



# 前海开源沪港深创新成长灵活配置

## 混合型证券投资基金

### 招募说明书

(20231212 更新)

基金管理人：前海开源基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

### 重要提示

本基金经 2016 年 3 月 22 日中国证券监督管理委员会下发的证监许可[2016]584 号文注册募集，基金合同已于 2016 年 6 月 24 日正式生效。

基金管理人保证本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价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资人在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括但不限于：市场风险、信用风险、管理风险、流动性风险、操作和技术风险、合规性风险、股指期货投资风险、本基金特有的风险、启用侧袋机制的风险、其他风险及本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等。本基金为混合型基金，属于中高风险收益的投资品种，其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金，低于股票型基金。本基金若投资港股通标的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。

本基金的投资范围包括存托凭证，可能面临存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与创新企业、境外发行人、存托凭证发行机制以及交易机制相关的风险。

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

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

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行承担。投资有风险，投资人在投资本基金前应认真阅读本基金的招募说明书、基金合同、基金产品资料概要等信息披露文件。

特别风险提示：基金名称仅表明基金可以通过港股通机制投资港股，基金资产对港股标的的投资比例会根据市场情况、投资策略等发生较大的调整，存在不对港股进行投资的可能。

本招募说明书已经本基金托管人复核（不属于基金托管人法定复核责任范围且其不掌握相关信息的内容除外），有关财务数据和净值表现截止日为 2023 年 09 月 30 日（未经审计）。

## 目 录

一、绪言	3
二、释义	4
三、基金管理人	8
四、基金托管人	18
五、相关服务机构	20
六、基金的募集	54
七、基金合同的生效	55
八、基金份额的申购与赎回	56
九、基金的投资	65
十、基金的财产	80
十一、基金资产的估值	81
十二、基金的收益分配	86
十三、基金的费用与税收	88
十四、基金的会计与审计	90
十五、基金的信息披露	91
十六、侧袋机制	97
十七、风险揭示	100
十八、基金的终止与清算	106
十九、基金合同的内容摘要	108
二十、基金托管协议的内容摘要	133
二十一、对基金份额持有人的服务	150
二十二、其他应披露事项	152
二十三、招募说明书的存放及查阅方式	156
二十四、备查文件	157

## 一、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》）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）等有关法律法规的规定，以及《前海开源沪港深创新成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》（以下简称基金合同）的约定编写。

本招募说明书阐述了前海开源沪港深创新成长灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”或“基金”）的投资目标、策略、风险、费率等与投资人投资决策有关的必要事项，投资人在做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合同当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

本招募说明书关于基金产品资料概要的编制、披露及更新等内容，将不晚于 2020 年 9 月 1 日起执行。

## 二、释义

在本招募说明书中，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：指前海开源沪港深创新成长灵活配置混合型证券投资基金
- 2、基金管理人：指前海开源基金管理有限公司
- 3、基金托管人：指中国建设银行股份有限公司
- 4、基金合同：指《前海开源沪港深创新成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充
- 5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《前海开源沪港深创新成长灵活配置混合型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
- 6、招募说明书或本招募说明书：指《前海开源沪港深创新成长灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》及其更新
- 7、基金份额发售公告：指《前海开源沪港深创新成长灵活配置混合型证券投资基金基金份额发售公告》
- 8、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等
- 9、《基金法》：指2003年10月28日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，自2004年6月1日起实施，并经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》修改的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 10、《销售办法》：指中国证监会2013年3月15日颁布、同年6月1日起实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 11、《信息披露办法》：指中国证监会2019年7月26日颁布、同年9月1日起实施的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 12、《运作办法》：指中国证监会2014年7月7日颁布、同年8月8日起实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 13、《流动性风险管理规定》：指中国证监会2017年8月31日颁布、同年10月1日起施行的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订
- 14、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设立的证券交易服务公司，向香港联合交易所有限公司（以下简称“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股票
- 15、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

- 16、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会
- 17、基金合同当事人：指受基金合同约定，根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人
- 18、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人
- 19、机构投资者：指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织
- 20、合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》（包括其不时修订）及相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者
- 21、人民币合格境外机构投资者：指按照《人民币合格境外机构投资者境内证券投资试点办法》（包括其不时修订）及相关法律法规规定，运用来自境外的人民币资金进行境内证券投资的境外机构投资者
- 22、投资人：指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称
- 23、基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人
- 24、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务
- 25、销售机构：指前海开源基金管理有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务协议，办理基金销售业务的机构
- 26、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
- 27、登记机构：指办理登记业务的机构。基金的登记机构为前海开源基金管理有限公司或接受前海开源基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构
- 28、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
- 29、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
- 30、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
- 31、基金合同终止日：指基金合同规定的基金合同终止事由出现后，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

- 32、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
- 33、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限
- 34、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日
- 35、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
- 36、T+n日：指自T日起第n个工作日（不包含T日），n为自然数
- 37、开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日（若本基金参与港股通交易且该工作日为非港股通交易日时，则基金管理人可根据实际情况决定本基金是否开放申购、赎回及转换业务，具体以届时提前发布的公告为准）
- 38、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
- 39、《业务规则》：指《前海开源基金管理有限公司开放式基金业务规则》，是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金登记方面的业务规则，由基金管理人 and 投资人共同遵守
- 40、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
- 41、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
- 42、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
- 43、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
- 44、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
- 45、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
- 46、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%
- 47、元：指人民币元
- 48、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

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

50、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

51、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

52、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

53、基金份额的类别：本基金根据是否收取销售服务费，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，并分别计算和公布基金份额净值和基金份额累计净值

54、A类基金份额：指不从基金资产中计提销售服务费的基金份额

55、C类基金份额：指从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额

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

57、不可抗力：指基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

58、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

59、基金产品资料概要：指《前海开源沪港深创新成长灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要》及其更新（基金合同关于基金产品资料概要的编制、披露及更新等内容，将不晚于2020年9月1日起执行）

60、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

61、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



### 三、基金管理人

#### （一）基金管理人概况

- 1、名称：前海开源基金管理有限公司
- 2、住所：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）
- 3、设立日期：2013年1月23日
- 4、法定代表人：李强
- 5、批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监许可[2012]1751号
- 6、组织形式：有限责任公司
- 7、办公地址：深圳市福田区深南大道7006号万科富春东方大厦22楼
- 8、电话：0755-88601888 传真：0755-83181169
- 9、联系人：何凌
- 10、注册资本：人民币2亿元
- 11、存续期限：持续经营
- 12、股权结构：开源证券股份有限公司出资25%，北京市中盛金期投资管理有限公司出资25%，北京长和世纪资产管理有限公司出资25%，深圳市和合投信资产管理合伙企业（有限合伙）出资25%。

#### （二）主要人员情况

##### 1、基金管理人董事会成员

李强先生，董事长，硕士研究生，国籍：中国。历任建设银行陕西省分行筹资处科员、副主任科员，中国证监会深圳监管局法规处、机构监管处、基金监管处副主任科员、主任科员、副处长、处长等职务，深圳市前海管理局副局长（挂职），前海金融控股有限公司总经理、党委书记、董事长（曾兼任深圳市前海管理局局长助理、汇丰前海证券有限责任公司董事长、恒生前海基金管理有限公司董事长、前海再保险股份有限公司董事、深圳市前海金融同业公会会长、万科企业股份有限公司独立董事等职务），世纪证券有限责任公司党委书记、董事长。2022年4月加入前海开源基金管理有限公司，现任前海开源基金管理有限公司董事长。

蔡颖女士，副董事长，硕士研究生，国籍：中国。历任南方证券广州分公司营业部电脑部主管、经纪业务部主管、电子商务部副经理，南方基金管理有限公司广州代表处首席代表、南方区域总部高级经理，鹏华基金管理有限公司华南营销中心（广州）副总经理、广州分公司总经理，曾任前海开源基金管理有限公司总经理、前海开源资产管理有限公司董事长。现任前海开源基金管理有限公司副董事长。

王兆华先生，董事，本科学历，国籍：中国。历任中国人民银行西安市分行职员，中国工商银行西安市开发区支行副行长、分行信贷处处长，华夏证券西安营业部总经理、华

夏证券济南管理总部党委书记兼总经理、华夏证券总裁助理兼重庆分公司党委书记、总经理，华夏证券总裁助理，开源证券董事长兼总经理，前海开源资产管理有限公司董事长，前海开源基金管理有限公司董事长。现任前海开源基金管理有限公司董事。

范镭先生，董事，本科学历，国籍：中国。历任中国建设银行武汉分行、华安保险北京分公司、交通银行天津分行、北京长和世纪资产管理有限公司投资总监。现任北京万盛祥如投资顾问有限公司执行董事，正方天恒资产管理有限公司执行董事、总经理。

秦亚峰先生，董事、总经理、固定收益投资决策委员会主席。清华大学硕士，中国社科院博士，国籍：中国。历任中国银行湖南分行信托咨询公司技术员，中国东方信托湖南证券营业部部门经理，银河证券湖南证券营业部部门经理，亚洲证券湖南证券营业部部门经理，华安财产保险股份有限公司资产管理中心副总经理、总经理，华安财产保险股份有限公司副总经理，华安财保资产管理有限责任公司总经理，华安汇富资本投资管理有限公司董事长，现任前海开源基金管理有限公司董事、总经理、固定收益投资决策委员会主席。

武怀良先生，董事，研究生学历，国籍：中国。历任航空航天部西安远东公司技术员、力学计量室主任，西安证券交易中心交易员、交易部经理，南方证券公司西安营业部副总经理，华弘证券有限责任公司营业部总经理，中邮证券有限责任公司营业部总经理、自营资产运营部总经理。2012年加盟开源证券，历任自营总部总经理、公司总经理助理。现任开源证券职工董事、执行委员会委员、副总经理。

SHI SHA（沙石）先生，董事，北京大学经济系本科和硕士，美国纽约州立大学石溪校园(SUNY at Stony Brook)经济学博士学位。国籍：美国。曾任国家计划经济委员会经济研究所研究员，纽约大通银行、荷兰银行助理、副总裁、董事，瑞士银行、巴克莱银行董事、执行董事以及中国金融期货交易所国际事务高级顾问等职。现任施罗德交银理财有限公司独立董事，恒泰期货股份有限公司独立董事，民生期货股份有限公司独立董事，以及澳帝桦（上海）商贸有限公司中国区外部顾问等职。

龚方雄先生，董事，北京大学物理学学士、运筹学及经济学硕士，费城坦普尔大学物理学硕士，宾夕法尼亚大学沃顿商学院金融经济学博士。国籍：中国香港。历任美国联邦储备银行经济学家，美国银行首席策略师、全球货币及利率市场策略部联席主管，摩根大通中国区研究部主管、首席策略师、首席大中华区经济学家、中国综合公司（企业）投融资主席，摩根大通中国投资银行主席。现任FXG Capital Intl.Limited, FXG Asset Management Limited 等机构董事职务。

Qing Li（李庆）先生，独立董事，国籍：美国。哥伦比亚大学商学院金融博士，北京大学数学学士，曾入选中国数学奥林匹克国家集训队。特许金融分析师（CFA）。历任美国 Lehman Brothers 股票自营交易部研究员，美国 Fortress Investment Group 基金经

理，美国 Tykhe Capital LLC 量化投资基金经理，美国 SAC Capital Advisors 投资组合基金经理。现任美国量化投资基金公司 Siencecast Management 首席执行官，普通合伙人。

樊臻宏先生，独立董事，国籍：中国。纽约大学 STERN 商学院商业管理博士学位。历任 ARGONAUT 资本管理公司（对冲基金）分析员、美林证券全球科技策略师、中国人寿资产管理公司国际业务部副总经理及项目部副总经理、北京春湖投资顾问有限公司总经理，天津汇通太和投资管理有限公司总经理。现任瑞能半导体科技股份有限公司董事，北京建广资产管理有限公司董事，叮当健康科技集团有限公司独立非执行董事。

Terence Culver 先生，独立董事，硕士学历。国籍：美国。历任哈佛大学国际发展研究所项目经理，联合国 GeSCI 组织全球新兴市场政府顾问及开发专家，哥伦比亚大学国际和公共事务学院副院长等职务，现任美国数字金融集团—DFG Fund 首席执行官、普通合伙人。

Samuel T. Lundquist 先生，独立董事，本科学历。国籍：美国。在美国宾夕法尼亚大学沃顿商学院先后工作 25 年，现任宾夕法尼亚大学沃顿商学院对外事务副院长。

## 2、基金管理人监事会成员

骆新都女士，监事会主席，经济学硕士，经济师，国籍：中国。历任民政部外事处处长、南方证券有限公司副总裁、南方基金管理有限公司董事长、监事会主席。现任前海开源基金管理有限公司监事会主席。

陆琦先生，监事，理学学士和工学硕士学位。国籍：中国。历任穆迪信息咨询有限公司研发工程师，项目研发组组长，南方基金风险管理部，2015 年 10 月加入前海开源基金，担任金融工程部总监。

傅智先生，监事，本科学历，注册会计师。国籍：中国。历任天健信德会计师事务所审计员、南方基金管理有限公司运作保障部总监助理、副总监、执行总监，现任前海开源基金管理有限公司基金核算部总监。

曾媛媛女士，经济学硕士。国籍：中国。曾任博时基金管理有限公司交易员。2014 年 4 月加入前海开源基金管理有限公司，现任交易部总监。

汤力女士，硕士研究生。国籍：中国。历任中青国际出版集团法务部主任，汤森路透法律集团产品培训师，英大基金管理有限公司监察稽核部高级经理。2013 年 11 月起加入前海开源基金管理有限公司，现担任监察稽核部总监。

刘艳女士，金融学硕士。国籍：中国。2006 年 8 月至 2013 年 9 月任长城基金管理有限公司渠道总对总主管，2014 年 10 月加入前海开源基金管理有限公司，现任第三方渠道部总监。

崔宸龙先生，材料科学与工程博士研究生。国籍：中国。2016 年 11 月至 2017 年 8 月任深圳市前海安康投资发展有限公司研究部研究员，2017 年 8 月加盟前海开源基金管理有限公司，现任投资部负责人、首席 ESG 官、基金经理。

李刚先生，管理学硕士。国籍：中国。先后任职于长江证券，任营运管理总部业务管理部主管、公司交易所产品创新小组秘书；曾任西部证券信用业务部高级经理、零售业务总部副总经理；曾任长江证券西安营业部副总经理兼投顾总监、深圳深南路营业部总经理。2020年加入开源证券，现任开源证券经纪业务总部总经理。

孙达先生，管理学硕士。国籍：中国。先后任职于中国铁路第五工程局，任土木工程师；曾任北京嘉恒基础设施投资有限公司，任工程部经理。现任北京长和世纪资产管理有限公司投资部总经理。

### 3、高级管理人员情况

秦亚峰先生，董事、总经理、固定收益投资决策委员会主席。清华大学硕士，中国社科院博士，国籍：中国。历任中国银行湖南分行信托咨询公司技术员，中国东方信托湖南证券营业部部门经理，银河证券湖南证券营业部部门经理，亚洲证券湖南证券营业部部门经理，华安财产保险股份有限公司资产管理中心副总经理、总经理，华安财产保险股份有限公司副总经理，华安财保资产管理有限责任公司总经理，华安汇富资本投资管理有限公司董事长，现任前海开源基金管理有限公司董事、总经理、固定收益投资决策委员会主席。

孙辰健先生，督察长。西安交通大学经济学博士，高级经济师。国籍：中国。历任深圳证券交易所交易运行部副经理、西北服务中心主任、信息管理部总监；深圳证券通信有限公司董事、总经理；中证指数有限公司董事；中国证券登记结算有限责任公司北京数据技术分公司副总经理；中证信息技术服务有限责任公司副总经理；华鑫证券有限责任公司副总经理、监事会主席；摩根斯坦利华鑫基金管理公司董事；华鑫证券投资有限公司、华鑫宽众投资有限公司董事长。2021年10月加入前海开源基金管理有限公司，现任前海开源基金管理有限公司督察长。

何隹先生，副总经理、首席信息官。硕士研究生，国籍：中国。历任国信证券信息技术部经理，汉唐证券红岭中路营业部副总经理、深圳、东莞银证通负责人，华泰联合证券部门总经理，华林证券总裁助理。2016年6月加入前海开源基金管理有限公司，现担任前海开源基金管理有限公司副总经理、首席信息官。

曲扬先生，副总经理，权益投资决策委员会主席。清华大学计算机科学与技术系博士。曾任职南方基金管理有限公司，历任研究员、基金经理助理、基金经理。2014年7月加入前海开源基金管理有限公司，现任前海开源基金管理有限公司副总经理、权益投资决策委员会主席。

邱杰先生，副总经理，专户投资决策委员会主席、FOF投资决策委员会主席。北京大学经济学硕士。曾任职福建省财政厅、南方基金管理有限公司、建信基金管理有限公司。2014年2月加入前海开源基金管理有限公司，现任前海开源基金管理有限公司副总经理、专户投资决策委员会主席、FOF投资决策委员会主席。

#### 4、本基金基金经理

本基金历任基金经理为：倪枫先生，管理时间为2016年6月24日至2018年7月13日、史程先生，管理时间为2017年12月13日至2019年7月18日、苏天杉先生，管理时间为2018年7月13日至2019年7月18日、邱杰先生，管理时间为2019年5月15日至2021年3月12日、章俊先生，管理时间为2021年3月12日至今。

章俊先生，同济大学硕士。2006年4月至2007年11月任新理益集团有限公司投资部研究员，2007年12月至2011年4月任国华人寿保险股份有限公司投资部副总经理，2011年5月至2018年2月任安盛天平财产保险股份有限公司投资部首席投资官，2018年3月至2020年12月任国华人寿保险股份有限公司资产管理中心投资总监，2020年12月加盟前海开源基金管理有限公司，现任公司董事总经理、基金经理。2021年3月12日至今，任前海开源祥和债券型证券投资基金基金经理、2021年3月12日至今，任前海开源沪港深创新成长灵活配置混合型证券投资基金基金经理、2021年12月28日至今，任前海开源裕瑞混合型证券投资基金基金经理、2022年8月8日至今，任前海开源沪港深景气行业精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。章俊先生具备基金从业资格。

#### 5、投资决策委员会成员情况

##### 权益投资决策委员会

权益投资决策委员会名单如下：曲扬、邱杰、崔宸龙、吴国清、王霞、杨德龙、肖立强。曲扬为权益投资决策委员会主席，邱杰为权益投资决策委员会副主席，肖立强为权益投资决策委员会秘书。

##### 固定收益投资决策委员会

固定收益投资决策委员会名单如下：秦亚峰、刘静、章俊、李炳智、史延、吴彦、林悦、易千。秦亚峰为固定收益投资决策委员会主席，刘静、章俊为固定收益投资决策委员会副主席，李炳智为固定收益投资决策委员会秘书。

##### FOF投资决策委员会

FOF投资决策委员会名单如下：邱杰、曲扬、杨德龙、李赫、肖立强。邱杰为FOF投资决策委员会主席，曲扬为FOF投资决策委员会副主席，李赫为FOF投资决策委员会秘书。

#### 6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

#### （三）基金管理人的职责

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

2、办理基金备案手续；

3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；

4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

- 5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- 6、编制季度报告、中期报告和年度报告；
- 7、计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回价格；
- 8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；
- 9、按照规定召集基金份额持有人大会；
- 10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- 11、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- 12、中国证监会规定的其他职责。

#### （四）基金管理人的承诺

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

##### 2、基金管理人的禁止行为：

- （1）将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
- （2）不公平地对待公司管理的不同基金财产；
- （3）利用基金财产或职务之便为基金份额持有人以外的人牟取利益；
- （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）法律法规以及中国证监会禁止的其他行为。

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

- （1）越权或违规经营；
- （2）违反法律法规、基金合同或托管协议；
- （3）故意损害基金份额持有人或基金合同其他当事人的合法权益；
- （4）在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；
- （5）拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
- （6）玩忽职守、滥用职权；
- （7）泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

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

(9) 贬损同行，以提高自己；

(10) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；

(11) 以不正当手段谋求业务发展；

(12) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；

(13) 其他法律、行政法规禁止的行为。

#### 4、基金经理承诺

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

(2) 不得利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者谋取利益；

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

(4) 不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

#### (五) 基金管理人的内部控制制度

为保证公司规范化运作，有效地防范和化解经营风险，促进公司诚信、合法、有效经营，保障基金份额持有人利益，维护公司及公司股东的合法权益，本基金管理人建立了科学、严密、高效的内部控制体系。

##### 1、内部控制的总体目标

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

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

(3) 确保基金、公司财务和其他信息真实、准确、完整、及时。

(4) 促进公司全体员工恪守职业操守，正直诚信，廉洁自律，勤勉尽责。

##### 2、制订内部控制制度应当遵循以下原则：

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

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

(3) 独立性原则。公司各机构、部门和岗位职责应当保持相对独立，公司基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离。

(4) 相互制约原则。公司内部部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡。

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

（6）适时性原则。内部控制应具有前瞻性，并且必须随着公司经营战略、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及时进行相应的修改和完善。

