6 个月持有期。每日基金开放申赎，逐笔计算持有满 6 个月之后可以赎回。在基金份额的 6 个月持有期到期日前（不含当日），基金份额持有人不能对该基金份额提出赎回申请；基金份额的 6 个月持有期到期日起（含当日），基金份额持有人可对该基金份额提出赎回申请；因不可抗力或基金合同约定的其他情形致使基金管理人无法在基金份额的 6 个月持有期到期日按时开放办理该基金份额的赎回业务的，该基金份额的 6 个月持有期到期日顺延至不可抗力或基金合同约定的其他情形的影响因素消除之日起的下一个工作日。因此基金份额持有人面临在锁定期内不能赎回基金份额的风险。

3、本基金为发起式基金，《基金合同》生效满3年之日（指自然日），若基金资产净值低于2亿元，无需召开基金持有人大会审议，基金合同应当终止，且不得通过召开基金持有人大会的方式延续。若届时的法律法规或中国证监会规定发生变化，上述终止规定被取消、更改或补充，则本基金可以参照届时有效的法律法规或中国证监会规定执行。投资者将面临基金合同可能终止的不确定性风险。

### 4、本基金投资港股通标的股票的风险

本基金通过“内地与香港股票市场交易互联互通机制”投资于香港市场，在市场进入、投资额度、可投资对象、分红派息、税务政策等方面都有一定的限制，而且此类限制可能会不断调整，这些限制因素的变化可能对本基金进入或退出当地市场造成障碍，从而对投资收益以及正常的申购赎回产生直接或间接的影响。比如：

#### 1) 港股交易失败风险

港股通业务试点期间存在每日额度限制。在香港联合交易所开市前阶段，当日额度使用完毕的，新增的买单申报将面临失败的风险；在香港联合交易所持续交易时段，当日额度使用完毕的，当日本基金面临不能通过港股通进行买入交易的风险。如果未来港股通相关业务规则发生变化，以新的业务规则为准。另外还面临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）。

## 2) 汇率风险

本基金以人民币募集和计价,但本基金通过港股通投资香港证券市场。港币相对于人民币的汇率变化将会影响本基金以人民币计价的基金资产价值,从而导致基金资产面临潜在风险。人民币对港币的汇率的波动也可能加大基金净值的波动,从而对基金业绩产生影响。此外,由于基金运作中的汇率取自汇率发布机构,如果汇率发布机构出现汇率发布时间延迟或是汇率数据错误等情况,可能会对基金运作或者投资者的决策产生不利影响。

## 3) 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,对于调出投资范围的港股,只能卖出不能买入,因此本基金存在因港股通可投资标的范围调整,不能及时买入投资标的的风险。

## 4) 境外市场的风险

(1) 香港出现台风、黑色暴雨或者香港联合交易所规定的其他情形时,联交所将可能停市,本基金将面临在停市期间无法进行港股通交易的风险;出现境内证券交易所证券交易服务公司认定的交易异常情况时,境内证券交易所证券交易服务公司可能暂停提供部分或者全部港股通服务,本基金将面临在暂停服务期间无法进行港股通交易的风险。

(2) 香港市场证券交易价格并无涨跌幅上下限的规定,因此每日涨跌幅空间相对较大。

(3) 只有内地与香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。

(4) 内地与香港股票市场交易互联互通机制关于股票分红、代理投票、交收安排等方面对本基金投资安排产生影响的相关规定。

5) 本基金会根据市场环境的变化以及投资策略的需要进行调整,选择将部分基金资产投资于港股通标的股票或选择不将基金资产投资于港股通标的股票,因此本基金存在不对港股进行投资的可能。

5、本基金可投资于资产支持证券(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。

6、本基金可投资于股指期货,股指期货作为一种金融衍生品,主要存在以下风险:

(1) 市场风险:是指由于股指期货价格变动而给投资者带来的风险。

(2) 流动性风险:是指由于股指期货合约无法及时变现所带来的风险。

(3) 基差风险:是指股指期货合约价格和标的指数价格之间的价格差的波动所造成的风险。

(4) 保证金风险:是指由于无法及时筹措资金满足建立或者维持股指期货合约头寸所

要求的保证金而带来的风险。

(5) 杠杆风险：因股指期货采用保证金交易而存在杠杆，基金财产可能因此产生更大的收益波动。

(6) 信用风险：是指期货经纪公司违约而产生损失的风险。

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

7、本基金可投资于国债期货，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。

8、本基金的投资范围包括股票期权，股票期权作为一种金融衍生品，具备一些特有的风险点。投资股票期权所面临的主要风险是衍生品价格波动带来的市场风险；衍生品基础资产交易量大于市场可报价的交易量而产生的流动性风险；衍生品合约价格和标的指数价格之间的价格差的波动而造成基差风险；无法及时筹措资金满足建立或者维持衍生品合约头寸所要求的保证金而带来的保证金风险；交易对手不愿或无法履行契约而产生的信用风险；以及各类操作风险。

9、本基金投资存托凭证，可能受到存托凭证的境外基础证券价格波动影响，存托凭证的境外基础证券的相关风险可能直接或间接成为本基金的风险。除价格波动风险外，本基金还将面临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。

10、本基金投资范围包括证券公司短期公司债券，由于证券公司短期公司债券非公开发行和交易，且限制投资者数量上限，潜在流动性风险相对较大，若发行主体信用质量恶化或投资者大量赎回需要变现资产时，受流动性所限，本基金可能无法卖出所持有的证券公司短期公司债券，由此可能给基金资产净值带来不利影响或损失。

11、本基金可参与融资交易，融资交易的风险主要包括流动性风险、信用风险等，这些风险可能会给基金净值带来一定的负面影响和损失。为了更好的防范融资交易所面临的各类风险，基金管理人将遵守审慎经营原则，制定科学合理的投资策略和风险管理制度，有效防范和控制风险，切实维护基金财产的安全和基金份额持有人利益。

12、本基金收益分配方式有现金分红和红利再投资两种，对于选择红利再投资的投资者，通过红利再投资所得基金份额的最短持有期起始日与该认/申购份额最短持有期起始日相同，

---

敬请投资人留意。

## 二、市场风险

证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响，导致基金收益水平变化，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。随经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化。基金投资于国债与上市公司的股票，收益水平也会随之变化，从而产生风险；

3、利率风险。金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着国债的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。基金投资于国债和股票，其收益水平会受到利率变化的影响；

4、上市公司经营风险。上市公司的经营好坏受多种因素影响，如管理能力、财务状况、市场前景、行业竞争、人员素质等，这些都会导致企业的盈利发生变化。如果基金所投资的上市公司经营不善，其股票价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，使基金投资收益下降。虽然基金可以通过投资多样化来分散这种非系统风险，但不能完全规避；

