

东方核心动力混合型证券投资基金  
招募说明书（更新）  
（2024 年第 1 号）

基金管理人：东方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

## 重要提示

东方核心动力混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）根据2009年4月14日中国证券监督管理委员会《关于核准东方核心动力股票型开放式证券投资基金募集的批复》（证监许可[2009]302号）和《关于东方核心动力股票型开放式证券投资基金募集时间安排的确认函》（基金部函[2009]301号）的核准募集。本基金基金合同于2009年6月24日正式生效。

东方基金管理股份有限公司（以下简称“本基金管理人”、“管理人”或“本公司”）保证《东方核心动力混合型证券投资基金招募说明书》（以下简称“《招募说明书》”或“本《招募说明书》”）的内容真实、准确、完整。本《招募说明书》经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

投资有风险，投资者在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的招募说明书、基金产品资料概要和基金合同，全面认识本基金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，并对认购（或申购）本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资者基金投资要承担相应风险，包括市场风险、管理风险、流动性风险和本基金所投资的各种投资工具的相关风险等。在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化导致的投资风险，由投资者自行承担。

本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他可投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与中国存托凭证发行机制相关的风险。

当本基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，基金管理人履行相应程序后，可以启用侧袋机制，具体详见基金合同和本招募说明书“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，且不办理侧袋账户的申购赎回。请基金份额持有人仔细阅读相关内容并关注本基金启用侧袋机制时的特定风险。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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

基金管理人于2015年7月31日在基金管理人网站发布《关于东方核心动力股票型开放式证券投资基金变更基金名称并修改基金合同的公告》，决定不变更本基金的股票投资比例，将本基金的类别变更为混合型，基金名称变更为“东方核心动力混合型证券投资基金”，基金简称变更为“东方核心动力混合”，基金代码不变。基金管理人于2015年7月31日在基金管理人网站对更名后的基金合同、托管协议进行了披露。上述文件可通过本基金管理人网站查阅。

根据中国证监会2017年10月1日起施行的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》的要求，经与相关基金托管人协商一致，并报监管部门备案后，本基金管理人对旗下部分基金的基金合同及托管协议进行了修订，修订后的基金合同及托管协议自2018年3月31日起生效，具体情况请参阅本基金管理人于2018年3月31日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及本基金管理人网站上发布的公告。

根据中国证监会2019年9月1日起施行的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的要求，经与相关基金托管人协商一致，本基金管理人对旗下部分基金的基金合同及托管协议进行了修订，报监管部门备案并按规定在指定媒介上公告。

根据中国证监会2018年6月6日颁布并实施的《存托凭证发行与交易管理办法（试行）》的要求，经与相关基金托管人协商一致，本基金管理人对旗下部分基金的基金合同及托管协议进行了修订，报监管部门备案并按规定在指定媒介上公告。

根据中国证监会2020年7月10日颁布、同年8月1日实施的《公开募集证券投资基金侧袋机制指引（试行）》的要求，经与相关基金托管人协商一致，本基金管理人对旗下部分基金的基金合同及托管协议进行了修订，报监管部门备案并按规定在指定媒介上公告。

本基金管理人于2022年1月26日在《中国证券报》和本基金管理人网站发布《关于东方核心动力混合型证券投资基金增加C类基金份额并修改〈基金合同〉等法律文件的公告》，本基金于2022年1月27日起增加C类基金份额，并对本基金的基金合同、托管协议等文件作相应修改。

经与本基金托管人协商一致，本基金管理人于2023年8月28日起调整本基金基金费率，对本基金的基金合同、托管协议等文件作相应修改，并在规定媒介

上公告。

有关财务数据和净值表现截止日为2024年3月31日（财务数据未经审计），  
如无其他特别说明，本招募说明书其他所载内容截止日为2024年6月24日。

## 目录

第一部分绪言 .....	1
第二部分释义 .....	2
第三部分基金管理人 .....	8
第四部分基金托管人 .....	24
第五部分相关服务机构 .....	26
第六部分基金的募集与基金合同的生效 .....	53
第七部分基金份额的申购与赎回 .....	54
第八部分基金的投资 .....	65
第九部分基金的业绩 .....	77
第十部分基金的财产 .....	79
第十一部分基金资产的估值 .....	80
第十二部分基金的收益与分配 .....	85
第十三部分基金的费用与税收 .....	87
第十四部分基金的会计与审计 .....	90
第十五部分基金的信息披露 .....	91
第十六部分侧袋机制 .....	96
第十七部分风险揭示 .....	100
第十八部分基金的终止与清算 .....	104
第十九部分基金合同的内容摘要 .....	106
第二十部分托管协议内容摘要 .....	121
第二十一部分对基金份额持有人的服务 .....	130
第二十二部分其他应披露事项 .....	133
第二十三部分招募说明书的存放及查阅方式 .....	135
第二十四部分备查文件 .....	136

## 第一部分 绪 言

《东方核心动力混合型证券投资基金招募说明书》（以下简称“本招募说明书”）依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《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》”）及其他有关规定以及《东方核心动力混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

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

本《招募说明书》根据本基金的基金合同编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金合同当事人之间基本权利义务的法律文件，其他与本基金相关的涉及基金合同当事人之间权利义务关系的任何文件或表述，均以基金合同为准。基金合同的当事人包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人。基金投资者自依基金合同取得本基金基金份额，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。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为必要条件。基金合同当事人按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

本《招募说明书》约定的基金产品资料概要编制、披露与更新要求，自《信息披露办法》实施之日起一年后开始执行。

## 第二部分 释 义

在《东方核心动力混合型证券投资基金招募说明书》中，除非文义另有所指，下列词语具有如下含义：

基金或本基金：	指东方核心动力混合型证券投资基金；
基金合同或本基金合同：	指《东方核心动力混合型证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充；
招募说明书：	指《东方核心动力混合型证券投资基金招募说明书》及其更新；
基金产品资料概要：	指《东方核心动力混合型证券投资基金基金产品资料概要》及其更新；
发售公告：	指《东方核心动力混合型证券投资基金基金份额发售公告》
托管协议：	指《东方核心动力混合型证券投资基金托管协议》及其任何有效修订和补充；
中国证监会：	指中国证券监督管理委员会；
中国银监会：	指中国银行业监督管理委员会；
《基金法》：	指2012年12月28日经第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议通过，自2013年6月1日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订；
《销售办法》：	指2013年2月17日经中国证券监督管理委员会第28次主席办公会议通过，自2013年6月1日起实施的《证券投资基金销售管理办法》及不时做出的修订；
《运作办法》：	指2014年7月7日由中国证监会公布并于2014年8月8日起实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及不时做出的修订；
《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；

《信息披露办法》：	指中国证监会2019年7月26日颁布并于2019年9月1日实施的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及不时作出的修订；
元：	指人民币元；
基金管理人：	指东方基金管理股份有限公司；
基金托管人：	指中国银行股份有限公司；
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
份额登记业务：	指本基金登记、存管、清算和交收业务，具体内容包括投资者基金账户管理、基金份额注册登记、清算及基金交易确认、发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等；
份额登记机构：	指办理本基金份额登记业务的机构。本基金的份额登记机构为东方基金管理股份有限公司或接受东方基金管理股份有限公司委托代为办理本基金份额登记业务的机构；
投资者：	指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和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者；
个人投资者：	指依据中华人民共和国有关法律法规可以投资于证券投资基金的自然人；
机构投资者：	指在中国境内合法注册登记或经有权政府部门批准设立和有效存续并依法可以投资于证券投资基金的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织；
合格境外机构投资者：	指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》及相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者；
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
基金份额持有人大会：	指按照本基金合同第九部分之规定召集、召开并由基金份额持有人或其合法的代理人进行表决的会议；
基金募集期：	指基金合同和招募说明书中载明，并经中国证监会核准的



	基金份额募集期限，自基金份额发售之日起最长不超过3个月；
基金合同生效日：	指募集结束，基金募集的基金份额总额、募集金额和基金份额持有人人数符合相关法律法规和基金合同规定的，基金管理人依据《基金法》向中国证监会办理备案手续后，中国证监会的书面确认之日；
存续期：	指本基金合同生效至终止之间的不定期期限；
工作日：	指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日；
认购：	指在基金募集期内，投资者按照本基金合同的规定申请购买本基金基金份额的行为；
申购：	指在本基金合同生效后的存续期间，投资者申请购买本基金基金份额的行为；
定期定额投资计划：	指投资者通过有关销售机构提出申请，约定每期扣款日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资者指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式
赎回：	指在本基金合同生效后的存续期间，基金份额持有人按基金合同规定的条件要求基金管理人购回本基金基金份额的行为；
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%
基金转换：	指基金份额持有人按基金管理人规定的条件，申请将其持有的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的基金份额的行为；
转托管：	指基金份额持有人将其基金账户内的某一基金的基金份额从一个销售机构托管到另一销售机构的行为；
非交易过户：	指不采用申购、赎回等基金交易方式，将一定数量的基金

	份额按照一定规则从某一投资者基金账户转移到其他投资者基金账户的行为
指令：	指基金管理人在运用基金资产进行投资时，向基金托管人发出的资金划拨及实物券调拨等指令；
基金销售业务	指基金管理人或其他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、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务
直销机构：	指东方基金管理股份有限公司
其他销售机构：	指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并接受基金管理人委托，代为办理基金认购、申购、赎回和其他基金业务的机构；
销售机构：	指基金管理人及本基金其他销售机构；
基金销售网点：	指基金管理人的直销中心及基金其他销售机构的销售网点；
指定媒介：	指中国证监会指定的用以进行信息披露的全国性报刊（以下简称“指定报刊”）及指定互联网网站（以下简称“指定网站”，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；
基金账户：	指份额登记机构为基金投资者开立的记录其持有的由该份额登记机构办理注册登记的基金份额余额及其变动情况的账户；
交易账户：	指销售机构为投资者开立的记录投资者通过该销售机构办理认购、申购、赎回、转换及转托管等业务而引起的基金份额的变动及结余情况的账户；
开放日：	指为投资者办理基金申购、赎回等业务的工作日；
T日：	指销售机构受理投资者申购、赎回或其他业务申请的日期；
T+n日：	指T日后（不包括T日）第n个工作日，n指自然数；
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、证券持有期间产生的公允价值变动及因运

	用基金财产带来的成本和费用的节约以及其他合法收入；
基金资产总值：	指基金持有的各类有价证券、银行存款本息、应收申购款以及以其他资产等形式存在的基金财产的价值总和；
基金资产净值：	指基金资产总值减去基金负债后的价值；
基金份额净值：	指以计算日各类别基金资产净值除以计算日该类基金份额余额所得的单位该类基金份额的价值；
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；
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；
法律法规：	指中华人民共和国现行有效的法律、行政法规、司法解释、地方法规、地方规章、部门规章及其他规范性文件以及对于该等法律法规的不时修改和补充；
不可抗力：	指任何无法预见、无法克服、无法避免的事件和因素，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、疫情、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律变化、突发停电、电脑系统或数据传输系统非正常停止以及其他突发事件、证券交易场所非正常暂停或停止交易等；
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；
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；
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；
A类基金份额：	指收取申购费用、但不从本类别基金资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；
C类基金份额：	指从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额。

## 第三部分 基金管理人

### 一、基金管理人概况

名称：东方基金管理股份有限公司

住所：北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层

办公地址：北京市丰台区金泽路 161 号院 1 号楼远洋锐中心 26 层

邮政编码：100073

法定代表人：崔伟

成立日期：2004 年 6 月 11 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：叁亿叁仟叁佰叁拾叁万元人民币

营业期限：2004 年 6 月 11 日至长期

经营范围：基金募集；基金销售；资产管理；从事境外证券投资管理业务；

中国证监会许可的其他业务

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2004]80 号

统一社会信用代码：911100007635106822

联系人：李景岩

电话：010-66295888

股权结构：

股东名称	认购股份数（万股）	持股比例
东北证券股份有限公司	19200	57.60%
河北国控资本管理有限公司	8100	24.30%
渤海国际信托股份有限公司	2700	8.10%
海南汇智长行企业管理咨询合伙企业（有限合伙）	1170	3.51%
海南汇远长行企业管理咨询合伙企业（有限合伙）	1123	3.37%
海南汇聚长行企业管理咨询合伙企业（有限合伙）	1040	3.12%
合计	33333	100%

内部组织结构：

股东会是公司的最高权力机构，下设董事会和监事会，董事会下设合规与风

风险控制委员会、薪酬与提名委员会；公司组织管理实行董事会领导下的总经理负责制，下设战略发展委员会、风险控制委员会、投资决策委员会、产品委员会、IT治理委员会、预算管理委员会、估值委员会、反洗钱工作组和权益投资部、权益研究部、固定收益投资部、固定收益研究部、量化投资部、绝对收益部、资产配置部、专户投资部、专户业务一部、专户业务二部、专户业务三部、市场部、渠道管理部、产品开发部、网络金融业务部、机构业务一部、战略客户部、财富管理部、董事会办公室、运营部、交易部、信息技术部、财务部、人力资源部、综合管理部、风险管理部、合规法务部、监察稽核部及北京分公司、上海分公司、广州分公司、成都分公司、海口分公司；公司设督察长，分管风险管理部、合规法务部、监察稽核部，负责组织指导公司的风险管理、合规管理和监察稽核工作。

## 二、基金管理人主要人员情况

### 1、董事会成员

崔伟先生，董事长，经济学博士。曾任中国人民银行副主任科员、主任科员、副处级秘书，中国证监会党组书记、秘书处副处长、处长，中国人民银行东莞中心支行副行长、党委委员，中国人民银行汕头中心支行行长、党委书记兼国家外汇管理局汕头中心支局局长，中国证监会海南监管局副局长兼党委委员、局长兼党委书记，中国证监会协调部副主任兼中国证监会投资者教育办公室召集人、中国证券投资基金业协会第一届理事、中国证券投资基金业协会第二届监事、东北证券股份有限公司副董事长、东方汇智资产管理有限公司董事长。

何俊岩先生，董事，硕士，高级会计师、中国注册会计师、中国注册资产评估师，吉林省五一劳动奖章获得者。曾任吉林省五金矿产进出口公司计划财务部财务科长，东北证券有限责任公司计划财务部总经理、客户资产管理总部总经理，福建凤竹纺织科技股份有限公司财务总监，东北证券有限责任公司财务总监，东北证券股份有限公司副总裁、常务副总裁，东证融达投资有限公司董事，东证融通投资管理有限公司董事，东方基金管理有限责任公司监事会主席；现任东北证券股份有限公司党委委员、副董事长、总裁，兼任吉林省人民政府决策咨询委员会第五届委员，长春市第十六届人大代表，东证融达投资有限公司董事长。

李雪飞先生，董事，硕士。曾任东北证券股份有限公司长春自由大路证券营业部总经理、长春同志街第三证券营业部总经理、客户服务部总经理、机构业务

部总经理、金融产品部总经理、营销管理部总经理、经纪业务发展与管理委员会副主任、总裁助理、职工监事；现任东北证券股份有限公司党委委员、副总裁、财富资管业务委员会主任、机构业务部总经理，兼任中国证券业协会投资者服务与保护委员会委员，上海证券交易所市场交易管理委员会副主任委员，吉林省资本市场发展促进会副会长、秘书长，长春市南关区第十八届、第十九届人民代表大会代表，东证融汇证券资产管理有限公司副董事长，渤海期货股份有限公司董事。