### 3、内部控制体系

#### （1）内部控制制度体系

公司制定了合理、完备、有效并易于执行的制度体系。公司制度体系由不同层面的制度构成。按照其效力大小分为四个层面：第一个层面是公司内部控制大纲，它是公司制定各项规章制度的纲要和总揽；第二个层面是公司基本管理制度，包括风险控制制度、投资管理制度、基金会计制度、信息披露制度、监察稽核制度、信息技术管理制度、公司财务制度、资料档案制度、业绩评估考核制度、紧急应变制度、合规管理制度、制度管理制度、反洗钱内部控制制度、公司机构设置及部门基本职能制度和销售管理制度等；第三个层面是部门业务规章，是在基本管理制度的基础上，对各部门的主要职责、岗位设置、岗位职责、操作守则等的具体说明；第四个层面是业务操作手册，是各项具体业务和管理工作的运行办法，是对业务各个细节、流程进行的描述和约束。它们的制订、修改、实施、废止应该遵循相应的程序，每一层面的内容不得与其以上层面的内容相违背。公司重视对制度的持续检验，结合业务的发展、法规及监管环境的变化以及公司风险控制的要求，不断检讨和增强公司制度的完备性、有效性。

#### （2）内部控制组织架构

##### 1) 董事会

负责制定公司的风险管理政策，对风险管理负完全的和最终的责任。

##### 2) 监察及风险控制委员会

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

##### 3) 督察长

独立行使督察权利，直接对董事会负责；向监察及风险控制委员会提交风险管理报告和风险管理建议。

##### 4) 监察稽核部

监察稽核部负责对公司的基金运作、内部管理、系统实施和合法合规情况进行内部监督，形成意见上报总经理及督察长；对公司各部门内部合规和内控制度、流程的建立和落实情况进行检查，对公司的内部合规和内控制度、流程的合理性、有效性进行分析，提出改进意见。



#### 5) 风险管理团队

风险管理团队负责建立和完善公司投资风险管理制度与流程，并为每一个部门的风险管理系统的发展提供协助。风险管理团队负责公司投资管理风险、信用风险、市场风险、流动性风险等日常风险管理工作，组织实施公司投资风险管理工作，确保公司各类投资风险得到良好监督与控制。

#### 6) 业务部门

风险和合规管理是每一个业务部门最首要的责任。部门经理对本部门的风险和合规负第一责任，负责履行公司的风险和合规管理程序，负责本部门的风险和合规管理系统的开发、执行和维护，用于识别、监控和降低风险。

### 4、内部控制措施

#### (1) 授权制度

公司的授权制度贯穿于整个公司活动。股东会、董事会、监事会和管理层必须充分履行各自的职权，健全公司逐级授权制度，确保公司各项规章制度的贯彻执行；各项经营业务和管理程序必须遵从管理层制定的操作规程，经办人员的每一项工作必须是在业务授权范围内进行。公司重大业务的授权必须采取书面形式，授权书应当明确授权内容和时效。公司授权要适当，对已获授权的部门和人员应建立有效的评价和反馈机制，对已不适用的授权应及时修改或取消授权。

#### (2) 公司研究业务

研究工作应保持独立、客观，不受任何部门及个人的不正当影响；建立严密的研究工作业务流程，形成科学、有效的研究方法；建立投资标的备选库制度，研究部门根据投资标的的特征，在充分研究的基础上建立和维护备选库。建立研究与投资的业务交流制度，保持畅通的交流渠道；建立研究报告质量评价体系，不断提高研究水平。

#### (3) 基金投资业务

基金投资应确立科学的投资理念，根据决策的风险防范原则和效率性原则制定合理的决策程序；在进行投资时应有明确的投资授权制度，并应建立与所授权限相应的约束制度和考核制度。建立严格的投资禁止和投资限制制度，保证基金投资的合法合规性。建立投资风险评估与管理制，将重点投资限制在规定的风险权限额度内；对于投资结果建立科学的投资管理业绩评价体系。

#### (4) 交易业务

建立集中交易制度，投资指令通过交易部完成；建立交易监测系统、预警系统和交易反馈系统，完善相关的安全设施；交易部应对交易指令进行审核，建立公平的交易分配制度，确保各基金利益的公平；交易记录应完善，并及时进行反馈、核对和存档保管；同时建立科学的投资交易绩效评价体系。

#### (5) 基金会计核算

公司根据法律法规及业务的要求建立会计制度，并根据风险控制点建立严密的会计系统，对于不同基金、不同客户独立建账，独立核算；公司通过复核制度、凭证制度、合理的估值方法和估值程序等会计措施真实、完整、及时地记载每一笔业务并正确进行会计核算和业务核算。同时还建立会计档案保管制度，确保档案真实完整。

#### （6）信息披露

公司建立了完善的信息披露制度，保证公开披露的信息真实、准确、完整。公司设立了信息披露负责人，并建立了相应的程序进行信息的收集、组织、审核和发布工作，以此加强对信息的审查核对，使所公布的信息符合法律法规的规定，同时加强对信息披露的检查和评价，对存在的问题及时提出改进办法。

#### （7）监察稽核

公司设立督察长，经董事会聘任，报中国证监会核准。根据公司监察稽核工作的需要和董事会授权，督察长可以列席公司相关会议，调阅公司相关档案，就内部控制制度的执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能。督察长定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况，董事会对督察长的报告进行审议。

公司设立监察稽核部开展监察稽核工作，并保证监察稽核部的独立性和权威性。公司明确了监察稽核部及内部各岗位的具体职责，严格制定了专业任职条件、操作程序和组织纪律。

监察稽核部强化内部检查制度，通过定期或不定期检查内部控制制度的执行情况，促使公司各项经营管理活动的规范运行。

公司董事会和管理层充分重视和支持监察稽核工作，对违反法律法规和公司内部控制制度的，追究有关部门和人员的责任，并纳入年度合规专项考核。

### 5、基金管理人关于内部合规控制书的声明

（1）基金管理人确知建立、实施和维持内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任；

（2）基金管理人承诺以上关于内部控制的披露真实、准确；

（3）基金管理人承诺根据市场变化和公司发展不断完善内部控制体系和内部控制制度。

## 四、基金托管人

### （一）基金托管人情况

#### 1、基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司（简称：中国建设银行）

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：田国立

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

联系人：王小飞

联系电话：(021)6063 7103

#### 2、主要人员情况

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合处、基金业务处、证券保险业务处、理财信托业务处、全球业务处、养老金业务处、新兴业务处、客户服务与业务协同处、运营管理处、跨境与外包管理处、托管应用系统支持处、内控合规处等 12 个职能处室，在北京、上海、合肥设有托管运营中心，共有员工 300 余人。自 2007 年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

#### 3、基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、(R)QFII、(R)QDII、企业年金、存托业务等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至 2022 年年末，中国建设银行已托管 1270 只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行多次被《全球托管人》、《财资》、《环球金融》杂志及《中国基金报》评选为“最佳托管银行”、连续多年荣获中央国债登记结算有限责任公司（中债）“优秀资产托管机构”、银行间市场清算所股份有限公司（上清所）“优秀托管银行”奖项、并先后荣获《亚洲银行家》颁发的 2017 年度“最佳托管系统实施奖”、2019 年度“中国年度托管业务科技实施奖”、2021 年度“中国最佳数字化资产托管银行”、以及 2020 及 2022 年度“中国年度托管银行（大型银行）”

奖项。2022 年度，荣获《环球金融》“中国最佳次托管银行”，并作为唯一中资银行获得《财资》“中国最佳 QFI 托管银行”奖项。

## （二）基金托管人的内部控制制度

### 1、内部控制目标

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

### 2、内部控制组织结构

中国建设银行设有风险内控管理委员会，负责全行风险管理与内部控制工作，对托管业务风险管理和内部控制的有效性进行指导。资产托管业务部配备了专职内控合规人员负责托管业务的内控合规工作，具有独立行使内控合规工作职权和能力。

### 3、内部控制制度及措施

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

## （三）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

### 1、监督方法

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。利用自行开发的“新一代托管应用监督子系统”，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）每工作日按时通过新一代托管应用监督子系统，对各基金投资运作比例控制等情况进行监控，如发现投资异常情况，向基金管理人进行风险提示，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，如有重大异常事项及时报告中国证监会。

（2）收到基金管理人的划款指令后，对指令要素等内容进行核查。

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

## 五、相关服务机构

### （一）基金份额销售机构

#### 1、直销机构

##### （1）前海开源基金管理有限公司直销柜台

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

办公地址：深圳市福田区深南大道7006号万科富春东方大厦10层

法定代表人：李强

联系人：何凌

电话：（0755）83181190

传真：（0755）83180622

##### （2）前海开源基金管理有限公司电子直销交易

客服电话：4001-666-998

网址：www.qhkyfund.com

微信公众号：qhkyfund

微信小程序：前海开源基金

官方APP：前海开源基金

#### 2、代销机构：

序号	代销机构	销售机构信息
1	和讯信息科技有限公司	和讯信息科技有限公司 注册地址：北京市朝阳区朝外大街22号1002室 办公地址：北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层 法定代表人：章知方 客服电话：400-9200-022 网址：www.hexun.com
2	诺亚正行基金销售有限公司	诺亚正行基金销售有限公司 注册地址：上海市虹口区飞虹路360弄9号6层 办公地址：上海市闵行区申滨南路1226号诺亚财富中心 法定代表人：吴卫国 客服电话：400-821-5399 网址：www.noah-fund.com
3	一路财富（深圳）	一路财富（深圳）基金销售有限公司

	基金销售有限公司	注册地址：深圳市前海深港合作区南山街道兴海大道3046号香江金融大厦2111 办公地址：深圳市前海深港合作区南山街道兴海大道3046号香江金融大厦2111 法定代表人：吴雪秀 客服电话：400-001-1566 网址：www.yilucaifu.com
4	北京加和基金销售有限公司	北京加和基金销售有限公司 注册地址：北京市西城区平原里21号楼4层A502 办公地址：北京市西城区平原里21号楼4层A502 法定代表人：曲阳 客服电话：400-820-1115 网址：www.bzfunds.com
5	深圳富济基金销售有限公司	深圳富济基金销售有限公司 注册地址：深圳市福田区福田街道岗厦社区福华三路88号财富大厦28E 办公地址：深圳市福田区福田街道岗厦社区福华三路88号财富大厦28E 法定代表人：祝中村 客服电话：0755-83999907 网址：www.fujifund.cn
6	光大证券股份有限公司	光大证券股份有限公司 注册地址：上海市静安区新闻路1508号 办公地址：上海市静安区新闻路1508号 法定代表人：刘秋明 客服电话：95525 网址：www.ebscn.com
7	中国中金财富证券有限公司	中国中金财富证券有限公司 注册地址：深圳市南山区粤海街道海珠社区科苑南路2666号中国华润大厦L4601-L4608 办公地址：深圳市南山区粤海街道海珠社区科苑南路2666号中国华润大厦46层 法定代表人：高涛

		<p>客服电话：95532；4006-008-008</p> <p>网址：www.ciccwm.com</p>
8	国泰君安证券股份有限公司	<p>国泰君安证券股份有限公司</p> <p>注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号</p> <p>办公地址：上海市静安区南京西路 768 号国泰君安大厦</p> <p>法定代表人：贺青</p> <p>客服电话：95521</p> <p>网址：www.gtja.com</p>
9	中信建投证券股份有限公司	<p>中信建投证券股份有限公司</p> <p>注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼</p> <p>办公地址：北京市东城区朝内大街 188 号鸿安国际大厦</p> <p>法定代表人：王常青</p> <p>客服电话：4008-888-108</p> <p>网址：www.csc108.com</p>
10	深圳众禄基金销售股份有限公司	<p>深圳众禄基金销售股份有限公司</p> <p>注册地址：深圳市罗湖区笋岗街道笋西社区梨园路 8 号 HALO 广场一期四层 12-13 室</p> <p>办公地址：深圳市罗湖区笋岗街道笋西社区梨园路 8 号 HALO 广场一期四层 12-13 室</p> <p>法定代表人：薛峰</p> <p>客服电话：400-678-8887</p> <p>网址：www.zlfund.cn；www.jjmmw.com</p>
11	蚂蚁（杭州）基金销售有限公司	<p>蚂蚁（杭州）基金销售有限公司</p> <p>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</p> <p>办公地址：浙江省杭州市西湖区西溪路 556 号</p> <p>法定代表人：王珺</p> <p>客服电话：95188-8</p> <p>网址：www.fund123.cn</p>
12	申万宏源证券有限公司	<p>申万宏源证券有限公司</p> <p>注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层</p> <p>办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号世纪商贸广场 45 层</p>

		<p>法定代表人：杨玉成</p> <p>客服电话：95523；4008-895-523</p> <p>网址：www.swhysc.com</p>
13	东方证券股份有限公司	<p>东方证券股份有限公司</p> <p>注册地址：中国上海市黄浦区中山南路 119 号东方证券大厦</p> <p>办公地址：中国上海市黄浦区中山南路 119 号东方证券大厦</p> <p>法定代表人：金文忠</p> <p>客服电话：95503</p> <p>网址：www.dfzq.com.cn</p>
14	中国邮政储蓄银行股份有限公司	<p>中国邮政储蓄银行股份有限公司</p> <p>注册地址：北京市西城区金融大街 3 号</p> <p>办公地址：北京市西城区金融大街 3 号</p> <p>法定代表人：张金良</p> <p>客服电话：95580</p> <p>网址：www.psbc.com</p>
15	兴业证券股份有限公司	<p>兴业证券股份有限公司</p> <p>注册地址：福建省福州市湖东路 268 号</p> <p>办公地址：福州：福建省福州市鼓楼区湖东路 268 号兴业证券大厦；上海：上海市浦东新区长柳路 36 号兴业证券大厦</p> <p>法定代表人：杨华辉</p> <p>客服电话：95562</p> <p>网址：www.xyzq.com.cn</p>
16	广发银行股份有限公司	<p>广发银行股份有限公司</p> <p>注册地址：广州市越秀区东风东路 713 号</p> <p>办公地址：广东省广州市越秀区东风东路 713 号</p> <p>法定代表人：王凯</p> <p>客服电话：400-830-8003</p> <p>网址：www.cgbchina.com.cn</p>
17	南京苏宁基金销售有限公司	<p>南京苏宁基金销售有限公司</p> <p>注册地址：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号</p>



		<p>办公地址：江苏省南京市玄武区苏宁大道 1-5 号</p> <p>法定代表人：钱燕飞</p> <p>客服电话：95177</p> <p>网址：www.snjijin.com</p>
18	大河财富基金销售有限公司	<p>大河财富基金销售有限公司</p> <p>注册地址：贵州省贵阳市观山湖区(高新区)湖滨路 109 号瑜赛进丰高新财富中心 26 层 1 号</p> <p>办公地址：贵州省贵阳市观山湖区湖滨路 17 号友山基金大厦 26 层 1 号</p> <p>法定代表人：何帅</p> <p>客服电话：400-888-0008</p> <p>网址：www.urainf.com</p>
19	西南证券股份有限公司	<p>西南证券股份有限公司</p> <p>注册地址：重庆市江北区金沙门路 32 号</p> <p>办公地址：重庆市江北区金沙门路 32 号西南证券总部大楼</p> <p>法定代表人：吴坚</p> <p>客服电话：95355</p> <p>网址：www.swsc.com.cn</p>
20	北京坤元基金销售有限公司	<p>北京坤元基金销售有限公司</p> <p>注册地址：北京市石景山区古城大街特钢公司十一区(首特创业基地 A 座)八层 816 号</p> <p>办公地址：北京市朝阳区东三环中路 7 号院北京财富中心写字楼 A 座 30 层</p> <p>法定代表人：杜福胜</p> <p>客服电话：4006498989</p> <p>网址：www.kunyuanfund.com</p>
21	上海大智慧基金销售有限公司	<p>上海大智慧基金销售有限公司</p> <p>注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 428 号 1 号楼 1102 单元</p> <p>办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 428 号 1 号楼 1102 单元</p> <p>法定代表人：张俊</p>

		<p>客服电话：021-20292031</p> <p>网址：www.wg.com.cn</p>
22	<p>玄元保险代理有限公司</p>	<p>玄元保险代理有限公司</p> <p>注册地址：上海市嘉定区南翔镇银翔路 799 号 506 室-2</p> <p>办公地址：上海市嘉定区南翔镇银翔路 799 号 506 室-2</p> <p>法定代表人：马永谔</p> <p>客服电话：400-080-8208</p> <p>网址：www.licaimofang.com</p>
23	<p>华瑞保险销售有限公司</p>	<p>华瑞保险销售有限公司</p> <p>注册地址：上海市嘉定区南翔镇众仁路 399 号运通星财富广场 1 号楼 B 座 14 层</p> <p>办公地址：上海市嘉定区南翔镇众仁路 399 号运通星财富广场 1 号楼 B 座 14 层</p> <p>法定代表人：杨新章</p> <p>客服电话：952303</p> <p>网址：www.huaruisales.com</p>
24	<p>通华财富（上海）基金销售有限公司</p>	<p>通华财富（上海）基金销售有限公司</p> <p>注册地址：上海市虹口区同丰路 667 弄 107 号 201 室</p> <p>办公地址：上海市浦东新区金沪路 55 号通华科技大厦 10 层</p> <p>法定代表人：沈丹义</p> <p>客服电话：400-101-9301</p> <p>网址：www.tonghuafund.com</p>
25	<p>北京钱景基金销售有限公司</p>	<p>北京钱景基金销售有限公司</p> <p>注册地址：北京市石景山区城通街 26 号院 2 号楼 17 层 1735</p> <p>办公地址：北京市石景山区城通街金融长安中心 26 号院 2 号楼 17 层</p> <p>法定代表人：王利刚</p> <p>客服电话：010-59422766</p> <p>网址：www.qianjing.com</p>
26	<p>天风证券股份有限公司</p>	<p>天风证券股份有限公司</p> <p>注册地址：湖北省武汉市东湖新技术开发区高新大道</p>

		<p>446 号天风证券大厦 20 层</p> <p>办公地址：湖北省武汉市武昌区中北路 217 号天风大厦 2 号楼</p> <p>法定代表人：余磊</p> <p>客服电话：95391</p> <p>网址：www.tfzq.com</p>
27	国海证券股份有限公司	<p>国海证券股份有限公司</p> <p>注册地址：广西壮族自治区桂林市辅星路 13 号</p> <p>办公地址：广西壮族自治区南宁市滨湖路 46 号国海大厦</p> <p>法定代表人：何春梅</p> <p>客服电话：95563</p> <p>网址：www.ghzq.com.cn</p>
28	华宝证券股份有限公司	<p>华宝证券股份有限公司</p> <p>注册地址：上海市自由贸易试验区浦电路 370 号 2、3、4 层</p> <p>办公地址：上海市自由贸易试验区浦电路 370 号 2、3、4 层</p> <p>法定代表人：刘加海</p> <p>客服电话：400-820-9898</p> <p>网址：www.cnhbstock.com</p>
29	广发证券股份有限公司	<p>广发证券股份有限公司</p> <p>注册地址：广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街 2 号 618 室</p> <p>办公地址：广东省广州市天河区马场路 26 号广发证券大厦</p> <p>法定代表人：林传辉</p> <p>客服电话：95575</p> <p>网址：www.gf.com.cn</p>
30	京东肯特瑞基金销售有限公司	<p>京东肯特瑞基金销售有限公司</p> <p>注册地址：北京市海淀区知春路 76 号(写字楼)1 号楼 4 层 1-7-2</p> <p>办公地址：北京市亦庄经济开发区科创十一街 18 号院 A</p>

		座 法定代表人：邹保威 客服电话：400-098-8511；400-088-8816 网址：kenterui.jd.com
31	招商证券股份有限公司	招商证券股份有限公司 注册地址：深圳市福田区福田街道福华一路 111 号 办公地址：深圳市福田区福华一路 111 号招商证券大厦 法定代表人：霍达 客服电话：95565 网址：www.cmschina.com
32	第一创业证券股份有限公司	第一创业证券股份有限公司 注册地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼 办公地址：广东省深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼 法定代表人：吴礼顺 客服电话：95358 网址：www.firstcapital.com.cn
33	华福证券有限责任公司	华福证券有限责任公司 注册地址：福建省福州市鼓楼区鼓屏路 27 号 1#楼 3 层、4 层、5 层 办公地址：上海市浦东新区滨江大道 5129 号 N1 座 法定代表人：苏军良 客服电话：95547 网址：www.hfzq.com.cn
34	中国人寿保险股份有限公司	中国人寿保险股份有限公司 注册地址：北京市西城区金融大街 16 号 办公地址：北京市西城区金融大街 16 号 法定代表人：白涛 客服电话：95519 网址：www.e-chinalife.com
35	上海攀赢基金销售有限公司	上海攀赢基金销售有限公司 注册地址：上海市闸北区广中西路 1207 号 306 室