5、购买力风险。基金的利润将主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀的影响而导致购买力下降，从而使基金的实际收益下降；

6、信用风险。主要是指债务人的违约风险，若债务人经营不善，资不抵债，债权人可能会损失掉大部分的投资，这主要体现在企业债中；

7、债券收益率曲线变动风险。债券收益率曲线变动风险是指与收益率曲线非平行移动有关的风险，单一的久期指标并不能充分反映这一风险的存在；

8、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（即前面所提到的利率风险）互为消长。具体为当利率下降时，基金从投资的固定收益证券所得的利息收入进行再投资时，将获得较少的收益率。

## 三、开放式基金共有的风险

1、管理风险。在基金管理运作过程中基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的占有和对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平，造成管理风险。

2、流动性风险。基金投资组合中的投资品种会因各种原因面临流动性风险，使证券交易的执行难度提高，买入成本或变现成本增加。此外，本基金属开放式基金，对每份基金份额设置 6 个月持有期，在所有开放日管理人有权接受持有期届满的基金份额的投资人的赎回。如果出现巨额赎回的情形，可能造成基金仓位调整和资产变现困难，加剧流动性风险。

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

### 3、操作风险

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。

### 四、其他风险

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,可能导致基金资产的损失。金融市场危机、代理商违约、基金托管人违约等超出基金管理人自身直接控制能力之外的风险,可能导致基金或者基金份额持有人利益受损。

### 五、本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险

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

### 六、流动性风险评估

#### (1) 本基金的申购、赎回安排

投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回,但本基金对每份基金份额设置 6 个月持有期,如果投资人多次认购/申购本基金,则其持有的每份基金份额的赎回开放的时间可能不同。申购和赎回的具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间(若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,具体以届时依照法律法规发布的公告为准),但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。基金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。

#### (2) 投资市场、行业及资产的流动性风险评估

本基金为混合型基金,本基金主要投资对象为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、港股通标的股票、债券等,本基金股票及存托凭证资产占基金资产的比例为 60%-95%(其中港股通标的股票占股票资产的比例不超过 50%),其中投资于本基金所界

定的创新医疗主题相关行业股票的比例不低于非现金基金资产的 80%，主要投资标的均具有良好的流动性。同时，根据《流动性风险管理规定》的相关要求，本基金会审慎评估所投资资产的流动性，并针对性制定流动性风险管理措施，因此本基金流动性风险也可以得到有效控制。

### (3) 巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

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

a. 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。

b. 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，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

c. 如发生单个开放日内单个基金份额持有人申请赎回的基金份额超过前一开放日的基金总份额的 30%时，本基金管理人对该单个基金份额持有人持有的赎回申请实施延期办理。对于其超过基金总份额 30%以上部分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。对于其不超过基金总份额 30%部分作为当日有效赎回申请，基金管理人可以根据前述“a. 全额赎回”或“b. 部分延期赎回”的约定方式对该部分有效赎回申请与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。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；延期部分如选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。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。

d. 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。

### (4) 实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响

本基金在面临大规模赎回的情况下有可能因为无法变现造成流动性风险。如果出现流动

性风险,基金管理人经与基金托管人协商,在确保投资者得到公平对待的前提下,可实施备用的流动性风险管理工具,作为特定情形下基金管理人流动性风险管理的辅助措施,包括但不限于延期办理巨额赎回申请、暂停接受赎回申请、延缓支付赎回款项、暂停基金估值、摆动定价、基金实施侧袋机制以及中国证监会认定的其他措施。同时基金管理人应时刻防范可能产生的流动性风险,对流动性风险进行日常监控,保护持有人的利益。当实施备用的流动性风险管理工具时,有可能无法按合同约定的时限支付赎回款项。

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

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

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

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

## 第十九部分 基金合同的变更、终止和基金财产的清算

### 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 2 日内在规定媒介公告。

### 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、基金合同生效满三年之日（指自然日），若基金资产净值低于两亿元的；
- 4、《基金合同》约定的其他情形；
- 5、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### 三、基金财产的清算

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

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、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。

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

#### 4、基金财产清算程序：

- (1) 《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；
- (2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- (3) 对基金财产进行估值和变现；
- (4) 制作清算报告；
- (5) 聘请符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所对清算报告进行外部审



---

计, 聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书;

(6) 将清算报告报中国证监会备案并公告;

(7) 对基金剩余财产进行分配。

5、基金财产清算的期限为 6 个月, 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财产中支付。

#### 五、基金财产清算剩余资产的分配

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

#### 六、基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告; 基金财产清算报告经符合《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。

#### 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不低于法律法规规定的最低期限。

## 第二十部分 基金合同的内容摘要

### 一、基金合同当事人及其权利义务

#### (一) 基金管理人的权利与义务

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

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

(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，但应监管机构、司法机关等有权机关的要求，或向审计、法律等外部专业顾问提供的情况除外；
- (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、为基金办理场外证券、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，但应监管机构、司法机关等有权机关的要求，或因审计、法律等外部专业顾问提供的情况除外；

(8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值、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不低于法律法规规定的最低期限；

(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，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) 基金份额持有人的权利与义务

基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受，基金投资

者自依据《基金合同》取得基金份额，即成为本基金份额持有人和《基金合同》的当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为《基金合同》当事人并不以在《基金合同》上书面签章或签字为必要条件。

同一类别每份基金份额具有同等的合法权益。

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

- (1) 分享基金财产收益；
- (2) 参与分配清算后的剩余基金财产；
- (3) 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) 发起资金提供方持有认购的基金份额不少于 3 年；
- (10) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## 二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

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

本基金份额持有人大会不设日常机构。若将来法律法规对基金份额持有人大会另有规定的，以届时有效的法律法规为准。

(一) 召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会，但法律法规、中国证监会另有规定的除外：

- (1) 终止《基金合同》，基金合同另有约定的除外；
- (2) 更换基金管理人；
- (3) 更换基金托管人；
- (4) 转换基金运作方式；
- (5) 调整基金管理人、基金托管人的报酬标准或提高销售服务费；
- (6) 变更基金类别；
- (7) 本基金与其他基金的合并；
- (8) 变更基金投资目标、范围或策略；
- (9) 变更基金份额持有人大会程序；
- (10) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- (11) 单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；
- (12) 对基金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、调低销售服务费或变更收费方式；
- (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、非交易过户、转托管等业务规则；
- (6) 增加、取消或调整基金份额类别设置；
- (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证明委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或基金托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