董晨先生，董事，硕士。曾任华夏证券研究所副所长，中信建投证券研发部副总经理、机构业务部执行总经理（行政负责人）；西南证券研发中心总经理，宏源证券研究所（机构客户部）所长（总经理），东北证券股份有限公司上海研究咨询分公司总经理。现任东北证券股份有限公司党委委员、副总裁、战略规划部总经理，兼任中国证券业协会发展战略委员会委员，东证融通投资管理有限公司董事长，渤海期货股份有限公司董事，东证融汇证券资产管理有限公司监事。

王真女士，董事，工商管理硕士。曾任沧州日报社记者，燕赵都市报社经济新闻部主任，河北青年报社副总编辑，河北建设投资集团有限公司集团办公室副主任，河北省国有资产控股运营有限公司战略投资部部长；现任河北国控资本管理有限公司党委书记、董事长，兼任河北省国有资产控股运营有限公司总经理助理、资本运营总监。

董丁丁先生，董事，金融学硕士。曾任海南航空股份有限公司飞行计划员、机组资源管理员、海航集团财务有限公司金融服务部信贷信息主管、公司业务经理、总经理助理，资金信贷部副总经理、总经理。现任渤海国际信托股份有限公司党委委员、财务总监。

刘鸿鹏先生，董事、总经理，行政管理硕士。曾任新华证券股份有限公司长春同志街营业部总经理，东北证券股份有限公司杭州营业部总经理、营销管理总部副总经理、总经理，东方基金管理股份有限公司（原东方基金管理有限责任公司）总经理助理兼市场总监、公司副总经理；现任东方基金管理股份有限公司董事、总经理兼首席信息官，兼任东方汇智资产管理有限公司董事。

刘峰先生，独立董事，大学本科。曾任湖北省黄石市律师事务所副主任，海南方圆律师事务所主任，中华全国律师协会律师发展战略研究委员会副主任，金融证券委员会委员，曾被国家食品药品监督管理总局聘为首批餐饮服务食品安全

法律组专家；现任上海市锦天城律师事务所高级合伙人，兼任北京百普赛斯生物科技股份有限公司独立董事。

陈守东先生，独立董事，经济学博士。曾任通化煤矿学院教师，吉林大学数学系教师，吉林大学经济管理学院副教授，吉林大学商学院教授、博士生导师，吉林大学数量经济研究中心教授、博士生导师；现已退休，兼任东方集团股份有限公司独立董事，吉林舒兰农村商业银行股份有限公司（非上市公司）独立董事，吉林瑞科汉斯电气股份有限公司独立董事，长春一汽富维汽车零部件股份有限公司独立董事，中国金融学年会常务理事。

雷小玲女士，独立董事，注册会计师，经济学学士、工商管理硕士。曾任贵阳市财经学校会计专业教师，贵州省财经学院会计学系教师。现任中审众环会计师事务所（特普）监事长、海南分所负责人，兼任海南省注册会计师协会专业技术咨询委员会主任委员。

王大刚先生，独立董事，管理学博士。曾任中国国家开发投资公司国投穗甬（现国瑞金融）资产管理公司党支部书记副总裁，广西广投资产管理公司常务副总裁等，现任上海复瞳管理咨询有限公司董事长，兼任复旦大学中国不良资产研究中心副理事长等。

## 2、监事会成员

赵振兵先生，监事会主席，本科，高级经济师。历任河北华联商厦团委副书记、总经理助理、副总经理，河北省商贸集团经营二公司副总经理，河北省工贸资产经营有限公司改革发展处副处长，河北省国有资产控股运营有限公司团委书记、企业管理部副部长、资产运营部部长、副总裁；现任河北省国有资产控股运营有限公司总经理、党委副书记、副董事长。

庞菁菁女士，职工代表监事，博士研究生。毕业后入职本基金管理人，曾任产品开发部总经理助理、量化投资部总经理助理、风险管理部副总经理；现任公司风险管理部总经理。

张强先生，职工代表监事，大学本科。曾任职于北京市怀柔区喇叭沟门满族乡政府、《金融理财》杂志社、北京正商时代营销顾问有限公司。现任公司市场部总经理。

## 3、高级管理人员

刘鸿鹏先生，总经理兼首席信息官，简历请参见董事介绍。



秦熠群先生，副总经理，兼任东方汇智资产管理有限公司董事，中央财经大学经济学博士。曾任中央财经大学经济学院副院长、学校分部副主任。2011年7月加盟本基金管理人，历任董办主任、董秘、总经理助理，期间兼任人力资源部、综合管理部、风险管理部等部门总经理。

张科先生，副总经理，中国人民银行研究生部金融学博士。曾任甘肃银光化学工业公司中学教师，深圳发展银行蛇口支行会计、信贷业务员，深圳发展银行上海分行资金部部门负责人，平安银行北京分行副行长、资深销售总监；2019年12月加盟本基金管理人，曾任特别助理。

杨贵宾先生，副总经理、固定收益投资总监，公募投资决策委员会副主任委员，东方双债添利债券型证券投资基金基金经理、东方可转债债券型证券投资基金基金经理，西安交通大学经济学博士。曾任富国基金管理有限公司固定收益研究员、基金经理，上海海通证券资产管理有限公司投资主办、固定收益投资总监、公司总经理助理，2019年9月加盟本基金管理人，曾任总经理助理、固定收益投资总监，东方多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方兴润债券型证券投资基金基金经理。

关洪波先生，副总经理、市场总监，吉林大学工商管理硕士。曾任新华证券有限责任公司长春安达街营业部副总经理，东北证券有限责任公司南京中山北路营业部总经理，东北证券股份有限公司松原营业部总经理、长春建设街营业部总经理、运营管理部总经理。2017年11月加盟本基金管理人，曾任总经理助理、市场总监。

许文波先生，副总经理、权益投资总监，公募投资决策委员会副主任委员，东方精选混合型开放式证券投资基金基金经理、东方强化收益债券型证券投资基金基金经理、东方龙混合型开放式证券投资基金基金经理、东方欣冉九个月持有期混合型证券投资基金基金经理、东方创新医疗股票型证券投资基金基金经理，吉林大学工商管理硕士。曾任新华证券有限责任公司投资顾问部分析师；东北证券股份有限公司资产管理分公司投资管理部投资经理、部门经理；德邦基金管理有限公司基金经理、投资研究部总经理。2018年4月加盟本基金管理人，曾任公司总经理助理、权益投资总监，东方双债添利债券型证券投资基金基金经理、东方价值挖掘灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方中国红利混合型证券投资基金基金经理、东方欣利混合型证券投资基金基金经理、东方欣益一年持有期

偏债混合型证券投资基金基金经理、东方成长回报平衡混合型证券投资基金基金经理。

李景岩先生，督察长，硕士研究生，中国注册会计师。曾任东北证券股份有限公司延吉证券营业部财务经理、北京管理总部财务经理。2004年6月加盟本基金管理人，曾任财务主管，财务部经理，财务负责人，综合管理部经理兼人力资源部经理、总经理助理。

郝丽琨女士，财务负责人，吉林大学社会学硕士，中国注册会计师，国际注册内审师。曾任吉林省物资贸易大厦财务部会计、吉林省证券交易中心财务部会计、东北证券股份有限公司财务部高级项目经理、稽核审计部副总经理，2010年2月加盟本基金管理人，任财务负责人。

#### 4、本基金基金经理

姓名	任职时间	简历
盛泽 (先生)	2019年9月17 日至今	量化投资部总经理，资产配置部总经理、公募投资决策委员会委员。华威大学经济与国际金融经济学硕士，9年证券从业经历。曾任德邦基金管理有限公司投资研究部研究员、基金经理助理职位。2018年7月加盟本基金管理人，曾任量化投资部总经理助理，东方启明量化先锋混合型证券投资基金基金经理、东方中证500指数增强型证券投资基金基金经理，现任东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方岳灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方量化多策略混合型证券投资基金基金经理、东方核心动力混合型证券投资基金基金经理、东方欣冉九个月持有期混合型证券投资基金基金经理、东方沪深300指数增强型证券投资基金基金经理。
薛子徵 (先生)	自2015年4月30日至2019年9月16日任本基金基金经理。	
张岗	自2010年9月16日至2015年4月30日任本基金基金经理。	

（先生）	
郑军恒 （先生）	自 2009 年 6 月 24 日至 2010 年 9 月 15 日任本基金基金经理。
朱晓栋 （先生）	自 2015 年 4 月 30 日至 2018 年 1 月 23 日任本基金基金经理。

#### 5、公募投资决策委员会成员

刘鸿鹏先生，总经理兼首席信息官，公募投资决策委员会主任委员，简历请参见董事介绍。

杨贵宾先生，公司副总经理、固定收益投资总监、公募投资决策委员会副主任委员，简历请参见高级管理人员介绍。

许文波先生，公司副总经理、权益投资总监、公募投资决策委员会副主任委员，简历请参见高级管理人员介绍。

李瑞先生，权益投资部总经理、公募投资决策委员会委员。中国人民大学金融学硕士，13年证券从业经历。2011年7月加盟本基金管理人，曾任绝对收益部副总经理、权益投资部研究员，东方精选混合型开放式证券投资基金基金经理助理、东方安心收益保本混合型证券投资基金（于2019年8月2日起转型为东方成长回报平衡混合型证券投资基金）基金经理、东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金（于2018年6月21日起转型为东方新能源汽车主题混合型证券投资基金）基金经理、东方成长回报平衡混合型证券投资基金基金经理、东方新策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方惠新灵活配置混合型证券投资基金基金经理，现任东方新能源汽车主题混合型证券投资基金基金经理、东方汽车产业趋势混合型证券投资基金基金经理、东方高端制造混合型证券投资基金基金经理、东方兴瑞趋势领航混合型证券投资基金基金经理。

王然女士，权益研究部总经理，公募投资决策委员会委员。北京交通大学产业经济学硕士，16年证券从业经历。曾任益民基金交通运输、纺织服装、轻工制造行业研究员。2010年4月加盟本基金管理人，曾任权益研究部副总经理，权益投资部交通运输、纺织服装、商业零售行业研究员，东方策略成长股票型开放式证券投资基金（于2015年8月7日转型为东方策略成长混合型开放式证券投资基金）基金经理助理、东方策略成长股票型开放式证券投资基金（于2015年8月7日转型为东方策略成长混合型开放式证券投资基金）基金经理、东方赢家保本混

合型证券投资基金基金经理、东方保本混合型开放式证券投资基金（于2017年5月11日转型为东方成长收益平衡混合型证券投资基金）基金经理、东方荣家保本混合型证券投资基金基金经理、东方民丰回报赢安定期开放混合型证券投资基金（于2017年9月13日起转型为东方民丰回报赢安混合型证券投资基金）基金经理、东方成长收益平衡混合型证券投资基金（于2018年1月17日转型为东方成长收益灵活配置混合型证券投资基金）基金经理、东方大健康混合型证券投资基金基金经理、东方成长收益灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方价值挖掘灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方合家保本混合型证券投资基金基金经理、东方民丰回报赢安混合型证券投资基金基金经理、东方盛世灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方新思路灵活配置混合型证券投资基金基金经理，现任东方策略成长混合型开放式证券投资基金基金经理、东方新兴成长混合型证券投资基金基金经理、东方城镇消费主题混合型证券投资基金基金经理、东方品质消费一年持有期混合型证券投资基金基金经理。

吴萍萍女士，公司总经理助理，固定收益投资副总监，固定收益投资部总经理，公募投资决策委员会委员。中国人民大学应用经济学硕士，13年证券从业经历。曾任安信证券投资组资金交易员、民生加银基金管理有限公司专户投资经理。2015年11月加盟本基金管理人，曾任固定收益投资部副总经理，东方稳健回报债券型证券投资基金基金经理助理、东方添益债券型证券投资基金基金经理助理、东方利群混合型发起式证券投资基金基金经理助理、东方强化收益债券型证券投资基金基金经理助理、东方添益债券型证券投资基金基金经理、东方安心收益保本混合型证券投资基金（于2019年8月2日起转型为东方成长回报平衡混合型证券投资基金）基金经理、东方稳健回报债券型证券投资基金基金经理、东方成长回报平衡混合型证券投资基金基金经理、东方臻悦纯债债券型证券投资基金基金经理、东方合家保本混合型证券投资基金基金经理、东方卓行18个月定期开放债券型证券投资基金基金经理、东方臻选纯债债券型证券投资基金基金经理、东方臻萃3个月定期开放纯债债券型证券投资基金基金经理、东方永泰纯债1年定期开放债券型证券投资基金基金经理、东方永悦18个月定期开放纯债债券型证券投资基金基金经理、东方臻享纯债债券型证券投资基金基金经理、东方金账簿货币市场证券投资基金基金经理、东方恒瑞短债债券型证券投资基金基金经理、东方中债1-5年政策性金融债指数证券投资基金基金经理，现任东方永兴18个月定期

开放债券型证券投资基金基金经理、东方添益债券型证券投资基金基金经理、东方臻裕债券型证券投资基金基金经理、东方锦合一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理、东方享悦90天滚动持有债券型证券投资基金基金经理、东方享誉30天滚动持有债券型证券投资基金基金经理。

刘长俊先生，固定收益投资部副总经理，公募投资决策委员会委员。上海财经大学金融学硕士，13年证券从业经历。曾任平安银行股份有限公司投资经理、德邦基金管理有限责任公司固定收益研究员、基金经理。2019年7月加盟本基金管理人，曾任东方恒瑞短债债券型证券投资基金基金经理、东方中债1-5年政策性金融债指数证券投资基金基金经理，现任东方稳健回报债券型证券投资基金基金经理、东方卓行18个月定期开放债券型证券投资基金基金经理、东方臻慧纯债债券型证券投资基金基金经理、东方臻选纯债债券型证券投资基金基金经理、东方臻善纯债债券型证券投资基金基金经理。

盛泽先生，量化投资部总经理，资产配置部总经理、公募投资决策委员会委员。简历请参见基金经理介绍。

车日楠女士，固定收益研究部总经理、公募投资决策委员会委员。北京交通大学计算数学专业硕士，9年证券从业经历。2015年7月加盟本基金管理人，曾任固定收益研究部研究员、交易部债券交易员，东方永泰纯债1年定期开放债券型证券投资基金基金经理助理、东方臻选纯债债券型证券投资基金基金经理助理、东方永兴18个月定期开放债券型证券投资基金基金经理助理、东方稳健回报债券型证券投资基金基金经理助理、东方成长回报平衡混合型证券投资基金基金经理助理、东方添益债券型证券投资基金基金经理助理、东方臻享纯债债券型证券投资基金基金经理助理、东方价值挖掘灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、东方多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方臻选纯债债券型证券投资基金基金经理、东方臻善纯债债券型证券投资基金基金经理，现任东方臻享纯债债券型证券投资基金基金经理、东方臻萃3个月定期开放纯债债券型证券投资基金基金经理、东方永悦18个月定期开放纯债债券型证券投资基金基金经理、东方永泰纯债1年定期开放债券型证券投资基金基金经理、东方兴润债券型证券投资基金基金经理、东方中债绿色普惠主题金融债券优选指数证券投资基金基金经理。