		<p>办公地址：上海市浦东新区银城路 116 号大华银行大厦 7 楼</p> <p>法定代表人：郑新林</p> <p>客服电话：8621-68889082</p> <p>网址：www.pytz.cn</p>
36	上海陆亨基金销售有限公司	<p>上海陆亨基金销售有限公司</p> <p>注册地址：中国(上海)自由贸易试验区临港新片区环湖西二路 888 号 1 幢 1 区 14032 室</p> <p>办公地址：上海市浦东新区世纪大道 1196 号世纪汇广场 2 座 16 楼 01、08 单元</p> <p>法定代表人：粟旭</p> <p>客服电话：400-168-1235</p> <p>网址：www.luxxfund.com</p>
37	南京证券股份有限公司	<p>南京证券股份有限公司</p> <p>注册地址：南京市江东中路 389 号</p> <p>办公地址：南京市江东中路 389 号</p> <p>法定代表人：李剑锋</p> <p>客服电话：95386</p> <p>网址：www.njzq.com.cn</p>
38	中国建设银行股份有限公司	<p>中国建设银行股份有限公司</p> <p>注册地址：北京市西城区金融大街 25 号</p> <p>办公地址：北京市西城区金融大街 25 号</p> <p>法定代表人：田国立</p> <p>客服电话：95533</p> <p>网址：www.ccb.com</p>
39	北京增财基金销售有限公司	<p>北京增财基金销售有限公司</p> <p>注册地址：北京市西城区德胜门外大街 83 号 4 层 407</p> <p>办公地址：北京市西城区德胜门外大街 83 号 4 层 407</p> <p>法定代表人：刘洁</p> <p>客服电话：010-67000988</p> <p>网址：www.zcvc.com.cn</p>
40	北京虹点基金销售有限公司	<p>北京虹点基金销售有限公司</p> <p>注册地址：北京市朝阳区东三环北路 17 号 10 层 1015</p>

		<p>室</p> <p>办公地址：北京市朝阳区东三环北路 17 号 10 层 1015 室</p> <p>法定代表人：张晓杰</p> <p>客服电话：400-618-0707</p> <p>网址：www.hongdianfund.com</p>
41	平安证券股份有限公司	<p>平安证券股份有限公司</p> <p>注册地址：深圳市福田区福田街道益田路 5023 号平安金融中心 B 座第 22-25 层</p> <p>办公地址：深圳市福田区福田街道益田路 5023 号平安金融中心 B 座第 22-25 层</p> <p>法定代表人：何之江</p> <p>客服电话：95511-8</p> <p>网址：www.stock.pingan.com</p>
42	申万宏源西部证券有限公司	<p>申万宏源西部证券有限公司</p> <p>注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室</p> <p>办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室</p> <p>法定代表人：王献军</p> <p>客服电话：95523；400-800-0562</p> <p>网址：www.swhysc.com</p>
43	华龙证券股份有限公司	<p>华龙证券股份有限公司</p> <p>注册地址：兰州市城关区东岗西路 638 号兰州财富中心 21 楼</p> <p>办公地址：兰州市城关区东岗西路 638 号财富中心</p> <p>法定代表人：祁建邦</p> <p>客服电话：95368</p> <p>网址：www.hlzq.com</p>
44	万联证券股份有限公司	<p>万联证券股份有限公司</p> <p>注册地址：广州市天河区珠江东路 11 号 18、19 楼</p> <p>办公地址：广东省广州市天河区珠江东路 11 号 18、19 楼</p>

		<p>法定代表人：王达</p> <p>客服电话：95322</p> <p>网址：www.wlzq.cn</p>
45	华泰证券股份有限公司	<p>华泰证券股份有限公司</p> <p>注册地址：江苏省南京市建邺区江东中路 228 号</p> <p>办公地址：江苏省南京市建邺区江东中路 228 号</p> <p>法定代表人：张伟</p> <p>客服电话：95597</p> <p>网址：www.htsc.com.cn</p>
46	深圳市华融基金销售有限公司	<p>深圳市华融基金销售有限公司</p> <p>注册地址：深圳市福田区福田街道滨河路 5022 号联合广场 A 座裙楼 A302</p> <p>办公地址：深圳市福田区滨河路 5022 号联合广场 A 座裙楼 A302</p> <p>法定代表人：喻天柱</p> <p>客服电话：400-600-0583</p> <p>网址：www.hrjijin.com</p>
47	北京格上富信基金销售有限公司	<p>北京格上富信基金销售有限公司</p> <p>注册地址：北京市朝阳区东三环北路 19 号楼 701 内 09 室</p> <p>办公地址：北京市朝阳区东三环北路 19 号楼 701 内 09 室</p> <p>法定代表人：肖伟</p> <p>客服电话：400-080-8528</p> <p>网址：www.igesafe.com</p>
48	海银基金销售有限公司	<p>海银基金销售有限公司</p> <p>注册地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 8 号 401 室</p> <p>办公地址：上海市浦东新区银城中路 8 号海银金融中心 4 楼</p> <p>法定代表人：孙亚超</p> <p>客服电话：400-808-1016</p> <p>网址：www.fundhaiyin.com</p>



49	华西证券股份有限公司	<p>华西证券股份有限公司</p> <p>注册地址：中国（四川）自由贸易试验区成都市高新区天府二街 198 号</p> <p>办公地址：四川省成都市高新区天府二街 198 号</p> <p>法定代表人：杨炯洋</p> <p>客服电话：95584</p> <p>网址：www.hx168.com.cn</p>
50	和耕传承基金销售有限公司	<p>和耕传承基金销售有限公司</p> <p>注册地址：河南自贸试验区郑州片区(郑东)东风南路东康宁街北 6 号楼 5 楼 503</p> <p>办公地址：河南自贸试验区郑州片区(郑东)东风南路东康宁街北 6 号楼 503</p> <p>法定代表人：温丽燕</p> <p>客服电话：4000-555-671</p> <p>网址：www.hgccpb.com</p>
51	大连网金基金销售有限公司	<p>大连网金基金销售有限公司</p> <p>注册地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号诺德大厦 2 层 202 室</p> <p>办公地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号诺德大厦 2 层 202 室</p> <p>法定代表人：樊怀东</p> <p>客服电话：4000-899-100</p> <p>网址：www.yibaijin.com</p>
52	中证金牛（北京）基金销售有限公司	<p>中证金牛（北京）基金销售有限公司</p> <p>注册地址：北京市丰台区东管头 1 号 2 号楼 2-45 室</p> <p>办公地址：北京市丰台区丽泽金融商务区铭丰大厦 4 层 401</p> <p>法定代表人：吴志坚</p> <p>客服电话：4008-909-998</p> <p>网址：www.jnlc.com</p>
53	中信百信银行股份有限公司	<p>中信百信银行股份有限公司</p> <p>注册地址：北京市朝阳区安定路 5 号院 3 号楼 8 层</p> <p>办公地址：北京市朝阳区安定路 5 号院 3 号楼 6-11 层</p>



		<p>法定代表人：李如东</p> <p>客服电话：400-818-0100</p> <p>网址：www.aibank.com</p>
54	上海联泰基金销售有限公司	<p>上海联泰基金销售有限公司</p> <p>注册地址：上海市普陀区兰溪路900弄15号526室</p> <p>办公地址：上海市虹口区北外滩临潼路188号</p> <p>法定代表人：尹彬彬</p> <p>客服电话：400-188-1188</p> <p>网址：www.66liantai.com</p>
55	深圳安见基金销售有限公司	<p>深圳安见基金销售有限公司</p> <p>注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)</p> <p>办公地址：广东省深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室</p> <p>法定代表人：程隆</p> <p>客服电话：400-800-8668</p>
56	华鑫证券有限责任公司	<p>华鑫证券有限责任公司</p> <p>注册地址：深圳市福田区香蜜湖街道东海社区深南大道7888号东海国际中心一期A栋2301A</p> <p>办公地址：上海市黄浦区福州路666号</p> <p>法定代表人：俞洋</p> <p>客服电话：95323；4001-099-918</p> <p>网址：www.cfsc.com.cn</p>
57	国金证券股份有限公司	<p>国金证券股份有限公司</p> <p>注册地址：四川省成都市青羊区东城根上街95号</p> <p>办公地址：四川省成都市青羊区东城根上街95号</p> <p>法定代表人：冉云</p> <p>客服电话：95310</p> <p>网址：www.gjzq.com.cn</p>
58	国新证券股份有限公司	<p>国新证券股份有限公司</p> <p>注册地址：北京市西城区车公庄大街4号2幢1层A2112室</p> <p>办公地址：北京市朝阳区朝阳门北大街18号中国人保</p>

		<p>寿险大厦</p> <p>法定代表人：张海文</p> <p>客服电话：95390</p> <p>网址：www.crsec.com.cn</p>
59	国信证券股份有限公司	<p>国信证券股份有限公司</p> <p>注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 16-26 层</p> <p>办公地址：广东省深圳市福田区福华一路 125 号国信金融大厦</p> <p>法定代表人：张纳沙</p> <p>客服电话：95536</p> <p>网址：www.guosen.com.cn</p>
60	海通证券股份有限公司	<p>海通证券股份有限公司</p> <p>注册地址：上海市广东路 689 号</p> <p>办公地址：上海市黄浦区中山南路 888 号海通外滩金融广场</p> <p>法定代表人：周杰</p> <p>客服电话：95553</p> <p>网址：www.htsec.com</p>
61	中信证券（山东）有限责任公司	<p>中信证券（山东）有限责任公司</p> <p>注册地址：青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001</p> <p>办公地址：青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座 5 层</p> <p>法定代表人：肖海峰</p> <p>客服电话：95548</p> <p>网址：sd.citics.com</p>
62	开源证券股份有限公司	<p>开源证券股份有限公司</p> <p>注册地址：陕西省西安市高新区锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层</p> <p>办公地址：陕西省西安市高新区锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层</p> <p>法定代表人：李刚</p> <p>客服电话：95325</p>

		网址: <a href="http://www.kysec.cn">www.kysec.cn</a>
63	奕丰基金销售有限公司	奕丰基金销售有限公司 注册地址: 深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入住深圳市前海商务秘书有限公司) 办公地址: 深圳市南山区海德三道航天科技广场A座17楼1704室 法定代表人: TEO WEE HOWE 客服电话: 400-684-0500 网址: <a href="http://www.ifastps.com.cn">www.ifastps.com.cn</a>
64	嘉实财富管理有限公司	嘉实财富管理有限公司 注册地址: 海南省三亚市天涯区凤凰岛1号楼7层710号 办公地址: 北京市朝阳区建国门外大街21号北京国际俱乐部C座写字楼11层 法定代表人: 张峰 客服电话: 400-021-8850 网址: <a href="http://www.harvestwm.cn">www.harvestwm.cn</a>
65	阳光人寿保险股份有限公司	阳光人寿保险股份有限公司 注册地址: 海南省三亚市迎宾路360-1号三亚阳光金融广场16层 办公地址: 北京市朝阳区光华路阳光金融中心4、5、6、7层 法定代表人: 李科 客服电话: 40088-95510 网址: <a href="http://life.sinosig.com">life.sinosig.com</a>
66	鼎信汇金(北京)投资管理有限公司	鼎信汇金(北京)投资管理有限公司 注册地址: 北京市朝阳区霄云路40号院1号楼3层306室 办公地址: 北京市朝阳区霄云路40号院1号楼3层306室 法定代表人: 齐凌峰 客服电话: 400-158-5050 网址: <a href="http://www.9ifund.com">www.9ifund.com</a>

67	东吴证券股份有限公司	东吴证券股份有限公司 注册地址：苏州工业园区星阳街5号 办公地址：苏州工业园区星阳街5号 法定代表人：范力 客服电话：95330 网址：www.dwzq.com.cn
68	青岛意才基金销售有限公司	青岛意才基金销售有限公司 注册地址：山东省青岛市市南区澳门路98号海尔洲际酒店B座20层 办公地址：山东省青岛市市南区澳门路98号海尔洲际酒店B座20层 法定代表人：Giamberto Giraldo 客服电话：400-612-3303 网址：www.yitsai.com
69	长沙银行股份有限公司	长沙银行股份有限公司 注册地址：湖南省长沙市岳麓区滨江路53号楷林商务中心B座 办公地址：湖南省长沙市岳麓区滨江路长沙银行大厦 法定代表人：赵小中 客服电话：0731-96511 网址：bankofchangsha.com
70	杭州银行股份有限公司	杭州银行股份有限公司 注册地址：浙江省杭州市庆春路46号 办公地址：浙江省杭州市庆春路46号 法定代表人：宋剑斌 客服电话：95398/400-8888-508 网址：www.hzbank.com.cn
71	北京展恒基金销售股份有限公司	北京展恒基金销售股份有限公司 注册地址：北京市朝阳区安苑路11号西楼6层604、607 办公地址：北京市朝阳区安苑路11号西楼6层604、607 法定代表人：闫振杰

		<p>客服电话：400-818-8000</p> <p>网址：www.myfund.com</p>
72	大同证券有限责任公司	<p>大同证券有限责任公司</p> <p>注册地址：山西省大同市平城区迎宾街15号桐城中央21层</p> <p>办公地址：山西省太原市小店区长治路111号山西世贸中心A座F12、F13</p> <p>法定代表人：董祥</p> <p>客服电话：400-7121-212</p> <p>网址：www.dtsbc.com.cn</p>
73	中泰证券股份有限公司	<p>中泰证券股份有限公司</p> <p>注册地址：山东省济南市市中区经七路86号</p> <p>办公地址：山东省济南市市中区经七路86号</p> <p>法定代表人：王洪</p> <p>客服电话：95538</p> <p>网址：www.zts.com.cn</p>
74	爱建证券有限责任公司	<p>爱建证券有限责任公司</p> <p>注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道1600号1幢32楼</p> <p>办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道1600号1幢32楼</p> <p>法定代表人：祝健</p> <p>客服电话：4001-962-502</p> <p>网址：www.ajzq.com</p>
75	财达证券股份有限公司	<p>财达证券股份有限公司</p> <p>注册地址：河北省石家庄市自强路35号</p> <p>办公地址：河北省石家庄市桥西区自强路35号</p> <p>法定代表人：翟建强</p> <p>客服电话：0311-95363</p> <p>网址：www.s10000.com</p>
76	中信期货有限公司	<p>中信期货有限公司</p> <p>注册地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层</p>

		<p>办公地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层</p> <p>法定代表人：窦长宏</p> <p>客服电话：400-990-8826</p> <p>网址：www.citicsf.com</p>
77	长江证券股份有限公司	<p>长江证券股份有限公司</p> <p>注册地址：湖北省武汉市江汉区淮海路88号</p> <p>办公地址：湖北省武汉市江汉区淮海路88号</p> <p>法定代表人：金才玖</p> <p>客服电话：95579</p> <p>网址：www.cjsc.com.cn</p>
78	安信证券股份有限公司	<p>安信证券股份有限公司</p> <p>注册地址：深圳市福田区福田街道福华一路119号安信金融大厦</p> <p>办公地址：深圳市福田区福田街道福华一路119号安信金融大厦</p> <p>法定代表人：黄炎勋</p> <p>客服电话：95517</p> <p>网址：www.essence.com.cn</p>
79	长城证券股份有限公司	<p>长城证券股份有限公司</p> <p>注册地址：深圳市福田区福田街道金田路2026号能源大厦南塔楼10-19层</p> <p>办公地址：广东省深圳市福田区福田街道金田路2026号能源大厦南塔楼10-19层</p> <p>法定代表人：王军</p> <p>客服电话：400-666-6888</p> <p>网址：www.cgws.com</p>
80	宜信普泽（北京）基金销售有限公司	<p>宜信普泽（北京）基金销售有限公司</p> <p>注册地址：北京市朝阳区建国路118号24层2405、2406</p> <p>办公地址：北京市朝阳区建国路118号招商局大厦24F</p> <p>法定代表人：胡雄征</p> <p>客服电话：400-6099-200</p>

		网址: <a href="http://www.puzefund.com">www.puzefund.com</a>
81	北京中植基金销售有限公司	北京中植基金销售有限公司 注册地址: 北京市北京经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室 办公地址: 北京市朝阳区建国路 91 号金地中心 A 座 21、29 层 法定代表人: 武建华 客服电话: 400-8180-888 网址: <a href="http://www.zzfund.com">www.zzfund.com</a>
82	上海基煜基金销售有限公司	上海基煜基金销售有限公司 注册地址: 上海市黄浦区广东路 500 号 30 层 3001 单元 办公地址: 上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 1503 室 法定代表人: 王翔 客服电话: 400-820-5369; 021-6537-0077 网址: <a href="http://www.jigoutong.com">www.jigoutong.com</a> ; <a href="http://www.jiyufund.com.cn">www.jiyufund.com.cn</a>
83	上海挖财基金销售有限公司	上海挖财基金销售有限公司 注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区杨高南路 759 号 2 号楼 18 层 03 单元 办公地址: 上海市浦东新区杨高南路 759 号 2 号楼 18 层 03 单元 法定代表人: 方磊 客服电话: 021-50810673 网址: <a href="http://www.wacaijin.com">www.wacaijin.com</a>
84	济安财富(北京)基金销售有限公司	济安财富(北京)基金销售有限公司 注册地址: 北京市朝阳区太阳宫中路 16 号院 1 号楼 10 层 1005 办公地址: 北京市朝阳区太阳宫中路 16 号院 1 号楼冠捷大厦 11 层 1105 单 法定代表人: 杨健 客服电话: 400-673-7010 网址: <a href="http://www.jianfortune.com">www.jianfortune.com</a>
85	万家财富基金销售有限公司	万家财富基金销售(天津)有限公司

	(天津)有限公司	<p>注册地址：天津自贸区(中心商务区)迎宾大道1988号滨海浙商大厦公寓2-2413室</p> <p>办公地址：北京市东城区朝阳门北大街9号泓晟国际中心16层</p> <p>法定代表人：戴晓云</p> <p>客服电话：010-59013895</p> <p>网址：www.wanjiawealth.com</p>
86	东方财富证券股份有限公司	<p>东方财富证券股份有限公司</p> <p>注册地址：西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城10栋楼</p> <p>办公地址：上海市徐汇区宛平南路88号金座东方财富大厦</p> <p>法定代表人：戴彦</p> <p>客服电话：95357</p> <p>网址：www.18.cn</p>
87	上海爱建基金销售有限公司	<p>上海爱建基金销售有限公司</p> <p>注册地址：上海市黄浦区西藏中路336号1806-13室</p> <p>办公地址：上海市徐汇区肇嘉浜路746号</p> <p>法定代表人：吴文新</p> <p>客服电话：4008032733</p> <p>网址：www.ajwm.com.cn（筹建中）</p>
88	中银国际证券股份有限公司	<p>中银国际证券股份有限公司</p> <p>注册地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层</p> <p>办公地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层</p> <p>法定代表人：宁敏</p> <p>客服电话：400-620-8888</p> <p>网址：www.bocichina.com.cn</p>
89	浙江同花顺基金销售有限公司	<p>浙江同花顺基金销售有限公司</p> <p>注册地址：浙江省杭州市文二西路1号元茂大厦903室</p> <p>办公地址：杭州市西湖区文二西路1号元茂大厦903室</p> <p>法定代表人：吴强</p>



		<p>客服电话：952555</p> <p>网址：www.5ifund.com</p>
90	浦领基金销售有限公司	<p>浦领基金销售有限公司</p> <p>注册地址：北京市朝阳区建国路乙 118 号 16 层 1611</p> <p>办公地址：北京市朝阳区望京东园四区 2 号楼 10 层 1001 号 04 室</p> <p>法定代表人：张莲</p> <p>客服电话：400-012-5899</p> <p>网址：www.prolinkfund.com</p>
91	上海陆金所基金销售有限公司	<p>上海陆金所基金销售有限公司</p> <p>注册地址：中国(上海)自由贸易试验区源深路 1088 号 7 层(实际楼层 6 层)</p> <p>办公地址：中国(上海)自由贸易试验区源深路 1088 号 7 层(实际楼层 6 层)</p> <p>法定代表人：陈祎彬</p> <p>客服电话：400-8219-031</p> <p>网址：www.lufunds.com</p>
92	深圳市金斧子基金销售有限公司	<p>深圳市金斧子基金销售有限公司</p> <p>注册地址：深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路 15 号科兴科学园 B 栋 3 单元 11 层 1108</p> <p>办公地址：深圳市南山区粤海街道科技园社区科苑路 15 号科兴科学园 B 栋 B3-1801</p> <p>法定代表人：赖任军</p> <p>客服电话：400-8224-888</p> <p>网址：www.jfzinv.com</p>
93	中信证券华南股份有限公司	<p>中信证券华南股份有限公司</p> <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</p> <p>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：陈可可</p> <p>客服电话：95548</p> <p>网址：www.gzs.com.cn</p>

94	上海天天基金销售有限公司	<p>上海天天基金销售有限公司</p> <p>注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼二层</p> <p>办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号东方财富大厦</p> <p>法定代表人：其实</p> <p>客服电话：95021</p> <p>网址：www.1234567.com.cn</p>
95	中国银河证券股份有限公司	<p>中国银河证券股份有限公司</p> <p>注册地址：北京市丰台区西营街 8 号院 1 号楼 7 至 18 层 101</p> <p>办公地址：北京市丰台区西营街 8 号院 1 号楼青海金融大厦</p> <p>法定代表人：王晟</p> <p>客服电话：4008-888-888、95551</p> <p>网址：www.chinastock.com.cn</p>
96	山西证券股份有限公司	<p>山西证券股份有限公司</p> <p>注册地址：山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼</p> <p>办公地址：山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼</p> <p>法定代表人：王怡里</p> <p>客服电话：400-666-1618；95573</p> <p>网址：www.i618.com.cn</p>
97	中国工商银行股份有限公司	<p>中国工商银行股份有限公司</p> <p>注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号</p> <p>办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号</p> <p>法定代表人：陈四清</p> <p>客服电话：95588</p> <p>网址：www.icbc.com.cn</p>
98	北京创金启富基金销售有限公司	<p>北京创金启富基金销售有限公司</p> <p>注册地址：北京市西城区白纸坊东街 2 号院 6 号楼 712 室</p> <p>办公地址：北京市西城区白纸坊东街 2 号经济日报社综合楼 A 座 712 室</p>