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

（2）经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）。若到会者在权益登记日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、在法律法规或监管机构允许的情况下，经会议通知载明，基金份额持有人大会可通过网络、电话或其他方式召开，基金份额持有人也可以采用网络、电话或其他方式进行表决，或者采用网络、电话或其他方式授权他人代为出席会议并表决。

#### （五）议事内容与程序

##### 1、议事内容及提案权

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

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

##### 2、议事程序

###### （1）现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第（七）条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的二分之一以上（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同等表决权。

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、中国证监会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 2 日内在规定媒介上公告。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、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) 本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定,凡是直接引用法律法规或监管规则的部分,如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的,基金管理人经与基金托管人协商一致并履行适当程序后,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、基金的收益与分配

#### (一) 基金利润的构成

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

#### (二) 基金可供分配利润

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

#### (三) 基金收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下,基金管理人可以根据实际情况进行收益分配,具体分配方案详见届时基金管理人发布的公告,若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配;

2、本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;通过红利再投资所得基金份额的最短持有期起始日与该认/申购份额最短持有期起始日相同;

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

4、由于本基金 A 类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;

5、法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

在不违反法律法规、基金合同的约定以及对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下,基金管理人可在与基金托管人协商一致,并按照监管部门要求履行适当程序后对基金收益分配原则进行调整,不需召开基金份额持有人大会,但应于变更实施日在规定媒介公告。

#### (四) 收益分配方案

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

#### (五) 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,在 2 日内在规定媒介公告。

#### (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,详见招募说明书的规定。

### 四、基金费用与税收

#### (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、从 C 类基金份额的基金财产中计提的销售服务费;
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用,但法律法规、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、仲裁费和诉讼费;
- 6、基金份额持有人大会费用;
- 7、基金的证券/期货交易费用;
- 8、基金的银行汇划费用;
- 9、基金相关账户的开户及维护费用;
- 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 1.2%年费率计提。管理费的计算方法如下:

$$H=E \times 1.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延至最近可支付日支付。

## 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.2% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，日期顺延至最近可支付日支付。

## 3、C 类基金份额的销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.4%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务，基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。

销售服务费计提的计算公式如下：

$$H=E \times 0.4\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月起第 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构，由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等，日期顺延至最近可支付日支付。

销售服务费主要用于本基金持续销售以及基金份额持有人服务等各项费用。

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，详见招募说明书的规定。

## （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。

## 五、基金的投资

### （一）投资目标

在严格控制风险和保持资产流动性的前提下，把握创新医疗相关的行业投资机会，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产的长期稳健增值。

### （二）投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、存托凭证、港股通标的股票、债券（包括国债、金融债、地方政府债券、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府支持债券、政府支持机构债券、次级债、证券公司短期公司债券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券等）、资产支持证券、债券回购、货币市场工具、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、金融衍生品（包括股指期货、国债期货、股票期权）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：本基金股票及存托凭证资产占基金资产的比例为 60%-95%（其中港股通标的股票占股票资产的比例不超过 50%），其中投资于本基金所界定的创新医疗主题相关行业股票的比例不低于非现金基金资产的 80%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约、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 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或中国证监会变更上述投资品种的比例限制，以变更后的比例为准，本基金的投资比例会做相应调整。

### （三）投资策略

#### 1、大类资产配置策略

本基金通过定性与定量相结合的方法分析证券市场发展趋势，对证券市场当期的风险收益特征以及未来可预见的时期内股票、债券等大类资产的预期风险和预期收益率进行分析评估，并据此制定本基金在股票、债券、现金等资产之间的配置比例、调整原则和调整范围，



在保持总体风险水平相对稳定的基础上,力争实现投资组合的稳定增值。此外,本基金将持续地进行定期与不定期的资产配置风险监控,并适时地做出相应的调整。

## 2、股票投资策略

### (1) 创新医疗主题的界定

创新是医疗行业最核心的推动力,持续引领医疗行业的变革与发展,本基金主要投资于医疗行业中创新医疗主题相关的上市公司,其中医疗行业是指从事医药产品研发、生产和销售的行业,涵盖预防、保健、诊断、治疗、康复领域的医疗全产业链条,包括化学制药行业、生物制药行业、中药行业、医疗器械行业、医疗诊断行业、医疗服务行业;创新医疗主题是指医疗行业中的创新领域,主要包括创新医疗药物、创新医疗器械、创新医疗技术、创新医疗服务。

(1) 创新医疗药物:是指具有自主知识产权专利,且在化学结构、药品组分和药理作用不同于现有药品的药物,包括但不限于境内外均未上市的创新药及改良型新药。

(2) 创新医疗器械:是指制造工艺、技术水平以及科技含量较高的高端医疗器械,包括 CT、核磁、超声、放疗为代表的大型设备,以手术机器人、诊断仪器为代表的中型设备,以及以植入式装置、内窥镜、骨科材料、可穿戴设备为代表的小型器械。

(3) 创新医疗技术:是指新型诊疗技术,包括免疫诊断、干细胞诊疗、精准医疗。

(4) 创新医疗服务:是指新型医疗服务,包括创新药研发服务、高端医疗服务、医疗信息化、移动医疗、医药电商。

未来随着科技进步、医疗需求演变、政策或市场环境发生变化导致本基金对创新医疗主题的界定范围发生变动,本基金在审慎研究的基础上,并履行适当必要的程序后,可根据实际情况调整创新医疗主题的界定标准。

### (2) 行业配置策略

本基金将综合考虑创新医疗主题下各细分子行业的生命周期、行业景气、竞争格局、创新变革等因素,全方位评估各细分子行业的中长期投资价值,在此基础上确定细分子行业的配置比例,并根据基本面和估值水平变化进行动态调整。

### (3) 个股投资策略

本基金股票投资采用定量和定性分析相结合的策略。

#### 1) 定性分析

在定性分析方面,本基金主要挑选全部或部分具备以下特征的上市公司:

A、公司受益于国家新发展格局下的不断改革创新,并且可分享改革创新过程中的政策红利;

B、公司所处的行业符合国家的战略发展方向,并且公司在行业中具有明显的竞争优势;

C、公司具有良好的治理结构,从大股东、管理层到中层业务骨干有良好的激励机制,并且信息披露公开透明;