郑雪莹女士，固定收益投资部副总经理、公募投资决策委员会委员。复旦大

学财务学专业硕士，9年证券从业经历。2015年7月加盟本基金管理人，曾任固定收益研究部研究员、交易部债券交易员，东方永熙18个月定期开放债券型证券投资基金基金经理助理、东方金元宝货币市场基金基金经理助理、东方臻宝纯债债券型证券投资基金基金经理助理、东方民丰回报赢安混合型证券投资基金基金经理助理、东方新价值混合型证券投资基金基金经理助理、东方惠新灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、东方金账簿货币市场证券投资基金基金经理助理、东方金证通货币市场基金基金经理助理、东方多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、东方盛世灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、东方永熙18个月定期开放债券型证券投资基金基金经理，现任东方金元宝货币市场基金基金经理、东方金账簿货币市场证券投资基金基金经理、东方金证通货币市场基金基金经理、东方臻宝纯债债券型证券投资基金基金经理、东方恒瑞短债债券型证券投资基金基金经理。

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

### 三、基金管理人职责

#### 1、基金管理人的权利

- （1）依法募集基金，办理基金备案手续；
- （2）依照法律法规和基金合同独立管理运用基金财产；
- （3）根据法律法规和基金合同的规定，制订、修改并公布有关基金认购、申购、赎回、转托管、基金转换、非交易过户、冻结、收益分配等方面的业务规则；
- （4）根据法律法规和基金合同的规定决定本基金的相关费率结构和收费方式，获得基金管理费，收取认购费、申购费、赎回费及其他事先核准或公告的合理费用以及法律法规规定的其他费用；
- （5）根据法律法规和基金合同的规定销售基金份额；
- （6）在本合同的有效期内，在不违反公平、合理原则以及不妨碍基金托管人遵守相关法律法规及其行业监管要求的基础上，基金管理人有权对基金托管人履行本合同的情况进行必要的监督。如认为基金托管人违反了法律法规或基金合同规定对基金财产、其他基金合同当事人的利益造成重大损失的，应及时呈报中国证监会和中国银监会，以及采取其他必要措施以保护本基金及相关基金合同当事人的利益；

（7）根据基金合同的规定选择适当的基金其他销售机构并有权依照销售协议和有关法律法规对基金其他销售机构行为进行必要的监督和检查；

（8）自行承担基金份额登记机构或选择、更换基金注册登记代理机构，办理基金份额登记业务，并按照基金合同规定对基金注册登记代理机构进行必要的监督和检查；

（9）在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回的申请；

（10）在法律法规允许的前提下，为基金份额持有人的利益依法为基金进行融资、融券；

（11）依据法律法规和基金合同的规定，制订基金收益分配方案；

（12）按照法律法规，代表基金对被投资企业行使股东权利，代表基金行使因投资于其他证券所产生的权利；

（13）在基金托管人职责终止时，提名新的基金托管人；

（14）依据法律法规和基金合同的规定，召集基金份额持有人大会；

（15）选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构并确定有关费率；

（16）法律法规、基金合同规定的其他权利。

## 2、基金管理人的义务

（1）依法募集基金，办理或者委托经国务院证券监督管理机构认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、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、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；

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

（5）建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和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）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；

（7）除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第

三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

（8）进行基金会计核算并编制基金的财务会计报告；

（9）依法接受基金托管人的监督；

（10）编制季度报告、中期报告和年度报告；

（11）采取适当合理的措施使计算开放式基金份额认购、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；

（12）计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回价格；

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

（14）保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、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以保密，不得向他人泄露；

（15）按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

（16）保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表、代表基金签订的重大合同及其他相关资料；

（17）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；

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

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

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

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

（22）法律法规、基金合同及中国证监会规定的其他义务。

#### 四、基金管理人的承诺

1、本基金管理人承诺严格遵守现行有效的相关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反现



行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会有关规定的行为发生。

2、本基金管理人承诺严格遵守《证券法》、《基金法》及有关法律法规，建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止下列行为发生：

- （1）将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
- （2）不公平地对待其管理的不同基金财产；
- （3）利用基金财产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）法律法规或中国证监会禁止的其他行为。

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

- （1）越权或违规经营；
- （2）违反基金合同或托管协议；
- （3）故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法利益；
- （4）在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；
- （5）拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
- （6）玩忽职守、滥用职权；
- （7）违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；

（8）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；

- （9）贬损同行，以抬高自己；
- （10）以不正当手段谋求业务发展；
- （11）有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；
- （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）其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

#### 4、基金经理承诺

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

- （2）不利用职务之便为自己及其代理人、受雇人或任何第三人谋取利益；

（3）不违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；

（4）不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

## 五、基金管理人的内部控制制度

### 1、内部控制制度

#### （1）内部控制的原则

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

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

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

④相互制约原则：公司内部部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡。

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

#### （2）内部控制的主要内容

##### 〈1〉控制环境

①控制环境构成公司内部控制的基础，环境控制包括管理思想、经营理念、控制文化、公司治理结构、组织结构和员工道德素质等内容。

②管理层通过定期学习、讨论、检讨内控制度，组织内控设计并以身作则、积极执行，牢固树立诚实信用和内控优先的思想，自觉形成风险管理观念；通过营造公司内控文化氛围，增进员工风险防范意识，使其贯穿于公司各部分、岗位和业务环节。

③董事会负责公司内部控制基本制度的制定和内控工作的评估审查，对公司建立有效的内部控制系统承担最终责任；同时，通过充分发挥独立董事和监事会的监督职能，避免不正当关联交易、利益输送和内部人控制现象的发生，建立健全符合现代企业制度要求的法人治理结构。

④建立决策科学、运营规范、管理高效的运行机制，包括民主透明的决策程

序和管理议事规则，高效严谨的业务执行系统，以及健全有效的内部监督和反馈系统。

⑤建立科学的聘用、培训、轮岗、考评、晋升、淘汰等人事管理制度，严格制定单位业绩和个人工作表现挂钩的薪酬制度，确保公司职员具备和保持正直、诚实、公正、廉洁的品质与应有的专业能力。

#### <2>风险评估

公司定期评估公司风险状况，范围包括所有能对经营目标产生负面影响的内部和外部因素，评估这些因素对公司总体经营目标产生影响的程度及可能性，并将评估报告报公司董事会及高级管理人员。

#### <3>组织体系

内部控制组织体系包括三个层次：

第一层次：董事会层面对公司经营管理过程中的风险控制工作的指导；

公司董事会通过其下设的合规与风险控制委员会、督察长对公司和基金的合法合规性进行监督。

合规与风险控制委员会代表董事会在董事会授权范围内对公司和基金运作的合法合规性及风险控制状况进行评估，并督促经理层、督察长落实或改进。

督察长根据法律、法规的规定，监督检查基金和公司运作的合法合规及公司内部风险控制情况，行使法律、法规及中国证监会和公司章程规定的职权。

第二层次：公司管理层对经营风险进行预防和控制的组织主要是总经理办公会、风险控制委员会和风险与监察稽核部门；

①总经理办公会为公司经营重大事项之决策机构，并负责公司层面风险管理工作。

②风险控制委员会是公司基金投资的最高风险控制机构。风险控制委员会的主要职权是拟定基金投资风险控制的基本制度和标准，划分和量化市场风险，并进行基金投资组合的风险评估和业绩评价。

③风险与监察稽核部门，负责对公司、基金运作和资产管理的合法合规性、内部控制制度的有效性及公司日常风险和基金投资的绩效评价进行风险管理、监察、稽核。

第三层次：各职能部门对各自业务的自我检查和控制。

公司各业务部门作为公司内部风险控制的具体实施单位，在公司各项基本管

理制度的基础上，根据具体情况制订和执行本部门的业务管理办法和操作流程，对各自业务中潜在风险进行自我检查和控制。

#### <4>制度体系

制度是内部控制的指引和规范，制度缜密是内部控制体系的基础。

①内部控制制度包括内部管理控制制度、业务控制制度、会计核算控制制度、信息披露制度、监察稽核制度等。

②内部管理控制制度包括授权管理制度、人力资源及业绩考核制度、行政管理制  
度、员工行为规范、纪律程序。

③业务控制制度包括投资管理制度、风险控制制度、资料档案管理制度、技术保障制度和危机处理制度。

#### <5>信息与沟通

建立内部办公自动化信息系统与业务汇报体系，通过建立有效的信息交流渠道，保证公司员工及各级管理人员可以充分了解与其职责相关的信息，保证信息及时送达适当的人员进行处理。

### 2、基金管理人关于内部控制的声明

（1）本公司确知建立、实施和维持内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任，董事会承担最终责任；

（2）上述关于内部控制的披露真实、准确；

（3）本公司承诺将根据市场环境的变化及公司的发展不断完善内部控制制度。

## 第四部分 基金托管人

### 一、基金托管人的基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

首次注册登记日期：1983 年 10 月 31 日

注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整

法定代表人：葛海蛟

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号

托管部门信息披露联系人：许俊

传真：（010）66594942

中国银行客服电话：95566

### 二、基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于 1998 年，现有员工 110 余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60% 以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内，中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。

### 三、证券投资基金托管情况

截至 2024 年 6 月 30 日，中国银行已托管 1111 只证券投资基金，其中境内基金 1046 只，QDII 基金 65 只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型、FOF、REITs 等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

#### 四、托管业务的内部控制制度

中国银行托管业务部风险管理与控制工作是中国银行全面风险控制工作的组成部分，秉承中国银行风险控制理念，坚持“规范运作、稳健经营”的原则。中国银行托管业务部风险控制工作贯穿业务各环节，通过风险识别与评估、风险控制措施设定及制度建设、内外部检查及审计等措施强化托管业务全员、全面、全程的风险管控。

2007年起，中国银行连续聘请外部会计会计师事务所开展托管业务内部控制审阅工作。先后获得基于“SAS70”、“AAF01/06”“ISAE3402”和“SSAE16”等国际主流内控审阅准则的无保留意见的审阅报告。2020年，中国银行继续获得了基于“ISAE3402”和“SSAE16”双准则的内部控制审计报告。中国银行托管业务内控制度完善，内控措施严密，能够有效保证托管资产的安全。

#### 五、托管人对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》的相关规定，基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。

## 第五部分 相关服务机构

### 一、直销机构

#### 1、柜台交易

名称：东方基金管理股份有限公司直销中心

住所：北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层

办公地址：海南省海口市龙华区滨海大道 77 号中环国际广场 21 层

法定代表人：崔伟

联系人：李媛

电话：0898-68666597

传真：0898-68666580

网址：[www.orient-fund.com](http://www.orient-fund.com) 或 [www.df5888.com](http://www.df5888.com)

#### 2、电子交易

投资者可以通过本公司网上交易系统办理基金的申购、赎回等业务，具体业务办理情况及业务规则请登录本公司网站查询。

网址：[www.orient-fund.com](http://www.orient-fund.com) 或 [www.df5888.com](http://www.df5888.com)

### 二、其他销售机构

销售机构	销售机构信息
中国工商银行股份有限公司	住所：中国北京复兴门内大街 55 号 办公地址：中国北京复兴门内大街 55 号 法定代表人：廖林 联系人：陶仲伟 电话：010-66107900 传真：010-66107914 客服电话：95588 网址： <a href="http://www.icbc.com.cn">www.icbc.com.cn</a>
中国农业银行股份有限公司	住所：北京市东城区建国门内大街 69 号 办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 法定代表人：谷澍 客服电话：95599 网址： <a href="http://www.abchina.com">www.abchina.com</a>
中国银行股份有限公司	住所：北京市西城区复兴门内大街 1 号 办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号中国银行总行办公大楼

	法定代表人：葛海蛟 客服电话：95566 网址：www.boc.cn
中国建设银行股份有限公司	住所：北京市西城区金融大街25号 办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼 长安兴融中心 法定代表人：张金良 客服电话：95533 网址：www.ccb.com
交通银行股份有限公司	住所：上海市浦东新区银城中路188号 办公地址：上海市浦东新区银城中路188号 法定代表人：任德奇 客服电话：95559 网址：www.bankcomm.com
招商银行股份有限公司	注册地址：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦 办公地址：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦 法定代表人：缪建民 联系人：季平伟 客户服务电话：95555 网址：www.cmbchina.com
中信银行股份有限公司	住所：北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层 办公地址：北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层 法定代表人：朱鹤新 客服电话：95558 网址：www.citicbank.com
兴业银行股份有限公司	注册地址：福建省福州市台江区江滨中大道398号兴业银行大厦 办公地址：上海市银城路167号 法定代表人：吕家进 联系人：蔡宣铭 电话：021-52629999 客服电话：95561 网址：www.cib.com.cn
中国民生银行股份有限公司	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 客服电话：95568 网址：www.cmbc.com.cn
中国邮政储蓄银行股份有限公司	注册地址：北京市西城区金融大街3号 办公地址：北京市西城区金融大街3号



	<p>法人代表：刘建军  客服电话：95580  公司网站：www.psbcb.com</p>
北京银行股份有限公司	<p>住所：北京市西城区金融大街甲17号首层  办公地址：北京市西城区金融大街丙17号  法定代表人：霍学文  客服电话：95526  网址：www.bankofbeijing.com.cn</p>
平安银行股份有限公司	<p>注册地址：深圳市罗湖区深南东路5047号  法定代表人：谢永林  客服电话：95511-3  网址：bank.pingan.com</p>
宁波银行股份有限公司同业易管家	<p>住所：浙江省宁波市鄞州区宁东路345号  办公地址：上海市浦东新区世纪大道210号19楼  法人代表：陆华裕  联系人：马艺玮  电话：021-23262715  客服电话：95574  网址：www.nbcb.com.cn</p>
青岛银行股份有限公司	<p>住所：青岛市崂山区秦岭路6号3号楼  办公地址：青岛市崂山区秦岭路6号3号楼  法定代表人：郭少泉  联系人：陈界交  电话：0532-68629956  传真：0532-68629939  客户服务电话：96588(青岛)；400-66-96588(全国)  网址：www.qdccb.com</p>
东莞银行股份有限公司	<p>住所：东莞市莞城区体育路21号东莞银行大厦  办公地址：东莞市莞城区体育路21号东莞银行大厦  法定代表人：卢国锋  联系人：朱杰霞  电话：0769-27239605  客服电话：956033  网址：www.dongguanbank.cn</p>
吉林银行股份有限公司	<p>住所：吉林省长春市东南湖大路1817号  办公地址：吉林省长春市东南湖大路1817号  法定代表人：王立生  联系人：孟明  电话：0431-84992680  传真：0431-84992649  客服电话：400-88-96666(全国)、96666(吉林省)  网址：www.jlbank.com.cn</p>
晋商银行股份有限公司	<p>住所：山西省太原市小店区长风街59号</p>