		<p>法定代表人：梁蓉</p> <p>客服电话：400-6262-818</p> <p>网址：www.5irich.com</p>
99	北京雪球基金销售有限公司	<p>北京雪球基金销售有限公司</p> <p>注册地址：北京市朝阳区创远路34号院6号楼15层1501室</p> <p>办公地址：北京市朝阳区创远路34号院6号楼15层1501室</p> <p>法定代表人：李楠</p> <p>客服电话：400-159-9288</p> <p>网址：www.danjuanapp.com</p>
100	上海有鱼基金销售有限公司	<p>上海有鱼基金销售有限公司</p> <p>注册地址：上海自由贸易试验区浦东大道2123号3层3E-2655室</p> <p>办公地址：上海市徐汇区桂平路391号国际商务中心B座20楼</p> <p>法定代表人：周锋</p> <p>客服电话：021-61265457</p> <p>网址：www.youyufund.com</p>
101	深圳市前海排排网基金销售有限责任公司	<p>深圳市前海排排网基金销售有限责任公司</p> <p>注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）</p> <p>办公地址：广东深圳市福田区福保街道新洲路2008号新洲同创汇D栋3层</p> <p>法定代表人：杨柳</p> <p>客服电话：400-666-7388</p> <p>网址：www.simuwang.com</p>
102	喜鹊财富基金销售有限公司	<p>喜鹊财富基金销售有限公司</p> <p>注册地址：西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦1513室</p> <p>办公地址：西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦1513室</p> <p>法定代表人：卢士远</p> <p>客服电话：4006997719</p> <p>网址：www.xiquefund.com</p>

103	上海万得基金销售有限公司	上海万得基金销售有限公司 注册地址：中国（上海）自由贸易试验区浦明路 1500 号 8 层 M 座 办公地址：上海市浦东新区浦明路 1500 号万得大厦 法定代表人：简梦雯 客服电话：400-799-1888 网址：www.520fund.com.cn
104	兴业银行股份有限公司	兴业银行股份有限公司 注册地址：福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦 办公地址：福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦 法定代表人：吕家进 客服电话：95561 网址：www.cib.com.cn
105	北京富国大通基金销售有限公司	北京富国大通基金销售有限公司 注册地址：北京市海淀区首体南路 9 号 4 楼 3 层 302-01 办公地址：北京市朝阳区安定路 5 号院 3 号楼中建财富国际中心 25 层 法定代表人：许家宝 客服电话：400-088-0088 网址：www.fuguowealth.com
106	江苏汇林保大基金销售有限公司	江苏汇林保大基金销售有限公司 注册地址：南京市高淳区经济开发区古檀大道 47 号 办公地址：南京市鼓楼区中山北路 2 号绿地紫峰大厦 2005 室 法定代表人：吴言林 客服电话：025-66046166 转 849 网址：www.huilinbd.com
107	中邮证券有限责任公司	中邮证券有限责任公司 注册地址：陕西省西安市唐延路 5 号陕西邮政信息大厦 9-11 层 办公地址：西安市高新区唐延路 5 号陕西邮政大厦 9-11

		<p>层</p> <p>法定代表人：郭成林</p> <p>客服电话：4008-888-005</p> <p>网址：www.cnpsec.com.cn</p>
108	腾安基金销售（深圳）有限公司	<p>腾安基金销售（深圳）有限公司</p> <p>注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）</p> <p>办公地址：深圳市南山区海天二路33号腾讯滨海大厦15楼</p> <p>法定代表人：谭广锋</p> <p>客服电话：4000-890-555</p> <p>网址：www.txfund.com</p>
109	上海凯石财富基金销售有限公司	<p>上海凯石财富基金销售有限公司</p> <p>注册地址：上海市黄浦区西藏南路765号602-115室</p> <p>办公地址：上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦</p> <p>法定代表人：陈继武</p> <p>客服电话：400-643-3389</p> <p>网址：www.vstonewealth.com</p>
110	深圳新华信通基金销售有限公司	<p>深圳新华信通基金销售有限公司</p> <p>注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）</p> <p>办公地址：深圳市福田区深南大道2003号华嵘大厦1806</p> <p>法定代表人：戴媛</p> <p>客服电话：400-000-5767</p> <p>网址：www.xintongfund.com</p>
111	福克斯（北京）基金销售有限公司	<p>福克斯（北京）基金销售有限公司</p> <p>注册地址：北京市怀柔区怀北镇怀北路308号</p> <p>办公地址：北京市朝阳区光华路15号院（亿利生态广场）1号楼10层1001室</p> <p>法定代表人：谢亚凡</p> <p>客服电话：400-689-7859</p> <p>网址：www.haofunds.com</p>

112	招商银行股份有限公司	<p>招商银行股份有限公司</p> <p>注册地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦</p> <p>办公地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦</p> <p>法定代表人：缪建民</p> <p>客服电话：95555</p> <p>网址：www.cmbchina.com</p>
113	平安银行股份有限公司	<p>平安银行股份有限公司</p> <p>注册地址：广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号</p> <p>办公地址：广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号</p> <p>法定代表人：谢永林</p> <p>客服电话：95511-3</p> <p>网址：bank.pingan.com</p>
114	北京新浪仓石基金销售有限公司	<p>北京新浪仓石基金销售有限公司</p> <p>注册地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期（西扩）N-1、N-2 地块新浪总部科研楼 5 层 518 室</p> <p>办公地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期（西扩）N-1、N-2 地块新浪总部科研楼</p> <p>法定代表人：李柳娜</p> <p>客服电话：010-62675369</p> <p>网址：www.xincai.com</p>
115	东莞证券股份有限公司	<p>东莞证券股份有限公司</p> <p>注册地址：广东省东莞市莞城区可园南路一号</p> <p>办公地址：广东省东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼</p> <p>法定代表人：陈照星</p> <p>客服电话：95328</p> <p>网址：www.dgzq.com.cn</p>
116	上海好买基金销售有限公司	<p>上海好买基金销售有限公司</p> <p>注册地址：上海市虹口区东大名路 501 号 6211 单元</p> <p>办公地址：上海市浦东新区张杨路 500 号华润时代广场商务楼 12 楼</p>

		<p>法定代表人：陶怡</p> <p>客服电话：400-700-9665</p> <p>网址：www.howbuy.com</p>
117	中信证券股份有限公司	<p>中信证券股份有限公司</p> <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</p> <p>办公地址：广东省深圳市福田区中心三路8号中信证券大厦/北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦</p> <p>法定代表人：张佑君</p> <p>客服电话：95548</p> <p>网址：www.citics.com</p>
118	渤海证券股份有限公司	<p>渤海证券股份有限公司</p> <p>注册地址：天津市经济技术开发区第二大街42号写字楼101室</p> <p>办公地址：天津市南开区宾水西道8号</p> <p>法定代表人：安志勇</p> <p>客服电话：956066</p> <p>网址：www.ewww.com.cn</p>
119	联储证券股份有限公司	<p>联储证券股份有限公司</p> <p>注册地址：山东省青岛市崂山区香港东路195号8号楼15层</p> <p>办公地址：北京市朝阳区安定路5号院3号楼中建财富国际中心27层</p> <p>法定代表人：吕春卫</p> <p>客服电话：956006</p> <p>网址：www.lczq.com</p>
120	东海证券股份有限公司	<p>东海证券股份有限公司</p> <p>注册地址：江苏省常州延陵西路23号投资广场18层</p> <p>办公地址：上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦</p> <p>法定代表人：钱俊文</p> <p>客服电话：95531；400-8888-588</p> <p>网址：www.longone.com.cn</p>

121	民商基金销售（上海）有限公司	民商基金销售（上海）有限公司 注册地址：上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区(东座)6 楼 A31 室 办公地址：上海市浦东新区张杨路 707 号生命人寿大厦 32 楼 法定代表人：贲惠琴 客服电话：021-50206003 网址：www.msftec.com
122	北京度小满基金销售有限公司	北京度小满基金销售有限公司 注册地址：北京市海淀区西北旺东路 10 号院西区 4 号楼 1 层 103 室 办公地址：北京市海淀区西北旺东路 10 号院西区 4 号楼 1 层 103 室 法定代表人：盛超 客服电话：95055-4 网址：www.duxiaomanfund.com
123	深圳市金海九州基金销售有限公司	深圳市金海九州基金销售有限公司 注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司） 办公地址：广东省深圳市福田区福华一路富德生命保险大厦 11 楼 法定代表人：彭维熙 客服电话：400-677-3333 网址：www.jhjzfund.com
124	泛华普益基金销售有限公司	泛华普益基金销售有限公司 注册地址：成都市成华区建设路 9 号高地中心 1101 室 办公地址：成都市金牛区花照壁西顺街 399 号 1 栋 1 单元龙湖西宸天街 B 座 12 层 法定代表人：杨远芬 客服电话：400-080-3388 网址：www.puyifund.com
125	财咨道信息技术有限公司	财咨道信息技术有限公司 注册地址：辽宁省沈阳市浑南区白塔二南街 18-2 号 B



		<p>座 601</p> <p>办公地址：辽宁省沈阳市浑南区白塔二南街 18-2 号 B 座 601</p> <p>法定代表人：朱荣晖</p> <p>客服电话：4000035811</p> <p>网址：www.jinjiwo.com</p>
126	宁波银行股份有限公司	<p>宁波银行股份有限公司</p> <p>注册地址：浙江省宁波市鄞州区宁东路 345 号</p> <p>办公地址：浙江省宁波市鄞州区宁东路 345 号</p> <p>法定代表人：陆华裕</p> <p>客服电话：95574</p> <p>网址：www.nbcb.com.cn</p>
127	泰信财富基金销售有限公司	<p>泰信财富基金销售有限公司</p> <p>注册地址：北京市朝阳区建国路乙 118 号 10 层 1206</p> <p>办公地址：北京市朝阳区建国路乙 118 号 10 层 1206</p> <p>法定代表人：彭浩</p> <p>客服电话：400-004-8821</p> <p>网址：www.taixincf.com</p>
128	博时财富基金销售有限公司	<p>博时财富基金销售有限公司</p> <p>注册地址：深圳市福田区莲花街道福新社区益田路 5999 号基金大厦 19 层</p> <p>办公地址：深圳市福田区莲花街道福新社区益田路 5999 号基金大厦 19 层</p> <p>法定代表人：王德英</p> <p>客服电话：400-610-5568</p> <p>网址：www.boserawealth.com</p>
129	深圳市新兰德证券投资咨询有限公司	<p>深圳市新兰德证券投资咨询有限公司</p> <p>注册地址：深圳市福田区梅林街道梅都社区中康路 136 号深圳新一代产业园 2 栋 3401</p> <p>办公地址：深圳市福田区梅林街道梅都社区中康路 136 号深圳新一代产业园 2 栋 3401</p> <p>法定代表人：张斌</p> <p>客服电话：400-166-1188</p>

		网址: <a href="http://www.xinlande.com.cn">www.xinlande.com.cn</a>
130	上海长量基金销售有限公司	上海长量基金销售有限公司 注册地址: 浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室 办公地址: 上海市浦东新区东方路 1267 号陆家嘴金融服务广场二期 11 层 法定代表人: 张跃伟 客服电话: 400-820-2899 网址: <a href="http://www.erichfund.com">www.erichfund.com</a>
131	上海利得基金销售有限公司	上海利得基金销售有限公司 注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区临港新片区海基六路 70 弄 1 号 208-36 室 办公地址: 上海市虹口区东大名路 1098 号浦江国际金融广场 53 层 法定代表人: 李兴春 客服电话: 400-032-5885 网址: <a href="http://www.leadfund.com.cn">www.leadfund.com.cn</a>
132	北京汇成基金销售有限公司	北京汇成基金销售有限公司 注册地址: 北京市西城区宣武门外大街甲 1 号 4 层 401-2 办公地址: 北京市西城区宣武门外大街甲 1 号环球财讯中心 D 座 4 层 法定代表人: 王伟刚 客服电话: 400-055-5728 网址: <a href="http://www.hcfunds.com">www.hcfunds.com</a>
133	上海汇付基金销售有限公司	上海汇付基金销售有限公司 注册地址: 上海市黄浦区九江路 769 号 1807-3 室 办公地址: 上海市徐汇区宜山路 700 号普天信息产业园 2 期 C5 栋 法定代表人: 金佶 客服电话: 021-34013999 网址: <a href="http://www.hotjijin.com">www.hotjijin.com</a>
134	珠海盈米基金销售有限公司	珠海盈米基金销售有限公司 注册地址: 珠海市横琴新区环岛东路 3000 号 2719 室

		<p>办公地址：广州市海珠区阅江中路 688 号保利国际广场北塔 33 楼、8 楼</p> <p>法定代表人：肖雯</p> <p>客服电话：020-89629066</p> <p>网址：www.yingmi.cn</p>
135	恒泰证券股份有限公司	<p>恒泰证券股份有限公司</p> <p>注册地址：内蒙古自治区呼和浩特市新城区海拉尔东街满世尚都办公商业综合楼</p> <p>办公地址：北京市西城区金融大街 17 号中国人寿中心 11 楼</p> <p>法定代表人：祝艳辉</p> <p>客服电话：956088</p> <p>网址：www.cnht.com.cn</p>
136	中山证券有限责任公司	<p>中山证券有限责任公司</p> <p>注册地址：深圳市南山区创业路 1777 号海信南方大厦 21、22 层</p> <p>办公地址：深圳市南山区创业路 1777 号海信南方大厦 21、22 层</p> <p>法定代表人：李永湖</p> <p>客服电话：95329</p> <p>网址：www.zszq.com</p>
137	粤开证券股份有限公司	<p>粤开证券股份有限公司</p> <p>注册地址：广州市黄埔区科学大道 60 号开发区控股中心 19、22、23 层</p> <p>办公地址：广州市黄埔区科学大道 60 号开发区控股中心 19、21、22、23 层</p> <p>法定代表人：严亦斌</p> <p>客服电话：95564</p> <p>网址：www.ykzq.com</p>
138	信达证券股份有限公司	<p>信达证券股份有限公司</p> <p>注册地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼</p> <p>办公地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼</p> <p>法定代表人：祝瑞敏</p>

		<p>客服电话：95321</p> <p>网址：www.cindasc.com</p>
139	中国农业银行股份有限公司	<p>中国农业银行股份有限公司</p> <p>注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号</p> <p>办公地址：北京市东城区建国门内大街 69 号</p> <p>法定代表人：谷澍</p> <p>客服电话：95599</p> <p>网址：www.abchina.com</p>
140	诚通证券股份有限公司	<p>诚通证券股份有限公司</p> <p>注册地址：北京市朝阳区东三环北路 27 号楼 12 层</p> <p>办公地址：北京市朝阳区东三环北路 27 号楼 12 层</p> <p>法定代表人：张威</p> <p>客服电话：95399</p> <p>网址：www.cctgsc.com.cn</p>
141	华安证券股份有限公司	<p>华安证券股份有限公司</p> <p>注册地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号</p> <p>办公地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号</p> <p>法定代表人：章宏韬</p> <p>客服电话：95318</p> <p>网址：www.hazq.com</p>
142	福建海峡银行股份有限公司	<p>福建海峡银行股份有限公司</p> <p>注册地址：福建省福州市台江区江滨中大道 358 号海峡银行大厦</p> <p>办公地址：福建省福州市台江区江滨中大道 358 号海峡银行大厦</p> <p>法定代表人：俞敏</p> <p>客服电话：400-893-9999</p> <p>网址：www.fjhxbank.com</p>
143	深圳秋实惠智基金销售有限公司	<p>深圳秋实惠智基金销售有限公司</p> <p>注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)</p> <p>办公地址：北京市朝阳区东三环北路 2 号南银大厦 2308-9 室</p>

		<p>法定代表人：张秋林</p> <p>客服电话：400-9987-593</p> <p>网址：fund.qiushicaifu.com</p>
144	中衍期货有限公司	<p>中衍期货有限公司</p> <p>注册地址：北京市朝阳区东四环中路 82 号 2 座 2-1 座、2-2 座 7 层、B2 座一层 108 单元</p> <p>办公地址：北京市朝阳区东四环中路 82 号金长安大厦 B 座 7 层</p> <p>法定代表人：马宏波</p> <p>客服电话：400-6881-117</p> <p>网址：www.cdfco.com.cn</p>
145	上海中正达广基金销售有限公司	<p>上海中正达广基金销售有限公司</p> <p>注册地址：上海市徐汇区龙兰路 277 号 1 号楼 1203、1204 室</p> <p>办公地址：上海市徐汇区龙兰路 277 号 1 号楼 1203、1204 室</p> <p>法定代表人：黄欣</p> <p>客服电话：400-6767-523</p> <p>网址：www.zhongzhengfund.com</p>
146	上海中欧财富基金销售有限公司	<p>上海中欧财富基金销售有限公司</p> <p>注册地址：中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 1008-1 室</p> <p>办公地址：上海市虹口区公平路 18 号 8 栋嘉昱大厦 6 楼</p> <p>法定代表人：许欣</p> <p>客服电话：400-100-2666</p> <p>网址：www.zocaifu.com</p>

## （二）登记机构

名称：前海开源基金管理有限公司

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

办公地址：深圳市福田区深南大道 7006 号万科富春东方大厦 22 楼

法定代表人：李强

联系人：罗炜

电话：（0755）83181579

传真：（0755）83181121

### （三）出具法律意见书的律师事务所

名称：广东信达律师事务所

注册地址：深圳市福田区益田路 6001 号太平金融大厦 12 楼

办公地址：深圳市福田区益田路 6001 号太平金融大厦 12 楼

负责人：张炯

经办律师：杨扬、胡云云

电话：（0755）88265288

传真：（0755）88265537

### （四）审计基金资产的会计师事务所

会计师事务所：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

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

室

办公地址：中国(上海)黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座 11 楼

首席合伙人：李丹

联系人：施翊洲

经办会计师：施翊洲、陈熹

电话：(021)23238888

传真：(021)23238800

## 六、基金的募集

本基金由基金管理人依照《基金法》和其他有关法律法规，以及基金合同的规定，经中国证监会 2016 年 3 月 22 日证监许可[2016]584 号文注册募集。

募集期自 2016 年 5 月 19 日至 2016 年 6 月 17 日，共募集有效认购份额 305,032,823.57 份，利息结转份额 106,374.98 份，合计 305,139,198.55 份，募集户数为 2,025 户。

本基金为契约型开放式混合型基金，基金存续期限为不定期。

## 七、基金合同的生效

### （一）基金合同的生效

本基金合同于 2016 年 6 月 24 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。

### （二）基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

《基金合同》生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。

法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。



## 八、基金份额的申购与赎回

### （一）申购和赎回场所

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。具体的销售机构将由基金管理人在相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并在管理人网站公示。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。

若基金管理人或其指定的销售机构开通电话、传真或电子直销等交易方式，投资人可以通过上述方式进行申购与赎回，具体办法由基金管理人或其指定的销售机构另行公告。

### （二）申购和赎回的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。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，则基金管理人可调整本基金的开放时间，具体安排以届时公告为准。

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

#### 2、申购、赎回开始日及业务办理时间

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

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

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

基金管理人不得在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。

本基金已于 2016 年 7 月 25 日开放日常申购赎回业务。

### （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、遵循“基金份额持有人利益优先”原则，基金管理人在办理基金份额申购、赎回业务时，如果发生申购、赎回损害持有人利益的情形时，应当及时暂停申购、赎回业务。

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

#### （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。

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

##### 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，否则所提交的申购申请不成立。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。

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。投资人赎回申请成功后，基金管理人将在 T+7 日(包括该日)内支付赎回款项。在发生巨额赎回或基金合同载明的其他暂停赎回或者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。

遇证券、期货交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其他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，则赎回款项划付时间相应顺延。

##### 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，投资人可在 T+2 日后(包括该日)到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功或无效，则申购款项本金退还给投资人。

销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到该申购、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。

#### （五）申购和赎回的限制

1、本基金对单个投资人不设累计持有的基金份额上限，但法律法规、中国证监会和《基金合同》另有规定的除外。

2、本基金首次申购和追加申购的单笔最低限额均为人民币 10 元（含申购费）。各销售机构对最低申购限额及交易级差有其他规定的，以各销售机构的业务规定为准。

3、投资人赎回本基金各类基金份额时，可申请将其持有的部分或全部基金份额赎回，但每笔最低赎回份额不得低于 10 份；各类基金份额的账户最低余额为 10 份基金份额，若某笔赎回将导致投资人在销售机构托管的本基金某类基金份额余额不足 10 份时，该笔赎回业务应包括账户内全部该类基金份额，否则，基金管理人有权将剩余部分的该类基金份额强制赎回。各销售机构对最低赎回份额及账户最低余额有其他规定的，以各销售机构的业务规定为准。

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

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

#### （六）申购和赎回的价格、费用及其用途

1、本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码，分别计算和公告两类基金份额净值和两类基金份额累计净值。本基金两类基金份额净值的计算，保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

#### 2、申购费率

（1）投资人通过代销机构申购本基金 A/C 类基金份额的申购费率见下表：

申购金额 M（万元） （含申购费）	申购费率
$M < 50$	1.50%
$50 \leq M < 250$	1.00%
$250 \leq M < 500$	0.60%
$M \geq 500$	每笔 1,000 元

（2）本基金对通过基金管理人直销柜台和电子直销交易系统申购的投资人实施差别的申购费率，详见基金管理人官网或相关公告。

部分销售机构如实行优惠费率，请投资人参见销售机构公告。

本基金 A 类和 C 类基金份额的申购费用应在投资人申购基金份额时收取。投资人在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。