D、公司具有良好的自主创新能力，包括科技、商业模式、管理、产品等方面，并且拥有持续创新的战略思维。

## 2) 定量分析

本基金将对反映上市公司质量和增长潜力的成长性指标、财务指标和估值指标等进行定量分析，以挑选具有成长优势、财务优势和估值优势的个股。

A、成长性指标：收入增长率、营业利润增长率和净利润增长率等；

B、财务指标：净资产收益率、毛利率、净利率等；

C、估值指标：市盈率（PE）、市盈率相对盈利增长比率（PEG）、市销率（PS）和总市值等。

## 3、港股通标的股票投资策略

本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场。

受到内地、香港市场行情和整体估值水平影响，部分创新医疗主题港股与行业内同类型 A 股相比估值较低，形成价值洼地。本基金将重点关注这类与 A 股相比有明显估值优势的行业和公司，通过定量与定性相结合的分析方法，考察上市公司的盈利能力、盈利质量、成长能力、运营能力以及负债水平等方面的数据，综合分析上市公司的业绩质量、成长性和估值水平等，筛选出财务健康、成长性良好的优质股票，挖掘香港市场创新医疗主题相关产业资本增值机会。

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。

## 4、存托凭证投资策略

对于存托凭证的投资，本基金将依照上述境内上市交易的股票投资策略在深入研究的基础上，通过定性与定量相结合的方式，筛选出具有比较优势的存托凭证作为投资标的。

## 5、债券投资策略

在选择债券品种时，首先根据宏观经济、资金面动向、投资人行为、市场成交量和活跃度等方面的分析判断未来利率期限结构变化，并充分考虑组合的流动性管理的实际情况，配置债券组合的久期；其次，结合信用分析、流动性分析、税收分析等确定债券组合的类属配置；再次，在上述基础上利用债券定价技术，进行个券选择，在深度信用分析后，选择被低估的债券进行投资。在具体投资操作中，采用杠杆操作、利率波段操作、骑乘操作、换券操作等灵活多样的操作方式，获取超额的投资收益。

### (1) 久期配置策略

久期配置是根据对宏观经济数据、金融市场运行特点等方面的分析来确定组合的整体久期，结合本基金的流动性需求及投资比例规定，动态调整组合的久期，有效地控制整体资产风险。当预测利率上升时，适当缩短投资组合的目标久期，预测利率水平降低时，适当延长投资组合的目标久期。

## (2) 收益率曲线策略

在确定了组合的整体久期后,组合将基于宏观经济研究和债券市场跟踪,结合收益率曲线的拟合和波动模拟模型,对未来的收益率曲线移动进行情景分析,从而根据不同期限的收益率变动情况,在期限结构配置上适时采取子弹型、哑铃型或者阶梯型等策略,进一步优化组合的期限结构,增强基金的收益。

## 6、金融衍生品投资策略

为更好的实现投资目标,本基金可投资股指期货、国债期货、股票期权和其他经中国证监会允许的衍生金融产品,本基金将根据风险管理的原则,主要选择流动性好、交易活跃的衍生品合约进行交易。

### (1) 股指期货投资策略

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位频繁调整的交易成本,以达到降低投资组合整体风险的目的。

### (2) 国债期货投资策略

本基金在进行国债期货投资时,将根据风险管理原则,以套期保值为主要目的,采用流动性好、交易活跃的国债期货合约,通过对债券现货市场和期货市场运行趋势的研究,结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平,与现货资产进行匹配,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

### (3) 股票期权投资策略

本基金投资股票期权以套期保值为主要目的,将根据风险管理的原则,充分考虑股票期权的流动性和风险收益特征,在风险可控的前提下,采取备兑开仓、delta 中性等策略适度参与股票期权投资。

本基金将关注其他金融衍生产品的推出情况,如法律法规或监管机构允许基金投资前述衍生工具,本基金将按届时有效的法律法规和监管机构的规定,制定与本基金投资目标相适应的投资策略和估值政策,在充分评估衍生产品的风险和收益的基础上,谨慎地进行投资。

## 7、资产支持证券投资策略

本基金将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析,并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型,评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。

## 8、可转换债券和可交换债券投资策略

本基金在分析宏观经济运行特征和证券市场趋势判断的前提下,在综合分析可转换债券的固定收益类证券特征、权益类证券特征等因素的基础上,选择其中安全边际较高、股性活跃并具有较高上涨潜力的品种进行投资。可交换债券同样兼具权益类证券特性和固定收益类证券特性,其中固定收益类证券特性与可转换债券相同,而对于权益类证券特性的分析则需

关注目标公司的股票价值以及发行人作为股东的换股意愿等。

#### 9、融资业务的投资策略

本基金参与融资业务,将在保障基金投资组合充足流动性以及有效控制融资杠杆风险的前提下,确定融资比例。根据风险管理的原则,在法律法规允许的范围和比例内、风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与融资业务。

#### 10、证券公司短期公司债券投资策略

本基金将通过对证券行业分析、证券公司资产负债分析、公司现金流分析等调查研究,分析证券公司短期公司债券的违约风险及合理的利差水平,对证券公司短期公司债券进行独立、客观的价值评估。

基金投资证券公司短期公司债券,基金管理人将根据审慎原则,制定严格的投资决策流程、风险控制制度,并经董事会批准,以防范信用风险、流动性风险等各种风险。

今后,随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等,基金还将积极寻求其他投资机会,如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,本基金将在履行适当程序后,将其纳入投资范围以丰富组合投资策略。

### (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) 本基金股票及存托凭证资产占基金资产的比例为 60%-95% (其中港股通标的股票占股票资产的比例不超过 50%), 其中投资于本基金所界定的创新医疗主题相关行业股票的比例不低于非现金基金资产的 80%。

(2) 本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约、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 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;

(3) 本基金持有一家公司发行的证券(同一家公司在内地和香港同时上市的 A+H 股合并计算),其市值不超过基金资产净值的 10%;

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

(5) 本基金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) 本基金债券正回购资金余额或逆回购资金余额不得超过其上一日基金资产净值的 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%; 完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述比例限制;

(13) 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;

(14) 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;

(15) 本基金参与股指期货、国债期货交易依据下列标准建构组合:

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

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

3. 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%; 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%; 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; 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%;

(16) 本基金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%; 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; 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；

(17) 本基金资产总值不超过基金资产净值的 140%；

(18) 本基金参与融资业务后，在任何交易日日终，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%；

(19) 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；

(20) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述第(2)、(9)、(13)和(14)项另有约定外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 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。

## 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。

法律法规或监管部门取消或变更上述限制，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或按变更后的规定执行。

## 六、基金净值信息的计算方法和公告方式

### (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及票据价值、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披露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, 通过其规定网站、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。

基金管理人应在不晚于半年度和年度最后一日的次日, 在规定网站披露半年度和年度最后一日的各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。

## 七、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 2 日内在规定媒介公告。

### (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、基金合同生效满三年之日(指自然日), 若基金资产净值低于两亿元的;
- 4、《基金合同》约定的其他情形;
- 5、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### (三) 基金财产的清算