	<p>办公地址：山西省太原市小店区长风街 59 号          法人代表：郝强          联系人：董嘉文          电话：0351-6819505          传真：0351-6819898          客户服务电话：95105588          网址：www.jshbank.com</p>
中信百信银行股份有限公司	<p>注册地址：北京市朝阳区安定路 5 号院 3 号楼 8 层          办公地址：北京市朝阳区安定路 5 号院 3 号楼 6-11 层          法定代表人：李如东          联系人：韩晓彤          客服电话：400-818-0100          网址：www.aibank.com</p>
国泰君安证券股份有限公司	<p>住所：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号          办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼          法定代表人：贺青          联系人：黄博铭          电话：021-38676666          传真：021-38670666          客服电话：95521          网址：www.gtja.com</p>
中信建投证券股份有限公司	<p>住所：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼          办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号          法定代表人：王常青          联系人：权唐          电话：010-85130588          传真：010-65182261          客服电话：400-8888-108          网址：www.csc108.com</p>
国信证券股份有限公司	<p>住所：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层          办公地址：深圳市福田区福华一路 125 号国信金融大厦 37 楼          法定代表人：何如          联系人：张帆          电话：0755-82136213          传真：0755-82133952          客服电话：95536          网址：www.guosen.com.cn</p>
招商证券股份有限公司	<p>住所：深圳市福田区福田街道福华一路 111 号          办公地址：深圳市福田区福华一路 111 号招商证券大厦 23 楼</p>

	<p>法定代表人：霍达  联系人：黄婵君  电话：0755-82960167  传真：0755-829734343  客服电话：95565、4008888111  网址：www.newone.com.cn</p>
广发证券股份有限公司	<p>住所：广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街2号618室  办公地址：广州市天河区马场路26号广发证券大厦  法定代表人：林传辉  联系人：黄岚  电话：020-66338888  传真：020-87555305  客服电话：95575  网址：www.gf.com.cn</p>
中信证券股份有限公司	<p>住所：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座  办公地址：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦  法定代表人：张佑君  联系人：郑慧  电话：010-6083 8888  传真：010-6083 6029  客服电话：95548  网址：www.cs.ecitic.com</p>
中国银河证券股份有限公司	<p>住所：北京市西城区金融大街35号2-6层  办公地址：北京市丰台区西营街8号院1号楼青海金融大厦  法定代表人：王晟  联系人：辛国政  电话：010-80928123  传真：010-80928123  客服电话：4008-888-888 或 95551  网址：www.chinastock.com.cn</p>
海通证券股份有限公司	<p>住所：上海市淮海中路98号  办公地址：上海市黄浦区广东路689号  法定代表人：周杰  联系人：凌方睿  电话：021-23219454  传真：021-23219100  客服电话：021-95553、400-8888-001 或拨打各城市营业网点咨询电话  网址：www.htsec.com</p>

申万宏源证券有限公司	住所：上海市徐汇区长乐路989号45层 办公地址：上海市徐汇区长乐路989号45层 法定代表人：杨玉成 联系人：余洁 电话：021-33389888 传真：021-33388224 客服电话：95523 或 4008895523 网址：www.swhysc.com
兴业证券股份有限公司	住所：福州市湖东路268号 办公地址：上海市浦东新区长柳路36号 法定代表人：杨华辉 联系人：乔琳雪 电话：021-38565547 客服电话：95562 网址：www.xyzq.com.cn
长江证券股份有限公司	住所：武汉市新华路特8号长江证券大厦 办公地址：武汉市新华路特8号 法定代表人：李新华 联系人：奚博宇 电话：027-65799999 传真：027-85481900 客服电话：95579 或 4008-888-999 网址：www.95579.com
国投证券股份有限公司	住所：深圳市福田区福田街道福华一路119号安信金融大厦 办公地址：深圳市福田区福田街道福华一路119号安信金融大厦 法定代表人：段文务 电话：0755-82558305 传真：0755-82558355 客服电话：95517 网址：www.essence.com.cn
民生证券股份有限公司	住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道1168号B座2101、2104A室 办公地址：上海市浦东新区浦明路8号财富金融广场1幢 法定代表人：冯鹤年 电话：010-85127642 传真：010-85127888 客户服务电话：95376 网址：www.msyzq.com
国元证券股份有限公司	住所：安徽省合肥市寿春路178号 办公地址：安徽省合肥市寿春路178号 法定代表人：蔡咏

	<p>联系人：李蔡  电话：0551-68167423  传真：0551-68167431  客服电话：95578  网址：www.gyzq.com.cn</p>
华泰证券股份有限公司	<p>住所：江苏省南京市江东中路228号  办公地址：南京市建邺区江东中路228号华泰证券广场、深圳市福田区深南大道4011号港中旅大厦18楼  法定代表人：周易  联系人：郭力铭  电话：0755-82492193  传真：0755-82492962  客服电话：95597  网址：www.htsc.com.cn</p>
山西证券股份有限公司	<p>住所：山西省太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼  办公地址：山西省太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼  法定代表人：王怡里  联系人：郭熠  电话：0351-8686659  传真：0351-8686619  客服电话：400-666-1618  网址：www.i618.com.cn</p>
中信证券（山东）有限责任公司	<p>住所：青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001  办公地址：青岛市市南区东海西路28号龙翔广场东座5层  法定代表人：冯恩星  联系人：刘晓明  电话：0531-89606165  传真：0532-85022605  客服电话：95548  网址：sd.citics.com</p>
东兴证券股份有限公司	<p>住所：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12、15层  办公地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12、15层  法定代表人：魏庆华  联系人：付梦雪  电话：010-66559079  传真：010-66555147  客服电话：95309  网址：www.dxzq.net</p>

方正证券股份有限公司	住所：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层 办公地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层 法定代表人：施华 客服电话：95571 网址：www.foundersc.com
光大证券股份有限公司	住所：上海市静安区新闻路1508号 办公地址：上海市静安区新闻路1508号3楼 法定代表人：刘秋明 联系人：戴巧燕 电话：021-22169999 传真：021-22169134 客服电话：95525 网址：www.ebscn.com
东北证券股份有限公司	住所：长春市生态大街6666号 办公地址：长春市生态大街6666号 法定代表人：李福春 联系人：安岩岩 电话：0431-85096517 传真：0431-85096795 客服电话：95360 网址：www.nesc.cn
上海证券有限责任公司	住所：上海市黄浦区四川中路213号7楼 办公地址：上海市黄浦区四川中路213号久事商务大厦7楼 法定代表人：何伟 联系人：邵珍珍 电话：021-53686888 传真：021-53686100，021-53686200 客服电话：021-962518 网址：www.962518.com
平安证券股份有限公司	住所：深圳市福田区福田街道益田路5023号平安金融中心B座第22-25层 办公地址：深圳市福田区福田街道益田路5023号平安金融中心B座第22-25层 法定代表人：何之江 联系人：王阳 电话：021-38632136 传真：021-58991896 客服电话：95511-8 网址：stock.pingan.com
华安证券股份有限公司	住所：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号 办公地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路

	<p>198号财智中心B1座          法定代表人：章宏韬          联系人：范超          电话：0551-65161666          传真：0551-5161600          客服电话：95318          网址：www.hazq.com</p>
东莞证券股份有限公司	<p>住所：广东省东莞市莞城区可园南路一号金源中心30楼          办公地址：广东省东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼          法定代表人：陈照星          联系人：孙旭          电话：0769-22119348          客服电话：961130（省内直拨，省外请加拨区号0769）          网址：www.dgzq.com.cn</p>
东海证券股份有限公司	<p>注册地址：常州延陵西路23号投资广场18层          办公地址：上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦          法定代表人：钱俊文          电话：021-20333333          传真：021-50498825          联系人：王一彦          客服电话：95531 或 400-8888-588          网址：www.longone.com.cn</p>
恒泰证券股份有限公司	<p>住所：呼和浩特市新城区海拉尔东街满世书香苑办公楼7楼          办公地址：呼和浩特市新城区海拉尔东街满世书香苑办公楼7楼          法定代表人：庞介民          联系人：熊丽          电话：0471-4972675          客服电话：956088          网址：www.cnht.com.cn</p>
华西证券股份有限公司	<p>注册地址：中国（四川）自由贸易试验区成都市高新区天府二街198号          办公地址：中国（四川）自由贸易试验区成都市高新区天府二街198号          法定代表人：杨炯洋          客服电话：95584          网站：www.hx168.com.cn</p>
中泰证券股份有限公司	<p>住所：济南市市中区经七路86号          办公地址：山东省济南市市中区经七路86号</p>

	<p>法定代表人：李峰  联系人：李明娟  电话：021-20315290  传真：021-20315125  客服电话：95538  网址：www.zts.com.cn</p>
华福证券有限责任公司	<p>住所：福州市五四路157号新天地大厦7、8层  办公地址：福州市五四路157号新天地大厦7至10层  法定代表人：黄金琳  联系人：王虹  电话：0591-87383623  传真：0591-87383610  客服电话：96326（福建省外请先拨0591）  网址：www.hfzq.com.cn</p>
华龙证券股份有限公司	<p>住所：兰州市城关区东岗西路638号兰州财富中心21楼  办公地址：兰州市城关区东岗西路638号19楼  法定代表人：祁建邦  联系人：范坤  电话：0931-4890208  传真：0931-4890628  客户服务电话：95368  网址：www.hlzq.com</p>
五矿证券有限公司	<p>住所：深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心办公楼47层01单元  办公地址：深圳市南山区滨海大道与后海滨路交汇处滨海大道3165号五矿金融大厦（18-25层）  法定代表人：黄海洲  联系人：戴佳璐  电话：0755-23375492  客服电话：40018-40028  网址：www.wkzq.com.cn</p>
华鑫证券有限责任公司	<p>住所：深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01（b）单元  办公地址：深圳市福田区莲花街道福中社区深南大道2008号中国凤凰大厦1栋20C-1房  法定代表人：俞洋  联系人：杨莉娟  电话：021-54967552  传真：021-54967293  客服电话：021-32109999；029-68918888；4001099918  网址：www.cfsc.com.cn</p>



中国中金财富证券有限公司	<p>注册地址：广东省深圳市南山区粤海街道海珠社区科苑南路 2666 号中国华润大厦 L4601-L4608</p> <p>办公地址：广东省深圳市南山区粤海街道海珠社区科苑南路 2666 号中国华润大厦</p> <p>法定代表人：高涛</p> <p>联系人：万玉琳</p> <p>联系电话：0755-82026907</p> <p>客服电话：95532 或 400-600-8008</p> <p>网站：www.ciccwm.com</p>
中山证券有限责任公司	<p>注册地址：深圳市南山区粤海街道蔚蓝海岸社区创业路 1777 号海信南方大厦 21 层、22 层</p> <p>办公地址：深圳市南山区创业路 1777 号海信南方大厦 21、22 层</p> <p>法定代表人：吴小静</p> <p>联系人：罗艺琳</p> <p>电话：0755-82943755</p> <p>传真：0755-82960582</p> <p>客服电话：95329</p> <p>网址：www.zszq.com</p>
东方财富证券股份有限公司	<p>注册地址：西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城 10 栋楼</p> <p>办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号东方财富大厦</p> <p>法定代表人：戴彦</p> <p>联系人：付佳</p> <p>客服电话：95357</p> <p>网址：www.18.cn</p>
粤开证券股份有限公司	<p>住所：广州经济技术开发区科学大道 60 号开发区金控中心 21、22、23 层</p> <p>办公地址：深圳市福田区深南中路 2002 号中广核大厦北楼 10 层</p> <p>法定代表人：严亦斌</p> <p>联系人：彭莲</p> <p>电话：0755-83331195</p> <p>客服电话：95564</p> <p>网址：www.lxsec.com</p>
江海证券有限公司	<p>住所：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号</p> <p>办公地址：哈尔滨市松北区创新三路 833 号</p> <p>法定代表人：赵洪波</p> <p>联系人：王金娇</p> <p>电话：0451-87765732</p> <p>传真：0451-82337279</p> <p>客户服务热线：400-666-2288</p> <p>网址：www.jhzq.com.cn</p>

国金证券股份有限公司	住所：四川省成都市东城根上街95号 办公地址：四川省成都市东城根上街95号 法定代表人：冉云 联系人：刘婧漪 电话：028-86690057 传真：028-86690126 客服电话：95310 网址：www.gjzq.com.cn
中国民族证券有限责任公司	住所：北京市朝阳区北四环中路27号5号楼 办公地址：北京市朝阳区北四环中路27号5号楼 法定代表人：何亚刚 联系人：尚蓓 电话：010-59355497 传真：010-56437030 客服电话：400-889-5618 网站：www.e5618.com
华宝证券股份有限公司	注册地：中国(上海)自由贸易试验区浦电路370号2、3、4层 办公地址：中国(上海)自由贸易试验区浦电路370号2、3、4层 法人代表：刘加海 电话：4008209898 公司官网：www.cnhbstock.com
华金证券股份有限公司	注册地址：上海市静安区天目西路128号19层1902室 办公地址：上海市静安区天目西路128号19层1902室 法定代表人：燕文波 客户服务电话：956011 网址：www.huajinsc.cn
深圳市新兰德证券投资咨询有限公司	注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006# 办公地址：北京市西城区宣武门外大街10号庄胜广场中央办公楼东翼7层727室 法定代表人：杨懿 联系人：张燕 客服电话：400-166-1188 网址：8.jrj.com.cn
和讯信息科技有限公司	注册地址：北京市朝阳区朝外大街22号1002室 办公地址：北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层 法定代表人：章知方 联系人：陈慧

	<p>客服电话：010-85650688 网址：www.hexun.com</p>
财咨道信息技术有限公司	<p>注册地址：辽宁省沈阳市浑南区白塔二南街18-2号B座601 办公地址：辽宁省沈阳市浑南区白塔二南街18-2号B座601 法定代表人：朱荣晖 联系人：庞文静 客服电话：400-003-5811 网址：www.jinjiwo.com</p>
江苏汇林保大基金销售有限公司	<p>注册地址：南京市高淳区经济开发区古檀大道47号 办公地址：南京市鼓楼区中山北路2号绿地紫峰大厦2005室 法定代表人：吴言林 联系人：孙平 客服电话：025-66046166 网址：www.huilinbd.com</p>
上海陆享基金销售有限公司	<p>注册地址：中国(上海)自由贸易试验区临港新片区环湖西二路888号1幢1区14032室 办公地址：上海市浦东新区世纪大道1196号世纪汇广场2座16楼01、08单元 法定代表人：粟旭 联系人：王玉 客服电话：400-168-1235 网址：www.luxxfund.com</p>
腾安基金销售（深圳）有限公司	<p>注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室 办公地址：深圳市南山区海天二路33号腾讯滨海大厦15层 法定代表人：刘明军 联系人：吴建国 客服电话：95017 网址：www.txfund.com</p>
北京度小满基金销售有限公司	<p>注册地址：北京市海淀区西北旺东路10号院西区4号楼1层103室 办公地址：北京市海淀区西北旺东路10号院西区4号楼 法定代表人：葛新 联系人：宋刚 客服电话：95055-4 网址：www.baiyingfund.com</p>
博时财富基金销售有限公司	<p>注册地址：深圳市福田区莲花街道福新社区益田路5999号基金大厦19层</p>