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。

### 3、申购份额的计算及余额的处理方式

基金的申购金额包括申购费用和净申购金额。

当投资人选择申购 A 类和 C 类基金份额时，申购份额的计算方法如下：

（1）A 类和 C 类基金份额的申购费率适用比例费率时：

净申购金额=申购金额/（1+申购费率）

申购费用=申购金额-净申购金额

申购份额=净申购金额/申购当日该类基金份额净值

（2）A 类和 C 类基金份额的申购费率适用固定金额时：

净申购金额=申购金额-固定金额

申购费用=固定金额

申购份额=净申购金额/申购当日该类基金份额净值

申购的有效份额单位为份，上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

举例二：某投资人投资 8 万元申购本基金 A 类基金份额，对应费率为 1.50%，假设申购当日该类基金份额的基金份额净值为 1.080 元，则可得到的申购份额为：

净申购金额=80,000/（1+1.50%）=78,817.73 元

申购费用=80,000-78,817.73=1182.27 元

申购份额=78,817.73/1.080=72979.38 份

即：投资人投资 8 万元申购本基金 A 类基金份额，假设申购当日 A 类基金份额的基金份额净值为 1.080 元，则其可得到 72979.38 份 A 类基金份额。

### 4、赎回费率

（1）本基金 A 类基金份额的赎回费率如下表所示：

持有时间 D（天）	A 类基金份额赎回费率
D<7	1.50%
7 ≤ D <30	0.75%
30 ≤ D <366	0.50%
366 ≤ D <731	0.25%
D ≥ 731	0%

投资者可将其持有的全部或部分 A 类基金份额赎回。赎回费由赎回 A 类基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回 A 类基金份额时收取。对持续持有期少于 30 日的 A 类基金份额持有人收取的赎回费全额计入基金财产；对持续持有期大于等于 30 天少于

90 天的 A 类基金份额持有人收取的赎回费总额的 75% 计入基金财产；对持续持有期大于等于 90 天少于 180 天的 A 类基金份额持有人收取的赎回费总额的 50% 计入基金财产；对持续持有期大于等于 180 天的 A 类基金份额持有人收取的赎回费总额的 25% 计入基金财产。未计入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。

(2) 本基金 C 类基金份额赎回费率如下表所示：

持有时间 D (天)	C 类基金份额赎回费率
$D < 7$	1.50%
$7 \leq D < 30$	0.50%
$D \geq 30$	0%

投资者可将其持有的全部或部分 C 类基金份额赎回。赎回费用由赎回 C 类基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回 C 类基金份额时收取。对持续持有期少于 30 日的 C 类基金份额持有人收取的赎回费全额计入基金财产。

#### 5、赎回金额的计算及处理方式

本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额的赎回金额的计算方式相同，按照各自对应的当日该类基金份额净值和赎回费率计算，净赎回金额为赎回总金额扣减赎回费用。赎回金额的计算方式如下：

赎回总金额 = 赎回份额 × 赎回当日该类基金份额净值

赎回费用 = 赎回总金额 × 赎回费率

净赎回金额 = 赎回总金额 - 赎回费用

赎回金额单位为元，计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

举例三：某投资人赎回本基金 1 万份 A 类基金份额，持有时间为 300 天，对应的赎回费率为 0.50%，假设赎回当日 A 类基金份额的基金份额净值是 1.088 元，则其可得到的赎回金额为：

赎回金额 =  $10,000 \times 1.088 = 10,880.00$  元

赎回费用 =  $10,880.00 \times 0.50\% = 54.4$  元

净赎回金额 =  $10,880.00 - 54.4 = 10825.60$  元

即：投资人赎回本基金 1 万份 A 类基金份额，持有期限为 300 天，假设赎回当日 A 类基金份额的基金份额净值是 1.088 元，则其可得到的净赎回金额为 10825.60 元。

6、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》的有关规定在指定媒介上公告。

7、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，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，基金管理人可以对销售费率实行一定的优惠。

#### （七）拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

- 1、因不可抗力导致基金无法正常运作。
- 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况。
- 3、证券、期货交易所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或无法办理申购业务。
- 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，或其他损害现有基金份额持有人利益的情形。
- 6、基金管理人、基金托管人、基金销售机构或登记机构的异常情况导致基金销售系统、基金登记结算系统、基金会计系统或证券登记系统无法正常运行。
- 7、港股通交易每日额度不足。
- 8、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过 50%，或者变相规避 50%集中度的情形时。
- 9、当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上的，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金申购申请。
- 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、7、9、10 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项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。

#### （八）暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

- 1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。
- 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况。
- 3、证券、期货交易所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、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、当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上的，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请。

## 7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付，并以受理赎回申请当日的该类基金份额净值为依据计算赎回金额。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。

### （九）巨额赎回的情形及处理方式

#### 1、巨额赎回的认定

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

#### 2、巨额赎回的处理方式

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

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

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

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

#### 3、巨额赎回的公告

当发生上述巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式（包括但不限于短信、电子邮件或由基金销售机构通知等方式）在3个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，并在2日内在指定媒介上刊登公告。

#### （十）暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

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

2、如发生暂停的时间为1日，基金管理人应于重新开放日，在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近1个开放日两类基金份额的基金份额净值。

3、如发生暂停的时间超过1日，基金管理人可以根据暂停申购或赎回的时间，依照《信息披露办法》的有关规定，最迟于重新开放日在指定媒介上刊登重新开放申购或赎回的公告；也可以根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间，届时不再另行发布重新开放的公告。

#### （十一）基金转换

基金管理人已于2016年7月25日起开通本基金与基金管理人旗下其他基金之间的转换业务，具体内容详见2016年7月21日在指定媒介上发布的《前海开源沪港深创新成长灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定投业务的公告》。

#### （十二）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，或者按照相关法律法规或国家有权机关要求的方式进行处理的行为。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，或者按照相关法律法规或国家有权机关要求的方式进行处理。

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。

#### （十三）基金的转托管

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

#### （十四）定期定额投资计划



基金管理人已于 2016 年 7 月 25 日开通本基金的定期定额投资业务，具体内容详见 2016 年 7 月 21 日在指定媒介上发布的《前海开源沪港深创新成长灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定投业务的公告》

#### **（十五）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。基金账户或基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益一并冻结，被冻结部分份额仍然参与收益分配与支付。法律法规或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，基金管理人将制定和实施相应的业务规则。

#### **（十六）基金份额的转让**

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

#### **（十七）实施侧袋机制期间本基金的申购与赎回**

本基金实施侧袋机制的，本基金的申购和赎回安排详见本招募说明书“侧袋机制”章节或届时发布的相关公告。

## 九、基金的投资

### （一）投资目标

本基金在综合研究的基础上，精选投资于具有创新能力的高成长性行业龙头企业，分享企业高速增长成果，在严格控制风险的前提下，追求基金资产的长期持续增值。

### （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（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内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、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券等）、资产支持证券、同业存单、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

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

基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的比例为 0-95%（其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的 0-95%，投资于港股通标的股票的比例占基金资产的 0-95%），其中投资于创新成长主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的 80%；持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，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、存出保证金和应收申购款等。

本基金所称的创新成长主题相关股票指的是在产品和服务、技术、商业模式、企业制度等方面具有创新能力的企业所发行的股票，隶属的行业包括但不限于节能环保、互联网技术、传媒、通信、医药、医疗服务、高端装备制造、新能源、新材料、汽车及家电等行业。

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

本基金参与股指期货交易，应符合法律法规规定和基金合同约定的投资限制并遵守相关期货交易所的业务规则。

### （三）投资策略

本基金的投资策略主要有以下七方面内容：

#### 1、大类资产配置

本基金综合运用定性和定量的分析手段，在对宏观经济因素进行充分研究的基础上，判断宏观经济周期所处阶段。本基金将依据经济周期理论，结合对证券市场的系统性风险

以及未来一段时期内各大类资产风险和预期收益率的评估，制定本基金在沪深 A 股、港股、债券、现金等大类资产之间的配置比例。

本基金通过对股票等权益类、债券等固定收益类和现金资产分布的实时监控，根据经济运行周期变动、市场利率变化、市场估值、证券市场变化等因素以及基金的风险评估进行灵活调整。在各类资产中，根据其参与市场基本要素的变动，调整各类资产在基金投资组合中的比例。

## 2、股票投资策略

本基金采用以“自下而上”为主，“自上而下”为辅、定性和定量相结合的分析方法，构建并调整投资组合，力争获取稳定的超额收益。

### （1）创新成长主题界定

本基金主要通过定性分析企业创新能力和成长性，挖掘出符合中国经济转型、人口结构变迁、具有爆发式增长机会、有利于改善人类生活质量、持续成长能力的优质企业。

#### 1) 创新能力强

本基金所指的创新，包括创新的产品及服务、重大新技术的应用、创新的商业模式、创新的企业制度等。具体而言，本基金将重点筛选出具有以下特征的上市公司：

a. 拥有创新产品和服务的企业。具体而言是指企业生产出与竞争对手有所不同的产品或服务，或者是全新的产品，或者是增加、改变了原有产品的功能和效用。通过这种创新产品或服务，客户可以获得新的需求满足，或更多的需求满足。

b. 拥有重大新技术应用的企业。具体而言是指企业改进、改善生产方法，创造出高于竞争对手的生产效率，或者创造出更高质量或拥有更好客户体验的产品或服务，或者通过技术创新降低成本投入。

c. 拥有创新商业模式的企业。具体而言是指企业把新的商业模式引入社会的生产体系，在生产、营销、服务领域引入全新的盈利方式，以实现企业的先发优势或核心竞争力的提升。

d. 拥有创新企业制度的企业，具体而言是指企业的组织方式、产权结构、管理体制的创新，通过这种创新可以调整企业中所有者、经营者、劳动者的权利和利益关系，使企业生产力得以释放，从而提高企业盈利能力。

本基金将通过对产品和服务创新、技术创新、商业模式创新、企业制度创新等进行分析，深入挖掘在商业模式、生产过程、企业管理等方面具有创新能力的企业。因而与本基金相关的行业包括但不限于节能环保、互联网技术、传媒、通信、医药、医疗服务、高端装备制造、新能源、新材料、汽车及家电等行业。由于创新是一个与时俱进动态更新的概念，本基金将根据经济发展状况、产业结构升级、各类技术发展以及国家的相关政策等因素动态调整创新所包括的产业领域和行业范畴。

#### 2) 持续成长性

本基金重点考察具有以上创新特征的企业在创新的可持续性、创新的可复制性、创新最终导致的企业盈利和竞争实力方面的变化情况，精选出创新较强并具有爆发式增长潜力、受益于中国经济转型、具有持续成长性的企业。本基金所指持续成长性具体如下：

- a. 公司的创新行为带来主营业务突出、竞争优势明显；
- b. 公司具有持续的成长能力和成长潜力；
- c. 较高的公司治理水平和优秀的管理能力。

#### （2）股票投资策略

本基金将选择股票池中具有如下特征的股票进行重点投资。

- 1) 所处行业景气向上且可持续。
- 2) 行业竞争格局良好且公司占据领先地位或具有领先潜力。
- 3) 公司提供的产品或服务市场空间大、竞争力强，具有爆发性增长潜力。
- 4) 公司治理完善、团队优秀。

本基金将根据上市公司的行业特性及公司本身的特点，选择合适的股票估值方法，通过考量备选股票的内在价值、P/E、P/B、EV/EBITDA、PEG 等指标，确定对其配置或调整的时机。

#### （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，不使用合格境内机构投资者(QDII)境外投资额度进行境外投资。本基金将优先将基本面健康、业绩向上弹性较大、具有估值优势的港股纳入本基金的股票投资组合。

#### 3、存托凭证投资策略

对于存托凭证投资，本基金将在深入研究的基础上，通过定性分析和定量分析相结合的方式，精选出具有比较优势的存托凭证进行投资。

#### 4、债券投资策略

在债券投资策略方面，本基金将在综合研究的基础上实施积极主动的组合管理，采用宏观环境分析和微观市场定价分析两个方面进行债券资产的投资。在宏观环境分析方面，结合对宏观经济、市场利率、债券供求等因素的综合分析，根据交易所市场与银行间市场类属资产的风险收益特征，定期对投资组合类属资产进行优化配置和调整，确定不同类属资产的最优权重。

在微观市场定价分析方面，本基金以中长期利率趋势分析为基础，结合经济趋势、货币政策及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素，重点选择那些流动性较好、风险水平合理、到期收益率与信用质量相对较高的债券品种。具体投资策略有收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略等积极投资策略构建债券投资组合。

#### 5、权证投资策略

本基金将权证的投资作为提高基金投资组合收益的辅助手段。根据权证对应公司基本面研究成果确定权证的合理估值，发现市场对股票权证的非理性定价；利用权证衍生工具的特性，通过权证与证券的组合投资，来达到改善组合风险收益特征的目的。

#### 6、资产支持证券投资策略

本基金通过对资产支持证券发行条款的分析、违约概率和提前偿付比率的预估，借用必要的数量模型来谋求对资产支持证券的合理定价，在严格控制风险、充分考虑风险补偿收益和市场流动性的条件下，谨慎选择风险调整后收益较高的品种进行投资。

本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。

#### 7、股指期货投资策略

本基金以套期保值为目的，参与股指期货交易。

本基金参与股指期货投资时机和数量的决策建立在对证券市场总体行情的判断和组合风险收益分析的基础上。基金管理人将根据宏观经济因素、政策及法规因素和资本市场因素，结合定性和定量方法，确定投资时机。基金管理人将结合股票投资的总体规模，以及中国证监会的相关限定和要求，确定参与股指期货交易的投资比例。

基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

基金管理人将在进行股指期货投资前将建立股指期货投资决策部门或小组，负责股指期货的投资管理的相关事项，同时针对股指期货投资管理制定投资决策流程和风险控制等制度，并经基金管理人董事会批准后执行。

若相关法律法规发生变化时，基金管理人期货投资管理从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。

### （四）投资决策依据及程序

#### 1、决策依据

以《基金法》、基金合同、公司章程等有关法律法规为决策依据，并以维护基金份额持有人利益作为最高准则。

#### 2、决策程序

（1）投资决策委员会制定整体投资战略。

（2）研究部根据自身以及其他研究机构的研究成果，构建股票备选库、精选库，对拟投资对象进行持续跟踪调研，并提供个股、债券决策支持。

（3）基金经理根据投资决策委员会的投资战略，设计和调整投资组合。设计和调整投资组合需要考虑的基本因素包括：每日基金申购和赎回净现金流量；基金合同的投资限

制和比例限制；研究员的投资建议；基金经理的独立判断；绩效与风险评估小组的建议等。

(4) 投资决策委员会对基金经理提交的方案进行论证分析，并形成决策纪要。

(5) 根据决策纪要，基金经理小组构造具体的投资组合及操作方案，交由交易部执行。

(6) 交易部按有关交易规则执行，并将有关信息反馈基金经理。

(7) 基金绩效评估岗及风险管理岗定期进行基金绩效评估，并向投资决策委员会提交综合评估意见和改进方案。

(8) 风险控制委员会对识别、防范、控制基金运作各个环节的风险全面负责，尤其重点关注基金投资组合的风险状况；基金绩效评估岗及风险管理岗重点控制基金投资组合的市场风险和流动性风险。

### （五）业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×55%+恒生指数收益率×15%+中证全债指数收益率×30%。

业绩比较基准选择理由：

沪深 300 指数是由中证指数有限公司编制发布、表征 A 股市场走势的权威指数。该指数是由上海和深圳证券交易所中选取 300 只 A 股作为样本编制而成的成份股指数。其样本覆盖了沪深市场六成左右的市值，具有良好的市场代表性。本基金选择该指数来衡量股票投资部分的绩效。

恒生指数是由恒生指数服务有限公司编制，以香港股票市场中的 50 家上市股票为成份股样本，以其发行量为权数的加权平均股价指数，是反映香港股市价幅趋势最有影响的一种股价指数。本基金选择该指数来衡量港股投资部分的绩效。

中证全债指数是中证指数有限公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数。该指数的样本由银行间市场和沪深交易所市场的国债、金融债券及企业债券组成，中证指数有限公司每日计算并发布中证全债的收盘指数及相应的债券属性指标。该指数的一个重要特点在于对异常价格和无价情况下使用了模型价，能更为真实地反映债券的实际价值和收益率特征。本基金选择该指数来衡量债券投资部分的绩效。

根据本基金的投资范围和投资比例约束，设定本基金的基准为沪深 300 指数收益率×55%+恒生指数收益率×15%+中证全债指数收益率×30%，该基准能客观衡量本基金的投资绩效。

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，本基金管理人协商基金托管人后可以在报中国证监会备案以后变更业绩比较基准并及时公告，但不需要召集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，属于中高风险收益的投资品种，其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金，低于股票型基金。本基金如果投资港股通标的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。

## （七）投资限制

### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金股票投资占基金资产的比例为 0-95%（其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的 0-95%，投资于港股通标的股票的比例占基金资产的 0-95%），其中投资于创新成长主题相关证券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需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；

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

（4）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券（同一家公司在境内和香港同时上市的 A+H 股合并计算），不超过该证券的 10%；

（5）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

（6）本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

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

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

（9）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

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

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

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

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

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

(15) 本基金投资流通受限证券，基金管理人应事先根据中国证监会相关规定，与基金托管人在本基金托管协议中明确基金投资流通受限证券的比例，根据比例进行投资。基金管理人应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；

(16) 本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；

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

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

(19) 本基金投资单只中期票据的额度不得超过其发行总额度的 10%，并且不得超过基金资产净值的 10%；

(20) 本基金参与股指期货交易，应遵循下列要求：

1) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值不得超过基金资产净值的 10%；

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

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

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

5) 本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；

(21) 本基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

(22) 本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行，与境内上市交易的股票合并计算；

(23) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。



基金管理人运用基金财产投资证券衍生品种的，应当根据风险管理的原则，并制定严格的授权管理制度和投资决策流程。基金管理人运用基金财产投资证券衍生品种的具体比例，应当符合中国证监会的有关规定。

本基金在开始进行股指期货投资之前，应与基金托管人就股指期货清算、估值、交割等事宜另行具体协商。

除上述第（2）、（12）、（17）、（18）项外，因证券、期货市场波动、上市公司合并、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。

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。

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，则本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准，但须提前公告，不需要经基金份额持有人大会审议。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- （1）承销证券；
- （2）违反规定向他人贷款或者提供担保；
- （3）从事承担无限责任的投资；
- （4）买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；
- （5）向其基金管理人、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其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，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。

如法律法规或监管部门取消或变更上述禁止性规定，本基金可不受上述规定的限制，或以变更后的规定为准，但须提前公告，不需要经基金份额持有人大会审议。

### （八）基金管理人代表基金行使股东权利及债权人权利的处理原则及方法

- 1、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；
- 2、有利于基金资产的安全与增值；

3、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金份额持有人的利益；

4、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利，保护基金份额持有人的利益。

#### （九）侧袋机制的实施和投资运作安排

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

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

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

#### （十）基金的投资组合报告

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

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

本投资组合报告所载数据截至 2023 年 09 月 30 日（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	224,229,133.39	34.94
-	其中：股票	224,229,133.39	34.94
2	基金投资	0.00	0.00
3	固定收益投资	656,078.40	0.10
-	其中：债券	656,078.40	0.10
-	资产支持证券	0.00	0.00
4	贵金属投资	0.00	0.00
5	金融衍生品投资	0.00	0.00
6	买入返售金融资产	0.00	0.00
-	其中：买断式回购的买入返售金融资产	0.00	0.00

7	银行存款和结算备付金合计	416,284,365.33	64.87
8	其他资产	534,728.00	0.08
9	合计	641,704,305.12	100.00

注：权益投资中通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 39,856,203.77 元，占资产净值比例 6.23%。

## 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	0.00	0.00
B	采矿业	0.00	0.00
C	制造业	91,863,497.71	14.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	0.00	0.00
E	建筑业	0.00	0.00
F	批发和零售业	0.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	0.00	0.00
H	住宿和餐饮业	0.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	66,200,788.56	10.36
J	金融业	0.00	0.00
K	房地产业	0.00	0.00
L	租赁和商务服务业	0.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	6,179,121.85	0.97
N	水利、环境和公共设施管理业	0.00	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	0.00	0.00
P	教育	0.00	0.00
Q	卫生和社会工作	0.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	20,129,521.50	3.15
S	综合	0.00	0.00
-	合计	184,372,929.62	28.84

### 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（%）
非必需消费品	14,633,069.38	2.29
必需消费品	25,223,134.39	3.95
合计	39,856,203.77	6.23

注：以上分类采用彭博行业分类标准（BICS）。

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	06969	思摩尔国际	3,866,000	25,223,134.39	3.95
2	688276	百克生物	277,160	17,871,276.80	2.80
3	300525	博思软件	990,380	15,697,523.00	2.46
4	00772	阅文集团	556,600	14,633,069.38	2.29
5	600845	宝信软件	291,580	13,173,584.40	2.06
6	002739	万达电影	885,400	11,935,192.00	1.87
7	301093	华兰股份	256,700	8,984,500.00	1.41
8	688515	裕太微	76,475	8,909,337.50	1.39
9	300413	芒果超媒	289,450	8,194,329.50	1.28
10	688089	嘉必优	397,389	7,776,902.73	1.22