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

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、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。

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

4、基金财产清算程序：

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

5、基金财产清算的期限为 6 个月，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财产中支付。

(五) 基金财产清算剩余资产的分配

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

(六) 基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经符合《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。

(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不低于法律法规规定的最低期限。

八、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，如经友好协商未能解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会，仲裁委员会根据该会届时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，仲裁费、律师费由败诉方承担。

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

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

#### 九、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

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

## 第二十一部分 基金托管协议的内容摘要

### 一、基金托管协议当事人

#### (一) 基金管理人(或简称“管理人”)

名称：兴华基金管理有限公司

注册地址：山东省青岛市李沧区金水路 187 号 2 号楼 8 层

办公地址：山东省青岛市李沧区金水路 187 号 2 号楼 8 层

法定代表人：张磊

成立时间：2020 年 4 月 28 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：【2020】368 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：1 亿元人民币

存续期间：持续经营

#### (二) 基金托管人(或简称“托管人”)

名称：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：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

广东省深圳市福田区中心三路 8 号中信证券大厦

法定代表人：张佑君

成立时间：1995 年 10 月 25 日

批准设立机关：国家工商总局

批准设立文号：100000000018305

组织形式：股份有限公司（上市）

注册资本：14,820,546,829 元人民币

基金托管资格批文及文号：《关于核准中信证券股份有限公司证券投资基金托管资格的批复》（证监许可[2014]1044 号）

经营范围：证券经纪（限山东省、河南省、浙江省天台县、浙江省苍南县以外区域）；证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问；证券承销与保荐；证券自营；证券资产管理；融资融券；证券投资基金代销；为期货公司提供中间介绍业务；代销金融产品；股票期权做市。

存续期间：无限期

### 二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

### (一) 基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权

1、基金托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定，对下述基金投资范围进行监督。

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

(1) 按法律法规的规定及《基金合同》的约定，基金的投资组合比例为：

本基金股票及存托凭证资产占基金资产的比例为 60%–95%（其中港股通标的股票占股票资产的比例不超过 50%），其中投资于本基金所界定的创新医疗主题相关行业股票的比例不低于非现金基金资产的 80%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约、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 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或中国证监会变更上述投资品种的比例限制，以变更后的比例为准，本基金的投资比例会做相应调整。

(2) 根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金投资组合遵循以下投资限制：

1) 本基金股票及存托凭证资产占基金资产的比例为 60%–95%（其中港股通标的股票占股票资产的比例不超过 50%），其中投资于本基金所界定的创新医疗主题相关行业股票的比例不低于非现金基金资产的 80%。

2) 本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约、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 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

3) 本基金持有一家公司发行的证券（同一家公司在内地和香港同时上市的 A+H 股合并计算），其市值不超过基金资产净值的 10%；

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

5) 本基金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) 本基金债券正回购资金余额或逆回购资金余额不得超过其上一日基金资产净值的 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) 本基金管理人管理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%; 完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述比例限制;

13) 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;

14) 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;

15) 本基金参与股指期货、国债期货交易依据下列标准建构组合:

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

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

3. 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%;

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%；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；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%；

16) 本基金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%；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；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；

17) 本基金资产总值不超过基金资产净值的 140%；

18) 本基金参与融资业务后，在任何交易日日终，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%；

19) 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；

20) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述第 2)、9)、13) 和 14) 项另有约定外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自《基金合同》生效之日起 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。

3、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投资禁止行为通过事后监督方式进行监督：

- (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。

如法律法规或监管部门取消或调整上述禁止性规定，如适用于本基金，基金管理人在履

行适当程序后, 则本基金投资不再受相关限制或按调整后的规定执行。

4、基金托管人依据有关法律法規的规定和《基金合同》的约定对于基金关联投资限制进行监督。

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, 并按法律法規予以披露。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。

5、本基金参与银行间市场交易, 由基金管理人决定银行间市场交易对手的名单, 并按照审慎的风险控制原则在该名单中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; 基金管理人在银行间市场进行现券买卖和回购交易时, 需按交易对手名单中约定的该交易对手所适用的交易结算方式进行交易。基金托管人不对本基金参与银行间市场交易的交易对手和交易结算方式进行监控。

#### 6、基金托管人对基金投资流通受限证券的监督

(1) 基金管理人投资流通受限证券, 应事先根据中国证监会相关规定, 明确基金投资流通受限证券的比例, 制订严格的投资决策流程和风险控制制度, 防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险。基金托管人对基金管理人是否遵守相关制度、流动性风险处置预案以及相关投资额度和比例等的情况进行监督。

(2) 此处流通受限证券与上文所述的流动性受限资产并不完全一致, 包括经中国证监会批准的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券, 不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。

(3) 基金管理人应在基金首次投资流通受限证券前, 向基金托管人提供经基金管理人董事会批准的有关基金投资流通受限证券的投资决策流程、风险控制制度。基金投资非公开发行股票, 基金管理人还应提供基金管理人董事会批准的流动性风险处置预案。上述资料应包括但不限于基金投资流通受限证券的投资额度和投资比例控制情况。

基金管理人应至少于首次执行投资指令之前两个工作日将上述资料书面发至基金托管人, 保证基金托管人有足够的时间进行审核。基金托管人应在收到上述资料后两个工作日内, 以书面或其他双方认可的方式进行确认。

(4) 基金投资流通受限证券前, 基金管理人应向基金托管人提供符合法律法規要求的有关书面信息, 包括但不限于拟发行证券主体的中国证监会批准文件、发行证券数量、发行价格、锁定期, 基金拟认购的数量、价格、总成本、总成本占基金资产净值的比例、已持有

流通受限证券市值占资产净值的比例、资金划付时间等。基金管理人应保证上述信息的真实、完整，并于拟执行投资指令前将上述信息书面发至基金托管人，保证基金托管人有足够的时间进行审核。

(5) 基金托管人应按照《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》规定，对基金管理人是否遵守法律法规进行监督，并审核基金管理人提供的有关书面信息。基金托管人认为上述资料可能导致基金出现风险的，有权要求基金管理人在投资流通受限证券前就该风险的消除或防范措施进行补充书面说明，并保留查看基金管理人风险管理部门就基金投资流通受限证券出具的风险评估报告等备查资料的权利。否则，基金托管人有权拒绝执行有关指令。因拒绝执行该指令造成基金财产损失的，基金托管人不承担任何责任，并有权报告中国证监会。