	<p>办公地址：深圳市福田区莲花街道福新社区益田路5999号基金大厦19层                  法定代表人：王德英                  联系人：崔丹                  客服电话：400-610-5568                  网址：www.boserawealth.com</p>
<p>诺亚正行基金销售有限公司</p>	<p>注册地址：上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室                  办公地址：上海市杨浦区昆明路508号北美广场B座12楼                  法定代表人：汪静波                  联系人：李娟                  客服电话：400-821-5399                  网址：www.noah-fund.com</p>
<p>深圳众禄基金销售股份有限公司</p>	<p>注册地址：深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元                  办公地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼                  法定代表人：薛峰                  联系人：童彩平                  客服电话：400 678 8887                  网址：www.zlfund.cn 及 www.jjmmw.com</p>
<p>上海天天基金销售有限公司</p>	<p>注册地址：上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层                  办公地址：上海市徐汇区宛平南路88号金座东方财富大厦                  法定代表人：其实                  联系人：施悦                  客服电话：400 1818 188                  网址：www.1234567.com.cn</p>
<p>上海好买基金销售有限公司</p>	<p>注册地址：上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室                  办公地址：上海市浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903~906室                  法定代表人：杨文斌                  联系人：张茹                  客服电话：400 700 9665                  网址：www.ehowbuy.com</p>
<p>蚂蚁（杭州）基金销售有限公司</p>	<p>注册地址：浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路969号3幢5层599室                  办公地址：浙江省杭州市西湖区西溪路556号                  法定代表人：王珺                  联系人：韩爱彬                  客服电话：95188-8</p>

	网址： <a href="http://www.fund123.cn">www.fund123.cn</a>
上海长量基金销售有限公司	注册地址：上海市浦东新区高翔路526号2幢220室 办公地址：上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层 法定代表人：张跃伟 联系人：单丙焯 客服电话：400 820 2899 网址： <a href="http://www.erichfund.com">www.erichfund.com</a>
浙江同花顺基金销售有限公司	注册地址：杭州市文二西路1号903室 办公地址：浙江省杭州市翠柏路7号杭州电子商务产业园2号楼2楼 法定代表人：凌顺平 联系人：刘晓倩 客服电话：4008-773-772 网址： <a href="http://www.5ifund.com">www.5ifund.com</a>
北京展恒基金销售股份有限公司	注册地址：北京市朝阳区华严北里2号民建大厦6层 办公地址：北京市朝阳区华严北里2号民建大厦6层 法定代表人：闫振杰 联系人：宋丽冉 客服电话：400 888 6661 网址： <a href="http://www.myfund.com">www.myfund.com</a>
上海利得基金销售有限公司	注册地址：上海宝山区蕴川路5475号1033室 办公地址：上海浦东新区峨山路91弄61号10号楼12楼 法定代表人：李兴春 联系人：赵沛然 客服电话：400-921-7755 网址： <a href="http://www.leadfund.com.cn">www.leadfund.com.cn</a>
天津市润泽基金销售有限公司	注册地址：天津市和平区南京路181号世纪都会1606-1607 办公地址：天津市和平区南京路181号世纪都会1606-1607 法定代表人：王正宇 联系人：孟媛媛 客服电话：400-706-6880 网址： <a href="http://www.fhcfjj.com">www.fhcfjj.com</a>
嘉实财富管理有限公司	注册地址：上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心办公楼二期46层4609-10单元 办公地址：北京市朝阳区建国路91号金地中心A座6层 法定代表人：赵学军

	<p>联系人：余永键  客服电话：400-021-8850  网址：www.harvestwm.cn</p>
北京创金启富基金销售有限公司	<p>注册地址：北京市西城区白纸坊东街2号院6号楼712室  办公地址：北京市西城区白纸坊东街2号院6号楼712室  法定代表人：梁蓉  联系人：张海洋  客服电话：010-66154828  网址：www.5irich.com</p>
泛华普益基金销售有限公司	<p>注册地址：成都市成华区建设路9号高地中心1101室  办公地址：成都市金牛区西宸龙湖国际B座12楼  法定代表人：杨远芬  联系人：史若芬  客服电话：400-080-3388  网址：www.puyifund.com</p>
宜信普泽(北京)基金销售有限公司	<p>注册地址：北京市朝阳区光华路7号楼20层20A1、20A2单元  办公地址：北京市朝阳区光华路7号楼20层20A1、20A2单元  法定代表人：才殿阳  联系人：魏晨  客服电话：400-6099-200  网址：www.yixinfund.com</p>
南京苏宁基金销售有限公司	<p>注册地址：南京市玄武区苏宁大道1-5号  办公地址：南京市玄武区徐庄软件园苏宁大道1号  法定代表人：王峰  联系人：张云飞  客服电话：025-66996699  网址：www.snjijin.com</p>
北京增财基金销售有限公司	<p>注册地址：北京市西城区南礼士路66号1号楼12层1208号  办公地址：北京市西城区南礼士路66号1号楼12层1208号  法定代表人：罗细安  联系人：史丽丽  客服电话：400-001-8811  网址：www.zcvc.com.cn</p>
通华财富(上海)基金销售有限公司	<p>注册地址：上海市浦东新区金沪路55号通华科技大厦10层  办公地址：上海市浦东新区金沪路55号通华科技大厦10层</p>

	<p>法定代表人：沈丹义                  联系人：陶律然                  客服电话：400-101-9301                  网址：www.tonghuafund.com</p>
北京中植基金销售有限公司	<p>注册地址：北京市北京经济技术开发区宏达北路10号五层5122室                  办公地址：北京朝阳区大望路金地中心A座28层                  法定代表人：武建华                  联系人：丛瑞丰                  客服电话：400-8180-888                  网址：www.zzfund.com</p>
北京汇成基金销售有限公司	<p>注册地址：北京市西城区宣武门外大街甲1号4层401-2                  办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲1号环球财讯中心D座406                  法定代表人：王伟刚                  联系人：丁向坤                  客服电话：400-055-5728                  网址：www.hcfunds.com</p>
一路财富（深圳）基金销售有限公司	<p>注册地址：深圳市前海深港合作区南山街道兴海大道3046号香江金融大厦2111                  办公地址：深圳市前海深港合作区南山街道兴海大道3046号香江金融大厦2111                  法定代表人：吴雪秀                  联系人：董宣                  客服电话：400-001-1566                  网址：www.yilucaifu.com</p>
北京钱景基金销售有限公司	<p>注册地址：北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012                  办公地址：北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012                  法定代表人：赵荣春                  联系人：申泽灏                  客服电话：400 678 5095                  网址：www.niuji.net</p>
海银基金销售有限公司	<p>注册地址：上海市浦东新区东方路1217号16楼B单元                  办公地址：上海市浦东新区东方路1217号6楼                  法定代表人：刘惠                  联系人：毛林                  客服电话：400-808-1016                  网址：www.fundhaiyin.com</p>
济安财富（北京）基金销售有限公司	<p>注册地址：北京市朝阳区东三环中路7号4号楼40层4601室</p>

	<p>办公地址：北京市朝阳区东三环中路7号北京财富中心A座46层                  法定代表人：杨健                  联系人：李海燕                  客服电话：400-673-7010                  网址：www.jianfortune.com</p>
上海万得基金销售有限公司	<p>注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路33号11楼B座                  办公地址：上海市浦东新区浦明路1500号万得大厦11楼                  法定代表人：黄伟                  联系人：张戈                  客服电话：400-799-1888                  网址：www.520fund.com.cn</p>
上海联泰基金销售有限公司	<p>注册地址：上海市普陀区兰溪路900弄15号526室                  办公地址：上海市虹口区临潼路188号                  法定代表人：尹彬彬                  联系人：陈东                  客服电话：400-118-1188                  网址：www.66liantai.com</p>
上海汇付金融服务有限公司	<p>注册地址：上海市中山南路100号金外滩国际广场19楼                  办公地址：上海市中山南路100号金外滩国际广场19楼                  法定代表人：金佶                  联系人：陈云卉                  客服电话：400-820-2819                  网址：www.chinapnr.com</p>
泰信财富基金销售有限公司	<p>注册地址：北京市朝阳区建国路乙118号10层1206                  办公地址：北京市朝阳区建国路乙118号京汇大厦1206                  法定代表人：彭浩                  联系人：韩艳丽                  客服电话：400-004-8821                  网址：www.taixinco.com</p>
上海基煜基金销售有限公司	<p>注册地址：上海市黄浦区广东路500号30层3001单元                  办公地址：上海市浦东新区银城中路488号太平金融大厦1503室                  法定代表人：王翔                  联系人：李鑫                  客服电话：400-820-5369</p>



	网址： <a href="http://www.jiyufund.com.cn">www.jiyufund.com.cn</a>
上海凯石财富基金销售有限公司	注册地址：上海市黄浦区西藏南路765号602-115室 办公地址：上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦4楼 法定代表人：陈继武 联系人：葛佳蕊 客服电话：4000178000 网址： <a href="http://www.lingxianfund.com">www.lingxianfund.com</a>
上海中正达广基金销售有限公司	注册地址：上海市徐汇区龙腾大道2815号302室 办公地址：上海市徐汇区龙腾大道2815号302室 法定代表人：黄欣 联系人：戴珉微 客服电话：400-6767-523 网址： <a href="http://www.zzwealth.cn">www.zzwealth.cn</a>
北京虹点基金销售有限公司	注册地址：北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙房2层222单元 办公地址：北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙房2层222单元 法定代表人：胡伟 联系人：牛亚楠 客服电话：400-618-0707 网址： <a href="http://www.hongdianfund.com">www.hongdianfund.com</a>
深圳新华信通基金销售有限公司	注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司） 办公地址：深圳市福田区深南大道2003号华嵘大厦710、711室 法定代表人：戴媛 联系人：原萱 客服电话：400-000-5767 网址： <a href="http://www.xintongfund.com">www.xintongfund.com</a>
深圳富济基金销售有限公司	注册地址：深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路3088号中洲大厦3203A单元 办公地址：深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路3088号中洲大厦3203A单元 法定代表人：刘鹏宇 联系人：刘勇 客服电话：0755-83999907 网址： <a href="http://www.fujifund.cn">www.fujifund.cn</a>
上海攀赢基金销售有限公司	注册地址：上海市闸北区广中西路1207号306室 办公地址：上海市浦东新区银城路116号大华银行大厦703室 法定代表人：郑新林

	<p>联系人：邓琦 电话：021-68889082 网址：www.pytz.cn</p>
<p>武汉市伯嘉基金销售有限公司</p>	<p>注册地址：湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际 SOHO 城（一期）第 7 栋 23 层 1 号、4 号 办公地址：湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际 SOHO 城（一期）第 7 栋 23 层 1 号、4 号 法定代表人：陶捷 联系人：孔繁 客服电话：400-027-9899 网址：www.buyfunds.cn</p>
<p>上海陆金所基金销售有限公司</p>	<p>注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元 办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 法定代表人：郭坚 联系人：宁博宇 客服电话：400-821-9031 网址：www.lufunds.com</p>
<p>珠海盈米基金销售有限公司</p>	<p>注册地址：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491 办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼 B1201-1203 法定代表人：肖雯 联系人：李孟军 客服电话：020-89629066 网址：www.yingmi.cn</p>
<p>和耕传承基金销售有限公司</p>	<p>注册地址：河南自贸试验区郑州片区（郑东）东风南路东康宁街北 6 号楼 5 楼 503 办公地址：河南自贸试验区郑州片区（郑东）东风南路东康宁街北 6 号楼 5 楼 503 法定代表人：温丽燕 联系人：胡静华 客服电话：4000555671 网址：www.hgccpb.com</p>
<p>奕丰基金销售有限公司</p>	<p>注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入住深圳市前海商务秘书有限公司） 办公地址：深圳市南山区海德三道航天科技广场 A 座 17 楼 1704 室 法定代表人：TEO WEE HOWE 联系人：叶健 客服电话：400-684-0500 网址：www.ifastps.com.cn</p>

<p>中证金牛（北京）基金销售有限公司</p>	<p>注册地址：北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室                  办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲1号环球财讯中心A座5层                  法定代表人：钱昊旻                  联系人：沈晨                  客服电话：4008-909-998                  网址：www.jnlc.com</p>
<p>上海爱建基金销售有限公司</p>	<p>注册地址：上海市黄浦区西藏中路336号1806-13室                  办公地址：上海市浦东新区民生路1299号丁香国际大厦西塔19层02/03室                  法定代表人：马金                  联系人：黄子珈                  客服电话：021-60608989                  网址：www.ajwm.com.cn</p>
<p>京东肯特瑞基金销售有限公司</p>	<p>注册地址：北京市海淀区西三旗建材城中路12号17号平房157                  办公地址：北京市通州区亦庄经济技术开发区科创十一街18号院京东集团总部A座15层                  法定代表人：王苏宁                  联系人：姜颖                  客服电话：95118                  网址：fund.jd.com</p>
<p>大连网金基金销售有限公司</p>	<p>注册地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路22号诺德大厦2层202室                  办公地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路22号诺德大厦2层                  法定代表人：樊怀东                  联系人：李鑫                  客服电话：4000-899-100                  网址：www.yibaijin.com</p>
<p>中民财富基金销售(上海)有限公司</p>	<p>注册地址：上海市黄浦区中山南路100号7层05单元                  办公地址：上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼27层                  法定代表人：弭洪军                  联系人：黄鹏                  客服电话：400-876-5716                  网址：www.cmiwm.com</p>
<p>北京雪球基金销售有限公司</p>	<p>注册地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507                  办公地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507</p>

	<p>法定代表人：钟斐斐                  联系人：侯芳芳                  客服电话：400-159-9288                  网址：danjuanapp.com</p>
深圳市前海排排网基金销售有限公司	<p>注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室                  办公地址：深圳市福田区新洲南路2008号新洲同创汇3层D303号                  法定代表人：杨柳                  联系人：林丽/刘文婷                  客服电话：400-666-7388                  网址：www.simuwang.com</p>
深圳前海财厚基金销售有限公司	<p>注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室                  办公地址：广东省深圳市南山区高新南十道深圳湾科技生态园三区11栋A座3608室                  法定代表人：杨艳平                  联系人：莫婉                  客服电话：400-1286-800                  网址：www.caiho.cn</p>
上海中欧财富基金销售有限公司	<p>注册地址：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路479号1008-1室                  办公地址：上海市虹口区公平路18号8栋嘉昱大厦6层                  法定代表人：许欣                  联系人：张政                  客服电话：400-100-2666                  网址：www.zocaifu.com</p>
上海华夏财富投资管理有限公司	<p>注册地址：上海市虹口区东大名路687号1幢2楼268室                  办公地址：北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层                  法定代表人：毛淮平                  联系人：张静怡                  客服电话：400-817-5666                  网址：www.amcfortune.com</p>
洪泰财富（青岛）基金销售有限公司	<p>注册地址：山东省青岛市市北区龙城路31号卓越世纪中心1号楼5006户                  办公地址：北京市朝阳区润世中心A座5层                  法定代表人：李赛                  联系人：张萌                  客服电话：400-8189-598                  网址：www.hongtaiwealth.com</p>
中国国际期货股份有限公司	<p>注册地址：北京市朝阳区建国门外光华路14</p>

司	号1幢1层、2层、9层、11层、12层 办公地址：北京市朝阳区麦子店西路3号新恒基国际大厦15层 法定代表人：王兵 联系人：许黎婧 客服电话：95162 或 400 888 8160 网址：www.cifco.net
中信期货有限公司	住所：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层 办公地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层 法定代表人：张皓 联系人：刘宏莹 电话：010-60833754 传真：0755-83201097 客服电话：400-990-8826 网址：www.citicsf.com
中信证券华南股份有限公司	住所：广州市天河区珠江西路5号501房 办公地址：广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔5层 法人代表：胡伏云 客服电话：95548 网址：www.gzs.com.cn
申万宏源西部证券有限公司	住所：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室 办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室 法定代表人：王献军 联系人：梁丽 电话：0991-2307105 传真：0991-2301927 客服电话：95523 或 4008895523 网址：www.swhysc.com
中国国际金融股份有限公司	注册地址：北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层 办公地址：北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层 法定代表人：沈如军 客服电话：010-65051166 或 010-65051156 网站：www.cicc.com
玄元保险代理有限公司	注册地址：中国（上海）自由贸易试验区张杨路707号1105室 办公地址：中国（上海）自由贸易试验区张杨路707号1105室