注：所用证券代码采用当地市场代码。

### 4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	0.00	0.00
2	央行票据	0.00	0.00
3	金融债券	0.00	0.00
-	其中：政策性金融债	0.00	0.00
4	企业债券	0.00	0.00
5	企业短期融资券	0.00	0.00
6	中期票据	0.00	0.00
7	可转债（可交换债）	656,078.40	0.10
8	同业存单	0.00	0.00
9	其他	0.00	0.00

10	合计	656,078.40	0.10
----	----	------------	------

**5. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细**

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	118044	赛特转债	4,900	490,042.96	0.08
2	118032	建龙转债	1,480	166,035.44	0.03

注：本基金本报告期末仅持有以上债券。

**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**  
 无。

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

**8. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**  
 无。

**9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**
**9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**  
 无。

**9.2 本基金投资股指期货的投资政策**  
 无。

**10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**
**10.1 本期国债期货投资政策**  
 无。

**10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**  
 无。

**10.3 本期国债期货投资评价**  
 无。

**11. 投资组合报告附注**

11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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 本基金投资的前十名股票没有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	501,114.84
2	应收证券清算款	0.00
3	应收股利	0.00

4	应收利息	0.00
5	应收申购款	33,613.16
6	其他应收款	0.00
7	其他	0.00
8	合计	534,728.00

#### 11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	118032	建龙转债	166,035.44	0.03

#### 11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

#### 11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

### （十一）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资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

#### 前海开源沪港深创新成长混合 A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
2016.6.24- 2016.12.31	0.10%	0.60%	4.56%	0.54%	-4.46%	0.06%
2017.1.1- 2017.12.31	50.32%	0.95%	15.33%	0.44%	34.99%	0.51%
2018.1.1- 2018.12.31	-23.26%	1.24%	-14.06%	0.89%	-9.20%	0.35%
2019.1.1- 2019.12.31	29.20%	1.23%	22.35%	0.78%	6.85%	0.45%
2020.1.1- 2020.12.31	10.14%	1.00%	15.39%	0.95%	-5.25%	0.05%

2021.1.1- 2021.12.31	37.66%	1.60%	-3.05%	0.78%	40.71%	0.82%
2022.1.1- 2022.12.31	-28.17%	1.31%	-13.20%	0.95%	-14.97%	0.36%
2023.1.1- 2023.9.30	-0.79%	1.14%	-2.81%	0.63%	2.02%	0.51%
2016.6.24- 2023.9.30	61.20%	1.20%	19.67%	0.78%	41.53%	0.42%

前海开源沪港深创新成长混合 C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
2016.6.24- 2016.12.31	-0.10%	0.59%	4.56%	0.54%	-4.66%	0.05%
2017.1.1- 2017.12.31	49.29%	0.96%	15.33%	0.44%	33.96%	0.52%
2018.1.1- 2018.12.31	-23.41%	1.24%	-14.06%	0.89%	-9.35%	0.35%
2019.1.1- 2019.12.31	29.16%	1.24%	22.35%	0.78%	6.81%	0.46%
2020.1.1- 2020.12.31	9.96%	1.00%	15.39%	0.95%	-5.43%	0.05%
2021.1.1- 2021.12.31	37.50%	1.60%	-3.05%	0.78%	40.55%	0.82%
2022.1.1- 2022.12.31	-28.23%	1.31%	-13.20%	0.95%	-15.03%	0.36%
2023.1.1- 2023.9.30	-0.87%	1.14%	-2.81%	0.63%	1.94%	0.51%



2016.6.24- 2023.9.30	58.70%	1.20%	19.67%	0.78%	39.03%	0.42%
-------------------------	--------	-------	--------	-------	--------	-------



## 十、基金的财产

### （一）基金资产总值

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

### （二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### （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。

## 十一、基金资产的估值

### （一）估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券、期货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开放日。

### （二）估值对象

基金所拥有的股票、权证、股指期货合约、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、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；同一股票同时在两个或两个以上市场交易的，按股票所处的市场分别估值；

（2）在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（另有规定的除外），选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值；

（3）对在交易所市场上市交易的可转换债券，按照每日收盘价作为估值全价；

（4）对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募证券，估值日不存在活跃市场时采用估值技术确定其公允价值进行估值。如成本能够近似体现公允价值，应持续评估上述做法的适当性，并在情况发生改变时做出适当调整。

#### 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的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

（3）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计量日的公允价值进行估值；对于活跃市场报价未能代表计量日公允价值的情况下，按成本应对市场报价进行调整，确认计量日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，则采用估值技术确定公允价值；

（4）首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3、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、存款的估值方法

持有的银行定期存款或通知存款以本金列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入。

#### 5、投资证券衍生品的估值方法

（1）从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的权证按估值日在证券交易所挂牌的该权证的收盘价估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考监管机构或行业协会有关规定，或者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，确定公允价值。

（2）首次发行未上市的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

（3）因持有股票而享有的配股权，以及停止交易但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值进行估值。在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行估值。

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

7、本基金可以采用第三方估值机构按照上述公允价值确定原则提供的估值价格数据。

8、估值计算中涉及到港币、美元、英镑、欧元、日元等主要货币对人民币汇率的，以基金估值日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价为准。

9、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。

10、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

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

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

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

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

#### （四）估值程序

1、基金份额净值是按照每个估值日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到0.001元，小数点后第4位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人于每个估值日计算基金资产净值及两类基金份额净值，并按规定公告。

2、基金管理人应每个估值日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个估值日对基金资产估值后，将两类基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

#### （五）估值错误的处理

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

基金合同的当事人应按照以下约定处理：

##### 1、估值错误类型

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

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

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

##### 2、估值错误处理原则

（1）估值错误已发生，但尚未给当事人造成损失时，估值错误责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正估值错误发生的费用由估值错误责任方承担；由于估值错误责任方未及时更正已产生的估值错误，给当事人造成损失的，由估值错误责任方对直接损失

承担赔偿责任；若估值错误责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责任。估值错误责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保估值错误已得到更正。

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

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

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

### 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

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

### 4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

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

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

(3) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

### (六) 暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券、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、出现基金管理人认为属于会导致基金管理人不能出售或评估基金资产的紧急事故的任何情况；

- 4、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一致的；
- 5、法律法规、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

#### （七）基金净值的确认

用于基金信息披露的基金资产净值和两类基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个估值日交易结束后计算当日的基金资产净值和两类基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金净值予以公布。

#### （八）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，暂停披露侧袋账户基金净值信息。

#### （九）特殊情形的处理

基金管理人、基金托管人按估值方法的第 10 项进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

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

## 十二、基金的收益分配

### （一）基金利润的构成

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

### （二）基金可供分配利润

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

### （三）基金收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，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；若投资者选择红利再投资方式进行收益分配，收益的计算以权益登记日当日收市后计算的两类基金份额净值为基准转为相应类别的基金份额进行再投资；

3、基金收益分配后两类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的两类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、本基金两类基金份额在费用收取上不同，其对应的可分配收益可能有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在对基金份额持有人利益无实质不利影响的情况下，基金管理人可在法律法规允许的前提下酌情调整以上基金收益分配原则，此项调整不需要召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在指定媒介公告。

### （四）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。由于不同基金份额类别对应的可分配收益不同，基金管理人可相应制定不同的收益分配方案。

### （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，依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过 15 个工作日。

### （六）基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为相应类别的基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。

#### **（七）实施侧袋机制期间的收益分配**

本基金实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配，详见本招募说明书“侧袋机制”章节的规定。



## 十三、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、销售服务费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、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、证券、期货账户开户费用、银行账户维护费用；
- 10、因投资港股通标的股票而产生的各项合理费用；
- 11、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

### （二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

#### 2、基金托管人的托管费

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

#### 3、基金的销售服务费

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 0.10%。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。

销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.10% 年费率计提。计算方法如下：

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

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

销售服务费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。销售服务费由登记机构代收并按照相关合同规定支付给基金销售机构。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

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

### （三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

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

（四）基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率和销售服务费率等相关费率。降低基金管理费率、基金托管费率和销售服务费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须依照有关规定于新的费率实施日前在指定媒介刊登公告。

### （五）实施侧袋机制期间的基金费用

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

### （六）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。

## 十四、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；
- 3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
- 4、会计制度执行国家有关会计制度；
- 5、本基金独立建账、独立核算；
- 6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；
- 7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

### （二）基金的年度审计

- 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的具有证券、期货相关从业资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意。
- 3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所需按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

## 十五、基金的信息披露

（一）本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《基金合同》及其他有关规定。相关法律法规对信息披露的披露方式、登载媒介、报备方式等规定发生变化时，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中国证监会指定的全国性报刊（以下简称“指定报刊”）及指定互联网网站（以下简称“指定网站”）等媒介披露，并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

（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。同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证不同文本的内容一致。不同文本之间发生歧义的，以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

### （五）公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

- 1、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指定网站上；基金招募说明书其

他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。

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

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

基金募集申请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，将基金招募说明书、《基金合同》摘要登载在指定媒介上；基金管理人、基金托管人应当将《基金合同》、基金托管协议登载在网站上。

## 2、基金份额发售公告

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

## 3、《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备案文件的次日在指定媒介上登载《基金合同》生效公告。

## 4、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公告一次基金资产净值和两类基金份额净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过指定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日的两类基金份额净值和两类基金份额累计净值。

基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在指定网站披露半年度和年度最后一日的两类基金份额净值和两类基金份额累计净值。

## 5、基金份额申购、赎回价格

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

## 6、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，将年度报告登载在指定网站上，并将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计。

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

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

《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。

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。

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

## 7、临时报告

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

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

- (1) 基金份额持有人大会的召开及决定的事项；
- (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) 基金份额净值计价错误达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) 基金信息披露义务人认为可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的其他事项或中国证监会规定的其他事项。

## 8、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。

## 9、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，应当依法报国务院证券监督管理机构备案，并予以公告。

## 10、基金投资股指期货的信息披露

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

## 11、基金投资资产支持证券的信息披露

若本基金投资了资产支持证券，需按照法规要求在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露资产支持证券的交易情况。基金管理人应在基金年报及中期报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产

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

#### 12、基金投资港股通标的股票的相关公告

基金管理人应当在基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中按届时有效的法律法规或监管机构的要求披露港股通标的股票的投资情况。若中国证监会对公开募集证券投资基金通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资香港股票市场的信息披露另有规定的，从其规定。

#### 13、实施侧袋机制期间的信息披露

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

#### 14、中国证监会规定的其他信息。

### （六）信息披露事务管理

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

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

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

基金管理人、基金托管人应当在指定报刊中选择一家报刊披露本基金信息。基金管理人、基金托管人应当向中国证监会基金电子披露网站报送拟披露的基金信息，并保证相关报送信息的真实、准确、完整、及时。

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

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

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

### （七）信息披露文件的存放与查阅



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

**（八）暂停或延迟信息披露的情形**

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；
- 2、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；
- 3、出现基金管理人认为属于会导致基金管理人不能出售或评估基金资产的紧急事故的任何情况；
- 4、法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的情况。

**（九）本基金信息披露事项以法律法规规定及本章节约定的内容为准。**

## 十六、侧袋机制

### （一）侧袋机制的实施条件、实施程序和特定资产范围

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

特定资产包括：（1）无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性的资产；（2）按摊余成本计量且计提资产减值准备仍导致资产价值存在重大不确定性的资产；（3）其他资产价值存在重大不确定性的资产。

### （二）侧袋机制实施期间的基金运作安排

#### 1、基金份额的申购与赎回

##### （1）侧袋账户

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

##### （2）主袋账户

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

（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基金估值，并暂停接受基金申购赎回申请或延缓支付赎回款项。

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

#### 2、基金份额的登记

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

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

侧袋账户资产完全清算后，基金管理人将注销侧袋账户。

#### 3、基金的投资及业绩

侧袋机制实施期间，本基金的各项投资运作指标和基金业绩指标应当以主袋账户资产为基准。基金管理人不得在侧袋账户中进行除特定资产处置变现以外的其他投资操作。

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

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

#### 4、基金的估值

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

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

#### 5、基金的费用

侧袋机制实施期间，侧袋账户资产不收取管理费。因启用侧袋机制产生的咨询、审计费用等由基金管理人承担。

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

#### 6、基金的收益分配

侧袋机制实施期间，在主袋账户份额满足基金合同收益分配条件的情形下，基金管理人可对主袋账户份额进行收益分配。侧袋账户不进行收益分配。

#### 7、基金的信息披露

##### （1）基金净值信息

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

##### （2）定期报告

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

- 1) 侧袋账户的基金代码、基金名称、侧袋账户成立日期等基本信息；
- 2) 侧袋账户的初始资产、初始负债；
- 3) 特定资产的名称、代码、发行人等基本信息；
- 4) 报告期内的特定资产处置进展情况、与处置特定资产相关的费用情况及其他与特定资产状况相关的信息；

5) 可根据特定资产处置进展情况披露特定资产的可变现净值或净值参考区间, 该净值或净值区间并不代表特定资产最终的变现价格, 不作为基金管理人对特定资产最终变现价格的承诺;

6) 可能对投资者利益存在重大影响的其他情况及相关风险提示。

### (3) 临时报告

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

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

处置特定资产的临时公告内容应当包括特定资产处置价格和时间、向侧袋账户份额持有人支付的款项、相关费用发生情况等重要信息。侧袋机制实施期间, 若侧袋账户资产无法一次性完成处置变现, 基金管理人在每次处置变现后均将按规定及时发布临时公告。

## 8、特定资产处置清算

基金管理人将按照基金份额持有人利益最大化原则, 采取将特定资产予以处置变现等方式, 及时向侧袋账户份额持有人支付对应款项。无论侧袋账户资产是否全部完成变现, 基金管理人都将及时向侧袋账户份额持有人支付已变现部分对应的款项。

## 9、侧袋的审计

基金管理人应当在启用侧袋机制和终止侧袋机制后, 及时聘请符合《证券法》规定的会计师事务所进行审计并披露专项审计意见, 具体如下:

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

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

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

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

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

## 十七、风险揭示

本基金的风险主要包括：市场风险、信用风险、管理风险、流动性风险、操作和技术风险、合规性风险、股指期货投资风险、本基金特有的风险、启用侧袋机制的风险、其他风险及本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等。

### （一）市场风险

基金主要投资于证券市场，而证券市场价格因受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响而产生波动，从而导致基金收益水平发生变化，产生风险。主要的风险因素包括：

#### 1、政策风险

因财政政策、货币政策、产业政策、地区发展政策等国家宏观政策发生变化，导致市场价格波动，影响基金收益而产生风险。

#### 2、经济周期风险

随着经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化，基金投资的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。利率直接影响着债券的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。基金投资于债券和股票，其收益水平可能会受到利率变化的影响。

#### 4、上市公司经营风险

上市公司的经营状况受多种因素的影响，如管理能力、行业竞争、市场前景、技术更新、财务状况、新产品研究开发等都会导致公司盈利发生变化。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。上市公司还可能出现难以预见的变化。虽然基金可以通过投资多样化来分散这种非系统风险，但不能完全避免。

#### 5、通货膨胀风险

基金投资的目的是基金资产的保值增值，如果发生通货膨胀，基金投资于证券所获得的收益可能会被通货膨胀抵消，从而影响基金资产的保值增值。

#### 6、债券收益率曲线变动的风险

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。

#### 7、再投资风险

市场利率下降将影响固定收益类证券利息收入的再投资收益率，这与利率上升所带来的价格风险互为消长。

### （二）信用风险

基金在交易过程中可能发生交收违约或者所投资债券的发行人违约、拒绝支付到期本息等情况，从而导致基金资产损失。

### （三）管理风险

基金管理人的专业技能、研究能力及投资管理水平直接影响到其对信息的占有、分析和对经济形势、证券价格走势的判断，进而影响基金的投资收益水平。同时，基金管理人的投资管理制度、风险管理和内部控制制度是否健全，能否有效防范道德风险和其他合规性风险，以及基金管理人的职业道德水平等，也会对基金的风险收益水平造成影响。

### （四）流动性风险

1、我国证券市场作为新兴转轨市场，市场整体流动性风险较高。基金投资组合中的股票和债券会因各种原因面临较高的流动性风险，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，基金投资者的赎回需求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股原则的基础上，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。

#### 2、本基金主要的流动性风险管理方法说明

（1）在申购、赎回安排方面，本基金将加强对开放式基金申购环节的管理，合理控制基金份额持有人集中度，审慎确认大额申购申请，在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，基金管理人将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对基金规模予以控制，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。

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

（3）在本基金出现巨额赎回情形下，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况或巨额赎回份额占比情况决定全额赎回或部分延期赎回。同时，如本基金单个基金份额持有人在单个开放日申请赎回基金份额超过基金总份额一定比例以上的，基金管理人有权实施延期办理赎回申请的措施。具体内容详见本招募说明书第八章。

（4）本基金可能实施备用的流动性风险管理工具，以更好地应对流动性风险。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，可依照法律法规及基金合同的约定，综合运用各类流动性风险管理工具，对赎回申请等进行适度调整，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：1）延期办理巨额赎回申请；2）暂停接受赎回申请；3）延缓支付赎回款项；4）收取短期赎回费，本基金对持续持

有期少于7日的投资者收取不低于1.5%的赎回费；5）暂停基金估值，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一致，本基金将暂停基金估值；6）实施侧袋机制。

当基金管理人实施流动性风险管理工具时，可能对投资者具有一定的潜在影响，包括但不限于不能申购本产品、赎回申请不能确认或者赎回款项延迟到账、如持有期限少于7日会产生较高的赎回费造成收益损失等。提示投资者了解自身的流动性偏好、合理做好投资安排。

#### （五）操作和技术风险

基金的相关当事人在各业务环节的操作过程中，可能因内部控制不到位或者人为因素造成操作失误或违反操作规程而引致风险，如越权交易、内幕交易、交易错误和欺诈等。

此外，在开放式基金的后台运作中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行甚至导致基金份额持有人利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理人、基金托管人、登记机构、销售机构、证券交易所和证券登记结算机构等。

#### （六）合规性风险

指基金管理或运作过程中，违反国家法律、法规或基金合同有关规定的风险。

#### （七）股指期货投资风险

1、基差风险。标的股票指数价格与股指期货价格之间的价差被称为基差。在股指期货交易中因基差波动的不确定性而导致的风险被称为基差风险；

2、合约品种差异造成的风险。合约品种差异造成的风险，是指类似的合约品种，在相同因素的影响下，价格变动不同。表现为两种情况：A. 价格变动的方向相反；B. 价格变动的幅度不同。类似合约品种的价格，在相同因素作用下变动幅度上的差异，也构成了合约品种差异的风险；

3、标的物风险。股指期货交易中，标的物风险是由于投资组合与股指期货的标的指数的结构不完全一致，导致投资组合特定风险无法完全锁定所带来的风险；

4、衍生品模型风险。本基金在构建股指期货组合时，可能借助模型进行期货合约的选择。由于模型设计、资本市场的剧烈波动或不可抗力，按模型结果调整股指期货合约或者持仓比例也可能将给本基金的收益带来影响。

#### （八）本基金特有的风险

本基金为主动管理灵活配置混合型基金，其投资风格和投资范围决定了本基金具有如下特有风险：

##### 1、股票最低仓位风险

基金管理人重视股票投资风险的防范，虽然股票投资仓位在0% - 95%内灵活配置，但无法完全规避股票市场的下跌风险。

##### 2、资产配置偏离优化水平风险

本基金为混合型基金，资产配置策略对基金的投资业绩具有较大的影响。在类别资产配置中可能会由于市场环境、公司治理、制度建设等因素的不同影响，导致资产配置偏离优化水平，为组合绩效带来风险。

### 3、港股交易失败风险

本基金可通过港股通投资于港股，现行的港股通规则，对港股通设有每日额度上限的限制；本基金可能因为港股通市场每日额度不足，而不能买入看好之投资标的进而错失投资机会的风险。在香港联合交易所开市前阶段，当日额度使用完毕的，新增的买单申报将面临失败的风险；在香港联合交易所持续交易时段，当日额度使用完毕的，当日本基金将面临不能通过港股通进行买入交易的风险。

### 4、汇率风险

本基金将投资港股通标的股票，在交易时间内提交订单依据的港币买入参考汇率和卖出参考汇率，并不等于最终结算汇率。港股通交易日日终，中国证券登记结算有限责任公司进行净额换汇，将换汇成本按成交金额分摊至每笔交易，确定交易实际适用的结算汇率。故本基金投资面临汇率风险。

### 5、境外市场的风险

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

(2) 香港市场交易规则有别于内地A股市场规则，参与香港股票投资还将面临包括但不限于如下特殊风险：

1) 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。

2) 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。

3) 香港出现台风、黑色暴雨或者香港联合交易所规定的其他情形时，香港联合交易所将可能停市，投资者将面临在停市期间无法进行交易的风险；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，投资者将面临在暂停服务期间无法进行港股通交易的风险。

4) 投资者因港股通股票权益分派、转换、上市公司被收购等情形或者异常情况，所取得的港股通股票以外的香港联合交易所上市证券，只能通过港股通卖出，但不得买入，交易所另有规定的除外；因港股通股票权益分派或者转换等情形取得的香港联合交易所上市股票的认购权利在香港联合交易所上市的，可以通过港股通卖出，但不得行权；因港股



通股票权益分派、转换或者上市公司被收购等所取得的非香港联合交易所上市证券，可以享有相关权益，但不得通过港股通买入或卖出。

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

#### 6、投资于存托凭证的风险

本基金的投资范围包括存托凭证，可能面临存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与创新企业、境外发行人、存托凭证发行机制以及交易机制相关的风险，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；境内外证券交易机制、法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险。

