

银河 ESG 主题混合型发起式
证券投资基金

招募说明书

基金管理人：银河基金管理有限公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

【重要提示】

本基金根据中国证券监督管理委员会 2024 年 4 月 16 日《关于准予银河 ESG 主题混合型发起式证券投资基金注册的批复》（证监许可【2024】695 号）的注册，进行募集。

基金管理人保证《银河 ESG 主题混合型发起式证券投资基金招募说明书》（以下简称“招募说明书”或“本招募说明书”）的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值和市场前景作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

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

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资人在投资本基金前，需全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对投资本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资人根据所持有份额享受基金的收益，但同时也需承担相应的投资风险。投资本基金可能遇到的风险包括：市场风险、管理风险、流动性风险、信用风险、本基金特定风险、未知价风险、启用侧袋机制的风险、本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险及其他风险等。

本基金为混合型基金，其风险收益水平高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。

当本基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，基金管理人履行相应程序后，可以启用侧袋机制，具体详见基金合同和本招募说明书“侧袋机制”等有关章节。侧袋机制实施期间，基金管理人将对基金简称进行特殊标识，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。

本基金的投资范围包括存托凭证，若投资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，以及与存托凭证发行机制以及交易机制等相关的风险。

具体风险烦请查阅基金招募说明书的“风险揭示”章节内容。

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

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

本基金为发起式基金，《基金合同》生效满 3 年后的对应日（指自然日，若无对应日则顺延至下一日），若基金资产规模低于 2 亿元，《基金合同》应当终止，且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续，故投资者将面临基金合同可能终止的不确定性风险。

投资有风险，投资人在投资本基金前应认真阅读基金合同、本招募说明书、基金产品资料概要等信息披露文件。基金的过往业绩并不代表未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。

目 录

一、绪言.....	5
二、释义.....	6
三、基金管理人.....	12
四、基金托管人.....	23
五、相关服务机构.....	28
六、基金的募集.....	30
七、基金合同生效.....	35
八、基金份额的申购与赎回.....	37
九、基金的投资.....	50
十、基金财产.....	60
十一、基金资产估值.....	61
十二、基金收益与分配.....	68
十三、基金的费用与税收.....	70
十四、基金的会计与审计.....	73
十五、基金的信息披露.....	74
十六、侧袋机制.....	82
十七、风险揭示.....	85
十八、基金合同的变更、终止与基金财产清算.....	92
十九、基金合同的内容摘要.....	94
二十、基金托管协议内容摘要.....	112
二十一、对基金份额持有人的服务.....	133
二十二、其他应披露事项.....	135
二十三、招募说明书存放及查阅方式.....	136
二十四、备查文件	137

一、绪言

《银河 ESG 主题混合型发起式证券投资基金招募说明书》依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）和其他相关法律法规的规定以及《银河 ESG 主题混合型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

本招募说明书阐述了银河 ESG 主题混合型发起式证券投资基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资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。

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：指银河 ESG 主题混合型发起式证券投资基金
- 2、基金管理人：指银河基金管理有限公司
- 3、基金托管人：指中国民生银行股份有限公司
- 4、基金合同：指《银河 ESG 主题混合型发起式证券投资基金基金合同》

及对基金合同的任何有效修订和补充

5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《银河 ESG 主题混合型发起式证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充

6、招募说明书：指《银河 ESG 主题混合型发起式证券投资基金招募说明书》及其更新

7、基金产品资料概要：指《银河 ESG 主题混合型发起式证券投资基金基金产品资料概要》及其更新

8、基金份额发售公告：指《银河 ESG 主题混合型发起式证券投资基金基金份额发售公告》

9、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等

10、《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，经 2012 年 12 月 28 日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自 2013 年 6 月 1 日起实施，并经 2015 年 4 月 24 日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修正的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订

11、《销售办法》：指中国证监会 2020 年 8 月 28 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

12、《信息披露办法》：指中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1 日实施，并经 2020 年 3 月 20 日中国证监会《关于修改部分证券期货规章的决定》修正的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

13、《运作办法》：指中国证监会 2014 年 7 月 7 日颁布、同年 8 月 8 日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

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

15、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

16、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或国家金融监督管理总局

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

18、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

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

20、合格境外投资者：指符合《合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者境内证券期货投资管理办法》（包括颁布机关对其不时做出的修订）及相关法律法规规定使用来自境外的资金进行境内证券期货投资的境外机构投资者，包括合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者

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

22、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者

23、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

24、销售机构：指银河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

25、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

26、登记机构：指办理登记业务的机构。基金的登记机构为银河基金管理有限公司或接受银河基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构

27、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

28、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

29、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

30、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

31、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

32、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

33、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

34、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

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

36、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，基金管理人可调整本基金的开放日或开放时间，具体安排以届时提前发布的公告为准

37、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

38、《业务规则》：指《银河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，由基金管理人和投资人共同遵守

39、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

40、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

41、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

42、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份额的行为

43、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

44、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，由销售机构在投资人指定银行账户内自动完成扣款并于每期约定的申购日提交基金申购申请的一种投资方式

45、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%的情形

46、元：指人民币元

47、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

48、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

49、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

50、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

51、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

52、规定媒介：指符合中国证监会规定条件的用以进行信息披露的全国性报刊（以下简称“规定报刊”）及《信息披露办法》规定的互联网网站（以下简称“规定网站”，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

53、销售服务费：指从基金财产中计提的，用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务的费用

54、A 类基金份额：指在投资人认购/申购基金时收取认购/申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，并不再从本类别基金财产中计提销售服务费的基金份额

55、C 类基金份额：指在投资人认购/申购基金时不收取认购/申购费用，而是从本类别基金财产中计提销售服务费，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额

56、发起式基金：指按照《运作办法》和中国证监会规定的相关条件募集，由基金管理人、基金管理人股东、基金管理人高级管理人员或基金经理（指基金管理工作人员中依法具有基金经理资格者，包括但不限于本基金的基金经理，下同）等人员承诺认购一定金额并持有一定期限的证券投资基金

57、发起资金：指用于认购发起式基金且来源于基金管理人股东资金、基金管理人固有资金、基金管理人高级管理人员或基金经理等人员的资金。发起资金认购本基金的金额不低于 1000 万元，且持有期限不低于三年

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

59、港股通标的股票：指内地投资者委托内地证券公司，经由上海证券交易所、深圳证券交易所或经中国证监会认可的机构设立的证券交易服务公司，向香港联合交易所进行申报，买卖规定范围内的香港联合交易所上市的股票

60、流动性受限资产：指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通

受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等

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

62、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

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

64、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

65、中国：指中华人民共和国（仅为基金合同之目的，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区及台湾地区）

三、基金管理人

(一)基金管理人概况

基金管理人：银河基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区富城路 99 号 21-22 层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区富城路 99 号 21-22 层

法定代表人：宋卫刚

成立日期：2002 年 6 月 14 日

注册资本：2.0 亿元人民币

电话：(021)38568888

联系人：罗琼

股权结构：

持股单位	出资额(万元)	占总股本比例
中国银河金融控股有限责任公司	10000	50%
中国石油天然气集团有限公司	2500	12.5%
上海城投（集团）有限公司	2500	12.5%
首都机场集团有限公司	2500	12.5%
湖南电广传媒股份有限公司	2500	12.5%
合 计	20000	100%

(二)主要人员情况

1、基金管理人董事、监事、经理及其他高级管理人员基本情况

董事长宋卫刚先生，中共党员，经济学博士，高级经济师。现任中国银河金融控股有限责任公司党委副书记、执行董事、总经理，银河基金管理有限公司党委书记、董事长。历任财政部办公厅科员、副主任科员，财政部办公厅部长办公室副科级、科级、副处级、正处级秘书，财政部经济建设司调研员、处长、副司长级干部；中国证券投资者保护基金有限责任公司副董事长、党委委员；中国银河金融控股有限责任公司党委委员、副总经理，中国银河投资管理有限公司党委书记、董事长。

董事史平武先生，中共党员，研究生学历，硕士学位。历任中国农业银行山

西省分行直属国贸支行副行长、太原市分行副行长；大华银行（中国）有限公司助理副总裁、金融机构部负责人；农银金融租赁有限公司交通运输部副总经理（主持工作）、国际业务部总经理；中建投租赁股份有限公司副总经理、董事、总经理、党委委员、党委副书记。2023 年 5 月起加入银河基金管理有限公司，现任党委副书记、总经理。

董事吕智先生，中共党员，哲学博士。现任中国银河金融控股有限责任公司董事、中国银河资产管理有限责任公司董事、银河基金管理有限公司董事。历任斯伦贝谢公司现场工程师、高级现场工程师、总现场工程师、现场服务经理、市场拓展经理、技术经理，中投海外直接投资有限责任公司中投君义资产管理有限责任公司高级经理，中国投资有限责任公司董事总经理。

董事杨茂铎先生，中共党员，军事硕士。2019 年 10 月被选举为银河基金第四届董事会董事。历任福建省军区海防 13 师代理副师长，南京军区联勤部物资油料部副部长，航务军事代表办事处主任。现任上海城投（集团）有限公司党委副书记、董事。

董事付维刚先生，硕士学历，曾任快乐购股份有限公司董秘办高级总监，江西博胜信息科技有限公司财务总监。现任湖南电广传媒股份有限公司董事、副总经理、财务总监。

董事付华杰先生，中共党员，硕士研究生学历。2018 年 3 月被选举为银河基金管理有限公司第四届董事会董事。历任金飞民航经济发展中心投资主管，首都机场地产集团有限公司部门经理助理，首都机场集团资产管理有限公司部门经理。现任首都机场集团公司资本运营部副总经理。

董事戚振忠先生，中共党员，企业管理硕士，高级经济师。2017 年 2 月被选举为银河基金管理有限公司第四届董事会董事。历任大港油田总机械厂技术员、大港油田局办公室科员、大港油田经济研究所科员，现任中石油集团公司资本运营部处长。

独立董事王福山先生，中共党员，大学本科学历，高级工程师。2002 年 6 月被选举为银河基金管理有限公司第一届董事会独立董事，第二届、第三届、第四届董事会连任。历任北京大学教师，国家地震局副局长，中国人民保险公司部门总经理，中国人保信托投资公司副董事长，深圳阳光基金管理公司董事长等职。

现任中国人寿保险公司巡视员。

独立董事王建宁先生，中共党员，硕士，律师。2015年11月被选举为银河基金管理有限公司第四届董事会独立董事。历任国家建设委员会干部，国家经济委员会外事局干部，国家计划委员会工业经济联合会国际部干部，日本野村证券株式会社总部投资及咨询顾问，全国律协会会员法律助理，现任北京德恒律师事务所律师、合伙人。

独立董事郭田勇先生，2014年4月被选举为银河基金管理有限公司独立董事。中央财经大学金融学院教授、博士生导师，中央财经大学中国银行业研究中心主任。亚洲开发银行高级顾问、中国人民银行货币政策委员会咨询专家、中国银监会外聘专家、中国支付清算协会互联网金融专家委员会委员、中国国际金融学会理事。

独立董事楼建波先生，北京大学法学院教授、博士生导师，北京大学房地产法研究中心主任。兼任中国法学会商法学研究会理事，北京市物权法研究会副会长；曾任英国剑桥大学中国商法讲师。

监事刘晓彬女士，大学本科学历。曾任职于申银万国证券股份有限公司，2003年3月入职银河基金管理有限公司。现为银河基金管理有限公司基金运营部总监。

监事赵斌先生，中共党员，大学本科学历。2015年11月被选举为银河基金管理有限公司第四届监事会监事。先后任职于北京城建华城监理公司、银河证券有限公司。现为银河基金管理有限公司渠道业务部副总监兼北京分公司总经理。

总经理史平武先生，中共党员，研究生学历，硕士学位。历任中国农业银行山西省分行直属国贸支行副行长、太原市分行副行长；大华银行（中国）有限公司助理副总裁、金融机构部负责人；农银金融租赁有限公司交通运输部副总经理（主持工作）、国际业务部总经理；中建投租赁股份有限公司副总经理、董事、总经理、党委委员、党委副书记。2023年5月起加入银河基金管理有限公司，现任党委副书记、总经理。

副总经理金立国先生，中共党员，研究生学历，硕士学位。历任北京 NEC 集成电路设计有限公司财务投资专员；中国出口信用保险公司承保人、产品经理；中证互联股份有限公司董事、副总经理、纪委委员。2018年3月加入银河基金

管理有限公司，历任总经理助理、党委委员、纪委书记，现任党委委员、副总经理。

副总经理吴磊先生，中共党员，研究生学历，管理学博士。2004年4月加入银河基金管理有限公司，历任研究员、市场部总监、产品规划部总监、战略规划部总监、专户投资部总监、总经理助理、银河资本资产管理有限公司总经理、董事长等职。现任公司党委委员、副总经理。

督察长秦长建先生，中共党员，研究生学历，硕士学位。持有中国注册会计师、国际注册内部审计师、法律职业资格证书、中国注册资产评估师等专业资格证书，先后在会计师事务所、上市公司等行业从事内审、财务、资产评估等工作。2007年加入银河基金，先后任监察部监察稽核(内审)、财务部总监、综合管理部总监。

副总经理徐琳女士，中共党员，工商管理硕士。曾先后在南方证券有限公司上海分公司、中银基金管理有限公司从事营销、管理等工作。2016年12月加入银河基金管理有限公司，历任总经理助理、市场部总监。

首席信息官管良权先生，研究生学历，硕士学位。曾先后在上海神通电信有限公司、金信证券、华安基金管理有限公司、中银基金管理有限公司从事系统开发、信息技术管理等相关工作。2021年12月加入银河基金管理有限公司，现任首席信息官。