	<p>法定代表人：马永谔  联系人：卢亚博  客服电话：400-080-8208  网址：www.licaimofang.cn</p>
阳光人寿保险股份有限公司	<p>注册地址：海南省三亚市迎宾路360-1号三亚阳光金融广场16层  办公地址：北京市朝阳区朝外大街乙12号1号楼昆泰国际大厦12层  法定代表人：李科  客服电话：95510  网址：life.sinosig.com</p>
方德保险代理有限公司	<p>注册地址：北京市东城区东直门南大街3号楼7层711  办公地址：北京市朝阳区门外大街18号丰联广场A座1009  法定代表人：邢耀  联系人：马浩  客服电话：010-64068617  网址：www.fdsure.com</p>
中国人寿保险股份有限公司	<p>注册地址：北京市西城区金融大街16号  办公地址：北京市西城区金融大街16号  法定代表人：王滨  联系人：秦泽伟  客服电话：95519  网址：www.chinalife.com.cn</p>
平安银行股份有限公司行E通平台	<p>注册地址：深圳市罗湖区深南东路5047号  办公地址：深圳市罗湖区深南东路5047号  法定代表人：谢永林  客服电话：0755-82243265  网址：https://cor.etbank.com.cn/</p>
乾道基金销售有限公司	<p>注册地址：北京市西城区德胜门外大街13号院1号楼1302  办公地址：北京市西城区平安里西大街28号楼中海国际中心6层607  法定代表人：董云巍  联系人：马林  客服电话：400-003-0358  网址：www.qiandaojr.com</p>
江苏银行股份有限公司	<p>注册地址：南京市中华路26号  办公地址：江苏省南京市中华路26号  法定代表人：葛仁余  客服电话：95319  网站：http://www.jsbchina.cn/</p>

上海大智慧基金销售有限公司	<p>注册地址：中国(上海)自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102单元</p> <p>办公地址：中国上海市浦东新区杨高南路428号1号楼1102单元</p> <p>法定代表人：张俊</p> <p>联系人：蒋凯帆</p> <p>客服电话：021-20292031</p> <p>网址：www.wg.com.cn</p>
德邦证券股份有限公司	<p>注册地址：上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼</p> <p>办公地址：上海市黄浦区中山东二路600号外滩金融中心S2幢22楼</p> <p>法定代表人：武晓春</p> <p>客服电话：400-8888-128</p> <p>网站：www.tebon.com.cn</p>
麦高证券有限责任公司	<p>注册地址：沈阳市沈河区热闹路49号</p> <p>办公地址：沈阳市沈河区热闹路49号</p> <p>法定代表人：宋成</p> <p>客服电话：400-618-3355</p> <p>网站：www.mgzq.com</p>
甬兴证券有限公司	<p>注册地址：浙江省宁波市鄞州区海晏北路565、577号8-11层</p> <p>办公地址：浙江省宁波市鄞州区海晏北路565、577号8-11层</p> <p>上海市浦东新区南泉北路429号泰康保险大厦31-32层</p> <p>法定代表人：李抱</p> <p>客服电话：400-916-0666</p> <p>网站：www.yongxingsec.com</p>
喜鹊财富基金销售有限公司	<p>注册地址：西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦1513室</p> <p>办公地址：西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦1513室</p> <p>法定代表人：陈皓</p> <p>联系人：麦文桢</p> <p>客服电话：400-6997-719</p> <p>网址：www.xiquefund.com</p>

备注:为维护投资者利益,东方基金管理股份有限公司暂停喜鹊财富基金销售有限公司办理本公司旗下基金的基金开户、增开交易账户、变更交易账户、认购、申购、定期定额投资、转换、转托管入业务。已通过喜鹊财富持有本公司旗下基金的投资者,当前持有基金份额的赎回业务、转托管出业务不受影响,本公司恢复上述相关业务的具体时间,将另行公告。

### 三、份额登记机构

名称:东方基金管理股份有限公司

住所:北京市西城区锦什坊街28号1-4层

办公地址:北京市丰台区金泽路161号院1号楼远洋锐中心26层

法定代表人:崔伟

联系人:肖向辉

电话:010-66295871

传真:010-66578680

网址:www.orient-fund.com 或 www.df5888.com

### 四、律师事务所和经办律师

名称:上海市通力律师事务

住所:上海市银城中路68号时代金融中心19楼

办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼

负责人:韩炯

联系人:吕红

电话:021-31358666

传真:021-31358600

经办律师:吕红、黎明

### 五、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



联系人：龚凯

电话：86（10）8508 7927

传真：86（10）8518 5111

经办注册会计师：龚凯

## 第六部分 基金的募集与基金合同的生效

一、本基金根据 2009 年 4 月 14 日中国证券监督管理委员会《关于核准东方核心动力股票型开放式证券投资基金募集的批复》（证监许可[2009]302 号）和《关于东方核心动力股票型开放式证券投资基金募集时间安排的确认函》（基金部函[2009]301 号）的核准，并按照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定进行募集。

二、本基金类型：混合型

本基金存续期间：不定期

三、本基金募集期为：2009 年 5 月 5 日至 2009 年 6 月 19 日

募集份额为：771,742,249.97 份

有效户数为：17,585 户

四、本基金根据《关于东方核心动力股票型开放式证券投资基金备案确认的函》（基金部函[2009]419 号）的批准，于 2009 年 6 月 24 日基金合同生效。

本基金基金合同生效后，基金份额持有人数量不满两百人或者基金资产净值低于五千万元的，基金管理人应当及时报告中国证监会；连续 20 个工作日出现上述情形的，基金管理人应向中国证监会说明原因并报送解决方案。

法律法规或监管部门另有规定的，按其规定办理。

## 第七部分 基金份额的申购与赎回

### 一、申购和赎回的办理场所

- 1、本基金管理人的直销机构为直销中心以及电子交易平台。
- 2、经本基金管理人委托，具有销售开放式基金资格的商业银行或其他机构的营业网点即其他销售机构销售网点。目前其他销售机构的名称、住所等信息请详见本招募说明书“第五部分 相关服务机构”中“二、其他销售机构”。本基金管理人可根据情况增减基金其他销售机构机构，并在基金管理人网站公示。
- 3、投资者可通过本基金直销机构或指定的其他销售机构按照规定的方式进行申购或赎回。

### 二、申购和赎回的开放日及时间

- 1、本基金办理日常申购和赎回的开放日为上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日（本基金管理人公告暂停时除外）。具体业务办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所交易日的交易时间。目前，上海证券交易所、深圳证券交易所的交易时间为交易日上午 9：30-11：30，下午 1：00-3：00。
- 2、若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他原因，基金管理人可对前述开放日及具体业务办理时间进行相应的调整并于实施前在中国证监会指定媒介上公告。
- 3、投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回申请的，其基金份额申购、赎回视为下一开放日的交易申请。
- 4、本基金自 2009 年 7 月 8 日开始正常申购；自 2009 年 7 月 8 日开始正常办理赎回。

### 三、申购与赎回的原则

- 1、“未知价”原则，即基金的申购与赎回价格以受理申请当日收市后计算的各类基金份额的基金份额净值为基准进行计算；
- 2、基金采用金额申购和份额赎回的方式，即申购以金额申请，赎回以份额申请；
- 3、基金份额持有人在赎回基金份额时，基金管理人按先进先出的原则，即对

该基金份额持有人在该销售机构托管的基金份额进行处理时，申购确认日期在先的基金份额先赎回，申购确认日期在后的基金份额后赎回，以确定所适用的赎回费率；

4、当日的申购与赎回申请可以在当日业务办理时间结束前撤销，在当日的业务办理时间结束后不得撤销；

5、基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可更改上述原则，但最迟应在新的原则实施前按规定在指定媒介上公告。

#### 四、申购与赎回的程序

##### 1、申购与赎回的申请方式

基金投资者须按销售机构规定的手续，在开放日的业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

投资者申购本基金，须按销售机构规定的方式全额交付申购款项。

投资者提交赎回申请时，其在销售机构（网点）必须有足够的基金份额余额。

##### 2、申购与赎回申请的确认

T日规定时间受理的申请，正常情况下，基金份额登记机构在T+1日内为投资者对该交易的有效性进行确认，在T+2日后（包括该日）投资者可向销售机构或以销售机构规定的其他方式查询申购与赎回的成交情况。

##### 3、申购与赎回的款项支付

申购采用全额交款方式，若资金在规定时间内未全额到账则申购不成功，申购款项将退回投资者账户。

投资者T日赎回申请成功后，基金管理人将通过基金份额登记机构及其相关基金销售机构在T+7日（包括该日）内将赎回款项划往基金份额持有人账户。在发生巨额赎回时，赎回款项的支付办法按本基金合同和有关法律法规规定处理。

基金管理人可以在法律法规允许的范围内，对上述业务办理时间进行调整，并提前公告。

#### 五、申购与赎回的数额限制

1、投资者每次最低申购金额为1.00元（含申购费），每次定期定额最低申购金额为1.00元，具体办理要求以销售渠道的交易细则为准，但不得低于基金管

理公司规定的最低限额。

2、基金份额持有人在销售机构赎回时，每次赎回申请不得低于 1.00 份基金份额。基金份额持有人赎回时或赎回后在销售机构（网点）保留的基金份额余额不足 1.00 份的，在赎回时需一次全部赎回。

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

4、基金管理人可根据市场情况，合理调整对申购金额和赎回份额的数量限制，基金管理人进行前述调整必须按规定在指定媒介上公告。

## 六、申购费用和赎回费用

### 1、申购费用

本基金 A 类基金份额的申购费用由申购 A 类基金份额的申购人承担，不列入基金资产，C 类基金份额不收取申购费用。申购费用用于本基金的市场推广和销售等。投资者选择红利再投资转基金份额时不收取申购费用。

本基金 A 类基金份额的申购费采用前、后端收费模式，具体如下表所示：

前端收费费率如下：

申购金额（含申购费）	前端申购费率
50 万元以下	1.5%
50 万元以上（含 50 万元）-100 万元以下	1.2%
100 万元以上（含 100 万元）-500 万元以下	0.8%
500 万元以上（含 500 万元）	每笔 1,000.00 元

后端收费费率如下：

持有期限（一年按 365 天计算）	后端申购费率
1 年以内	1.8%
1 年以上（含 1 年）-3 年以内	1.0%
3 年以上（含 3 年）-5 年以内	0.6%
5 年以上（含 5 年）	0

### 2、赎回费用

本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额的赎回费用由该类基金份额的基金赎回人承担，未归入基金资产的部分作为注册登记等其他必要的手续费。

赎回费率如下：

	持有期限（一年按365天计算）	赎回费率	归入基金资产比例
A类基金份额	7日以内	1.50%	100%
	7日以上（含7日）-1年以内	0.5%	25%
	1年以上（含1年）-3年以内	0.25%	25%
	3年以上（含3年）-5年以内	0.1%	25%
	5年以上（含5年）	0	——
C类基金份额	7日以内	1.50%	100%
	7日以上（含7日）-30日以内	0.50%	100%
	30日以上（含30日）	0.00%	0%

3、基金管理人可以根据《基金合同》的相关约定调整费率或收费方式，基金管理人应于新的费率或收费方式实施日前按规定在指定媒介上公告。

4、基金管理人可以在不违背法律法规规定及《基金合同》约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对特定地域范围、特定行业、特定职业的投资者以及以特定交易方式（如网上交易、电话交易等）等进行基金交易的投资者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相关手续后基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

## 七、申购份额与赎回金额的计算

### 1、申购份额、申购费和赎回金额及赎回费的处理方式

申购份额、申购费、赎回费的处理方式：采用截位法，即：保留小数点后两位，小数点后两位以后的部分舍去。由此产生的误差由基金财产承担。

赎回金额的处理方式：采用四舍五入法保留小数点后2位，由此产生的误差由基金资产承担。

### 2、本基金申购份额的计算

#### (1) A类基金份额申购份额的计算方式

①前端收费模式：前端申购费用在投资者申购A类基金份额时收取。

申购费用适用比例费率时，A类基金份额申购份额的计算方法如下：

前端申购费用 = {申购金额 / (1 + 前端申购费率)} \* 前端申购费率

净申购金额 = 申购金额 - 前端申购费用

申购份额 = 净申购金额 / 申购日A类基金份额的基金份额净值

申购费用为固定金额时，申购份额的计算方法如下：

前端申购费用 = 固定金额

净申购金额 = 申购金额 - 前端申购费用

申购份额 = 净申购金额 / 申购日 A 类基金份额的基金份额净值

前端申购费用在投资者申购 A 类基金份额时收取。

例一：某投资者投资 4 万元申购本基金 A 类基金份额，申购费率为 1.5%，假设申购当日 A 类基金份额的基金份额净值为 1.0400 元，如果其选择前端收费方式，则其可得到的 A 类基金份额申购份额为：

前端申购费用 =  $\{40,000 / (1 + 1.5\%)\} \times 1.5\% = 591.13$  元

净申购金额 =  $40,000 - 591.13 = 39,408.87$  元

申购份额 =  $39,408.87 / 1.0400 = 37,893.14$  份

②后端收费模式：后端申购费用在投资者赎回 A 类基金份额时收取。

申购份额 = 申购金额 / 申购日 A 类基金份额的基金份额净值

后端申购费用 = 赎回份额 × 申购日 A 类基金份额的基金份额净值 × 后端申购费率

后端申购费用在投资者赎回 A 类基金份额时收取。

例二：某投资者投资 4 万元申购本基金 A 类基金份额，假设申购当日 A 类基金份额的基金份额净值为 1.0400 元，如果其选择后端收费方式，则其可得到的 A 类基金份额申购份额为：

申购份额 =  $40,000 / 1.0400 = 38,461.53$  份

(2) C 类基金份额申购份额的计算方式

申购份额 = 申购金额 / 申购日 C 类基金份额的基金份额净值

例三：某投资者投资 100,000.00 元申购本基金 C 类基金份额，假设申购当日 C 类基金份额的基金份额净值为 1.1200 元，则其可得到的申购份额为：

申购份额 =  $100,000.00 / 1.1200 = 89,285.71$  份

### 3、本基金赎回金额的计算

(1) 如果投资者在申购 A 类基金份额时选择交纳前端申购费用，则赎回金额的计算方法如下：

赎回费用 = 赎回份额 × 赎回日 A 类基金份额的基金份额净值 × 赎回费率

赎回金额 = 赎回份额 × 赎回日 A 类基金份额的基金份额净值 - 赎回费用

例四：某投资者赎回 1 万份 A 类基金份额，对应的赎回费率为 0.5%，假设赎回当日 A 类基金份额的基金份额净值是 1.0160 元，则其可得到的赎回金额为：

$$\text{赎回费用} = 10,000 \times 1.0160 \times 0.5\% = 50.80 \text{ 元}$$

$$\text{赎回金额} = 10,000 \times 1.0160 - 50.80 = 10,109.20 \text{ 元}$$

（2）如果投资者在申购 A 类基金份额时选择交纳后端申购费用，则赎回金额的计算方法如下：

后端申购费用 = 赎回份额 × 申购日 A 类基金份额的基金份额净值 × 后端申购费率

$$\text{赎回费用} = \text{赎回份额} \times \text{赎回日 A 类基金份额的基金份额净值} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{赎回金额} = \text{赎回份额} \times \text{赎回日 A 类基金份额的基金份额净值} - \text{后端申购费用} - \text{赎回费用}$$