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

7、本基金投资银行存款的信用风险主要包括存款银行的信用等级、存款银行的支付能力等涉及到存款银行选择方面的风险。本基金的基金管理人根据相应规则确定存款银行，本基金投资存款银行以外的银行存款出现由于存款银行信用风险而造成的损失时由相关责任人进行赔偿。基金托管人不对本基金投资银行存款的存款银行进行监控。

(二) 基金托管人应根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料(需基金管理人主动提供)中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查。

(三) 基金托管人发现基金管理人的投资运作及其他运作违反法律法规、《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管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应在下一个工作日前及时核对，并以书面形式向基金托管人发出回函，进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限。

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。基金管理人应赔偿因其违反法律法规、行业自律性规定或《基金合同》或本托管协议及其他有关规定而致使投资者和基金托管人遭受的损失。

对于依据交易程序尚未成交的且基金托管人在交易前能够监控的投资指令，基金托管人发现该投资指令违反有关法律法规规定或者违反《基金合同》约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并向中国证监会报告。

对于必须于估值完成后方可获知的监控指标或依据交易程序已经成交的投资指令，基金托管人发现该投资指令违反有关法律法规或者违反《基金合同》约定的，应当立即通知基金管理人，并报告中国证监会。

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

基金托管人发现基金管理人重大违规行为,应立即报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正。

基金管理人无正当理由,拒绝、阻挠基金托管人根据本协议规定行使监督权,或采取拖延、欺诈等手段妨碍基金托管人进行有效监督,情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的,基金托管人应报告中国证监会。

### 三、基金管理人对于基金托管人的业务核查

(一)基金管理人对于基金托管人履行托管职责情况进行核查,核查事项包括但不限于基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户、证券账户等投资所需账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

(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,基金管理人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确认并以书面形式向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。在上述限期内,基金管理人有权随时对通知事项进行复查,督促基金托管人改正,并予协助配合。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。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的,基金管理人应报告中国证监会。

(三)基金管理人发现基金托管人有重大违规行为,应立即报告中国证监会,同时通知基金托管人限期纠正,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、阻挠基金管理人根据本协议规定行使监督权,或采取拖延、欺诈等手段妨碍基金管理人进行有效监督,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、基金财产的保管

#### (一)基金财产保管的原则

1、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。

2、基金托管人应安全保管基金财产,未经基金管理人的合法合规指令或法律法规、《基金合同》及本协议另有规定,不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。



3、基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户、证券账户等投资所需账户，相关开户费用由基金资产承担。

4、基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，分账管理，独立核算，确保基金财产的完整与独立。

5、对于因为基金认申购、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。基金管理人未及时催收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，基金托管人对此不承担任何责任。

6、对因为基金管理人投资产生的存放或存管在基金托管人以外机构的基金财产，或交由期货公司或证券公司负责清算交收的基金财产（包括但不限于期货保证金账户内的资金、期货合约等）及其收益，若由于该等机构或该机构会员单位等本协议当事人外第三方的原因给基金财产造成的损失等，基金托管人不承担责任。

7、除依据法律法规、《基金合同》及其他有关规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

#### （二）《基金合同》生效前募集资金的验资和入账

1、基金募集期间募集的资金应存于基金管理人在具有托管资格的银行开立的“基金募集专户”，该账户由基金管理人开立并管理。基金募集期满或基金管理人宣布停止募集时，发起资金认购金额及承诺持有期限符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，基金管理人应将属于本基金财产的全部资金划入在基金托管人为本基金开立的基金银行账户。同时在规定时间内，由基金管理人在法定期限内聘请符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所对基金进行验资，并出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的 2 名以上(含 2 名)中国注册会计师签字方为有效。

2、若基金募集期限届满，未能达到《基金合同》生效的条件，由基金管理人按规定办理退款等事宜，基金托管人应提供必要的协助。

#### （三）基金的银行账户的开设和管理

1、基金托管人应负责本基金的银行账户的开设和管理。

2、基金托管人以本基金的名义在具有基金托管资格的商业银行开设本基金的银行账户。本基金的银行预留印鉴为“中信证券股份有限公司托管业务结算专用章”和基金托管人有权人名章。本基金的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益、收取申购款，均需通过本基金的银行账户进行。

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

4、基金银行账户的管理应符合《人民币银行结算账户管理办法》、《现金管理暂行条例》、

《支付结算办法》以及其他相关规定。

#### (四) 基金证券账户和结算备付金账户的开设和管理

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

2、本基金证券账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借或未经另一方同意擅自转让本基金的证券账户；亦不得使用本基金的证券账户进行本基金业务以外的活动。

3、基金证券账户的开立由基金托管人负责，账户资产的管理和运用由基金管理人负责。

4、证券账户开立后，证券经纪商选择指定营业网点为本基金开立证券资金账户，并通知基金托管人，该证券资金账户与基金托管资金专门账户之间建立银证转账对应关系。

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

#### (五) 债券托管账户的开设和管理

《基金合同》生效后，基金管理人负责以基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表基金进行交易；基金托管人根据中国人民银行、银行间市场登记结算机构的有关规定，以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司、银行间市场清算所股份有限公司开设银行间债券市场债券托管账户和资金结算专户，并代表基金进行银行间债券市场债券和资金的清算。基金管理人和基金托管人应共同负责完成银行间债券市场准入备案。

#### (六) 期货账户的开设和管理

基金管理人根据投资需要按照规定开立期货保证金账户及期货交易编码等。完成上述账户开立后，基金管理人应以书面形式将期货公司提供的期货保证金账户的初始资金密码和市场监控中心的登录用户名及密码告知基金托管人。资金密码和市场监控中心登录密码重置由基金管理人进行，重置后务必及时通知托管人。

基金托管人和基金管理人应当在开户过程中相互配合，并提供所需资料。基金管理人保证所提供的账户开户材料的真实性和有效性，且在相关资料变更后及时将变更的资料提供给基金托管人。

#### (七) 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

基金管理人协助基金托管人按照有关法律法规和本协议的约定协商后开立。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。

#### (八) 基金投资银行存款账户的开立和管理

基金投资银行定期存款应由基金管理人与存款银行总行或其授权分行签订总体合作协议，并将资金存放于存款银行总行或其授权分行指定的分支机构。

存款账户必须以基金名义开立，账户名称为基金名称，存款账户开户文件上加盖预留印鉴及基金管理人公章。预留印鉴为“中信证券股份有限公司托管业务结算专用章”和基金托管人有权人名章。存款证实书原件由托管人负责保管。

本基金投资银行存款时，基金管理人应当与存款银行签订具体存款协议，明确存款的类型、期限、利率、金额、账号、对账方式、支取方式、账户管理等细则。存款协议须约定将托管人为本产品开立的托管银行账户指定为唯一回款账户，任何情况下，存款银行都不得将存款本息划往任何其他账户。