2、本基金基金经理

鲍武斌先生，中共党员，硕士研究生学历，10年证券从业经历。曾就职于诺安基金管理有限公司，担任研究员。2015年4月加入银河基金管理有限公司研究部，现任股票投资部基金经理。2022年3月起担任银河鑫利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2022年3月至2023年3月担任银河行业优选混合型证券投资基金的基金经理，2023年3月起担任银河睿达灵活配置混合型证券投资基金、银河新动能混合型证券投资基金、银河大国智造主题灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

3、投资决策委员会成员

权益投委会：总经理史平武先生，股票投资部总监郑巍山先生，股票投资部副总监袁曦女士。

固收投委会：总经理史平武先生，固定收益部总监郑可成先生，固定收益部总监助理蒋磊先生，固定收益部基金经理张沛先生，研究部固收研究员洪汉先生。

4、上述人员之间均无近亲属关系。

（三）基金管理人职责

基金管理人应严格依法履行下列职责：

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

2、办理基金备案手续；

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

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

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

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

7、依法接受基金托管人的监督；

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

9、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

10、编制季度报告、中期报告和年度报告；

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

12、保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露，但根据监管机构、司法机关等有权机关的要求，或因审计、法律等

外部专业顾问提供服务而向其提供的情况除外；

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

14、按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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

16、按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 20 年以上，法律法规另有规定的从其规定；

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（税后）在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人；

25、执行生效的基金份额持有人大会的决议；

26、建立并保存基金份额持有人名册；

27、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(四) 基金管理人承诺

1、基金管理人承诺不从事违反《基金法》的行为，并承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反《基金法》行为的发生；

2、基金管理人承诺不从事以下违反《基金法》的行为，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止下列行为的发生：

(1) 将基金管理人固有财产或者其他财产混同于基金财产从事证券投资；

(2) 不公平地对待管理的不同基金财产；

(3) 利用基金财产或者职务之便为基金份额持有人以外的第三人谋取利益；

(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) 依照法律、行政法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他行为。

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、规章及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下活动：

(1) 越权或违规经营；

(2) 违反基金合同或托管协议；

(3) 故意损害基金持有人或其他基金相关机构的合法权益；

(4) 在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；

(5) 拒绝、干扰、阻挠或者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；

(8) 除按本公司制度进行基金运作投资外，直接或间接进行其他股票投资；

(9) 协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易；

(10) 违反证券交易场所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；

- (11) 贬损同行，以提高自己；
- (12) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
- (13) 以不正当手段谋求业务发展；
- (14) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；
- (15) 其他法律、行政法规禁止的行为。

4、基金管理人关于禁止性行为的承诺

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

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

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

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

(五) 基金经理承诺

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

2、不协助、接受委托或者以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易，不利用职务之便为自己或任何第三者谋取利益；

3、不违反现行有效法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，

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；

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。

（六）基金管理人内部控制制度

1、内部控制制度概述

为了保证公司规范运作，有效地防范和化解管理风险、经营风险以及操作风险，确保基金财务和公司财务以及其他信息真实、准确、完整，从而最大程度地保护基金份额持有人的利益，本基金管理人建立了科学合理、控制严密、运行高效的内部控制制度。

内部控制制度是指公司为实现内部控制目标而建立的一系列组织机制、管理方法、操作程序与控制措施的总称。内部控制制度由内部控制大纲、基本管理制度、部门业务规章等组成。

公司内部控制大纲是对公司章程规定的内控原则的细化和展开，是对各项基本管理制度的总揽和指导，内部控制大纲明确了内控目标、内控原则、控制环境、内控措施等内容。

基本管理制度包括内部会计控制制度、风险控制制度、投资管理制度、监察稽核制度、基金会计制度、信息披露制度、信息技术管理制度、资料档案管理制度、业绩评估考核制度和紧急应变制度等。

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。

2、内部控制原则

健全性原则。内部控制机制必须覆盖公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员，并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个运作环节。

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。

独立性原则。公司各机构、部门、和岗位在职能上应当保持相对独立，公司基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离。

相互制约原则。公司内部部门和岗位的设置必须权责分明、相互制衡，并通过切实可行的措施来实行。

成本效益原则。公司应充分发挥各机构、各部门及各级员工的工作积极性，运用科学化的方法尽量降低经营运作成本，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。

3、主要内部控制制度

（1）内部会计控制制度

公司依据《中华人民共和国会计法》、《证券投资基金会计核算业务指引》、《企业财务通则》等国家有关法律、法规制订了基金会计制度、公司财务会计制度、会计工作操作流程和会计岗位职责，并针对各个风险控制点建立严密的会计系统控制。

内部会计控制制度包括凭证制度、复核制度、账务处理程序、基金估值制度和程序、基金财务清算制度和程序、成本控制制度、财务收支审批制度和费用报销管理办法、财产登记保管和实物资产盘点制度、会计档案保管和财务交接制度等。

（2）风险管理控制制度

风险控制制度由风险控制委员会组织各部门制定，风险控制制度由风险控制的目标和原则、风险控制的机构设置、风险控制的程序、风险类型的界定、风险控制的主要措施、风险控制的具体制度、风险控制制度的监督与评价等部分组成。

风险控制的具体制度主要包括投资风险管理制度、交易风险管理制度、财务风险控制制度以及岗位分离制度、防火墙制度、岗位职责、反馈制度、保密制度、员工行为准则等程序性风险管理制度。

（3）监察稽核制度

公司设立督察长，负责监督检查基金和公司运作的合法合规情况及公司内部风险控制情况。督察长由总经理提名，董事会聘任，并经全体独立董事同意。

督察长负责组织指导公司监察稽核工作。除应当回避的情况外，督察长享有充分的知情权和独立的调查权。督察长根据履行职责的需要，有权参加或者列席公司董事会以及公司业务、投资决策、风险管理等相关会议，有权调阅公司相关文件、档案。督察长应当定期或者不定期向全体董事报送工作报告，并在董事会及董事会下设的相关专门委员会定期会议上报告基金及公司运作的合法合规情况及公司内部风险控制情况。

公司设立监察稽核部门，具体执行监察稽核工作。公司配备了充足合格的监察稽核人员，明确规定了监察稽核部门及内部各岗位的职责和工作流程。

监察稽核制度包括内部稽核管理办法、内部稽核工作准则等。通过这些制度的建立，检查公司各业务部门和人员遵守有关法律、法规和规章的情况；检查公司各业务部门和人员执行公司内部控制制度、各项管理制度和业务规章的情况。

四、基金托管人

(一)基金托管人概况

1. 基本情况

名称：中国民生银行股份有限公司（以下简称“中国民生银行”）

住所：北京市西城区复兴门内大街 2 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：高迎欣

成立日期：1996 年 2 月 7 日

基金托管业务批准文号：证监基金字 [2004] 101 号

组织形式：其他股份有限公司（上市）

注册资本：43,782,418,502 元人民币

电话：010-58560666

联系人：罗菲菲

中国民生银行成立于 1996 年，是中国第一家主要由民营企业发起设立的全国性股份制商业银行，也是严格按照中国《公司法》和《商业银行法》设立的一家现代金融企业。

2000 年 12 月 19 日，中国民生银行 A 股股票（代码：600016）在上海证券交易所挂牌上市。2005 年 10 月 26 日，中国民生银行完成股权分置改革，成为国内首家实施股权分置改革的商业银行。2009 年 11 月 26 日，中国民生银行 H 股股票（代码：01988）在香港证券交易所挂牌上市。上市以来，中国民生银行不断完善公司治理，大力推进改革转型，持续创新商业模式和产品服务，致力于成为一家“让人信赖、受人尊敬”的上市公司。

2、主要人员情况

崔岩女士，中国民生银行资产托管部负责人，博士研究生，具有基金托管人高级管理人员任职资格，从事过全球托管业务、托管业务运作、银行信息管理等工作，具有多年金融从业经历，具备扎实的总部管理经验。曾任中国工商银行总行资产托管部营销专家。

3、基金托管业务经营情况

中国民生银行股份有限公司于 2004 年 7 月 9 日获得基金托管资格,成为《中华人民共和国证券投资基金法》颁布后首家获批从事基金托管业务的银行。为了更好地发挥后发优势,大力发展托管业务,中国民生银行股份有限公司资产托管部从成立伊始就本着充分保护基金持有人的利益、为客户提供高品质托管服务的原则,高起点地建立系统、完善制度、组织人员。资产托管部目前共有员工 98 人,平均年龄 38 岁,100%员工拥有大学本科以上学历,66%以上员工具有硕士以上学位。

中国民生银行坚持以客户需求为导向,秉承“诚信、严谨、高效、务实”的经营理念,依托丰富的资产托管经验、专业的托管业务服务和先进的托管业务平台,为境内外客户提供安全、准确、及时、高效的专业托管服务。中国民生银行资产托管部于 2018 年 2 月 6 日发布了“爱托管”品牌,近百余家资管机构及合作客户的代表受邀参加了启动仪式。资产托管部始终坚持以客户为中心,致力于为客户提供全面的综合金融服务。对内大力整合行内资源,对外广泛搭建客户服务平台,向各类托管客户提供专业化、增值化的托管综合金融服务,得到各界的充分认可,也在市场上树立了良好品牌形象,成为市场上一家有特色的托管银行。自 2021 年以来,中国民生银行荣获人力资源社会保障部颁发的“2020 年度企业年金和养老金产品信息报告工作优秀管理机构”奖,连续三年蝉联中央国债登记结算有限责任公司“年度优秀资产托管机构”奖项,获评《金融理财》颁发的“第十三届金貔貅奖 2022 年度金牌资产托管银行”。2023 年度,本行先后荣获《金融时报》“年度最佳资产托管银行”,《证券时报》“2023 年度杰出资产托管银行天玑奖”,以及《新浪财经》“养老金融服务创新银行”奖。

截至 2024 年 3 月 31 日,中国民生银行托管建信稳定得利债券型证券投资基金、中银新趋势灵活配置混合型证券投资基金、长信利盈灵活配置混合型证券投资基金等共 350 只证券投资基金,基金托管规模 12,432.65 亿元。

(二)基金托管人的内部控制制度

1. 内部风险控制目标

(1) 建立完整、严密、高效的风险控制体系,形成科学的决策机制、执行机制和监督机制,防范和化解经营风险,保障资产托管业务的稳健运行和托管财产的安全完整。

(2)大力培育合规文化，自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念，严格控制合规风险，保证资产托管业务符合国家有关法律法规和行业监管规则。

(3)以相互制衡健全有效的风控组织结构为保障，以完善健全的制度为基础，以落实到位的过程控制为着眼点，以先进的信息技术手段为依托，建立全面、系统、动态、主动、有利于差错防弊、堵塞漏洞、消除隐患、保证业务稳健运行的风险控制制度，确保托管业务信息真实、准确、完整、及时。

2. 内部风险控制组织结构

总行高级管理层负责部署全行的风险管理工作。总行风险管理委员会是总行高级管理层下设的风险管理专业委员会，对高级管理层负责，支持高级管理层履行职责。资产托管业务风险控制工作在总行风险管理委员会的统一部署和指导下开展。

总行各部门紧密配合，共同把控资产托管业务运行中的风险，具体职责与分工如下：总行风险管理部作为总行风险管理委员会秘书机构，是全行风险管理的统筹部门，对资产托管部的风险控制工作进行指导；总行法律合规部负责资产托管业务项下的相关合同、协议等法律性文件的审定，对业务开展进行合规检查并督导问题整改落实；总行审计部对全行托管业务进行内部审计，包括定期内部审计、现场和非现场检查等；总行办公室与资产托管部共同制定声誉风险应急预案。

3. 内部风险控制原则

(1)合法合规原则。风险控制应符合和体现国家法律、法规、规章和各项政策。

(2)全面性原则。风险控制覆盖托管部的各个业务中心、各个岗位和各级人员，并涵盖资产托管业务各环节。

(3)有效性原则。资产托管业务从业人员应全力维护内部控制制度的有效执行，任何人都没有超越制度约束的权力。

(4)预防性原则。必须树立“预防为主”的管理理念，控制资产托管业务中风险发生的源头，防患于未然，尽量避免业务操作中各种问题的产生。

(5)及时性原则。资产托管业务风险控制制度的制定应当具有前瞻性，并且随着托管部经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律法规、

政策制度等外部环境的改变进行及时的修改或完善。发现问题，要及时处理，堵塞漏洞。

(6)独立性原则。各业务中心、各岗位职能上保持相对独立性。风险合规管理中心是资产托管部下设的执行机构，不受其他业务中心和个人干涉。业务操作人员和检查人员严格分开，以保证风险控制机构的工作不受干扰。

(7)相互制约原则。各业务中心、各岗位权责明确，相互牵制，通过切实可行的相互制衡措施来消除风险控制的盲点。

(8)防火墙原则。托管银行自身财务与托管资产财务严格分开；托管业务日常操作部门与行政、研发和营销等部门隔离。

4. 内部风险控制制度和措施

(1)制度建设：建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度。

(2)建立健全的组织管理结构：前后台分离，不同部门、岗位相互牵制。

(3)风险识别与评估：定期组织进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施。

(4)相对独立的业务操作空间：业务操作区相对独立，实施门禁管理和音像监控。

(5)人员管理：进行定期的业务与职业道德培训，使员工树立风险防范与控制理念，并签订承诺书。

(6)应急预案：制定完备的应急预案，并组织员工定期演练；建立异地灾备中心，保证业务不中断。

5. 资产托管部内部风险控制

中国民生银行股份有限公司从控制环境、风险评估、控制活动、信息沟通、监控等五个方面构建了托管业务风险控制体系。

(1)坚持风险管理与业务发展同等重要的理念。中国民生银行股份有限公司资产托管部从成立之日起就特别强调规范运作，一直将建立一个系统、高效的风险防范和控制体系作为工作重点。随着市场环境的变化和托管业务的快速发展，新问题新情况不断出现，我们始终将风险管理放在与业务发展同等重要的位置，视风险防范和控制为托管业务生存和发展的生命线。