例五：某投资者赎回 1 万份 A 类基金份额，对应的赎回费率为 0.5%，假设赎回当日 A 类基金份额的基金份额净值是 1.0160 元，投资者对应的后端申购费是 1.8%，申购时的基金净值为 1.0100 元，则其可得到的赎回金额为：

$$\text{后端申购费用} = 10,000 \times 1.0100 \times 1.8\% = 181.80 \text{ 元}$$

$$\text{赎回费用} = 10,000 \times 1.0160 \times 0.5\% = 50.80 \text{ 元}$$

$$\text{赎回金额} = 10,000 \times 1.0160 - 181.80 - 50.80 = 9,927.40 \text{ 元}$$

（3）如果投资者赎回 C 类基金份额，则赎回金额的计算方法如下：

$$\text{赎回费用} = \text{赎回份额} \times \text{赎回日 C 类基金份额的基金份额净值} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{赎回金额} = \text{赎回份额} \times \text{赎回日 C 类基金份额的基金份额净值} - \text{赎回费用}$$

例六：某投资者赎回 1 万份 C 类基金份额，对应的赎回费率为 0.5%，假设赎回当日 C 类基金份额的基金份额净值是 1.0160 元，则其可得到的赎回金额为：

$$\text{赎回费用} = 10,000 \times 1.0160 \times 0.5\% = 50.80 \text{ 元}$$

$$\text{赎回金额} = 10,000 \times 1.0160 - 50.80 = 10,109.20 \text{ 元}$$

#### 4、基金份额净值的计算公式

A 类/C 类基金份额净值 = A 类/C 类基金资产净值总额 / 发行在外的 A 类/C 类基金份额总数

本基金 T 日的各类基金份额的基金份额净值在当日收市后计算，并在 T+1 日公告。各类基金份额的基金份额净值计算公式为计算日各类基金资产净值除以计算日该类发售在外的基金份额总数。基金份额净值的计算保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入。如遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。



## 八、申购和赎回的注册与过户登记

1、基金投资者提出的申购和赎回申请，在基金管理人规定的时间之前可以撤销。

2、投资者 T 日申购基金成功后，基金份额登记机构在 T+1 日为投资者增加权益并办理注册登记手续，投资者自 T+2 日起有权赎回该部分基金份额。

3、投资者 T 日赎回基金成功后，基金份额登记机构在 T+1 日为投资者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，并最迟于开始实施前按规定在指定媒介上公告。

## 九、巨额赎回的情形及处理方式

### 1、巨额赎回的认定

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%。

### 2、巨额赎回的处理方式

出现巨额赎回时，基金管理人可以根据本基金当时的资产组合状况决定接受全额赎回或部分延期赎回。

（1）接受全额赎回：当基金管理人认为有能力兑付投资者的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

（2）部分延期赎回：当基金管理人认为兑付投资者的赎回申请有困难，或认为兑付投资者的赎回申请进行的资产变现可能使基金资产净值发生较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一日基金总份额 10%的前提下，对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个基金份额持有人申请赎回份额占当日申请赎回总份额的比例，确定该基金份额持有人当日受理的赎回份额；未受理部分除投资者在提交赎回申请时选择将当日未获受理部分予以撤销者外，延迟至下一开放日办理，赎回价格为下一个开放日该类基金份额的价格。转入下一开放日的赎回申请不享有赎回优先权，以此类推，直到全部赎回为止。

（3）在出现巨额赎回且单个基金份额持有人当日的赎回申请超过上一开放日基金总份额 20%以上的情形时，对于该基金份额持有人当日申请赎回的超过上一开

放日基金总份额 20%以上的基金份额，基金管理人有权全部自动进行延期办理；对于该基金份额持有人未超过上述比例的部分，基金管理人可以根据前段“（1）接受全额赎回”或“（2）部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。但是，如该基金份额持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理部分的赎回申请将被撤销。

（4）当发生巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或招募说明书规定的其他方式，在 3 个工作日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，并按规定在指定媒介上予以公告。

（5）暂停接受和延缓支付：本基金连续 2 个开放日以上发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但延缓期限不得超过 20 个工作日，并应当在中国证监会指定媒介上公告。

## 十、拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理

1、在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资者的申购申请：

（1）因不可抗力导致基金管理人无法受理投资者的申购申请；

（2）证券交易场所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；

（3）发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况；

（4）基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人的利益的情形；

（5）基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过 50%，或者变相规避 50%集中度的情形时；

（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，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施；

（7）法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

基金管理人决定拒绝或暂停接受某些投资者的申购申请时，申购款项将退回投资者账户。基金管理人决定暂停接受申购申请时，应当依法公告。在暂停申购的情形消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理并依法公告。

2、在以下情况下，基金管理人可以暂停接受投资者的赎回申请：

（1）因不可抗力导致基金管理人无法支付赎回款项；

（2）证券交易场所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；

（3）基金连续发生巨额赎回，根据本基金合同规定，可以暂停接受赎回申请的情况；

（4）发生本基金合同规定的暂停基金资产估值的情况；

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

（6）法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一的，基金管理人应当及时公告。已接受的赎回申请，基金管理人应当足额支付；如暂时不能足额支付，应当按单个赎回申请人已被接受的赎回申请量占已接受的赎回申请总量的比例分配给赎回申请人，其余部分在后续开放日予以支付。

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依法公告。

3、暂停基金的申购、赎回，基金管理人应按规定公告。

4、暂停申购或赎回期间结束，基金重新开放时，基金管理人应依法公告。

（1）如果发生暂停的时间为一天，基金管理人将于重新开放日，在指定媒介刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并公告最近一个开放日的各类基金份额的基金份额净值。

（2）如果发生暂停的时间超过一天但少于两周，暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人将按规定在指定媒介刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近一个开放日的各类基金份额的基金份额净值。

（3）如果发生暂停的时间超过两周，暂停期间，基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次；当连续暂停时间超过两个月时，可对重复刊登暂停公告的频率进行调整。暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应按规定在指定媒介刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告

最近一个开放日的各类基金份额的基金份额净值。

## 十一、基金转换

为方便基金份额持有人，本公司已在部分销售机构开通本基金和旗下各只基金的基金转换业务。基金转换的数额限制、转换费率等具体规定以基金管理人对外发布的公告为准。

## 十二、定期定额投资计划

为方便投资者或基金份额持有人，本基金已在部分销售机构开通定期定额投资业务，具体内容详见基金管理人和其他其他销售机构有关基金定期定额投资的公告。未来在各项技术条件和准备完备的情况下，将在其它销售渠道酌情增加本基金的定期定额投资业务。

## 十三、基金的非交易过户、转托管、冻结与质押

1、基金份额登记机构只受理继承、捐赠、司法强制执行和经份额登记机构认可的其他情况下的非交易过户。其中：

“继承”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”仅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的情形；

“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、社会团体或其他组织。

办理非交易过户业务必须提供基金份额登记机构规定的相关资料。

2、符合条件的非交易过户申请办理时，申请人按基金份额登记机构规定的标准缴纳过户费用。

3、基金份额持有人可以办理其基金份额在不同销售机构的转托管手续。

4、基金份额登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金账户或基金份额的冻结与解冻。基金账户或基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益（包括现金分红和红利再投资）一并冻结。

5、如相关法律法规允许基金管理人办理基金份额的质押业务或其他基金业务，基金管理人将制定和实施相应的业务规则。

#### 十四、实施侧袋机制期间本基金的申购与赎回

本基金实施侧袋机制的，本基金的申购和赎回安排详见本招募说明书“侧袋机制”章节的规定或基金管理人届时发布的相关公告。

## 第八部分 基金的投资

### 一、投资目标

本基金的投资目标是：坚持长期投资理念，以全球视野考察中国经济、行业以及个股的成长前景，通过“核心-卫星”投资策略，把握中国经济崛起过程中的投资机遇，在控制投资风险的前提下，追求资本的长期稳定增值。

### 二、投资范围

本基金投资范围限于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行或上市 的股票（包括存托凭证）、债券及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他 金融工具。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。

本基金股票资产投资比例为基金资产的 60%-95%，债券、现金等类型资产及权 证、资产支持证券的投资比例为基金资产的 5%-40%，其中，现金（不包括结算备 付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年以内的政府债券投资比例不 低于基金资产净值的 5%，权证投资比例不高于基金资产净值的 3%，资产支持证券 投资比例不高于基金资产净值的 20%。

### 三、投资理念

本基金的投资理念：坚持价值投资理念，寻找具有长期竞争优势、公司治理 优良、估值合理的上市公司，把握中国经济崛起过程中出现的产业升级等造就具 有国际竞争力的世界级企业的投资机会。

### 四、投资策略

#### 1、资产配置

根据对宏观经济运行周期的研判，确定股票、债券、现金等资产的配置比例， 并根据不同资产类别的收益情况进行动态调整。

#### 2、股票投资策略

本基金采用“核心-卫星”投资策略，分别构建“核心”与“动力”两个投资 组合进行股票投资。其中核心组合的投资比例 X 控制在股票资产的 70%以上。

（1）核心组合选择以沪深 300 指数的成分股和备选成份股为投资对象，根据

中证指数有限公司发布的沪深 300 行业分类标准，结合定量与定性选股的方法，在十大类行业中选择行业地位突出、竞争优势明显并稳步增长的上市公司构建投资组合，以期获得超过沪深 300 指数的收益。

“核心组合”的定量选股方法，主要是根据增长性指标、盈利质量指标、估值水平指标等三方面因素，根据中证沪深 300 行业分类方法对十大类行业分别进行筛选，然后合并建立初选库。

①增长性指标：最近一年或一个季度的主营业务收入同比增长率、近三年平均主营业务收入增长率、近三年平均息税折旧前利润（EBITDA）增长率、市盈增长比率（PEG）；

②盈利质量指标：近三年平均净资产收益率（ROE）、近三年平均投资资本回报率（ROIC）；

③估值指标：市盈率（P/E）、市销率（P/S）、市净率（P/B）。

在备选股票池基础上，本基金将根据以下几个方面，对公司基本面进行深入研究，选择具备长期竞争优势、稳定增长的个股，纳入核心股票组合：

①公司在行业内的地位：如公司是否属于行业龙头；是否具有较高的市场占有率；是否具有产品的定价权或者能够影响主要产品的市场价格等；

②公司的竞争优势：是否具有与行业竞争结构相适应的、清晰的竞争战略；是否拥有成本优势、规模优势、品牌优势或其它特定优势；是否在特定领域具有原材料、专有技术或其它专有资源；有较强技术创新能力；

③公司的盈利质量：如公司未来盈利的可持续性和可预测性如何；公司的盈利模式和扩张方式等；

④公司的经营管理能力：管理层对企业未来发展是否有着明确的方向和清晰的思路；是否建立了制度化的管理机制；管理层对公司的控制力如何；

⑤公司的分红机制：是否具有持续稳定高分红记录或具备持续稳定分红潜力。

（2）动力组合主要选择沪深 300 指数成分股和备选成分股以外、具备核心优势和高成长性的中小企业作为投资对象，并根据价值和主题两个方面进行投资。

本基金价值投资的选股标准主要包括以下几个方面：

①企业长期的竞争优势：选择在激烈的市场竞争中，能够通过成本或差异化等战略获得优于竞争对手的竞争优势，并获得超越竞争对手的市场份额或者高于行业平均水平的回报率的上市公司；

②公司的治理结构：如董事会中独立董事的比例、股权结构是否过于集中等；

③估值水平：对稳定增长的公司，以历史平均市盈率作为参考标准；对高速增长的公司以公司未来有望可达到的股价贴现值作为参考标准。

本基金主题投资主要以国际竞争力为投资标准，通过自上而下的方法，以全球视野，从资本密集、劳动密集、技术成熟等三个方面出发，结合中国现阶段的产业环境、产业政策，考核产业的国际竞争力和未来的发展潜力。在具备国际竞争力的产业中，本基金将通过案头分析、公司实地调研等方式，挖掘出面向全球市场、有望成长为世界级企业的上市公司。通过长期持有，分享上市公司实现的盈利及增长，获得超过市场平均水平的收益。

### （3）存托凭证投资策略

本基金在深入研究的基础上，综合考虑预期收益、风险、流动性等因素，进行存托凭证的投资。

## 3、债券投资策略

在目前中国债券市场处于制度与规则快速调整的阶段，本基金将采用久期控制、期限结构配置、市场转换、相对价值判断和信用风险评估等管理手段，进行主动性投资。在有效控制整体资产风险的基础上，根据对宏观经济发展状况、金融市场运行特点等因素的分析，确定组合整体框架；对债券市场、收益率曲线以及各种债券品种价格的变化进行预测，相机而动、积极调整。

## 4、权证投资策略

本基金将通过对权证标的股票基本面的研究，结合权证定价模型寻求其合理估值水平，综合运用杠杆交易策略、看跌保护组合策略、保护组合成本策略、获利保护策略等策略，以达到获取权证投资收益、改善组合风险收益特征的目的。

## 五、投资管理流程

研究、决策、组合构建、交易、风险监控、评估和组合调整的有机配合共同构成了本基金的投资管理流程。严格的投资管理流程可以保证投资理念的正确执行，避免重大风险的发生。

### （一）研究

本基金的投资研究主要依托于公司整体的研究平台，采用自上而下和自下而上相结合的方式。通过对全球宏观经济形势、中国经济发展趋势、货币政策和财



政政策执行情况进行分析，深入研究行业景气状况、市场合理估值水平，预测利率变化趋势；深入研究其合理的投资价值；据此提出大类资产配置、行业配置、个股配置的投资建议。

## （二）资产配置决策

投资决策委员会依据上述研究报告，对基金的投资方向、资产配置比例等提出指导性意见。

基金经理基于研究员的投资建议，根据自己对未来一段时期内证券市场走势的基本判断，对基金资产的投资，制定月度资产配置和行业配置计划，并报投资决策委员会审批，审批通过，方可按计划执行。

## （三）组合构建

大类资产配置比例范围确定后，基金经理参考研究员的个股投资建议，结合自身的研究判断，决定具体的投资品种并决定买卖时机，其中重大单项投资决定需经投资总监或投资决策委员会审批。

## （四）交易执行

中央交易室负责具体的交易执行，依据基金经理的指令，制定交易策略，统一执行证券投资组合计划，进行具体品种的交易。

## （五）风险监控

本基金管理人各相关业务部门对投资组合计划的执行过程进行监控，定期向风险控制委员会汇报。风险控制委员会根据风险监控情况，责令投资不规范的基金经理进行检讨，并及时调整。