#### 7、其他投资风险

本基金的投资风格和决策过程决定了本基金具有其他投资风险。例如，本基金还投资于股指期货、权证等高风险品种，相应的市场波动也可能给基金财产带来较高的风险。

#### （九）启用侧袋机制的风险

当本基金启用侧袋机制时，实施侧袋机制期间，侧袋账户份额将停止披露各类基金份额净值，并不得办理申购、赎回和转换。因特定资产的变现时间具有不确定性，最终变现价格也具有不确定性并且有可能大幅低于启用侧袋机制时的特定资产的估值，基金份额持有人可能因此面临损失。

#### （十）其他风险

1、因基金业务快速发展而在制度建设、人员配备、风险管理和内控制度等方面不完善而产生的风险；

2、因金融市场危机、行业竞争压力可能产生的风险；

3、战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，可能严重影响证券市场运行，导致基金资产损失；

4、其他意外导致的风险。

#### （十一）本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代销机构)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。

## 十八、基金的终止与清算

### （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，并自决议生效后两个工作日内在指定媒介公告。

### （二）基金合同的终止事由

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

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

### （三）基金财产的清算

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

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

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

4、基金财产清算程序：

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

5、基金财产清算的期限为6个月。

6、基金管理人与基金托管人协商一致或基金资产清算小组认为有对基金份额持有人更为有利的清算方法，本基金财产的清算可按该方法进行，并及时公告，不需召开基金份额持有人大会。相关法律法规或监管部门另有规定的，按相关法律法规或监管部门的要求办理。

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

#### **（七）基金财产清算账册及文件的保存**

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 十九、基金合同的内容摘要

### （一）基金合同当事人的权利、义务

#### 1、基金份额持有人的权利与义务

（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) 依法申请赎回或转让其持有的基金份额；
- 4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会；
- 5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- 6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- 7) 监督基金管理人的投资运作；
- 8) 对基金管理人、基金托管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；
- 9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

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

#### 2、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、期货经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；
  - 16) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则；
  - 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；

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

14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

26) 建立并保存基金份额持有人名册；

27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

### 3、基金托管人的权利与义务

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

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

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

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

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

5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

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

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



- 4) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；
- 5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
- 6) 按规定开设基金财产的资金账户、证券账户等投资所需账户，按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
- 7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露，但向监管机构、司法机关及审计、法律等外部专业顾问提供的除外；
- 8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购、赎回价格；
- 9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
- 10) 对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行；如果基金管理人未执行《基金合同》规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；
- 11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；
- 12) 建立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》、《托管协议》的规定监督基金管理人的投资运作；
- 17) 参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- 18) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人；
- 19) 因违反《基金合同》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- 20) 按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿；
- 21) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- 22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## （二）基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。除法律法规另有规定或基金合同另有约定外，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。

#### 1、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，法律法规、中国证监会另有规定或基金合同另有约定的除外：

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

（2）在不违背法律法规和基金合同的约定，以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

- 1) 调低基金管理费、基金托管费、销售服务费和其他应由基金财产承担的费用；
- 2) 法律法规要求增加的基金费用的收取；
- 3) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式；
- 4) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；
- 5) 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生重大变化；

6) 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；

7) 基金推出新业务或服务；

8) 按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

## 2、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。

## 3、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

1) 会议召开的时间、地点和会议形式；

2) 会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；

3) 有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；

4) 授权委托证明的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；

5) 会务常设联系人姓名及联系电话；

6) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；

7) 召集人需要通知的其他事项。

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

#### 4、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、中国证监会允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。基金管理人、基金托管人须为基金份额持有人行使投票权提供便利。

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

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

2) 经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的 50%（含 50%）。

(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会议通知载明的其他形式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址。

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 50%（含 50%）；

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) 如果参加基金份额持有人大会的持有人的基金份额低于在权益登记日基金总份额的 50%，则召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月后、六个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应有代表三分之一以上（含三分之一）基金份额的持有人参加，方可召开。

(4) 在法律法规或监管机构允许的情况下，经基金份额持有人大会会议通知载明，基金份额持有人也可以选择网络、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，为此，基金份额持有人需在会议通知载明的期限内，以会议通知载明的有效方式向会议召集人提交相应有效的表决票或授权委托书。

## 5、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 7 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 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。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。

## 6、表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

（1）一般决议，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）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》、与其他基金合并，应以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时监督员及公证机关均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。

## 7、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。

### 8、生效与公告

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

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 个工作日内在指定媒介上公告。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。

### 9、实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定

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

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

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

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

(4) 当参与基金份额持有人大会投票的基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日相关基金份额的二分之一，召集人在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3

个月以后、6个月以内就原定审议事项重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）相关基金份额的持有人参与或授权他人参与基金份额持有人大会投票；

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

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

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

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

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

10、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、监管规则的部分，如将来法律法规、监管规则修改导致相关内容被取消或变更的或法律法规、监管规则增加新的持有人大会机制的，基金管理人与基金托管人协商一致并提前公告后，可直接对本部分内容进行修改、调整或补充，无需经基金份额持有人大会审议。

### （三）基金收益分配原则、执行方式

#### 1、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。

#### 2、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。

#### 3、基金收益分配原则

（1）在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为12次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的10%，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；若投资者选择红利再投资方式进行收益分配，收益的计算以权



益登记日当日收市后计算的两类基金份额净值为基准转为相应类别的基金份额进行再投资；

（3）基金收益分配后两类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的两类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

（4）本基金两类基金份额在费用收取上不同，其对应的可分配收益可能有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

（5）法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在对基金份额持有人利益无实质不利影响的情况下，基金管理人可在法律法规允许的前提下酌情调整以上基金收益分配原则，此项调整不需要召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在指定媒介公告。

#### 4、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。由于不同基金份额类别对应的可分配收益不同，基金管理人可相应制定不同的收益分配方案。

#### 5、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，依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过15个工作日。

#### 6、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。

#### 7、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

#### 1、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）销售服务费；
- （4）《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- （5）《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、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) 证券、期货账户开户费用、银行账户维护费用；
- (10) 因投资港股通标的股票而产生的各项合理费用；
- (11) 按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

## 2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

### (1) 基金管理人的管理费

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

### (2) 基金托管人的托管费

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

### (3) 基金的销售服务费

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 0.10%。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。

销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.10% 年费率计提。计算方法如下：

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

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

销售服务费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出

具资金划拨指令。销售服务费由登记机构代收并按照相关合同规定支付给基金销售机构。

若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

上述“1、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。

### 3、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。

4、基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率和销售服务费率等相关费率。降低基金管理费率、基金托管费率和销售服务费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须依照有关规定于新的费率实施日前在指定媒介刊登公告。

### 5、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。

### 6、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。

## （五）基金财产的投资范围和投资限制

### 1、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（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内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、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券等）、资产支持证券、同业存单、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

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

基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的比例为 0-95%（其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的 0-95%，投资于港股通标的股票的比例占基金资产的 0-95%），其中投资于创新成长主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的 80%；持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，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、存出保证金和应收申购款等。

本基金所称的创新成长主题相关股票指的是在产品和服务、技术、商业模式、企业制度等方面具有创新能力的企业所发行的股票，隶属的行业包括但不限于节能环保、互联网技术、传媒、通信、医药、医疗服务、高端装备制造、新能源、新材料、汽车及家电等行业。

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

本基金参与股指期货交易，应符合法律法规规定和基金合同约定的投资限制并遵守相关期货交易所的业务规则。

## 2、投资限制

### （1）组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

1) 本基金股票投资占基金资产的比例为 0-95%（其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的 0-95%，投资于港股通标的股票的比例占基金资产的 0-95%），其中投资于创新成长主题相关证券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需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；

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

4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券（同一家公司在境内和香港同时上市的 A+H 股合并计算），不超过该证券的 10%；

5) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

6) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

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

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

9) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

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

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

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

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

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

15) 本基金投资流通受限证券,基金管理人应事先根据中国证监会相关规定,与基金托管人在本基金托管协议中明确基金投资流通受限证券的比例,根据比例进行投资。基金管理人应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;

16) 本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的15%;本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的30%;

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

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

19) 本基金投资单只中期票据的额度不得超过其发行总额度的10%,并且不得超过基金资产净值的10%;

20) 本基金参与股指期货交易,应遵循下列要求:

a) 本基金在任何交易日日终,持有的买入股指期货合约价值不得超过基金资产净值的10%;

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

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

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

e) 本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；

21) 本基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

22) 本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行，与境内上市交易的股票合并计算；

23) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

基金管理人运用基金财产投资证券衍生品种的，应当根据风险管理的原则，并制定严格的授权管理制度和投资决策流程。基金管理人运用基金财产投资证券衍生品种的具体比例，应当符合中国证监会的有关规定。

本基金在开始进行股指期货投资之前，应与基金托管人就股指期货清算、估值、交割等事宜另行具体协商。

除上述第 2)、12)、17)、18) 项外，因证券、期货市场波动、上市公司合并、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。

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本基金合同生效之日起开始。

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，则本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准，但须提前公告，不需要经基金份额持有人大会审议。

## （2）禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

1) 承销证券；

2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；

3) 从事承担无限责任的投资；

4) 买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；

5) 向其基金管理人、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其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，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。

如法律法规或监管部门取消或变更上述禁止性规定，本基金可不受上述规定的限制，或以变更后的规定为准，但须提前公告，不需要经基金份额持有人大会审议。

## （六）基金资产估值

### 1、估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券、期货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开放日。

### 2、估值对象

基金所拥有的股票、权证、股指期货合约、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

### 3、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、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；同一股票同时在两个或两个以上市场交易的，按股票所处的市场分别估值；

2) 在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（另有规定的除外），选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值；

3) 对在交易所市场上市交易的可转换债券，按照每日收盘价作为估值全价；

4) 对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募证券，估值日不存在活跃市场时采用估值技术确定其公允价值进行估值。如成本能够近似体现公允价值，应持续评估上述做法的适当性，并在情况发生改变时做出适当调整。

#### （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的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

3) 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计量日的公允价值进行估值；对于活跃市场报价未能代

表计量日公允价值的情况下，按成本应对市场报价进行调整，确认计量日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，则采用估值技术确定公允价值；

4) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

(3) 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) 存款的估值方法

持有的银行定期存款或通知存款以本金列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入。

#### (5) 投资证券衍生品的估值方法

1) 从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的权证按估值日在证券交易所挂牌的该权证的收盘价估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考监管机构或行业协会有关规定，或者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，确定公允价值。

2) 首次发行未上市的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

3) 因持有股票而享有的配股权，以及停止交易但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值进行估值。在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行估值。

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

(7) 本基金可以采用第三方估值机构按照上述公允价值确定原则提供的估值价格数据。

(8) 估值计算中涉及到港币、美元、英镑、欧元、日元等主要货币对人民币汇率的，以基金估值日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价为准。

(9) 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。

(10) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。



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

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

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

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

#### 4、估值程序

(1) 基金份额净值是按照每个估值日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到 0.001 元，小数点后第 4 位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人于每个估值日计算基金资产净值及两类基金份额净值，并按规定公告。

(2) 基金管理人应每个估值日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或本基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个估值日对基金资产估值后，将两类基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

#### 5、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。当本基金 A 类或 C 类基金份额净值小数点后 3 位以内(含第 3 位)发生估值错误时，视为基金份额净值错误。

本基金合同的当事人应按照以下约定处理：

##### (1) 估值错误类型

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

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

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

#### （2）估值错误处理原则

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

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

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

4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

#### （3）估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

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

#### （4）基金份额净值估值错误处理的方法如下：

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

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

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。

#### 6、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) 出现基金管理人认为属于会导致基金管理人不能出售或评估基金资产的紧急事故的任何情况；
- (4) 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一致的；
- (5) 法律法规、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

#### 7、基金净值的确认

用于基金信息披露的基金资产净值和两类基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个估值日交易结束后计算当日的基金资产净值和两类基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金净值予以公布。

#### 8、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，暂停披露侧袋账户基金净值信息。

#### 9、特殊情形的处理

基金管理人、基金托管人按估值方法的第（10）项进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

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

### **（七）基金合同变更、终止与基金财产的清算**

#### 1、《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，并自决议生效后两个工作日内在指定媒介公告。

#### 2、《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

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

### 3、基金财产的清算

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

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

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

（4）基金财产清算程序：

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

（5）基金财产清算的期限为 6 个月。

（6）基金管理人与基金托管人协商一致或基金资产清算小组认为有对基金份额持有人更为有利的清算方法，本基金财产的清算可按该方法进行，并及时公告，不需召开基金份额持有人大会。相关法律法规或监管部门另有规定的，按相关法律法规或监管部门的要求办理。

### 4、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。

### 5、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。

#### 6、基金财产清算的公告

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

#### 7、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

#### （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，任何一方当事人均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点为北京市，仲裁裁决是终局的，并对各方当事人均有约束力。除非仲裁裁决另有规定，仲裁费用、律师费用由败诉方承担。

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

《基金合同》受中国法律管辖。

#### （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。

## 二十、基金托管协议的内容摘要

### （一）基金托管协议当事人

#### 1、基金管理人

名称：前海开源基金管理有限公司

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

办公地址：深圳市福田区深南大道7006号万科富春东方大厦22楼

邮政编码：518040

法定代表人：李强

成立日期：2013年1月23日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监许可[2012]1751号

组织形式：有限责任公司

注册资本：人民币2亿元

存续期间：持续经营

经营范围：基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务。

#### 2、基金托管人

名称：中国建设银行股份有限公司（简称：中国建设银行）

住所：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

邮政编码：100033

法定代表人：王洪章

成立日期：2004年09月17日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]12号

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

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

### （二）基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

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

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内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、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券等）、资产支持证券、同业存单、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

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

基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的比例为0-95%（其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的0-95%，投资于港股通标的股票的比例占基金资产的0-95%），其中投资于创新成长主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的80%；持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的3%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，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、存出保证金和应收申购款等。

本基金所称的创新成长主题相关股票指的是在产品和服务、技术、商业模式、企业制度等方面具有创新能力的企业所发行的股票，隶属的行业包括但不限于节能环保、互联网技术、传媒、通信、医药、医疗服务、高端装备制造、新能源、新材料、汽车及家电等行业。

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

本基金参与股指期货交易，应符合法律法规规定和基金合同约定的投资限制并遵守相关期货交易所的业务规则。

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

（1）本基金股票投资占基金资产的比例为0-95%（其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的0-95%，投资于港股通标的股票的比例占基金资产的0-95%），其中投资于创新成长主题相关证券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需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；

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

(4) 本基金管理人管理的全部基金持有有一家公司发行的证券（同一家公司在境内和香港同时上市的 A+H 股合并计算），不超过该证券的 10%；基金托管人对本条款的监督义务仅限于其托管的基金管理人管理的基金；

(5) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

(6) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；基金托管人对本条款的监督义务仅限于其托管的基金管理人管理的基金；

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

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

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

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

(11) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；基金托管人对本条款的监督义务仅限于其托管的基金管理人管理的基金；

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

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

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

(15) 本基金持有的所有流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的 15%；本基金持有的同一流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的 5%；

(16) 本基金投资单只中期票据的额度不得超过其发行总额度的 10%，并且不得超过基金资产净值的 10%；

(17) 本基金管理人管理的且由本基金托管人托管的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市



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

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

(19) 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；

(20) 本基金参与股指期货交易，应遵循下列要求：

1) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值不得超过基金资产净值的 10%；

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

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

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

5) 本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；

(21) 本基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

(22) 本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行，与境内上市交易的股票合并计算；

(23) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

基金管理人运用基金财产投资证券衍生品种的，应当根据风险管理的原则，并制定严格的授权管理制度和投资决策流程。基金管理人运用基金财产投资证券衍生品种的具体比例，应当符合中国证监会的有关规定。

本基金在进行期货投资之前，应与基金托管人、期货公司三方一同就期货开户、清算、估值、交收等事宜另行签署《期货投资托管操作三方备忘录》。

除上述第（2）、（12）、（18）、（19）项外，因证券、期货市场波动、上市公司合并、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。

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。

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，则本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准，但须提前公告，不需要经基金份额持有人大会审议。

3、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对本托管协议第十五条第（九）款基金投资禁止行为通过事后监督方式进行监督。

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其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先的原则，防范利益冲突，相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并履行信息披露义务。

4、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的、经慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手名单，并约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金管理人应严格按照交易对手名单的范围在银行间债券市场选择交易对手。基金托管人监督基金管理人是否按事前提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易。基金管理人可以每半年对银行间债券市场交易对手名单及结算方式进行更新，新名单确定前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。如基金管理人根据市场情况需要临时调整银行间债券市场交易对手名单及结算方式的，应向基金托管人说明理由，并在与交易对手发生交易前3个工作日内与基金托管人协商解决。

基金管理人负责对交易对手的资信控制，按银行间债券市场的交易规则进行交易，并负责解决因交易对手不履行合同而造成的纠纷及损失，基金托管人不承担由此造成的任何法律责任及损失。若未履约的交易对手在基金托管人与基金管理人确定的时间前仍未承担违约责任及其他相关法律责任的，基金管理人可以对相应损失先行予以承担，然后再向相关交易对手追偿。基金托管人则根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督。如基金托管人事后发现基金管理人没有按照事先约定的交易对手或交易方式进行交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人，基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任。

5、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金管理人投资流通受限证券进行监督。

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。

（1）本基金投资的受限证券须为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。本基金不投资有锁定期但锁定期不明确的证券。

本基金投资的受限证券限于可由中国证券登记结算有限责任公司或中央国债登记结算有限责任公司负责登记和存管，并可在证券交易所或全国银行间债券市场交易的证券。

本基金投资的受限证券应保证登记存管在本基金名下，基金管理人负责相关工作的落实和协调，并确保基金托管人能够正常查询。因基金管理人原因产生的受限证券登记存管问题，造成基金托管人无法安全保管本基金资产的责任与损失，及因受限证券存管直接影响本基金安全的责任及损失，由基金管理人承担。

本基金投资受限证券，不得预付任何形式的保证金。

（2）基金管理人投资非公开发行股票，应制订流动性风险处置预案并经其董事会批准。风险处置预案应包括但不限于因投资受限证券需要解决的基金投资比例限制失调、基金流动性困难以及相关损失的应对解决措施，以及有关异常情况的处置。基金管理人应在首次投资流通受限证券前向基金托管人提供基金投资非公开发行股票相关流动性风险处置预案。

基金管理人对本基金投资受限证券的流动性风险负责，确保对相关风险采取积极有效的措施，在合理的时间内有效解决基金运作的流动性问题。如因基金巨额赎回或市场发生剧烈变动等原因而导致基金现金周转困难时，基金管理人应保证提供足额现金确保基金的支付结算，并承担所有损失。对本基金因投资受限证券导致的流动性风险，基金托管人不承担任何责任。如因基金管理人原因导致本基金出现损失致使基金托管人承担连带赔偿责任的，基金管理人应赔偿基金托管人由此遭受的损失。

（3）本基金投资非公开发行股票，基金管理人应至少于投资前三个工作日向基金托管人提交有关书面资料，并保证向基金托管人提供的有关资料真实、准确、完整。有关资料如有调整，基金管理人应及时提供调整后的资料。上述书面资料包括但不限于：

- 1) 中国证监会批准发行非公开发行股票的批准文件。
- 2) 非公开发行股票有关发行数量、发行价格、锁定期等发行资料。
- 3) 非公开发行股票发行人与中国证券登记结算有限责任公司或中央国债登记结算有限责任公司签订的证券登记及服务协议。
- 4) 基金拟认购的数量、价格、总成本、账面价值。

（4）基金管理人应在本基金投资非公开发行股票后两个交易日内，在中国证监会指定媒介披露所投资非公开发行股票的名称、数量、总成本、账面价值，以及总成本和账面价值占基金资产净值的比例、锁定期等信息。

本基金有关投资受限证券比例如违反有关限制规定，在合理期限内未能进行及时调整，基金管理人应在两个工作日内编制临时报告书，予以公告。

（5）基金托管人根据有关规定有权对基金管理人进行以下事项监督：

- 1) 本基金投资受限证券时的法律法规遵守情况。
- 2) 在基金投资受限证券管理工作方面有关制度、流动性风险处置预案的建立与完善情况。
- 3) 有关比例限制的执行情况。
- 4) 信息披露情况。

(6) 相关法律法规对基金投资受限证券有新规定的，从其规定。

6、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金资产净值计算、两类基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查。

7、基金托管人发现基金管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作违反法律法规、《基金合同》和本托管协议的规定，应及时以电话提醒或书面提示等方式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到书面通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函，就基金托管人的疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

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

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

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

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

侧袋机制实施期间的具体规则依照相关法律法规的规定和基金合同的约定执行。

### **(三) 基金管理人**对**基金托管人**的业务**核查**

1、基金管理人**对基金托管人履行托管职责情况进行核查**，核查事项包括基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户等投资所需账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和两类基金份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

2、基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、《基金合同》、本协议及其他有关规定时，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正。基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式给基金管理人发出回函，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复基金管理人并改正。