(2)实施全员风险管理。将风险控制责任落实到具体业务中心和业务岗位，

每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责。

(3) 建立分工明确、相互牵制的风险控制组织结构。我们通过建立纵向双人制，横向多中心制的内部组织结构，形成不同中心、不同岗位相互制衡的组织结构。

(4) 以制度建设作为风险管理的核心。我们十分重视内部控制制度的建设，已经建立了一整套内部风险控制制度，包括业务管理办法、内部控制制度、员工行为规范、岗位职责及涵括所有后台运作环节的操作手册。以上制度随着外部环境和业务的发展还会不断增加和完善。

(5) 制度的执行和监督是风险控制的关键。制度落实检查是风险控制管理的有力保证。资产托管部内部设置风险合规管理中心，依照有关法律规章，定期对业务的运行进行检查。总行审计部不定期对托管业务进行审计。

(6) 将先进的技术手段运用于风险控制中。托管业务系统需求不仅从业务方面而且从风险控制方面都要经过多方论证，托管业务技术系统具有较强的自动控制功能。

(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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规的规定及基金合同、基金托管协议的约定，基金托管人对基金的投资范围、基金投资比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金份额净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金申购及赎回的价格、基金申购资金的到账和赎回资金的划付、基金收益分配等进行监督和核查。

基金托管人发现基金管理人违反《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规规定及基金合同、基金托管协议约定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对确认，并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

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

五、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、直销机构

（1）银河基金管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富城路 99 号 21-22 层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区富城路 99 号 21-22 层

法定代表人：宋卫刚

公司网站：www.cgf.cn（支持网上交易）

客户服务电话：400-820-0860

直销业务电话：(021)38568981/ 38568507

传真交易电话：(021)38568985

联系人：徐佳晶、郑夫桦

（2）银河基金管理有限公司北京分公司

地址：北京市西城区月坛西街 6 号 A-F 座 3 楼（邮编：100045）

电话：(010)56086900

传真：(010)56086939

联系人：郭森慧

（3）银河基金管理有限公司广州分公司

地址：广州市天河区广州大道中 988 号 2602 房自编之一（邮编 510610）

电话：(020) 88524556

联系人：王晓萍

2、代销机构

详见本基金基金份额发售公告以及基金管理人网站。

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的销售机构销售本基金，并在基金管理人网站公示。

（二）基金登记结算机构

名称：银河基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区富城路 99 号 21-22 层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区富城路 99 号 21-22 层

法定代表人：宋卫刚

电话：（021）38568888

传真：（021）38568800

联系人：富弘毅

（三）律师事务所和经办律师

名称：上海市通力律师事务所

地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：韩炯

电话：（021）31358666

传真：（021）31358666

经办律师：黎明、陈颖华

（四）会计师事务所和经办注册会计师

名称：毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：北京市东城区东长安街 1 号东方广场东 2 座办公楼 8 层

办公地址：北京市东城区东长安街 1 号东方广场东 2 座办公楼 8 层

法定代表人：邹俊

联系电话：+86(10)85085000

传真：+86(10)85185111

经办注册会计师：王国蓓、汪霞

联系人：汪霞

六、基金的募集

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定募集。

注册文件：中国证监会证监许可【2024】695号

注册日期：2024年4月16日

（一）基金类型与存续期间

1、基金类型：混合型发起式证券投资基金

2、存续期间：不定期

3、基金的运作方式：契约型开放式

（二）募集方式

通过各销售机构的基金销售网点或按基金管理人、销售机构提供的其他方式公开发售，各销售机构的具体名单见基金份额发售公告以及基金管理人网站。

（三）募集对象

符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、合格境外投资者、发起资金提供方以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。

（四）募集期限

本基金的募集期限自基金份额发售之日起不超过3个月。具体发售时间见本基金的基金份额发售公告。

（五）募集场所

本基金的认购将通过销售机构进行，具体参见本招募说明书第五章第（一）条、基金份额发售公告以及基金管理人网站。基金管理人可根据情况针对某类基金份额变更或增减销售机构，并在基金管理人网站公示。基金投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的认购。

（六）基金份额类别

本基金将基金份额分为不同的类别。其中：

1、在投资人认购/申购基金时收取认购/申购费用，在赎回时根据持有期限

收取赎回费用，并不再从本类别基金财产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额。

2、在投资人认购/申购基金时不收取认购/申购费用，而是从本类别基金财产中计提销售服务费，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，称为 C 类基金份额。

本基金 A 类、C 类基金份额分别设置基金代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类、C 类基金份额将分别计算并公布基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人可在法律法规和基金合同规定的范围内，且在不损害基金份额持有人利益以及不提高现有基金份额持有人适用费率的情况下，经与基金托管人协商一致，增加新的基金份额类别、变更收费方式、停止现有基金份额类别的销售或者对基金份额分类办法及规则进行调整等，无需召开基金份额持有人大会，但调整实施前基金管理人需及时公告。

（七）基金的最低募集金额

本基金为发起式基金，发起资金提供方使用发起资金认购本基金的金额不少于 1000 万元，且持有期限不少于 3 年。

（八）发起资金的认购

发起资金提供方使用发起资金认购本基金的金额不低于 1000 万元人民币，认购的基金份额持有期限不少于三年。认购基金份额的高级管理人员或基金经理等人员在上述期限内离职的，其持有期限的承诺不受影响。法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

本基金发起资金的认购情况见基金管理人届时发布的公告。

（九）本基金的基金份额发售面值、认购价格及计算公式、认购费用

1、基金份额发售面值：每份基金份额发售面值为人民币 1.00 元

2、认购价格：发售面值

3、本基金 A 类基金份额在认购时收取认购费，投资人在一天之内如果有多笔 A 类基金份额认购，适用费率按单笔 A 类基金份额的认购申请分别计算，已受理的认购申请不允许撤销；本基金 C 类基金份额不收取认购费。

本基金 A 类基金份额的认购费率如下：

A 类基金份额认购金额	A 类基金份额认购费率
50 万元以下	1.2%

50 万元(含)至 200 万元	0.8%
200 万元(含)至 500 万元	0.4%
500 万元(含)以上	1000 元/笔

本基金 A 类基金份额的认购费用由认购 A 类基金份额的投资人承担, 并应在投资人认购 A 类基金份额时收取, 不列入基金财产, 主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

4、认购份额的计算公式

(1) A 类基金份额的认购

如果投资人选择认购本基金的 A 类基金份额, 则认购份额的计算方式如下:

净认购金额 = 认购金额 / (1 + 认购费率)

(注: 对于适用固定金额认购费用的认购, 净认购金额 = 认购金额 - 固定认购费用金额)

认购费用 = 认购金额 - 净认购金额

(注: 对于适用固定金额认购费用的认购, 认购费用 = 固定认购费用金额)

认购份额 = (净认购金额 + 认购利息) / 基金份额发售面值

A 类基金份额认购的有效份额保留到小数点后 2 位, 小数点 2 位以后的部分四舍五入, 由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

例 1: 某投资人投资 10,000 元认购本基金的 A 类基金份额, 如果认购期内认购资金获得的利息为 3 元, 则其可得到的 A 类基金份额计算如下:

净认购金额 = $10,000 / (1 + 1.2\%) = 9,881.42$ 元

认购费用 = $10,000 - 9,881.42 = 118.58$ 元

认购份额 = $(9,881.42 + 3) / 1.00 = 9,884.42$ 份

即投资人投资 10,000 元认购本基金 A 类基金份额, 加上募集期间利息后一共可以得到 9,884.42 份 A 类基金份额。

例 2: 某投资人一次性投资 1,000 万元认购本基金 A 类基金份额, 如果认购期内认购资金获得的利息为 1,800 元, 则其可得到的 A 类基金份额计算如下:

认购金额 = 10,000,000 元

净认购金额 = $10,000,000 - 1,000 = 9,999,000.00$ 元

认购份额 = $(9,999,000 + 1,800) / 1.00 = 10,000,800.00$ 份

即投资人投资 1,000 万元认购本基金 A 类基金份额, 加上募集期间利息后一

共可以得到 10,000,800.00 份 A 类基金份额。

(2) C 类基金份额的认购

如果投资人选择认购本基金的 C 类基金份额，则认购份额的计算方式如下：

净认购金额=认购金额

认购份额=（净认购金额+认购利息）/基金份额发售面值

C 类基金份额认购的有效份额保留到小数点后 2 位，小数点 2 位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

例 3：某投资人投资 3 万元认购本基金 C 类基金份额，如果认购期内认购资金获得的利息为 3 元，则其可得到的 C 类基金份额计算如下：

认购金额 = 30,000.00 元

净认购金额 = 30,000.00 元

认购份额= (30,000+3.00)/1.00=30,003.00 份

即投资人投资 3 万元认购本基金 C 类基金份额，加上募集期间利息后一共可以得到 30,003.00 份 C 类基金份额。

(十) 投资人对基金份额的认购

1、本基金的认购时间安排：具体认购时间安排请见基金份额发售公告。

2、认购应提交的文件和办理手续：投资人认购本基金应首先办理开户手续，开立基金账户，然后办理基金认购手续。

投资人认购应提交的文件和办理的手续请详细查阅本基金的基金份额发售公告。

3、认购方式及确认

本基金认购采取金额认购的方式。T 日的申请是否有效应以登记机构的确认登记为准。投资人可以自 T+2 日起，通过其原认购网点柜台或本基金管理人客户服务中心，查询认购申请的受理情况。投资人可在基金合同生效后到各销售网点查询最终成交确认情况和认购的份额。

销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购申请的确认以登记机构的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利，否则，由此产生的任何损失由投资者自行承担。

4、认购限制

(1) 投资人认购时，需按销售机构规定的方式全额缴款。

(2) 基金投资者在基金募集期内可以多次认购基金份额。A 类基金份额的认购费按每笔 A 类基金份额的认购申请单独计算。认购申请一经受理不得撤销。

(3) 本基金代销机构首次认购和追加认购的最低金额按照基金管理人和代销机构约定的为准；本基金直销网点最低认购金额由基金管理人制定和调整。详见本基金的基金份额发售公告。

基金管理人可以对每个基金交易账户的单笔最低认购金额进行限制，具体限制请参看相关公告。

(4) 如本基金单个投资人累计认购的基金份额数达到或者超过基金总份额的 50%，基金管理人可以采取比例确认等方式对该投资人的认购申请进行限制。基金管理人接受某笔或者某些认购申请有可能导致投资者变相规避前述 50%比例要求的，基金管理人有权拒绝该等全部或者部分认购申请。基金管理人、基金管理人高级管理人员或基金经理等人员作为发起资金提供方使用发起资金认购的基金份额达到或超过基金总份额 50%的，不受上述限制。投资人认购的基金份额数以基金合同生效后登记机构的确认为准。

(十一) 首次募集期间认购资金的管理和利息的处理方式

基金募集期间募集的资金只能存入专用账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。有效认购款项在募集期间产生的利息将折算为相应类别的基金份额归基金份额持有人所有，其中利息转份额的具体数额以登记机构的记录为准。

基金募集期间的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用，不得从基金财产中列支。

七、基金合同生效

（一）基金备案的条件

本基金自基金份额发售之日起 3 个月内，在发起资金提供方使用发起资金认购本基金的金额不少于 1000 万元人民币且承诺持有期限不少于 3 年的条件下，基金募集期届满或基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售，并在 10 日内聘请法定验资机构验资，验资报告需对发起资金提供方及其持有的基金份额进行专门说明。基金管理人自收到验资报告之日起 10 日内，向中国证监会办理基金备案手续。

基金募集达到基金备案条件的，自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起，《基金合同》生效；否则《基金合同》不生效。基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对《基金合同》生效事宜予以公告。基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。

（二）基金合同不能生效时募集资金的处理方式

如果募集期限届满，未满足基金备案条件，基金管理人应当承担下列责任：

- 1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；
- 2、在基金募集期限届满后 30 日内退还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息（税后）；
- 3、如基金募集失败，基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬；基金管理人、基金托管人和销售机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。

（三）基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

《基金合同》生效满 3 年后的对应日（指自然日，若无对应日则顺延至下一日），若基金资产规模低于 2 亿元，《基金合同》应当终止，且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续。若届时法律法规或中国证监会规定发生变化，上述终止规定被取消、更改或补充，则本基金可以参照届时有效的法律法规或中国证监会规定执行。

《基金合同》生效满 3 年后继续存续的，连续 20 个工作日出现基金份额持

有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当在 10 个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并在 6 个月内召集基金份额持有人大会进行表决。法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

八、基金份额的申购与赎回

（一）申购和赎回的场所

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。销售机构名单和联系方式见上述第五章第（一）条或基金管理人网站。基金管理人可以根据情况针对某类基金份额变更或增减销售机构，并在基金管理人网站公示。投资人应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。

（二）申购和赎回的开放日及时间

1、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，若本基金参与港股通交易且该交易日为非港股通交易日时，基金管理人可调整本基金的开放日或开放时间，具体安排以届时提前发布的公告为准。但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

基金合同生效后，若出现不可抗力、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或根据业务需要，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