为防范特殊情况下的流动性风险，定期存款协议中应当约定提前支取条款。

基金所投资定期存款存续期间，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对的真实、准确。

#### (九) 基金财产投资的有关有价凭证的保管

实物证券、银行定期存款存单等有价凭证由基金托管人存放于其档案库或保险柜，但要与非本基金的其他有价凭证分开保管。保管凭证由基金托管人持有，基金托管人承担保管职责。基金托管人对由基金托管人以外机构实际有效控制的证券不承担保管责任。

#### (十) 与基金财产有关的重大合同及有关凭证的保管

基金托管人按照法律法规保管由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同及有关凭证。基金管理人代表基金签署有关重大合同后应在收到合同正本后 30 日内将一份正本的原件提交给基金托管人。除本协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时应保证基金一方持有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。重大合同的保管期限不少于法律法规的规定。

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与合同原件核对一致的并加盖基金管理人公章的合同传真件或复印件或扫描件，未经双方协商一致，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和复核

#### 1、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

某一类别基金份额净值是按照每个工作日闭市后,该类别基金资产净值除以当日该类别基金份额的余额数量计算,精确到 0.0001 元,小数点后第 5 位四舍五入。基金管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的,从其规定。

## 2、复核程序

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。估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算业务指引》及其他法律、法规的规定。基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算,基金托管人复核。基金管理人应于每个估值日对基金资产估值后,将基金资产净值、基金份额净值以双方认可的方式发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核后以双方认可的方式发送给基金管理人,由基金管理人按规定对基金净值予以公布。

根据《基金法》,基金管理人计算并公告基金净值信息,基金托管人复核、审查基金管理人计算的基金资产净值。因此,本基金的会计责任方是基金管理人,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信息的计算结果对外予以公布。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,按最新规定估值。

## (二) 基金资产估值方法

### 1、估值对象

基金所拥有的股票、资产支持证券、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、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,且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,以最近交易日的市价(收盘价)估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格;

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

(3) 交易所上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种,选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价进行估值;

(4) 交易所上市交易的可转换债券以每日收盘价作为估值全价;

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

(6) 对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为估值日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表估值日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认估值日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，应采用估值技术确定其公允价值，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、配股和公开增发的股票，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) 在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

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

4) 同一证券同时在两个或两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。

5) 本基金投资股指期货合约、国债期货合约、股票期权合约，按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。

6) 基金投资同业存单，按估值日第三方估值机构提供的估值净价估值；选定的第三方估值机构未提供估值价格的，按成本估值。

7) 本基金投资存托凭证的估值核算依照境内上市交易的股票执行。

8) 持有的银行定期存款或通知存款以本金列示，根据存款协议列示的利息总额或约定利率每自然日计提利息。

9) 本基金持有的回购以成本列示，按合同利率在回购期间内逐日计提应收或应付利息。

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

11) 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。

12) 估值计算中涉及中国人民银行或其授权机构公布人民币汇率中间价的货币，其对人

人民币汇率以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。

13) 如有确凿证据表明按原有方法进行估值不能客观反映上述资产或负债其公允价值的, 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方法估值。

14) 相关法律法规以及监管部门、自律规则另有规定的, 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信息的计算结果对外予以公布。

### (三) 基金份额净值错误的处理方式

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) 各类基金份额净值计算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,通知基金托管人,并报中国证监会备案。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。

(3) 由于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,尚不能达成一致的,基金管理人向基金托管人出具加盖公章的书面说明后,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。

(4) 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过错程度各自承担相应的责任。

(5) 如基金管理人和基金托管人对基金净值信息的计算结果,虽然多次重新计算和核对仍不能达成一致时,为避免不能按时披露净值的情形,以基金管理人的计算结果对外披露,由此给基金份额持有人和基金造成的损失,基金托管人予以免责。

(6) 由于一方当事人提供的信息错误,另一方当事人在采取了必要合理的措施后仍不

能发现该错误,进而导致净值计算错误造成基金份额持有人的损失,以及由此造成以后交易日净值计算顺延错误而引起的基金份额持有人的损失,由提供错误信息的当事人一方负责赔偿。

#### 5、特殊情况的处理

(1) 基金管理人或基金托管人按本协议约定的估值方法的第 13) 项进行估值时,所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

(2) 由于证券、期货交易所及其登记结算公司、证券经营机构、第三方估值机构发送的数据错误,有关会计制度变化或由于其他不可抗力原因,基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查,但是未能发现该错误的,由此造成的基金资产估值错误,基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

(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。

#### (四) 暂停估值的情形

- 1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;
- 2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时;
- 3、当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上的,经与基金托管人协商确认后,基金管理人应当暂停估值;
- 4、法律法规、中国证监会和《基金合同》认定的其他情形。

#### (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

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

经对账发现相关各方的账目存在不符的,基金管理人和基金托管人必须及时查明原因并纠正,保证相关各方平行登录的账册记录完全相符。若当日核对不符,暂时无法查找到错账的原因而影响到基金资产净值的计算和公告的,以基金管理人的账册为准。

#### (七) 基金财务报表和定期报告的编制和复核

##### 1、财务报表的编制

基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。月度报表的编制,应于每月终了后 5 个工作日内完成;《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;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,基金管理人不再更新基金招募说明书和基金产品资料概要。季度报告应在季度结束之日起 15 个工作日内予以公告;中期报告在会计年度半年终了后两个月内予以公告;年度报告在会计年度终了后三个月内予以公告。《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、报表复核

基金管理人在月度报表完成当日,将报表盖章后提供给基金托管人复核;基金托管人在收到后应在 3 日内进行复核,并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在季度报告完成当日,将有关报告提供给基金托管人复核,基金托管人应在收到后 7 个工作日内完成复核,并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在中期报告完成当日,将有关报告提供给基金托管人复核,基金托管人应在收到后 30 个工作日内完成复核,并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在年度报告完成当日,将有关报告提供基金托管人复核,基金托管人应在收到后 45 个工作日内完成复核,并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人和基金托管人之间的上述文件往来均以传真的方式或双方商定的其他方式进行。

基金托管人在复核过程中,发现双方的报表存在不符时,基金管理人和基金托管人应共同查明原因,进行调整,调整以双方认可的账务处理方式为准;若双方无法达成一致,以基金管理人的账务处理为准。核对无误后,基金托管人在基金管理人提供的报告上加盖业务印鉴或者出具加盖业务印鉴的复核意见书或进行电子确认,双方各自留存一份。如果基金管理人与基金托管人不能于应当发布公告之日之前就相关报表达成一致,基金管理人有权按照其编制的报表对外发布公告,基金托管人有权就相关情况报中国证监会备案。