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

#### **（四）基金财产的保管**

##### **1、基金财产保管的原则**

（1）基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。

（2）基金托管人应安全保管基金财产。

（3）基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户等投资所需账户。

（4）基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立。

（5）基金托管人按照《基金合同》和本协议的约定保管基金财产，如有特殊情况双方可另行协商解决。基金托管人未经基金管理人的指令，不得自行运用、处分、分配本基金的任何资产（不包含基金托管人依据中国证券登记结算有限责任公司结算数据完成场内交易交收、开户银行或交易/登记机构扣收交易费、结算费和账户维护费等费用）。

（6）对于因为基金投资产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金账户的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金财产造成损失的，基金管理人应负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。

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

## 2、基金募集期间及募集资金的验资

(1) 基金募集期间募集认购款项应存于基金认购专用账户。该账户由基金管理人或基金管理人委托的登记机构开立并管理。

(2) 基金募集期满或基金停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，基金管理人应将募集到的属于基金财产的全部资金划入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，聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的 2 名或 2 名以上中国注册会计师签字方为有效。

(3) 若基金募集期限届满，未能达到基金备案的条件，由基金管理人按规定办理退款等事宜。

## 3、基金银行账户的开立和管理

(1) 基金托管人可以基金的名义在其营业机构开立基金的银行账户，并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。

(2) 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任何其他银行账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

(3) 基金银行账户的开立和管理应符合银行业监督管理机构的有关规定。

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

## 4、基金证券账户和结算备付金账户的开立和管理

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

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

(3) 基金证券账户的开立和证券账户卡的保管由基金托管人负责，账户资产的管理和运用由基金管理人负责。

证券账户开户费由本基金财产承担。此项开户费由基金管理人先行垫付，待托管产品启始运营后，基金管理人可向基金托管人发送划款指令，将代垫开户费从本产品托管资金账户中扣还基金管理人。账户开立后，基金托管人应及时将证券账户开通信息通知基金管理人。

(4) 基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户，并代表所托管的基金完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级法人清算工作，基金管理人应予以积极协助。结算备付金、结算保证金、交收资金等的收取按照中国

证券登记结算有限责任公司的规定以及基金管理人与基金托管人签署的《托管银行证券资金结算协议》执行。

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

#### 5、债券托管专户的开设和管理

《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，以本基金的名义在银行间市场登记结算机构开立债券托管账户，持有人账户和资金结算账户，并代表基金进行银行间市场债券的结算。基金管理人和基金托管人共同代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议。

#### 6、其他账户的开立和管理

（1）在本托管协议订立日之后，本基金被允许从事符合法律法规规定和《基金合同》约定的其他投资品种的投资业务时，如果涉及相关账户的开设和使用，由基金管理人协助托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定，开立有关账户。该账户按有关规则使用并管理。

（2）法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

#### 7、基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的有关实物证券、银行存款开户证实书等有价凭证由基金托管人存放于基金托管人的保管库，也可存入中央国债登记结算有限责任公司、中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司、银行间市场清算所股份有限公司或票据营业中心的代保管库，保管凭证由基金托管人持有。实物证券、银行定期存款证实书等有价凭证的购买和转让，按基金管理人和基金托管人双方约定办理。属于基金托管人实际有效控制下的实物证券在基金托管人保管期间由于基金托管人的过错而导致的损坏、灭失，由此产生的责任应由基金托管人承担。基金托管人对由基金托管人以外机构实际有效控制的资产不承担保管责任。

#### 8、与基金财产有关的重大合同的保管

与基金财产有关的重大合同的签署，由基金管理人负责。由基金管理人代表基金签署的、与基金财产有关的重大合同的原件分别由基金管理人、基金托管人保管。除本协议另有规定外，基金管理人代表基金签署的与基金财产有关的重大合同包括但不限于基金年度审计合同、基金信息披露协议及基金投资业务中产生的重大合同，基金管理人应保证基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人应在重大合同签署后及时以加密方式将重大合同传真给基金托管人，并在三十个工作日内将正本送达基金托管人处。重大合同的保管期限为《基金合同》终止后 15 年。

对于无法取得二份以上的正本的，基金管理人应向基金托管人提供加盖公章的合同复印件，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

##### 1、基金资产净值的计算、复核与完成的时间及程序

（1）基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的金额。基金份额净值是按照每个估值日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到 0.001 元，小数点后第四位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人于每个估值日计算基金资产净值及两类基金份额净值，并按规定公告。

（2）基金管理人应每个估值日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或《基金合同》的规定暂停估值时除外。基金管理人每个估值日对基金资产估值后，将两类基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

##### 2、基金资产估值方法和特殊情形的处理

###### （1）估值对象

基金所拥有的股票、权证、股指期货合约、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

a. 交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；同一股票同时在两个或两个以上市场交易的，按股票所处的市场分别估值；

b. 在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（另有规定的除外），选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值；

c. 对在交易所市场上市交易的可转换债券，按照每日收盘价作为估值全价；

d. 对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募证券，估值日不存在活跃市场时采用估值技术确定其公允价值进行估值。如成本能够近似体现公允价值，应持续评估上述做法的适当性，并在情况发生改变时做出适当调整。

###### 2) 处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

a. 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；

b. 首次公开发行未上市的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；



c. 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计量日的公允价值进行估值；对于活跃市场报价未能代表计量日公允价值的情况下，按成本应对市场报价进行调整，确认计量日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，则采用估值技术确定公允价值；

d. 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3) 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) 存款的估值方法

持有的银行定期存款或通知存款以本金列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入。

#### 5) 投资证券衍生品的估值方法

a. 从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的权证按估值日在证券交易所挂牌的该权证的收盘价估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考监管机构或行业协会有关规定，或者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，确定公允价值。

b. 首次发行未上市的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

c. 因持有股票而享有的配股权，以及停止交易但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值进行估值。在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行估值。

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

7) 本基金可以采用第三方估值机构按照上述公允价值确定原则提供的估值价格数据。

8) 估值计算中涉及到港币、美元、英镑、欧元、日元等主要货币对人民币汇率的，以基金估值日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价为准。

9) 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。

10) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

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

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

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

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致意见的，基金管理人向基金托管人出具加盖公章的书面说明后，按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。

### (3) 特殊情形的处理

基金管理人、基金托管人按估值方法的第 10) 项进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

## 3、基金份额净值错误的处理方式

(1) 当本基金 A 类或 C 类基金份额净值小数点后 3 位以内(含第 3 位)发生估值错误时，视为基金份额净值错误；本基金 A 类或 C 类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；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；当发生净值计算错误时，由基金管理人负责处理，由此给基金份额持有人和基金造成损失的，应由基金管理人先行赔付，基金管理人按差错情形，有权向其他当事人追偿。

(2) 当基金份额净值计算差错给基金和基金份额持有人造成损失需要进行赔偿时，基金管理人和基金托管人应根据实际情况界定双方承担的责任，经确认后按以下条款进行赔偿：

1) 本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，与本基金有关的会计问题，如经双方在平等基础上充分讨论后，尚不能达成一致时，按基金管理人的建议执行，由此给基金份额持有人和基金财产造成的损失，由基金管理人负责赔付。

2) 若基金管理人计算的两类基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告，而且基金托管人未对计算过程提出疑义或要求基金管理人书面说明，基金份额净值出错且造成基金份额持有人损失的，应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金，就实际向投资者

或基金支付的赔偿金额，基金管理人与基金托管人按照管理费和托管费的比例各自承担相应的责任。

3)如基金管理人和基金托管人对两类基金份额净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对，尚不能达成一致时，为避免不能按时公布基金份额净值的情形，以基金管理人的计算结果对外公布，由此给基金份额持有人和基金造成的损失，由基金管理人负责赔付。

4)由于基金管理人提供的信息错误（包括但不限于基金申购或赎回金额等），进而导致基金份额净值计算错误而引起的基金份额持有人和基金财产的损失，由基金管理人负责赔付。

（3）由于证券、期货交易所及登记结算公司发送的数据错误，或由于其他不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误而造成的基金份额净值计算错误，基金管理人、基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

（4）基金管理人和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差，以基金管理人计算结果为准。

（5）前述内容如法律法规或者监管部门另有规定的，从其规定。如果行业另有通行做法，双方当事人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商。

#### 4、暂停估值与公告基金份额净值的情形

（1）基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

（2）因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

（3）出现基金管理人认为属于会导致基金管理人不能出售或评估基金资产的紧急事故的任何情况；

（4）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一致的；

（5）法律法规、中国证监会和《基金合同》认定的其他情形。

#### 5、基金会计制度

按国家有关部门规定的会计制度执行。

#### 6、基金账册的建立

基金管理人进行基金会计核算并编制基金财务会计报告。基金管理人独立地设置、记录和保管本基金的全套账册。基金托管人按规定制作相关账册并与基金管理人核对。若基金管理人和基金托管人对会计处理方法存在分歧，应以基金管理人的处理方法为准。若当日核对不符，暂时无法查找到错账的原因而影响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。

#### 7、基金财务报表与报告的编制和复核

### （1）财务报表的编制

基金财务报表由基金管理人编制，基金托管人复核。

### （2）报表复核

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

### （3）财务报表的编制与复核时间安排

#### 1) 报表的编制

基金管理人应当在每月结束后 5 个工作日内完成月度报表的编制；在每个季度结束之日起 15 个工作日内完成基金季度报告的编制；在上半年结束之日起 60 日内完成基金半年度报告的编制；在每年结束之日起 90 日内完成基金年度报告的编制。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。《基金合同》生效不足两个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。

#### 2) 报表的复核

基金管理人应及时完成报表编制，将有关报表提供基金托管人复核；基金托管人在复核过程中，发现双方的报表存在不符时，基金管理人和基金托管人应共同查明原因，进行调整，调整以国家有关规定为准。

基金管理人应留足充分的时间，便于基金托管人复核相关报表及报告。

8、基金管理人应在编制季度报告、半年度报告或者年度报告之前及时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。

#### 9、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资产净值和份额净值，暂停披露侧袋账户份额净值。

## （六）基金份额持有人名册的保管

基金份额持有人名册至少应包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。基金份额持有人名册由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分别保管基金份额持有人名册，保存期不少于 15 年。如不能妥善保管，则按相关法规承担责任。

在基金托管人要求或编制半年报和年报前，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，但法律法规或监管部门另有规定的除外。

## （七）争议解决方式

因本协议产生或与之相关的争议，双方当事人应通过协商、调解解决，协商、调解不能解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，仲裁地点为北京市，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力，仲裁费用和律师费用由败诉方承担。

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

本协议受中国法律管辖。

#### （八）托管协议的变更、终止与基金财产的清算

##### 1、托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行修改。修改后的新协议，其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突。基金托管协议的变更报中国证监会备案。

##### 2、基金托管协议终止出现的情形

- （1）《基金合同》终止；
- （2）基金托管人解散、依法被撤销、破产或由其他基金托管人接管基金资产；
- （3）基金管理人解散、依法被撤销、破产或由其他基金管理人接管基金管理权；
- （4）发生法律法规或《基金合同》规定的终止事项。

##### 3、基金财产的清算

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

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

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

##### （4）基金财产清算程序：

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

7)对基金剩余财产进行分配。

(5) 基金财产清算的期限为 6 个月。

(6) 基金管理人与基金托管人协商一致或基金资产清算小组认为有对基金份额持有人更为有利的清算方法，本基金财产的清算可按该方法进行，并及时公告，不需召开基金份额持有人大会。相关法律法规或监管部门另有规定的，按相关法律法规或监管部门的要求办理。

(7) 清算费用

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

(8) 基金财产清算剩余资产的分配：

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

(9) 基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计、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。

(10) 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 二十一、对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金投资人提供一系列的客户服务。基金管理人将根据基金投资人的需要和市场的变化，增加或变更服务项目。主要服务内容如下：

### （一）短信、邮件信息发送服务

基金管理人至少每年度以手机短信、电子邮件或其他形式向通过前海开源电子直销系统持有本公司基金份额的基金投资人提供基金保有情况信息。基金投资人可根据需要，通过基金管理人客服热线或官方网站订制、修改或取消该类服务。

1、手机短信服务可提供的定制内容包括基金净值、基金交易确认、分红确认、月末账户余额等信息。

2、电子邮件服务可提供的定制内容包括基金净值、基金交易确认、分红确认、月末账户余额等信息。

3、除发送基金投资人定制的上述信息外，基金管理人会不定期向留有手机号码和电子邮箱地址的基金投资人发送节日及生日问候、产品推广等信息。若基金投资人不需要接收到该类信息，可通过基金管理人客服热线取消该项服务。

4、手机短信依托于外部通讯服务商发送，电子邮件通过互联网进行信息传送，基金管理人根据服务规则发送相关信息，但不对信息的送达做出承诺和保证。由于基金投资人提供的手机号、电子邮箱不详、错误、未及时变更或通讯故障、延误等原因可能造成对账单无法按时或准确送达，请及时到原基金销售网点或致电基金管理人客户服务中心办理相关信息查询、核对或变更。如需补发对账单，敬请拨打客服热线电话。

### （二）客户服务中心（CALL-CENTER）电话服务

呼叫中心人工座席每个交易日（8：30-17：00）为基金投资人提供服务，客服热线服务内容包括业务咨询、信息查询、服务投诉、信息定制、资料修改等专项服务。

客服热线：4001-666-998

### （三）电子查询服务

基金投资人可通过基金管理人电子查询系统（网上查询系统、微信查询系统、APP 查询系统）完成基金账户的查询业务。

官方网站：[www.qhkyfund.com](http://www.qhkyfund.com)

官方微信号：qhkyfund

微信小程序：前海开源基金

官方 APP：前海开源基金

### （四）投诉受理服务

基金投资人可以拨打基金管理人客服热线或以书信、电子邮件等方式，对基金管理人和销售网点所提供的服务进行投诉。

对于工作日期间受理的投诉，以“及时回复”为处理原则，对于不能及时回复的投诉，基金管理人承诺在 3 个工作日之内对基金投资人的投诉做出回复。对于非工作日提出的投诉，基金管理人将在顺延到下 1 个工作日进行回复。

客服邮箱：service@qhkyfund.com

#### （五）电子直销交易系统开户与交易服务

基金投资人可以登录基金管理人电子直销交易系统（网上交易系统、微信交易系统和 APP 交易系统）进行开户与交易。适用业务范围包括：基金账户开户、认购、申购、赎回、账户资料变更、分红方式变更、信息查询等业务。电子直销交易业务规则以公告为准。

#### （六）定期投资计划

基金管理人将利用直销网点或其他销售网点为基金投资人提供定期投资的服务。通过定期投资计划，基金投资人可以通过相关渠道，定期申购基金份额。定期投资计划业务规则以公告为准。

（七）如本招募说明书存在任何您/贵机构无法理解的内容，请通过以上方式联系基金管理人。请确保投资前，您/贵机构已经全面理解了本招募说明书。



## 二十二、其他应披露事项

（一）前海开源基金管理有限公司（以下简称“本公司”）的从业人员在前海开源资产管理股份有限公司（以下简称“前海开源资管公司”或“子公司”）兼任董事、监事及领薪情况如下：

本公司王雅琴女士兼任前海开源资管公司董事；

本公司汤力女士兼任前海开源资管公司监事；

上述人员均不在前海开源资管公司领薪。本公司除上述人员以外未有从业人员在前海开源资管公司兼任职务的情况。

（二）2022年10月27日至2023年10月25日披露的公告：

2023-10-25 前海开源基金管理有限公司旗下部分基金 2023 年第三季度报告提示性公告
2023-10-25 前海开源沪港深创新成长灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第 3 季度报告
2023-10-20 关于防范不法分子冒用前海开源基金名义进行非法活动的风险提示
2023-10-20 前海开源基金管理有限公司关于旗下沪港深系列基金主要投资市场节假日暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告
2023-09-27 前海开源基金管理有限公司关于调整旗下部分证券投资基金通过华泰证券股份有限公司办理业务最低限额的公告
2023-09-27 前海开源基金管理有限公司关于旗下沪港深系列基金主要投资市场节假日暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告
2023-09-11 前海开源基金管理有限公司关于调整旗下部分证券投资基金通过北京新浪仓石基金销售有限公司办理业务最低限额的公告
2023-09-09 前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金于香港交易所休市期间暂停申购、赎回、定投、转换等业务的公告
2023-09-08 前海开源基金管理有限公司关于香港交易所临时休市的提示性公告
2023-09-04 关于防范不法分子冒用前海开源基金名义进行非法活动的风险提示
2023-09-04 前海开源基金管理有限公司关于终止与凤凰金信（海口）基金销售有限公司合作关系的公告
2023-09-02 前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金于香港交易所休市期间暂停申购、赎回、定投、转换等业务的公告
2023-09-01 前海开源基金管理有限公司关于香港交易所临时休市的提示性公告

2023-08-31 前海开源沪港深创新成长灵活配置混合型证券投资基金 2023 年中期报告
2023-08-31 前海开源基金管理有限公司旗下部分基金 2023 年中期报告提示性公告
2023-07-21 前海开源沪港深创新成长灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第 2 季度报告
2023-07-21 前海开源基金管理有限公司旗下部分基金 2023 年第二季度报告提示性公告
2023-07-20 关于防范不法分子冒用前海开源基金名义进行非法活动的风险提示
2023-07-18 前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金于香港交易所休市期间暂停申购、赎回、定投、转换等业务的公告
2023-07-17 前海开源基金管理有限公司关于香港交易所临时休市的提示性公告
2023-07-10 前海开源基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同和托管协议的公告
2023-06-20 前海开源基金管理有限公司关于旗下沪港深系列基金主要投资市场节假日暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告
2023-06-08 关于旗下部分基金增加杭州银行股份有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告
2023-05-24 前海开源基金管理有限公司关于旗下沪港深系列基金主要投资市场节假日暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告
2023-05-15 前海开源基金管理有限公司关于调整旗下部分证券投资基金通过上海中欧财富基金销售有限公司办理业务最低限额的公告
2023-05-04 前海开源基金管理有限公司关于调整旗下部分证券投资基金通过蚂蚁（杭州）基金销售有限公司办理业务最低限额的公告
2023-04-27 前海开源基金管理有限公司关于旗下沪港深系列基金主要投资市场节假日暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告
2023-04-22 前海开源基金管理有限公司旗下部分基金 2023 年第一季度报告提示性公告
2023-04-22 前海开源沪港深创新成长灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告
2023-04-04 前海开源基金管理有限公司关于旗下沪港深系列基金主要投资市场节假日暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告

2023-04-03 前海开源基金管理有限公司关于旗下沪港深系列基金主要投资市场节假日暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告
2023-03-31 前海开源沪港深创新成长灵活配置混合型证券投资基金 2022 年年度报告
2023-03-31 前海开源基金管理有限公司关于变更公司官方电子直销交易平台 APP 名称的公告
2023-03-31 前海开源基金管理有限公司旗下全部基金 2022 年年度报告提示性公告
2023-02-08 前海开源基金管理有限公司关于旗下基金定期定额投资业务起点金额的公告
2023-01-20 前海开源基金管理有限公司旗下部分基金 2022 年第四季度报告提示性公告
2023-01-20 前海开源沪港深创新成长灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告
2023-01-17 前海开源基金管理有限公司关于旗下沪港深系列基金主要投资市场节假日暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告
2023-01-13 前海开源基金管理有限公司关于电子直销交易系统停机维护的通知
2022-12-30 前海开源基金关于电子直销平台相关业务费率优惠的公告
2022-12-29 前海开源基金管理有限公司关于旗下沪港深系列基金主要投资市场节假日暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告
2022-12-28 前海开源基金管理有限公司关于终止与部分销售机构合作关系的公告
2022-12-22 前海开源基金管理有限公司关于旗下沪港深系列基金主要投资市场节假日暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告
2022-12-16 前海开源基金管理有限公司关于官网、客服呼叫中心及电子直销交易系统停机维护的通知
2022-12-13 前海开源基金管理有限公司关于终止与和谐保险销售有限公司合作关系的公告
2022-12-08 前海开源基金管理有限公司关于官网及电子直销交易系统停机维护的通知
2022-11-15 前海开源基金管理有限公司关于调整旗下部分证券投资基金通过中国工商银行股份有限公司办理业务最低限额的公告

2022-11-11 关于防范不法分子冒用前海开源基金名义进行非法活动的风险提示
2022-11-10 前海开源基金管理有限公司关于官网及电子直销交易系统停机维护的通知
2022-11-08 关于增加通华财富（上海）基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构并参加其费率优惠活动的公告
2022-11-03 前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金于香港交易所休市期间暂停申购、赎回、定投、转换等业务的公告
2022-11-02 前海开源基金管理有限公司关于香港交易所临时休市的提示性公告

## 二十三、招募说明书的存放及查阅方式

本招募说明书按相关法律法规，存放在基金管理人、基金销售机构等的办公场所，投资人可在办公时间免费查阅；也可在支付工本费后在合理时间内获取本招募说明书复制件或复印件，但应以招募说明书正本为准。投资人也可以直接登录基金管理人的网站进行查阅。

基金管理人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

## 二十四、备查文件

### （一）备查文件包括：

- 1、中国证监会准予注册前海开源沪港深创新成长灵活配置混合型证券投资基金募集的文件
- 2、《前海开源沪港深创新成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《前海开源沪港深创新成长灵活配置混合型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
- 7、中国证监会要求的其他文件

### （二）备查文件的存放地点和投资人查阅方式：

- 1、存放地点：《基金合同》、《托管协议》存放在基金管理人和基金托管人处；其余备查文件存放在基金管理人处。
- 2、查阅方式：投资人可在营业时间免费到存放地点查阅，也可按工本费购买复印件。

前海开源基金管理有限公司

2023年12月12日