2、申购、赎回开始日及业务办理时间

基金管理人将根据实际情况决定本基金开始办理申购的具体日期，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。

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

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

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

类基金份额申购、赎回或转换的价格。

（三）申购和赎回的原则

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

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；

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

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

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

基金管理人可在法律法规允许且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

（四）申购和赎回的数额限定

1、投资者通过销售机构首次申购基金份额单笔最低限额为人民币 10 元（含申购费）；追加申购单笔最低限额为人民币 10 元（含申购费）。

2、赎回的最低份额为 10 份基金份额。基金份额持有人可将其全部或部分基金份额赎回。若某投资者持有的基金份额不足 10 份或其某笔赎回导致该持有人持有的基金份额不足 10 份的，投资者在赎回时需一次全部赎回，否则将自动赎回。

3、代销网点的投资人欲转入直销网点进行交易要受直销网点最低金额的限制。基金管理人可根据市场情况，调整首次申购的最低金额。

4、投资人可多次申购，对单个投资人单日或单笔申购金额、累计持有份额不设上限限制。法律法规、中国证监会或基金合同另有规定的除外。

5、基金管理人有权规定本基金的总规模限额、单日申购金额限制、单日净申购比例上限，具体规定请参见更新的招募说明书或相关公告。

6、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，

基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施,切实保护存量基金份额持有人的合法权益。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要,可采取上述措施对基金规模予以控制。具体见基金管理人相关公告。

7、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或新增基金规模控制措施。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

(五) 申购和赎回的程序

1、申购和赎回的申请方式

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

2、申购和赎回的款项支付

投资人申购基金份额时,必须按销售机构规定的方式在规定的时间内全额交付申购款项,否则所提交的申购申请不成立。投资人按销售机构规定的方式在规定的时间内全额交付申购款项,申购申请成立;登记机构确认基金份额时,申购申请生效。

基金份额持有人在规定的时间内递交赎回申请,赎回成立;基金份额持有人在提交赎回申请时须持有足够的基金份额余额,否则所提交的赎回申请不成立。登记机构确认赎回时,赎回生效。投资人赎回申请生效后,基金管理人将在 T+7 日(包括该日)内支付赎回款项。在发生巨额赎回或基金合同载明的其他暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形时,款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。

遇证券、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、港股通交易系统或港股通资金交收规则限制或其它非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程时,赎回款项顺延至该因素消除的最近一个工作日划出。

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

3、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购

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

基金管理人可在法律法规允许的范围内,且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下,依法对上述申购和赎回申请的确认时间进行调整,并必须在调整实施日前按照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

基金销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表该申请一定成功,而仅代表销售机构确实接收到申购、赎回申请。申购、赎回申请的确认以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权利。因投资人怠于履行查询等各项义务,致使其相关权益受损的,基金管理人、基金托管人、销售机构不承担由此造成的损失或不利后果。

(六) 基金的申购费和赎回费

1、申购费用

本基金A类基金份额在申购时收取申购费,本基金A类基金份额申购设置级差费率,申购费率随申购金额的增加而递减,投资者可以多次申购,申购费率按每笔A类基金份额的申购申请单独计算;C类基金份额在申购时不收取申购费。

本基金A类基金份额的申购费率表如下:

A类基金份额申购金额	A类基金份额申购费率
50万元以下	1.5%
50万元(含)至200万元	1.2%
200万元(含)至500万元	0.8%
500万元(含)以上	1000元/笔

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

因红利自动再投资而产生的基金份额,不收取相应的申购费用。

2、赎回费用

投资者在赎回本基金A类、C类基金份额时,赎回费用由赎回各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相应类别基金份额时收取,其中对持续持有期少于7日的投资者收取不低于1.50%的赎回费,并将上述赎回费全

额计入基金财产。A类、C类基金份额的赎回费率具体如下：

持有期限 (N)	A类基金份额赎回费率	C类基金份额赎回费率
N<7 日	1.50%	1.50%
7 日≤N<30 日	0.75%	0.50%
30 日≤N<180 日	0.50%	0
N≥180 日	0	

对于收取的持续持有期少于 30 日的投资者的赎回费，基金管理人将全额计入基金财产。对于收取的持续持有期长于等于 30 日但少于 3 个月的投资者的赎回费，基金管理人将其总额的 75% 计入基金财产。对于收取的持续持有期长于等于 3 个月但少于 6 个月的投资者的赎回费，基金管理人将其总额的 50% 计入基金财产。未计入基金财产的部分用于支付登记结算费和其他必要的手续费。

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

4、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。

5、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定且对存量基金份额持有人利益无实质性不利影响的情形下，根据市场情况制定基金促销计划，针对投资人定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金销售费率，或针对特定渠道、特定投资群体开展有差别的费率优惠活动。

（七）申购和赎回的数额和价格

1、申购和赎回数额、余额的处理方式

（1）申购的有效份额为净申购金额除以当日的该类基金份额净值，有效份额单位为份，申购份额的计算结果按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

（2）赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日该类基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。赎回金额的计算结果按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

2、申购份额的计算

(1) A 类基金份额的申购份额的计算公式为:

申购总金额=申请总金额

净申购金额=申购总金额/ (1+申购费率)

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

申购费用=申购总金额-净申购金额

(注: 对于适用固定金额申购费用的申购, 申购费用=固定申购费用金额)

申购份额=净申购金额/ T 日 A 类基金份额净值

例 4: 某投资人投资 40,000 元申购本基金 A 类基金份额, 对应的申购费率为 1.5%, 假设申购当日 A 类基金份额净值为 1.0400 元, 则其可得到的申购份额为:

申购总金额=40,000 元

净申购金额=40,000/(1+1.5%)=39,408.87 元

申购费用=40,000-39,408.87=591.13 元

申购份额=39,408.87/1.0400=37,893.14 份

即该投资人投资 40,000 元申购本基金 A 类基金份额, 假设申购当日 A 类基金份额净值是 1.0400 元, 则其可得到 37,893.14 份 A 类基金份额。

例 5: 某投资人投资 1,000 万元申购本基金 A 类基金份额, 申购费为 1,000 元, 假设申购当日 A 类基金份额净值为 1.0400 元, 则其可得到的申购份额为:

申购总金额 = 10,000,000 元

申购费用=1,000 元

净申购金额 = 10,000,000-1,000=9,999,000.00 元

申购份额 = 9,999,000.00/1.0400=9,614,423.08 份

即该投资人投资 1,000 万元申购本基金 A 类基金份额, 假设申购当日 A 类基金份额净值是 1.0400 元, 则其可得到 9,614,423.08 份 A 类基金份额。

(2) C 类基金份额的申购份额的计算公式为:

申购总金额=申请总金额

申购份额=申购总金额/ T 日 C 类基金份额净值

例 6: 假设某投资者投资 10 万元申购本基金 C 类基金份额, 申购当日本基

金 C 类基金份额净值为 1.0600 元，则可得到的申购份额为：

申购总金额=100,000 元

申购份额=100,000/1.0600=94,339.62 份

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

3、赎回金额的计算

赎回费用=赎回份额×T 日各类基金份额净值×赎回费率

赎回金额=赎回份额×T 日各类基金份额净值-赎回费用

例 7：某投资人申购 1 万份本基金 A 类基金份额后，又在第 6 日（7 日内）赎回 1 万份 A 类基金份额，对应的赎回费率为 1.50%，假设赎回当日 A 类基金份额净值是 1.0160 元，则其可得到的赎回金额为：

赎回费用 = 10,000×1.0160×1.50%=152.40 元

赎回金额 = 10,000×1.0160-152.40=10,007.60 元

即：该投资人赎回其持有期为 6 日（7 日以内）的 1 万份 A 类基金份额，假设赎回当日 A 类基金份额净值是 1.0160 元，则其可得到的赎回金额为 10,007.60 元。

4、基金份额净值的计算公式

本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码，分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值。

某一类基金份额净值=该类基金资产净值总额/发行在外的该类基金份额总数

本基金 T 日的各类基金份额净值在当天收市后计算，并根据基金合同约定进行公告。遇特殊情况，经履行适当程序，可以适当延迟计算或公告。本基金各类基金份额净值的计算，均保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

（八）申购与赎回的注册登记

1、基金投资人提出的申购和赎回申请，在当日交易时间结束之前可以撤销；

2、投资人 T 日申购基金成功后，基金登记机构在 T+1 日内为投资人增加权益并办理注册登记手续，投资人自 T+2 日（包括该日）之后有权赎回该部分基金份额；

3、投资人 T 日赎回基金成功后，基金登记机构在 T+1 日内为投资人扣除权益并办理相应的注册登记手续；

4、基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，并最迟于调整实施日前按照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介予以公告。

(九) 拒绝或暂停申购的情形及处理方式

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

- 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时。
- 3、证券、期货交易所或外汇市场交易时间非正常停市，或基金参与港股通交易且港股通暂停交易，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
- 4、接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益或对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时。
- 5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或发生其他损害现有基金份额持有人利益的情形。
- 6、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结算系统无法正常运行。
- 7、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金申购申请。
- 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（基金管理人、基金管理人高级管理人员或基金经理等人员作为发起资金提供方除外）持有基金份额的比例达到或者超过 50%，或者变相规避 50%集中度的情形。
- 9、接受某笔或某些申购申请会超过基金管理人设定的本基金的总规模限额、单日申购金额限制、单日净申购比例上限、单个投资者单日或单笔申购金额上限的，或接受该申购申请会使单个投资者累计持有的基金份额超出基金管理人公告的限额时。
- 10、基金参与港股通交易且港股通交易每日额度不足，或者发生证券交易服务公司等机构认定的交易异常情况并决定暂停提供部分或者全部港股通服务，或

者发生其他影响通过内地与香港股票市场交易互联互通机制进行正常交易的情形。

11、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述除第 4、8、9 项以外的暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在规定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝，被拒绝的申购款项本金将退还给投资人，基金管理人及基金托管人不承担该退回款项产生的利息等损失。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

(十) 暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

- 1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。
- 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时。
- 3、证券、期货交易所或外汇市场交易时间非正常停市，或基金参与港股通交易且港股通暂停交易，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时。
- 5、发生继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时。
- 6、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请。
- 7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时，基金管理人应按规定报中国证监会备案，根据有关规定在规定媒介上刊登暂停赎回公告，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。若出现上述第 4 项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

(十一) 巨额赎回的情形及处理方式

- 1、巨额赎回的认定

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

2、巨额赎回的处理方式

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

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

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

(3) 若本基金发生巨额赎回，且在单个开放日内出现单个基金份额持有人超过前一开放日基金总份额 10%的赎回申请（“大额赎回申请人”）的情形时，基金管理人有权对大额赎回申请人的赎回申请延期办理，即按照保护其他赎回申请人（“小额赎回申请人”）利益的原则，基金管理人有权优先确认小额赎回申请人的赎回申请，对小额赎回申请人的赎回申请在当日被全部确认，且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，在仍可接受赎回申请的范围内对大额赎回申请人的赎回申请按比例确认。对大额赎回申请人当日未予确认的部分，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，当日未获处理的赎回申请将自动转入下一个开放日继续赎回，直至全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的赎回申请将被撤销。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，直至全部赎回为止。如大额赎回申请人在提交赎回申请时未作明确选择，大额赎回申请人未能赎回部分作自动延期赎回处理。如小额赎回申请人的赎回申请在当日未被全部确认，则对全部未确认的赎回申请（含小额赎回申请人的其余赎回申请与大额赎回申请人的全部赎回申请）延期办理。延期办理的具体程序，按照本条规定的延期赎回或取消赎回的方式办理；同时，基金管理人应当对延期办理事宜在规定媒介上刊登公告。基金管理人在履行适当程序后，有权根据当时市场环境调整前述比例和办理措施，并在规定媒介上进行公告。

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

3、巨额赎回的公告

当发生上述巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，并在 2 日内在规定媒介上刊登公告。

（十二）暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

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

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

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规定媒介上刊登重新开放申购或赎回的公告；也可以根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间，届时可不再另行发布重新开放的公告。

（十三）基金转换

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

（十四）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是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；捐赠是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。

（十五）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。

（十六）定期定额投资计划

基金管理人可以为投资人办理定期定额投资计划，具体规则由基金管理人另行规定。投资人在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额，每期扣款金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。

（十七）基金份额的冻结、解冻和质押

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。法律法规或监管部门另有规定的除外。

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

（十八）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。

（十九）实施侧袋机制期间本基金的申购与赎回

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

九、基金的投资

（一）投资目标

本基金秉持 ESG 主题投资理念，在保持资产流动性以及控制风险的基础上，通过积极主动的投资管理，追求基金资产的长期稳健增值。

（二）投资范围

本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票和存托凭证）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、地方政府债券、政府支持机构债券、政府支持债券、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、短期融资券、超短期融资券、中期票据、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、可交换债券及其他中国证监会允许基金投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、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）。

本基金可根据法律法规的规定参与融资业务。

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

基金的投资组合比例为：

本基金股票资产占基金资产的比例为 60%-95%，其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%，投资于 ESG 主题股票的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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

（三）投资策略

1、资产配置策略

本基金通过定量分析和定性分析相结合的方法，综合分析宏观经济面、政策面、市场面等多种因素以及证券市场的演化趋势，评估股票、债券等各类资产的

预期收益和风险，在投资比例限制范围内，确定或调整投资组合中股票、债券等各类资产的比例。

本基金考虑的宏观经济指标包括 GDP 增长率、居民消费价格指数、生产者价格指数、货币供应量的增长率等；政策面因素包括货币政策、财政政策、产业政策的变化趋势等；市场因素包括市场资金供求变化、上市公司的盈利增长情况、市场总体 PE、PB 等指标相对于长期均值水平的偏离度等。