基金托管人在对财务会计报告、季度报告、中期报告或年度报告复核完毕后,需盖章确认或出具相应的复核确认书或进行电子确认,以备有权机构对相关文件审核时提示。

(八) 基金管理人应每季向基金托管人提供基金业绩比较基准的基础数据和编制结果。

## 六、基金份额持有人名册的保管

### (一) 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基金的基金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按照目前相关规则分别保管基金份额持有人名册。保管方式可以采用电子或文档的形式。保管期限不低于法定最低期限。

在基金托管人要求或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。

若基金管理人或基金托管人由于自身原因无法妥善保管基金份额持有人名册,应按有关法规规定各自承担相应的责任。

## (二) 基金份额持有人名册的提交

基金管理人应当及时向基金托管人提交下列日期的基金份额持有人名册:《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、每年 6 月 30 日、每年 12 月 31 日的基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容必须包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。其中每年 12 月 31 日的基金份额持有人名册应于下月前十个工作日内提交;《基金合同》生效日、《基金合同》终止日等涉及到基金重要事项日期的基金份额持有人名册应于发生日后十个工作日内提交。

## 七、争议解决方式

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

(二) 基金管理人与基金托管人之间因本协议产生的或与本协议有关的争议可通过友好协商解决。但争议未能以协商方式解决的,则任何一方有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会,仲裁委员会根据该会届时有效的仲裁规则进行仲裁,仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局性的并对双方当事人具有约束力,仲裁费、律师费由败诉方承担。

(三) 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《托管协议》规定的义务,维护基金份额持有人的合法权益。

## 八、基金托管协议的变更、终止与基金财产的清算

### (一) 托管协议的变更与终止

#### 1、托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致,可以对协议的内容进行变更。变更后的托管协议,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须报中国证监会备案。

#### 2、基金托管协议终止的情形

发生以下情况,本托管协议终止:

- (1) 《基金合同》终止;
- (2) 基金托管人解散、依法被撤销、破产或有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、破产或有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。

### (二) 基金财产的清算

1、基金财产清算小组:自出现《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小

组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、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。

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

4、基金财产清算程序：

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

5、基金财产清算的期限为 6 个月，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，清算期限相应顺延。

6、清算费用

清算费用是指基金财产清算小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小组优先从基金财产中支付。

7、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。

8、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。

9、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存不低于法律法规规定的最低期限

---

---

## 第二十二部分 基金份额持有人服务

如本招募说明书存在任何您/贵机构无法理解的内容,请及时通过下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本招募说明书,并同意全部内容。

对基金份额持有人的服务主要由基金管理人、发售机构及销售机构提供,以下是基金管理人提供的主要服务内容。基金管理人根据基金份额持有人的需要和市场的变化,有权在符合法律法规的前提下,增加和修改相关服务项目。如因系统、第三方或不可抗力等原因,导致下述服务无法提供,基金管理人不承担任何责任。

### 一、基金份额持有人交易资料的寄送服务

每次交易结束后,基金份额持有人应在 T+2 日后及时通过销售机构的网点查询和打印确认单;在每季度结束后的 10 个工作日内,登记机构或基金管理人按基金份额持有人意愿,向在该季度内有交易的基金份额持有人以电子文件形式寄送季度对账单;在每年度结束后 15 个工作日内,登记机构或基金管理人所有的基金份额持有人以电子文件形式寄送年度对账单。

由于投资人提供的手机号码、电子邮箱不详、错误、未及时变更或电子邮箱设置、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人,请及时通过基金管理人官方网站或拨打基金管理人客户服务电话查询、核对、变更您的预留联系方式。

### 二、在线服务

基金份额持有人可以通过基金管理人的官方网站订制基金信息资讯、并享受本基金管理人为基金份额持有人提供的投资报告服务。

### 三、查询与咨询服务

基金管理人客户服务中心为基金份额持有人提供 7×24 小时的自动电话语音服务,基金份额持有人可通过客户服务热线 400-067-8815(国内免长途话费)的语音系统或登录基金管理人官方网站 [www.xinghuafund.com.cn](http://www.xinghuafund.com.cn) 查询基金净值、基金账户信息、基金产品介绍等情况,人工座席在工作时间(交易日 9:00-11:30、13:00-17:30)还将为基金份额持有人提供周到的人工答疑服务。

### 四、投诉受理

基金份额持有人可拨打客户服务热线 400-067-8815(国内免长途话费)投诉直销机构和其他销售机构的人员及其服务。

五、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本招募说明书。

## 第二十三部分 其他应披露事项

| 序号 | 公告事项   | 披露日期            |
|----|--|-----------------|
| 1  | 兴华创新医疗 6 个月持有期混合型发起式证券投资基金招募说明书及基金产品资料概要更新提示性公告          | 2023 年 6 月 10 日 |
| 2  | 兴华创新医疗 6 个月持有期混合型发起式证券投资基金招募说明书（2023 年 6 月更新）            | 2023 年 6 月 10 日 |
| 3  | 兴华创新医疗 6 个月持有期混合型发起式证券投资基金（A 份额）基金产品资料概要更新（2023 年 6 月更新） | 2023 年 6 月 10 日 |
| 4  | 兴华创新医疗 6 个月持有期混合型发起式证券投资基金（C 份额）基金产品资料概要更新（2023 年 6 月更新） | 2023 年 6 月 10 日 |
| 5  | 兴华基金管理有限公司关于旗下部分基金新增光大证券股份有限公司为销售机构的公告                   | 2023 年 6 月 16 日 |
| 6  | 兴华基金管理有限公司关于谨防虚假 APP、网站、二维码、公众号诈骗的风险提示                   | 2023 年 6 月 30 日 |
| 7  | 兴华创新医疗 6 个月持有期混合型发起式证券投资基金 2023 年第 2 季度报告                | 2023 年 7 月 20 日 |

---

---

## 第二十四部分 招募说明书存放及其查阅方式

本基金招募说明书存放在基金管理人的办公场所和营业场所，投资者可免费查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

基金管理人保证文本的内容与公告的内容完全一致。

---

---

## 第二十五部分 备查文件

- 1、中国证监会准予本基金注册的文件；
- 2、《兴华创新医疗 6 个月持有期混合型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《兴华创新医疗 6 个月持有期混合型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；

以上第 1 至 5 项备查文件存放在基金管理人办公场所、营业场所，第 6 项文件存放于基金托管人的办公场所。基金投资者在营业时间可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

兴华基金管理有限公司

2023 年 7 月 29 日