2、股票投资策略

本基金通过将环境、社会和公司治理（ESG）因素纳入投资决策开展可持续投资实践。本基金基于内部 ESG 评价体系与第三方 ESG 评级相结合的 ESG 评价数据库，采用负面剔除和 ESG 指标评价方法，在构建、调整投资组合时，根据负面剔除的原则，对不符合 ESG 理念以及有重大 ESG 负面记录的行业及个股进行剔除；在此基础上，对于符合 ESG 投资标准的公司，通过分析公司公开披露信息和实地调研等定性、定量相结合的方式综合评价其环境、社会和公司治理方面的表现，并持续跟踪以保证相关公司 ESG 评价的及时更新。

（1）ESG 主题的界定

ESG 投资是环境（Environmental）、社会（Social）、公司治理（Governance）投资的总称，也是现代社会责任投资的重要组成部分，在投资决策过程中，除基于传统的财务回报因素外，也要从环境、社会、公司治理三大角度，评估企业经营的可持续性，以及对社会价值观的影响。ESG 投资的核心就是希望可以探索出一条可持续发展的道路，将传统投资与 ESG 的相关理念结合起来，寻求商业价值与社会责任之间的平衡。

本基金重点关注 ESG 指标包括：

1) 环境(E)

环境维度重点考察企业活动对环境直接或间接的影响，主要包括：

环境管理：外部环境管理体系认证、公司节能节水政策、员工环境保护培训等；

环境披露：能源消耗量和节能量、耗水情况、碳排放、污染排放等；

负面事项：水污染、大气污染、固废污染负面事件等。

2) 社会(S)

社会维度重点考察企业员工管理、供应链管理、产品安全性等可能对社会造成的影响，主要包括：

责任披露管理：社会责任报告披露、社会责任报告编制质量等；

员工管理：员工健康与安全、员工多样化、女性员工数量、员工薪酬、员工培训情况、员工离职率等；

供应链管理：供应商管理政策和制度、供应链监督等；

客户管理：客户信息保护、客户满意度、客户投诉率等；

产品管理：质量体系认证、产品安全性等；

公益活动：企业基金会、企业捐赠、员工公益活动等；

负面事项：侵犯员工/供应商/客户权益、产品/服务质量问题、社会舆论影响较大的负面争议事件等。

3) 公司治理（G）

公司治理维度重点考察企业的内部治理问题，主要包括：

公司治理：信息披露、董事会独立性、关联交易、董事和高管薪酬、审计独立性等；

商业道德：反腐败和反贿赂、纳税透明度、反洗钱政策等；

负面事项：企业违法违规行为，如贪污受贿、财务造假、内部交易等。

本基金将根据上述环境、社会和公司治理（ESG）三个方面的评价指标，基于内部 ESG 评价体系与第三方 ESG 评级相结合的 ESG 评价数据库，计算公司的 ESG 得分，优选投资标的。在构建、调整投资组合时，根据负面剔除的原则，对不符合 ESG 理念以及有重大 ESG 负面记录的行业及个股进行剔除；在此基础上，对于符合 ESG 投资标准的公司，通过分析公司公开披露信息和实地调研等定性、定量相结合的方式综合评价其环境、社会和公司治理方面的表现。

ESG 评价基于 ESG 信息披露与舆论监控，进行定期更新与临时调整相结合的评价更新。当相关公司发生重大环境污染、安全事故、公司治理争议事件、财务舞弊等负面事件时，本基金管理人将通过内部研究对公司的 ESG 评价进行临时调整，以保证相关公司 ESG 评价的及时更新。

未来，随着 ESG 评估方法以及上市公司 ESG 信息披露规则等进一步完善，本基金可以结合监管要求与市场环境的变化，在履行适当程序后对 ESG 相关评

价指标进行动态调整。

（2）行业配置

在行业配置层面，本基金将主要投资于符合 ESG 主题的相关行业，通过跟踪各行业整体的收入增速、利润增速、毛利率变动幅度、ROIC 变动情况来判断各行业的景气度，根据行业整体的估值情况、市场预期、目前机构配置的比例等因素综合考虑各行业在投资组合中的配置比例。

（3）个股选择

本基金在 ESG 方法筛选的前提下，以“自下而上”的个股投资策略为主，采用定性分析和定量分析相结合，通过深入的基本面分析、估值分析和市场面分析，精选出具有清晰、可持续的业绩增长潜力且被市场相对低估、价格处于合理区间的股票进行投资，兼顾价值风格与成长风格的平衡。

1) 定性分析

公司核心优势：选择在产品、技术、创新能力、资源、品牌等方面具备核心竞争力的上市公司；

公司发展潜力：选择符合未来经济发展方向或受益于经济体制改革的上市公司；

公司商业模式：选择业务规划和发展战略清晰、核心商业模式具有可持续性的上市公司；

公司治理结构：选择公司治理结构良好、管理层经验丰富、激励机制合理的上市公司。

2) 定量分析

本基金主要通过成长性分析、财务分析和估值分析等，重点考察上市公司的资产质量、盈利能力、偿债能力、成本控制能力、成长性和相对价值等。成长性指标包括营业利润增长率、净利润增长率、收入增长率等；财务指标包括毛利率、营业利润率、净资产收益率、净利率、经营活动净收益/利润总额等；估值指标包括市盈率（PE）、市净率（PB）、市盈率相对盈利增长比率（PEG）、市销率（PS）等。

（4）港股通标的股票投资策略

本基金将采用“自下而上”的个股精选策略，结合公司基本面、相关行业发

展前景、香港市场资金面和投资者行为等因素，精选符合本基金投资目标的港股通标的股票。

（5）存托凭证的投资策略

本基金投资存托凭证的策略依照上述上市交易的股票投资策略执行。

3、债券投资策略

本基金将在分析和判断国际、国内宏观经济形势、资金供求曲线、市场利率走势、信用利差状况和债券市场供求关系等因素的基础上，动态调整组合久期和债券的配置结构，综合内外部信用评级，精选债券，获取收益。

4、可转换债券（含可交换债券）投资策略

可转换债券和可交换债券同时具有债券类与权益类证券的双重特性。本基金利用可转换债券及可交换债券的债券底价和到期收益率、信用风险来判断其债性，增强本金投资的安全性；利用可转换债券和可交换债券转股溢价率、基础股票基本面趋势和估值来判断其股性，在市场出现投资机会时，优先选择股性强的品种。综合选择安全边际较高、基础股票基本面优良的品种进行投资，获取超额收益。

5、资产支持证券投资策略

本基金将采用定量分析和定性分析相结合的方法，综合评估资产支持证券的利率风险、提前偿付风险、流动性风险、税收溢价等因素，选择具有较高投资价值的资产支持证券进行配置。

6、股指期货投资策略

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约以对冲投资组合的风险、有效管理现金流量或降低建仓或调仓过程中的冲击成本等。

7、融资业务投资策略

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

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

（四）投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金股票资产占基金资产的比例为 60%-95%，其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%，投资于 ESG 主题股票的比例不低于非现金基金资产的 80%；

（2）本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

（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 股合计计算），不超过该证券的 10%；完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金品种可以不受此条款规定的比例限制；

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

（6）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

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

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

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

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

（11）本基金资产总值不超过基金资产净值的 140%；

（12）本基金参与股指期货交易时，依据下列标准构建组合：

1) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值不得超过基金

资产净值的 10%；

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

3) 本基金在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过本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%；

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

(14) 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；

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

(16) 本基金若参与融资业务的，应当遵守下列要求：每个交易日日终，本基金持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；

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

(18) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述第(2)、(9)、(14)、(15)项另有约定外,因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的,基金管理人应当在10个交易日内进行调整,但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的,从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起六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,基金管理人在履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制或按变更后的规定执行。

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或者活动:

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

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

法律法规或监管部门取消或变更上述限制,如适用于本基金,基金管理人

在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按变更后的规定执行。

（五）业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：沪深 300ESG 基准指数收益率×65%+中证港股通综合指数收益率×10%+中债新综合指数（全价）收益率×25%

沪深 300ESG 基准指数从沪深 300 样本中剔除中证一级行业内 ESG 分数最低的 20%的上市公司证券，选取剩余证券作为指数样本，为 ESG 投资提供业绩比较基准和投资标的，适合作为本基金股票投资的业绩比较基准。

中证港股通综合指数由中证指数有限公司编制，反映了港股通范围内上市公司的整体状况和走势，具有良好的市场代表性，适合作为本基金港股投资部分的业绩比较基准。

中债新综合指数（全价）由中央国债登记结算有限责任公司编制，隶属于中债总指数族分类，该指数成分券包含除资产支持证券、美元债券、可转债以外剩余的所有公开发行的可流通债券，是一个反映境内人民币债券市场价格走势情况的宽基指数，是中债指数应用最广泛指数之一，适合作为本基金债券投资的业绩比较基准。

根据本基金的投资范围和投资比例约定，上述业绩比较基准与本基金的投资风格基本一致，可以比较客观地反映本基金的风险收益特征。

若今后上述基准指数停止计算编制或更改名称，或者未来法律法规发生变化，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，或者市场发生变化导致本业绩比较基准不再适用或本业绩比较基准停止发布，本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，在与基金托管人协商一致履行适当程序后调整业绩比较基准并及时公告，无需召开基金份额持有人大会。

（六）风险收益特征

本基金为混合型基金，其风险收益水平高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。

本基金可投资港股通标的股票，若投资，除需要承担与内地证券投资基金类似市场波动风险外，本基金还可能面临港股通机制下的诸如环境、市场波动风险、投资标的、市场制度以及交易规则等差异因素带来的特有风险。

（七）基金管理人代表基金行使股东或债权人权利的处理原则及方法

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

（八）侧袋机制的实施和投资运作安排

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

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

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

十、基金财产

（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、银行存款本息和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。除依法律法规和《基金合同》的规定处分外，基金财产不得被处分。

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

十一、基金资产估值

（一）估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券、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交易日。

（二）估值对象

基金所拥有的股票、存托凭证、债券、资产支持证券、股指期货合约、银行存款本息、应收款项和其它投资等资产及负债。

（三）估值原则

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

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

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

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

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

（四）估值方法

1、证券交易所上市的权益类证券的估值

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

（2）交易所上市不存在活跃市场的权益类证券，采用估值技术确定公允价值。

2、处于未上市期间的权益类证券应区分如下情况处理：

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

（2）首次公开发行未上市的股票，采用估值技术确定公允价值。

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

3、对于已上市或已挂牌转让的不含权固定收益品种，选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的估值全价。

4、对于已上市或已挂牌转让的含权固定收益品种，选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的唯一估值全价或推荐估值全价。

对于含投资者回售权的固定收益品种，行使回售权的，在回售登记日至实际收款日期间选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种的唯一估值全价或推荐估值全价，同时应充分考虑发行人的信用风险变化对公允价值的影响。回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的建议按照长待偿期所对应的价格进行估值。

5、对于在交易所市场上市交易的公开发行的可转换债券等有活跃市场的含转股权的债券，实行全价交易的债券选取估值日收盘价作为估值全价；实行净

价交易的债券选取估值日收盘价并加计每百元税前应计利息作为估值全价。

6、对于未上市或未挂牌转让且不存在活跃市场的固定收益品种，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定其公允价值。

7、对于发行人已破产、发行人未能按时足额偿付本金或利息，或者有其它可靠信息表明本金或利息无法按时足额偿付的债券投资品种，第三方估值基准服务机构可在提供推荐价格的同时提供价格区间作为公允价值的参考范围以及公允价值存在重大不确定性的相关提示。基金管理人在与基金托管人协商一致后，可采用价格区间中的数据作为该债券投资品种的公允价值。

8、同一证券同时在两个或两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。

9、估值计算中涉及港币对人民币汇率的，应当以估值日中国人民银行或其授权机构公布的人民币与港币的中间价为准。

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

11、股指期货合约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。

12、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。

13、本基金参与融资业务的，按照相关法律法规、监管部门和行业协会的相关规定进行估值。

14、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。

15、当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。

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

17、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，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净值信息的计算结果对外予以公布。

（五）估值程序

1、各类基金份额净值是按照每个估值日闭市后，各类基金资产净值除以当日该类基金份额的余额数量计算，均精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。基金管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人于每个估值日计算基金资产净值及各类基金份额净值，并按规定公告。

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

（六）估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当任一类基金份额净值小数点后 4 位以内(含第 4 位)发生估值错误时，视为该类基金份额净值错误。

基金合同的当事人应按照以下约定处理：

1、估值错误类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或登记机构、或销售机构、或投资人自身的过错造成估值错误，导致其他当事人遭受损失的，

过错的责任人应当对由于该估值错误遭受损失当事人(“受损方”)的直接经济损失按下述“估值错误处理原则”给予赔偿,承担赔偿责任。

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

2、估值错误处理原则

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

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

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

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

3、估值错误处理程序

估值错误被发现后,有关的当事人应当及时进行处理,处理的程序如下:

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

(2) 根据估值错误处理原则或当事人协商的方法对因估值错误造成的损失

进行评估；

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

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

4、基金估值错误处理的方法如下：

(1) 任一类基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

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

(3) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。如果行业另有通行做法，基金管理人、基金托管人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商。

(七) 暂停估值的情形

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

2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

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

4、法律法规规定、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

(八) 基金净值的确认

基金资产净值和各类基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个估值日交易结束后计算当日的基金资产净值和各类基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人按规定对基金净值信息予以公布。

(九) 特殊情况的处理

1、基金管理人、基金托管人按估值方法的第 14 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

2、由于不可抗力，或证券/期货交易所、登记结算机构及存款银行等第三方机构发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等非基金管理人与基金托管人原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

（十）实施侧袋机制期间的基金资产估值

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

十二、基金收益与分配

（一）基金利润的构成

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

（二）基金可供分配利润

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

（三）基金收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金可进行收益分配，具体分红方案见基金管理人根据基金运作情况届时不定期发布的相关分红公告；若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

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

4、由于本基金各类基金份额的费用不同，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同，本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

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

（四）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截至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供分配利润不同，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，在 2 日内在规定媒介公告。

（六）基金收益分配中发生的费用

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

（七）实施侧袋机制期间的收益分配

本基金实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配，详见本招募说明书“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、C类基金份额的销售服务费；
- 4、除法律法规、中国证监会另有规定外，《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、公证费、诉讼费和仲裁费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券、期货交易结算等费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、基金的相关账户的开户及维护费用；
- 10、因投资港股通标的股票而产生的各项合理费用；
- 11、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

(二) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.20%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、公休日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

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、公休日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

3、销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.60%年费率计提，计算方法如下：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

C 类基金份额销售服务费每日计提，按月支付，由基金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、公休日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

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

（三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；

- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

（四）实施侧袋机制期间的基金费用

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

（五）基金税收

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

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

（二）基金的年度审计

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

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》、《流动性风险管理规定》、基金合同及其他有关规定。相关法律法规关于信息披露的规定发生变化时，本基金从其最新规定。

(二) 信息披露义务人

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

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

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会规定媒介披露，并保证基金投资者能够按照基金合同约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

(三) 本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

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

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

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

(五) 公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

1、基金招募说明书、基金产品资料概要、基金合同、基金托管协议、基金份额发售公告

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

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

基金产品资料概要是基金招募说明书的摘要文件，用于向投资者提供简明的基金概要信息。基金管理人应当依照法律法规和中国证监会的规定编制、披露与更新基金产品资料概要。

基金合同生效后，基金招募说明书、基金产品资料概要的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书和基金产品资料概要，并登载在规定网站上，其中基金产品资料概要还应当登载在基金销售机构网站或营业网点；除重大变更事项之外，基金招募说明书、基金产品资料概要其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书和基金产品资料概要。

(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。

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

2、基金合同生效公告

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

基金合同生效公告中将说明基金募集情况及基金管理人、基金管理人高级管理人员、基金经理等人员以及基金管理人股东作为发起资金提供方持有的基金份额、承诺持有的期限等情况。

3、基金净值信息

《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周在规定网站披露一次各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。

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

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

4、基金份额申购、赎回价格

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

5、基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告

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

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

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

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

如报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额 20% 的情形，为保障其他投资者的权益，基金管理人至少应当在定期报告“影响投资者决

策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本基金的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

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

基金定期报告中应披露基金管理人、基金管理人高级管理人员、基金经理等投资管理人员以及基金管理人股东作为发起资金提供方持有基金的份额、期限及期间的变动情况。

6、临时报告

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

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

- (1) 基金份额持有人大会的召开及决定的事项；
- (2) 《基金合同》终止、基金清算；
- (3) 转换基金运作方式、基金合并；
- (4) 更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；
- (5) 基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；
- (6) 基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- (7) 基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人的实际控制人变更；
- (8) 基金募集期延长或提前结束募集；
- (9) 基金管理人高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；
- (10) 基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十；
- (11) 基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十；

- (12) 涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁；
- (13) 基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；
- (14) 基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易事项，中国证监会另有规定的情形除外；
- (15) 基金收益分配事项；
- (16) 管理费、托管费、销售服务费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- (17) 任一类基金份额净值估值错误达该类基金份额净值百分之零点五；
- (18) 本基金开始办理申购、赎回；
- (19) 本基金发生巨额赎回并延期办理；
- (20) 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；
- (21) 本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；
- (22) 调整基金份额类别的设置；
- (23) 本基金推出新业务或服务；
- (24) 发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；
- (25) 基金管理人采用摆动定价机制进行估值；
- (26) 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和基金合同约定的其他事项。

7、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。

8、基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。基金份额持有人或基金份额持有人大会的日常机构（如有）依法自主召集基

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

9、清算报告

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

10、投资资产支持证券的信息披露

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

11、投资港股通标的股票的信息披露

基金管理人应当在定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露本基金参与港股通标的股票投资的相关情况。

12、投资股指期货的信息披露

基金管理人应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露股指期货交易情况，包括交易政策、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。

13、参与融资业务的信息披露

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

14、投资存托凭证的信息披露

本基金投资存托凭证的信息披露依照境内上市交易的股票执行。

15、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。

16、中国证监会规定的其他信息

（六）信息披露事务管理

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

基金管理人、基金托管人应加强对未公开披露基金信息的管控，并建立基金敏感信息知情人登记制度。基金管理人、基金托管人及相关从业人员不得泄露未公开披露的基金信息。

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

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

基金管理人、基金托管人应当在规定报刊中选择一家报刊披露本基金信息。

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

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

基金管理人、基金托管人除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。

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

（七）信息披露文件的存放与查阅

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

（八）暂停或延迟披露基金相关信息的情形

当出现下述情况时，基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金信息：

- 1、不可抗力；
- 2、基金投资所涉及的证券、期货市场或外汇市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 3、发生暂停估值的情形；
- 4、法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情况。

（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和实施程序

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。基金管理人应当在启用侧袋机制当日报基金管理人所在地中国证监会派出机构备案。

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

（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）基金份额的登记

侧袋机制实施期间，基金管理人应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。

2、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

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。

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。

侧袋机制实施期间，基金管理人、基金服务机构在计算基金业绩相关指标时仅考虑主袋账户资产，分割侧袋账户资产导致的基金净资产减少在计算基金业绩相关指标时按投资损失处理。基金管理人、基金服务机构在展示基金业绩时，应当就前述情况进行充分的解释说明，避免引起投资者误解。

3、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，其他费用详见届时发布的相关公告。

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。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。

4、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。

5、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基金净值信息。

(2) 定期报告

侧袋机制实施期间，基金管理人应当按照法律法规的规定在基金定期报告中披露报告期内侧袋账户相关信息，基金定期报告中的基金会计报表仅需针对主袋账户进行编制。侧袋账户相关信息在定期报告中单独进行披露。会计师事务所对基金年度报告进行审计时，应对报告期内基金侧袋机制运行相关的会计核算和年度报告披露，执行适当程序并发表审计意见。

(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。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

应按照相关法律法规要求及时发布临时公告。

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。

6、特定资产的处置清算

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。

侧袋账户资产完全清算后，基金管理人应注销侧袋账户。

7、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《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所进行审计并披露专项审计意见。

(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

基金份额持有人须了解并承受以下风险：

（一）市场风险

证券市场价格因受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响而引起的波动，将对基金收益水平产生潜在风险，主要包括：

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

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

3、利率风险。金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着债券的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。基金投资于债券和债券回购，其收益水平会受到利率变化和货币市场供求状况的影响。

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

5、购买力风险。基金投资的目的是基金资产的保值增值，如果发生通货膨胀，基金投资于证券所获得的收益可能会被通货膨胀抵消，从而使基金的实际收益下降，影响基金资产的保值增值。

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

（二）管理风险

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

（三）流动性风险

流动性风险是指基金资产不能迅速转变成现金，或者不能应付可能出现的投资者大额赎回的风险。在开放式基金交易过程中，可能会发生巨额赎回的情形。巨额赎回可能会产生基金仓位调整的困难，导致流动性风险，甚至影响基金份额净值。

（1）基金申购、赎回安排

本基金在持有人集中度控制、巨额赎回监测及应对在投资者申购赎回方面均明确了管理机制，在接受申购申请对存量持有人利益构成潜在重大不利影响，以及市场大幅波动、流动性枯竭等极端情况下发生无法应对投资者巨额赎回的情形时，基金管理人在保障投资者合法权益的前提下可按照法律法规及基金合同的规定，审慎确认申购赎回申请并综合运用各类流动性风险管理工具作为辅助措施，全面应对流动性风险。具体申购、赎回安排详见本招募说明书第八章。

（2）拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

本基金主要投资于包括股票和存托凭证、港股通标的股票、债券、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、货币市场工具、股指期货等，上述资产均存在规范的交易场所，运作时间长，市场透明度较高，历史流动性状况良好。本基金实际投资过程中，将高度重视基金组合的流动性风险，合理配置资产。极端市场情况下，基金管理人会按照基金合同及相关法律法规要求，及时启动流动性风险应对措施，保护基金投资者的合法权益。

（3）巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

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决定全额赎回或部分延期赎回。同时，如本基金发生巨额赎回，且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前一开放日基金总份额一定比例的，基金管理人有权对前述单个赎回申请人赎回申请进行延期办理。具体内容详见本招募说明书第八章。

（4）实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响

在市场大幅波动、流动性枯竭等极端情况下发生无法应对投资者巨额赎回的情形时，基金管理人将以保障投资者合法权益为前提，严格按照法律法规及基金合同的规定，谨慎选取延期办理巨额赎回申请、暂停接受赎回申请、延缓支付赎

回款项、收取短期赎回费、暂停基金估值、摆动定价、启用侧袋机制等流动性风险管理工具作为辅助措施。对于各类流动性风险管理工具的使用，基金管理人将依照严格审批、审慎决策的原则，及时有效地对风险进行监测和评估，使用前经过内部审批程序并与基金托管人协商一致。在实际运用各类流动性风险管理工具时，投资者的申购赎回申请、赎回款项支付、投资成本等可能受到相应影响，基金管理人将严格依照法律法规及基金合同的约定进行操作，全面保障投资者的合法权益。

（四）信用风险

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

（五）本基金特定风险

1、股指期货投资风险

本基金的投资范围包括股指期货，股指期货采用保证金交易制度，由于保证金交易具有杠杆性，当出现不利行情时，股价指数微小的变动可能会使投资人权益遭受较大损失。股指期货采用每日无负债结算制度，如果没有在规定的时间内补足保证金，按规定将被强制平仓，可能给投资带来重大损失。

2、投资资产支持证券的风险

本基金可投资资产支持证券，由于资产支持证券一般都针对特定机构投资人发行，在特定机构投资人范围内流通转让，该品种的流动性较差，抵押资产的流动性一般较差，因此，持有资产支持证券可能给组合资产净值带来一定的风险。另外，资产支持证券还面临提前偿还和延期支付等风险。

3、投资存托凭证的风险

本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于境内股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与存托凭证发行机制相关的风险，包括存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险；存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险；存托协议自动约束存托凭证持有人的风险；因地上市造成存托凭证价格差异以及波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；存托凭证退市的风险；已在境外上市的

基础证券发行人，在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险；境内外法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险。

4、参与融资业务的相关风险

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

5、主要投资于 ESG 主题相关上市公司的风险

本基金非现金资产中不低于 80% 的资产将投资于 ESG 主题股票，并在此基础上筛选具备核心竞争优势、发展空间大、有持续成长潜力的公司，构建投资组合。由于市场存在不确定性，基金资产投资于证券场所获取的收益受多方面因素影响，因此根据投资策略进行投资可能面临无法盈利甚至亏损的风险。

本基金对于“ESG 主题”的界定标准可能与行业已有定义或一般认知预期存在差异，未来随着科技进步及商业模式发展，ESG 主题的外延将可能会不断扩大，相关上市公司的范围也会相应改变。在不改变本基金投资目标及风险收益特征的前提下，经履行适当必要的程序后，本基金将根据实际情况调整 ESG 主题的界定标准。因此，本基金还面临 ESG 主题界定标准变更的风险，特提请投资者关注并在理性判断的基础上审慎做出投资选择。

6、投资港股通标的股票的风险

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

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

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

1) 香港市场实行 T+0 回转交易, 且证券交易价格并无涨跌幅上下限的规定, 因此每日涨跌幅空间相对较大, 港股股价可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动;

2) 只有内地和香港两地均为交易日才为港股通交易日, 在内地开市香港休市的情形下, 港股通不能正常交易, 港股不能及时卖出, 可能带来一定的流动性风险;

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, 本基金将面临在停市期间无法进行港股通交易的风险; 出现内地证券交易服务公司认定的交易异常情况时, 内地证券交易服务公司可能暂停提供部分或者全部港股通服务, 本基金将面临在暂停服务期间无法进行港股通交易的风险;

4) 本基金因港股通标的股票权益分派、转换、上市公司被收购等情形或者异常情况, 所取得的港股通标的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, 证券交易所另有规定的除外; 因港股通标的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; 因港股通标的股票权益分派、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。由于中国结算是汇总投资者意愿后再向香港结算提交投票意愿, 中国结算对投资者设定的意愿征集期比香港结算的征集期稍早结束; 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;

6) 汇率风险。本基金可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。故本基金投资港股通标的股票还面临汇率风险, 汇率波动可能对基金的投资收益造成影响;

7) 港股通每日额度限制。港股通业务实施每日额度限制。在香港联合交易所开市前时段, 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或收市竞价交易时段，港股通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。

7、发起式基金及基金合同自动终止的风险

本基金为发起式基金，发起资金提供方运用发起资金认购本基金的金额不低于 1000 万元，且持有期限不低于三年。三年后，发起资金提供方将根据自身情况决定是否继续持有，届时，发起资金提供方有可能赎回所持有的认购份额。

另外，《基金合同》生效满 3 年后的对应日（指自然日，若无对应日则顺延至下一日），若基金资产规模低于 2 亿元，《基金合同》应当终止，且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续，故投资者将面临基金合同可能终止的不确定性风险。

（六）未知价风险

本基金基金资产净值可能受证券市场影响有所波动，产生未知价风险。

（七）启用侧袋机制的风险

当本基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，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，侧袋账户份额将停止披露基金净值信息，并不得办理申购、赎回和转换，基金份额持有人可能面临无法及时获得侧袋账户对应部分的资金的流动性风险。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，但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。

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

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

启用侧袋机制后，基金管理人计算各项投资运作指标和基金业绩指标时仅需考虑主袋账户资产，并根据相关规定对分割侧袋账户资产导致的基金净资产减少进行按投资损失处理，因此本基金披露的业绩指标不能反映特定资产的真实价值及变化情况。

（八）本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险

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

（九）其他风险

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

（十）声明

1、本基金未经任何一级政府、机构及部门担保。投资人自愿投资于本基金，须自行承担投资风险。

2、除基金管理人直接办理本基金的销售外，本基金还通过代销机构代理销售，但是，基金并不是代销机构的存款或负债，也没有经代销机构担保或者背书，代销机构并不能保证其收益或本金安全。

十八、基金合同的变更、终止与基金财产清算

（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。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，自决议生效后两日内在规定媒介公告。

（二）基金合同的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，基金合同应当终止：

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

（三）基金财产的清算

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

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

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

4、基金财产清算程序：

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

(4) 制作清算报告；

(5) 聘请符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；

(6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；

(7) 对基金剩余财产进行分配。

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

(四) 清算费用

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

(五) 基金财产清算剩余资产的分配

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

(六) 基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告，基金财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

(七) 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存，保存期限不少于法定最低期限。

十九、基金合同的内容摘要

一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

(一) 基金份额持有人的权利、义务

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

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

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

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

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

- (1) 认真阅读并遵守《基金合同》、招募说明书、基金产品资料概要等信息披露文件；

(2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；

(3) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；

(4) 交纳基金认购、申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；

(5) 在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；

(6) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；

(7) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；

(9) 遵守基金管理人、基金托管人、销售机构和登记机构的相关交易及业务规则；

(10) 提供基金管理人和监管机构依法要求提供的信息，以及不时的更新和补充，并保证其真实性；

(11) 发起资金提供方持有发起资金认购的基金份额不少于 3 年；

(12) 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、法规及中国证监会规定，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》及有关法律的规定决定基金收益的分配方案；

(11) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购、赎回或转换申请；

(12) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

(13) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；

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

(15) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券/期货经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；

(16) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、定期定额投资、转托管和收益分配等业务规则；

(17) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

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

(2) 办理基金备案手续；

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

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

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

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

(7) 依法接受基金托管人的监督；

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

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(10) 编制季度报告、中期报告和年度报告；

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

(12) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露，但根据监管机构、司法机关等有权机关的要求，或因审计、法律等外部专业顾问提供服务而向其提供的情况除外；

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

(14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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

(16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 20 年以上，法律法规另有规定的从其规定；

(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内发出，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（税后）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。

（三）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和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，但根据监管机构、司法机关等有权机关的要求，或因审计、法律等外部专业顾问提供服务而向其提供的情况除外；
- (8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、各类基金份额净值、基金份额申购、赎回价格；
- (9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
- (10) 对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行；如果基金管理人未执行《基金合同》规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；
- (11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 20 年以上，法律法规另有规定的从其规定；
- (12) 从基金管理人或其委托的登记机构处接收并保存基金份额持有人名

册；

(13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

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

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

(16) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；

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

(18) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行业监督管理机构，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。

本基金未设立基金份额持有人大会的日常机构，如今后设立基金份额持有人大会的日常机构，按照相关法律法规的要求执行。

(一) 召开事由

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

(1) 终止《基金合同》；

(2) 更换基金管理人；

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

2、在法律法规规定和《基金合同》约定的范围内且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

- (1) 法律法规要求增加的基金费用的收取；
- (2) 调整本基金的申购费率、调低销售服务费率、调整基金份额类别、变更收费方式或对基金份额分类办法及规则进行调整；
- (3) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；
- (4) 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生重大变化；
- (5) 基金管理人、登记机构、基金销售机构调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务规则，法律法规及中国证监会规定的除外；
- (6) 在履行适当程序后，基金推出新业务或服务；
- (7) 按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

（二）会议召集人及召集方式

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

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。

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

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

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

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

（三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

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

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

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

（四）基金份额持有人出席会议的方式

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

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

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

(2) 经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，

有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）。若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效的基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之一（含三分之一）。

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式或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或系统。通讯开会应以书面方式或会议通知载明的其他形式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

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

（3）本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）；若本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）基金份额的持有人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见；

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

3、在法律法规或监管机构允许的情况下，本基金的基金份额持有人亦可采用其他书面或非书面方式授权其代理人出席基金份额持有人大会并行使表决权，具体方式在会议通知中列明。

4、在法律法规和监管机关允许的情况下，本基金亦可采用其他非现场方式或者以非现场方式与现场方式相结合的方式召开基金份额持有人大会，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。基金份额持有人可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式进行表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

（五）议事内容与程序

1、议事内容及提案权

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

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

2、议事程序

（1）现场开会

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

会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓

名（或单位名称）、身份证明文件号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）和联系方式等事项。

（2）通讯开会

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

（六）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

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

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

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

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

在符合上述规则的前提下，具体规则以召集人发布的基金份额持有人大会通知为准。

（七）计票

1、现场开会

（1）如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持

人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理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异议，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

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

2、通讯开会

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

(八) 生效与公告

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

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 日内在规定媒介上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

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

人、基金托管人均有约束力。

(九) 实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定

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

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

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

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

4、若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二分之一以上（含二分之一）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人；

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本部分的相关规定。

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

三、基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

(一) 《基金合同》的变更

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

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，自决议生效后两日内在规定媒介公告。

(二) 《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：

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

(三) 基金财产的清算

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

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

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

4、基金财产清算程序：

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

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

(四) 清算费用

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

(五) 基金财产清算剩余资产的分配

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

(六) 基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告，基金财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

(七) 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存，保存期限不少于法定最低期限。

四、争议解决方式

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、调解未能解决的，任何一方均应当提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点在北京市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力。除非仲裁裁决另有决定，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，各方当事人应恪守职责，各自继续忠实、勤勉、尽责地履行《基金合同》规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

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

五、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、基金托管协议内容摘要

一、基金托管协议当事人

（一）基金管理人

名称：银河基金管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富城路 99 号 21-22 层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区富城路 99 号 21-22 层

邮政编码：200120

法定代表人：宋卫刚

成立日期：2002 年 6 月 14 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2002]21 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：2.0 亿元人民币

存续期间：持续经营

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理，中国证监会许可的其他业务

（二）基金托管人

名称：中国民生银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

邮政编码：100031

法定代表人：高迎欣

成立日期：1996 年 2 月 7 日

基金托管业务批准文号：证监基金字[2004]101 号

组织形式：其他股份有限公司（上市）

注册资本：43,782,418,502 元人民币

存续期间：1996 年 02 月 07 日至长期

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；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；从事结汇、售汇

业务；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项；提供保管箱服务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务；保险兼业代理业务；证券投资基金销售、证券投资基金托管。（市场主体依法自主选择经营项目，开展经营活动；保险兼业代理业务、证券投资基金销售、证券投资基金托管以及依法须经批准的项目，经相关部门批准后依批准的内容开展经营活动；不得从事国家和本市产业政策禁止和限制类项目的经营活动。）

二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

（一）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种池，以便基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合基金合同关于主题证券投资比例的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。基金管理人应通过电子邮件或双方认可的其他方式完整、准确地向基金托管人提供投资品种池信息，如因基金管理人原因未向基金托管人提供投资品种池而造成基金托管人投资监督不及时，基金托管人不承担相关责任。

本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票和存托凭证）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、地方政府债券、政府支持机构债券、政府支持债券、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、短期融资券、超短期融资券、中期票据、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、可交换债券及其他中国证监会允许基金投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、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）。

本基金可根据法律法规的规定参与融资业务。

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

本基金为混合型基金，投资组合比例为：本基金股票资产占基金资产的比例为 60%-95%，其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%，投资于 ESG 主题股票的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债

券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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

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

1. 本基金股票资产占基金资产的比例为 60%-95%，其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%，投资于 ESG 主题股票的比例不低于非现金基金资产的 80%；

2. 本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

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

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

6. 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

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

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

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

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

11. 本基金资产总值不超过基金资产净值的 140%；
12. 本基金参与股指期货交易时，依据下列标准构建组合：
 - (1) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值不得超过基金资产净值的 10%；
 - (2) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值与有价证券市值之和不得超过基金资产净值的 95%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；
 - (3) 本基金在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过本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%；
13. 本基金管理人管理且由本基金托管人托管的全部开放式基金（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%；本基金管理人管理且由本基金托管人托管的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述比例限制；
14. 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；
15. 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；
16. 本基金若参与融资业务的，应当遵守下列要求：每个交易日日终，本基金持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；

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

18. 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述第 2、9、14、15 项另有约定外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起六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，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按变更后的规定执行。

(三) 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进行监督。基金托管人通过事后监督方式对基金管理人基金投资禁止行为进行监督。

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

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

(四) 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,应及时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确认。如因基金管理人未能及时提供相关信息导致基金托管人无法有效监督产生的风险,基金托管人不承担责任。

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。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。

(五)基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对基金管理人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。首次投资流通受限证券前,基金管理人应与基金托管人就流通受限证券投资签订风险控制补充协议。

1. 本基金投资的流通受限证券与上文所述的流动性受限资产范围并不完全一致,须为经中国证监会批准的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。

本基金投资的流通受限证券限于可由中国证券登记结算有限责任公司(以下或称“中国结算”)或中央国债登记结算有限责任公司、银行间清算所股份有限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。

本基金投资的流通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流通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，及因流通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。

本基金投资流通受限证券，不得预付任何形式的保证金。

2. 基金管理人对本基金投资流通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。对本基金因投资流通受限证券导致的流动性风险，基金托管人不承担责任。如因基金管理人违反基金合同或预先确定的投资流通受限证券的比例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. 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) 本基金投资流通受限证券时的法律法规遵守情况。

2) 在基金投资流通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。

4. 相关法律法规对基金投资流通受限证券有新规定的，从其规定。

(六) 基金如投资银行存款，基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资银行存款的交易对手范围是否符合有关规定进行监督；基金管理人在签署银行存款协议前，应将草拟的银行存款协议送基金托管人审核。如基金托管人事后发现基金管理人没有按照事先约定的交易对手进行交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人，基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任。如因基金管理人未能及时提供相关信息导致托管人无法有效监督，托管人不承担责任。

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

行监督和核查。

（八）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，并及时向中国证监会报告。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内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。基金管理人指定专人接收托管人的通知和提示。在上述规定期限内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会（如需）。

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

（十）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，并及时向中国证监会报告。

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

（十二）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，本基金的投资组合比例、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（包括但不限于对基金赎回的影

响、信息披露、费用列支等)、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基金合同和招募说明书的规定。

基金托管人依照相关法律法规的规定以及基金合同和招募说明书的约定,对侧袋机制启用、特定资产处置和信息披露等方面进行监督。

三、基金管理人 对基金托管人的业务核查

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

(二) 基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、基金合同、本协议及其他有关规定时,应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正。基金托管人收到通知后应在下一工作日及时核对并以书面形式给基金管理人发出回函,说明违规原因及纠正期限,并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内,基金管理人有权随时对通知事项进行复查,督促基金托管人改正。基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为,包括但不限于:提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性,在规定时间内答复基金管理人并改正。

(三) 基金托管人有义务配合和协助基金管理人依照法律法规、基金合同和本托管协议对基金业务执行核查,包括但不限于:对基金管理人发出的书面提示,基金托管人应在规定时间内答复并改正,或就基金管理人的疑义进行解释或举证;基金托管人应积极配合提供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。

(四) 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

(一) 基金财产保管的原则

1. 基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。基金财产的债权、不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债务相抵销，不同基金财产的债权债务，不得相互抵销。基金管理人、基金托管人以其自有资产承担法律责任，其债权人不得对基金财产行使请求冻结、扣押和其他权利。

2. 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。

3. 基金托管人应安全保管基金财产。未经基金管理人依据合法程序作出的合法合规指令，基金托管人不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

4. 基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户、证券账户等投资需要的账户。

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

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

7. 对于因为基金投资产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金账户的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金财产造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金财产的损失，基金托管人对此不承担任何责任。

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

（二）基金募集期间及募集资金的验资

1. 基金募集期间应开立“基金募集专户”，用于存放募集的资金。该账户由基金管理人开立。

2. 基金募集期满或基金提前结束募集时，发起资金的认购金额、发起资金提供方及其承诺的持有期限符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，基金管理人应将募集的属于本基金财产的全部资金划入基金托管人为本基金开立的托管专户中，基金托管人在收到资金当日按双方约定方式出具确认文件。同时，基金管理人应聘请符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所进行验资，

出具验资报告，验资报告需对发起资金提供方及其持有份额进行专门说明。出具的验资报告应由参加验资的 2 名以上（含 2 名）中国注册会计师签字有效。

3. 若基金募集期限届满或基金停止募集时，未能达到基金合同生效的条件，由基金管理人按规定办理退款等事宜，基金托管人应提供充分协助。

（三）基金银行账户（即托管账户）的开立和管理

1. 基金托管人应负责本基金的银行账户的开设和管理。

2. 基金托管人应以本基金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。账户名称、账户预留印鉴以基金管理人向基金托管人出具的开户委托文件为准，基金托管人负责账户预留印鉴的保管和使用。该账户为不可提现账户。

3. 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。

4. 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。

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

（四）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、深圳分公司为本基金开立基金托管人与本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书面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由基金托管人负责，账户资产的管理和运用由基金管理人负责。

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

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，若无相关规定，则基金

托管人比照上述关于账户开立、使用的规定执行。

（五）债券托管账户的开设和管理

基金合同生效后，基金管理人代本基金向中国人民银行发起银行间债券市场准入备案，备案通过后，基金托管人代本基金根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司、银行间市场清算所股份有限公司的有关规定，以本基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司、银行间市场清算所股份有限公司开立债券托管与结算账户，并代表基金进行银行间市场债券的结算，基金管理人应在过程中给予必要的配合。基金管理人代表本基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议。

（六）定期存款账户的开设与管理

基金投资定期存款在存款机构开立的银行账户，包括实体或虚拟账户。定期存款账户户名应与托管专户保持一致，该账户预留印鉴经与基金托管人商议后预留。基金管理人应该在合理的时间内进行定期存款的投资和支取事宜。对于任何的定期存款投资，基金管理人都必须和存款机构签订定期存款协议，协议内容应至少包含起息日、到期日、存款金额、存款账户、存款利率、存款是否可以提前支取、定存到期支取账户、存款证实书如何交接以及存款证实书不得转让质押等条款。协议须约定基金托管人经办行名称、地址和账户，并将本基金托管专户指定为唯一回款账户，协议中涉及基金托管人相关职责的约定须由基金管理人和基金托管人双方协商一致后签署。

（七）其他账户的开立和管理

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

2. 法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

（八）基金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、银行间市场清算所股份有限公司、中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司或票据营业中心的代保管库，保管凭证由基金托管人持有。实物证券、银

行存款开户证实书等有价值凭证的购买和转让，由基金管理人和基金托管人共同办理。基金托管人对由基金托管人及基金托管人委托保管的机构以外机构实际有效控制的证券不承担保管责任，但基金托管人应妥善保管凭证。

（九）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。重大合同的保管期限为基金合同终止后 20 年，法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。

五、基金资产净值计算和会计核算

（一）基金资产净值的计算、复核与完成的时间及程序

1. 基金资产净值

各类基金份额净值是按照每个估值日闭市后，各类基金资产净值除以当日该类基金份额的余额数量计算，均精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。基金管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人于每个估值日计算基金资产净值及各类基金份额净值，并按规定公告。

2. 复核程序

基金管理人应每个估值日对基金资产估值，但基金管理人根据法律法规或基金合同的规定暂停估值时除外。估值原则应符合基金合同、《证券投资基金会计核算业务指引》及其他法律、法规的规定。基金管理人每个估值日对基金资产估值后，将各类基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人按规定对外公布。

3. 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，按照基金管理人对基金净值的计算结果对外予以公布。

（二）基金资产估值方法和特殊情形的处理

1. 估值对象

基金所拥有的股票、存托凭证、债券、资产支持证券、股指期货合约、银行存款本息、应收款项和其它投资等资产及负债。

2. 估值方法

（1）证券交易所上市的权益类证券的估值

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

2) 交易所上市不存在活跃市场的权益类证券，采用估值技术确定公允价值。

（2）处于未上市期间的权益类证券应区分如下情况处理：

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

2) 首次公开发行未上市的股票，采用估值技术确定公允价值。

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

（3）对于已上市或已挂牌转让的不含权固定收益品种，选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的估值全价。

（4）对于已上市或已挂牌转让的含权固定收益品种，选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的唯一估值全价或推荐估值全价。

对于含投资者回售权的固定收益品种，行使回售权的，在回售登记日至实际收款日期间选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种的唯一估值全价或推荐估值全价，同时应充分考虑发行人的信用风险变化对公允价值的影响。回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的建议按照长待偿期所对应的价格进行估值。

(5) 对于在交易所市场上市交易的公开发行的可转换债券等有活跃市场的含转股权的债券，实行全价交易的债券选取估值日收盘价作为估值全价；实行净价交易的债券选取估值日收盘价并加计每百元税前应计利息作为估值全价。

(6) 对于未上市或未挂牌转让且不存在活跃市场的固定收益品种，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定其公允价值。

(7) 对于发行人已破产、发行人未能按时足额偿付本金或利息，或者有其他可靠信息表明本金或利息无法按时足额偿付的债券投资品种，第三方估值基准服务机构可在提供推荐价格的同时提供价格区间作为公允价值的参考范围以及公允价值存在重大不确定性的相关提示。基金管理人在与基金托管人协商一致后，可采用价格区间中的数据作为该债券投资品种的公允价值。

(8) 同一证券同时在两个或两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。

(9) 估值计算中涉及港币对人民币汇率的，应当以估值日中国人民银行或其授权机构公布的人民币与港币的中间价为准。

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

(11) 股指期货合约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。

(12) 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。

(13) 本基金参与融资业务的，按照相关法律法规、监管部门和行业协会的相关规定进行估值。

(14) 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。

(15) 当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。

(16) 税收：对于按照中国法律法规和基金投资境内外股票市场交易互联互通机制涉及的境外交易场所所在地的法律法规规定应交纳的各项税金，本基金将按权责发生制原则进行估值；对于因税收规定调整或其他原因导致基金实际交纳

税金与估算的应交税金有差异的,基金将在相关税金调整日或实际支付日进行相应的估值调整。

(17) 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,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净值信息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(14)项进行估值时,所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

由于不可抗力,或证券/期货交易场所、登记结算机构及存款银行等第三方机构发送的数据错误,或国家会计政策变更、市场规则变更等非基金管理人与基金托管人原因,基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查,但未能发现错误的,由此造成的基金资产估值错误,基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

(三) 基金份额净值错误的处理方式

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。当某一类基金份额净值小数点后4位以内(含第4位)发生估值错误时,视为该类基金份额净值错误。

基金合同的当事人应按照以下约定处理:

1. 估值错误类型

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

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

2. 估值错误处理原则

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

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

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

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

3. 估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

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

4. 基金估值错误处理的方法如下：

(1) 任一类基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

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

(3) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。如果行业另有通行做法，基金管理人、基金托管人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商。

(四) 暂停估值的情形

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

2. 因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

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

4. 法律法规规定、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

(五) 基金会计制度

按国家有关部门规定的会计制度执行。

(六) 基金账册的建立

基金管理人进行基金会计核算并编制基金财务会计报告。基金管理人、基金托管人分别独立地设置、记录和保管本基金的全套账册。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净值的计算和公告的，以基金管理人的账册为准。

(七) 基金财务报表与报告的编制和复核

1. 财务报表的编制

基金财务报表由基金管理人编制，基金托管人复核。

2. 报表复核

基金托管人应当按照相关法律、行政法规、中国证监会的规定和基金合同的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、各类基金份额净值、基金份额申购赎

回价格、基金定期报告、更新的招募说明书、基金产品资料概要、基金清算报告等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。

3. 财务报表的编制与复核时间安排

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；在季度结束之日起 15 个工作日内完成基金季度报告的编制；在上半年结束之日起两个月内完成基金中期报告的编制；在每年结束之日起三个月内完成基金年度报告的编制。基金年度报告中的财务会计报告应当经过符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计。《基金合同》生效不足两个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。

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。

（八）基金管理人应在编制季度报告、中期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。

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，暂停披露侧袋账户的基金份额净值。

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，保存期自基金账户销户之日起不少于 20 年。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，保存期限不少于 20 年，法律法规另有规定或有权机关另有要求的除外。如不能妥善保管，则按相关法规承担责任。

基金管理人应及时以双方认可的方式向基金托管人提交基金份额持有人名册。每年 6 月 30 日和 12 月 31 日的基金份额持有人名册应于下月前十个工作日内提交；基金合同生效日、基金合同终止日等涉及到基金重要事项日期的基金份额持有人名册应于发生日后十个工作日内提交。

在基金托管人要求或编制中期报告和年度报告前，基金管理人应将有关资料送交基金托管人，不得无故拒绝或延误提供，并保证其的真实性、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。因基金管理人未能及时提供或提供信息有误的，托管人不承担相关责任。

七、争议解决方式

因本托管协议产生或与之相关的争议，双方当事人应通过协商、调解解决，协商、调解不能解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照该会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力，除非仲裁裁决另有决定，仲裁费由败诉方承担。

争议处理期间，本托管协议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（为本托管协议之目的，不包括香港、澳门特别行政区和台湾地区法律）管辖并从其解释。

八、托管协议的变更、终止与基金财产的清算

（一）托管协议的变更程序

本托管协议双方当事人经协商一致，可以对本托管协议进行修改。修改后的新托管协议，其内容不得与基金合同的规定有任何冲突。

（二）托管协议终止的情形

1. 基金合同终止；
2. 基金托管人解散、依法被撤销、破产或由其他基金托管人接管基金资产；
3. 基金管理人解散、依法被撤销、破产或由其他基金管理人接管基金管理权；
4. 发生法律法规、中国证监会或基金合同规定的终止事项。

（三）基金财产的清算

1. 基金财产清算小组

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

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

3) 基金财产清算小组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。

2. 基金财产清算程序

基金合同终止情形出现时，应当按法律法规和基金合同的有关规定对基金财产进行清算。基金财产清算程序主要包括：

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

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

3. 清算费用

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

4. 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，各类基金份额按基金份额持有人持有的该类基金份额比例进行分配。

5. 基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。基金财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

6. 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 20 年以上。

二十一、对基金份额持有人的服务

基金管理人树立并倡导“以客户为中心”的服务理念以及“基金份额持有人利益至上”的企业价值观，致力于为基金份额持有人提供完善的理财服务解决方案和卓越的服务体验实践。基金管理人通过完善服务过程，为基金份额持有人创造价值，为基金份额持有人提供专业和优质的理财服务体验。基金管理人根据基金份额持有人需求、业务发展和技术变迁，不断完善服务内容，提升服务品质。

对于基金份额持有人的共性需求，基金管理人主要利用两个公共接触点：公司网站和呼叫中心(Call Center)来提供公共服务；对于基金份额持有人的个性化需求与隐性需求，基金管理人采用服务定制的方式以及通过专业的理财顾问团队与基金份额持有人接触拜访、沟通和交流的机制，提供个性化服务。

基金管理人将根据基金份额持有人的需要和市场的变化，持续完善服务。主要服务内容如下：

（一）资料寄送

1、对账单服务

基金管理人根据基金份额持有人需求向基金份额持有人以电子文件或纸质形式定期或不定期寄送对账单。

2、其他相关的信息资料。

（二）基金收益分配申购基金份额

基金管理人为基金份额持有人提供将现金收益转换基金份额申购的服务，基金份额持有人可以事先选择将所获分配的现金收益，按照基金合同有关基金份额申购的约定转为基金份额；基金份额持有人事先未做出选择的，基金管理人将支付现金。

（三）基金转换服务

基金管理人可以根据相关法律法规以及基金合同的规定，在条件成熟的情况下提供本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换服务。基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及基金合同的规定制定并公告，并在合理时间内提前告知基金托管人与相关机构。

（四）呼叫中心及网站服务

基金管理人为基金份额持有人预设基金查询密码,预设的基金账户查询的缺省密码为基金持有人开户证件号码的后六位(若开户证件号码的后六位包含特殊字符或中文,该位字符以“0”替换)。为了维护基金份额持有人账户的安全和隐私权不受侵犯,请基金份额持有人在其知晓基金账号后,及时拨打基金管理人呼叫中心全国统一客服电话 400-820-0860 或登录基金管理人网站 www.cgf.cn 修改基金查询密码。基金份额持有人可以通过电话和网站查询其账户及交易信息。

基金管理人呼叫中心(400-820-0860)自动语音系统提供 7*24 小时账户余额、交易等信息的查询;呼叫中心人工坐席提供 5*8 小时的人工服务,为基金份额持有人提供业务咨询、账户信息查询、资料修改、投诉受理等服务。

基金份额持有人通过基金管理人网站 www.cgf.cn 可以得到各种网上在线服务。基金份额持有人通过基金管理人网上基金平台可以进行自助开户、基金交易、账户查询、信息修改等。

基金份额持有人可以通过基金管理人网站和呼叫中心全国统一客服电话进行服务定制。

(五) 投诉和建议受理

基金份额持有人可以通过基金管理人提供的呼叫中心自动语音留言、呼叫中心人工座席、书信、电子邮件、传真等渠道对基金管理人和代销机构所提供的服务进行投诉或提出建议。基金份额持有人还可以通过代销机构的服务电话对该代销机构提供的服务进行投诉。

二十二、其他应披露事项

基金合同如有未尽事宜，由基金合同当事人各方按有关法律法规协商解决。

二十三、招募说明书存放及查阅方式

本招募说明书存放在基金管理人和代销机构的办公场所和营业场所。投资人可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。基金管理人保证文本的内容与公告的内容完全一致。

二十四、备查文件

以下备查文件存放在基金管理人的办公场所，在办公时间可供免费查阅。

(一) 中国证监会准予银河 ESG 主题混合型发起式证券投资基金注册的批复文件

(二) 《银河 ESG 主题混合型发起式证券投资基金基金合同》

(三) 《银河 ESG 主题混合型发起式证券投资基金托管协议》

(四) 基金管理人业务资格批件、营业执照

(五) 基金托管人业务资格批件、营业执照

(六) 法律意见书

以上备查文件存放在基金管理人或基金托管人的办公场所和营业场所。投资人可以通过基金管理人网站，查阅或下载基金合同、招募说明书、托管协议及基金的各种定期和临时公告。

银河基金管理有限公司

2024年6月11日