## （六）风险绩效评估

风险管理部定期对基金的投资进行风险绩效评估，并提供相关报告，使投资决策委员会和基金经理能够更加清楚组合承担的风险水平以及是否符合既定的投资策略，并了解组合是否实现了投资预期、组合收益的来源及投资策略成功与否。基金经理可以据以检讨投资策略，进而调整投资组合。

## （七）组合调整

基金经理将依据宏观经济状况、证券市场和上市公司的发展变化，以及组合风险与绩效的评估结果，对投资组合进行动态调整，使之不断得到优化。

基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下，有权根据环境变化和实际需要对上述投资管理流程进行调整。

## 六、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%。

鉴于本基金占权益类投资比重 70%以上的核心组合，选择沪深 300 指数成分股和备选股为投资对象，因此我们认为沪深 300 指数与本基金实际投资风格比较相似，比较适合作为本基金股票类资产的业绩比较标准；同时考虑中证全债指数是中证指数公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数，由银行间市场和沪深交易所市场的国债、金融债券及企业债券组成，两者均具有良好的市场代表性，因此本基金债券组合的业绩比较基准采用中证全债指数。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时，本基金可以在与托管人协商一致、报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

## 七、风险收益特征

本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等风险水平的投资品种。

## 八、投资禁止行为与限制

### 1、禁止用本基金资产从事以下行为

- (1) 承销证券；
- (2) 向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
- (5) 向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- (6) 买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；
- (7) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

（8）依照法律、行政法规有关法律法规规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

## 2、基金投资组合比例限制

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

- （1）本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%；
- （2）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；
- （3）本基金管理人管理的全部基金持有一家上市公司发行的证券，不超过该证券的 10%；
- （4）本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；
- （5）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%；
- （6）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%；
- （7）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%；
- （8）进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；
- （9）本基金股票资产投资比例为基金资产的 60%—95%，债券、现金等类型资产及权证、资产支持证券的投资比例为基金资产的 5%—40%，其中，现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%，权证投资比例不高于基金资产净值的 3%，资产支持证券投资比例不高于基金资产净值的 20%。
- （10）本基金投资于资产支持证券，应投资于信用级别评级为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券；
- （11）本基金财产参与股票发行申购，基金所申报的金额不超过基金的总资产，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；
- （12）本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；

（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%；

（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、基金规模变动等本基金管理人之外的因素致使本基金不符合前述比例限制的，本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；

（17）法律法规及中国证监会规定的其他限制。

除第（9）中“现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%”及第（10）、（14）、（15）项外，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等本基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整。

如果法律法规对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

## 九、投资组合比例调整

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约定。除基金投资组合比例限制的（9）中“现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%”及第（10）、（14）、（15）项外，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等本基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的，基金管理人应当在十个交易日内进行调整。法律法规另有规定时，从其规定。

## 十、基金的融资、融券

本基金可以按照国家的有关规定进行融资、融券。

## 十一、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。

## 十二、基金的投资组合报告

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

本投资组合报告所载数据截至2024年3月31日（财务数据未经审计）。

### 1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	148,015,769.45	92.94
	其中：股票	148,015,769.45	92.94
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	8,665,342.47	5.44
	其中：债券	8,665,342.47	5.44
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,447,454.32	1.54
8	其他资产	134,200.44	0.08
9	合计	159,262,766.68	100.00

### 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

(1) 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	10,746,366.00	6.78
C	制造业	99,174,893.75	62.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,021,215.00	1.27
E	建筑业	7,658,849.00	4.83
F	批发和零售业	14,092.52	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	438,440.00	0.28
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	582,471.91	0.37
J	金融业	26,285,459.04	16.58
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,078,408.00	0.68
M	科学研究和技术服务业	15,574.23	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	148,015,769.45	93.34

(2) 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

3、期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

(1) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明

细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	4,959	8,444,681.10	5.33
2	000651	格力电器	93,200	3,663,692.00	2.31
3	601328	交通银行	553,800	3,511,092.00	2.21
4	601857	中国石油	329,900	3,259,412.00	2.06
5	000568	泸州老窖	17,350	3,202,636.50	2.02
6	601288	农业银行	748,300	3,165,309.00	2.00
7	600887	伊利股份	112,500	3,138,750.00	1.98
8	000338	潍柴动力	178,900	2,985,841.00	1.88

9	600016	民生银行	723,400	2,929,770.00	1.85
10	002415	海康威视	90,100	2,897,616.00	1.83

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	8,665,342.47	5.46
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	8,665,342.47	5.46

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	019703	23 国债 10	85,000	8,665,342.47	5.46
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### （1）报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

##### （2）本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

#### 10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### （1）本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

##### （2）报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

##### （3）本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 11、投资组合报告附注

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

本基金所持有的交通银行(601328.SH)总行、部分分支机构、高管近一年内被国家金融监督管理总局、中国银行保险监督管理委员会及地方监管分局多次处罚，主要违法违规事实涉及信贷违规、销售违规等。

本基金所持有的农业银行(601288.SH)总行、部分分支机构、高管近一年内被国家金融监督管理总局、中国银行保险监督管理委员会及地方监管分局多次处罚，主要违法违规事实涉及信贷违规、销售违规等。

本基金所持有的民生银行(600016.SH)总行、部分分支机构、高管近一年内被国家金融监督管理总局、中国银行保险监督管理委员会及地方监管分局多次处罚，主要违法违规事实涉及信贷违规、销售违规等。

以上事项不会对各公司本年度经营业绩产生重大负面影响。

本基金决策依据及投资程序：

①研究员对宏观经济、证券市场、行业和公司的发展变化进行深入而有效的研究，形成有关的各类报告或者量化投资策略，为本基金的投资管理提供决策依据。



②投资决策委员会定期召开会议，讨论本报告期内本基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定范围形成本基金的资产配置比例指导意见。

③基金经理根据投资决策委员会的决议，参考上述报告，并结合自身的分析判断，形成基金投资计划，主要包括行业配置和投资组合管理。

④交易部依据基金经理的指令，制定交易策略，统一进行具体品种的交易；基金经理必须遵守投资组合决定权和交易下单权严格分离的规定。

⑤投资决策委员会根据市场变化对投资组合计划提出市场风险防范措施，监察稽核部、合规法务部、风险管理部对投资组合计划的执行过程进行日常监督和量化风险控制。

本基金投资上述公司主要基于以下原因：该基金基于基本面进行选股，选择盈利增速较高、基本面向好、估值较低等符合选股标准的股票进行分散投资。

除上述情况外，本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未发现存在被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

（2）基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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

（3）其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	133,449.65
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	750.79
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	134,200.44

（4）报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

（5）报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## 第九部分 基金的业绩

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

### 一、基金净值表现

历史各时间段基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

东方核心动力混合 A

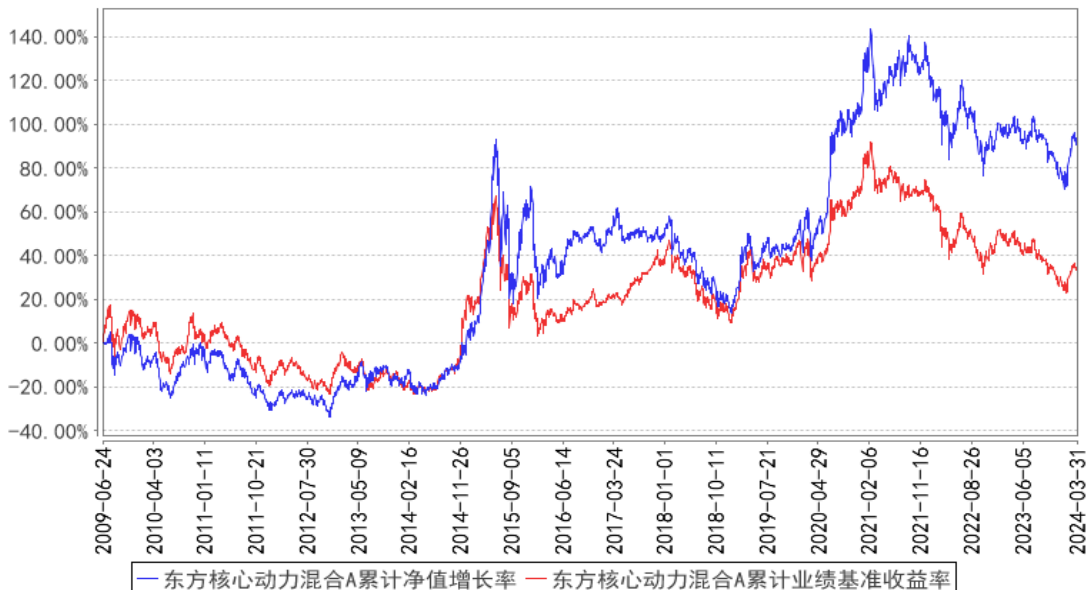
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2009.06.24-2009.12.31	2.83%	1.56%	13.03%	1.68%	-10.20%	-0.12%
2010.01.01-2010.12.31	-6.35%	1.34%	-9.15%	1.27%	2.80%	0.07%
2011.01.01-2011.12.31	-24.39%	1.13%	-19.39%	1.04%	-5.00%	0.09%
2012.01.01-2012.12.31	6.83%	1.11%	7.08%	1.02%	-0.25%	0.09%
2013.01.01-2013.12.31	7.68%	1.34%	-6.02%	1.12%	13.70%	0.22%
2014.01.01-2014.12.31	20.14%	1.15%	42.85%	0.97%	-22.71%	0.18%
2015.01.01-2015.12.31	62.35%	2.46%	7.52%	1.99%	54.83%	0.47%
2016.01.01-2016.12.31	-10.99%	1.50%	-8.42%	1.12%	-2.57%	0.38%
2017.01.01-2017.12.31	2.95%	0.71%	17.08%	0.51%	-14.13%	0.20%
2018.01.01-2018.12.31	-22.42%	1.11%	-19.17%	1.07%	-3.25%	0.04%
2019.01.01-2019.12.31	28.72%	1.13%	29.59%	0.99%	-0.87%	0.14%
2020.01.01-2020.12.31	44.11%	1.33%	22.48%	1.14%	21.63%	0.19%
2021.01.01-2021.12.31	6.08%	1.19%	-2.86%	0.94%	8.94%	0.25%
2022.01.01-2022.12.31	-17.06%	1.20%	-16.88%	1.02%	-0.18%	0.18%
2023.01.01-2023.12.31	-5.05%	0.70%	-8.15%	0.68%	3.10%	0.02%
2024.01.01-2024.03.31	7.78%	0.96%	3.00%	0.82%	4.78%	0.14%

东方核心动力混合 C

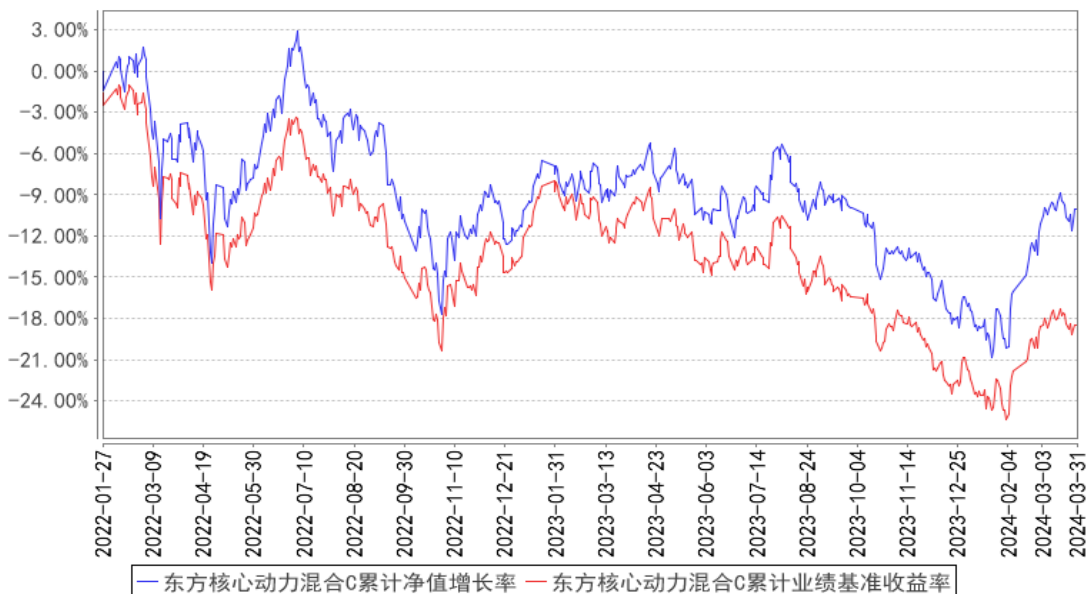
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2022.01.27-2022.12.31	-11.62%	1.21%	-13.85%	1.04%	2.23%	0.17%
2023.01.01-2023.12.31	-5.43%	0.70%	-8.15%	0.68%	2.72%	0.02%
2024.01.01-2024.03.31	7.68%	0.96%	3.00%	0.82%	4.68%	0.14%

## 二、本基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

东方核心动力混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



东方核心动力混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



## 第十部分基金的财产

### 一、基金资产总值

本基金的基金资产总值包括基金所持有的各类有价证券、银行存款本息、基金的应收款项和其他投资所形成的价值总和。

### 二、基金资产净值

本基金的基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

### 三、基金财产的账户

本基金根据相关法律法规、规范性文件开立基金资金账户以及证券账户，与基金管理人和基金托管人自有的财产账户以及其他基金财产账户独立。

### 四、基金财产的保管及处分

1、本基金财产独立于基金管理人及基金托管人的固有财产，并由基金托管人保管。

2、基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益，归基金财产。

3、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范围。

4、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。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

## 第十一部分 基金资产的估值

### 一、估值目的

基金估值的目的是为了准确、真实地反映基金相关金融资产和金融负债的公允价值。开放式基金份额申购、赎回价格应按基金估值后确定的基金份额净值计算。

### 二、估值日

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

### 三、估值对象

基金所持有的金融资产和金融负债。

### 四、估值方法

#### 1、股票估值方法

##### （1）上市流通股票的估值

上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，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）未上市股票的估值

送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在交易所挂牌的同一股票的收盘价估值；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，以最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，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。

首次发行未上市的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量的情况下，按成本估值。

##### （3）有明确锁定期股票的估值

首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上

市的同一股票的收盘价估值；非公开发行且处于明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会的有关规定确定公允价值。

（4）非公开发行有明确锁定期股票按以下方法估值：

如果估值日非公开发行有明确锁定期的股票的初始取得成本高于在证券交易所上市交易的同一股票的市价，应采用在证券交易所上市交易的同一股票的收盘价作为估值日该股票的估值价。如果估值日非公开发行有明确锁定期的股票的初始取得成本低于在证券交易所上市交易的同一股票的收盘价，应按以下公式确定该股票的价值：

$$FV=C+(P-C)\times(D1-Dr)/D1$$

其中：

FV 为估值日该非公开发行有明确锁定期的股票的价值；

C 为该非公开发行有明确锁定期的股票的初始取得成本（因权益业务导致市场价格除权时，应于除权日对其初始取得成本作相应调整）；

P 为估值日在证券交易所上市交易的同一股票的收盘价；

D1 为该非公开发行有明确锁定期的股票锁定期所含的交易所的交易天数；

Dr 为估值日剩余锁定期，即估值日至锁定期结束所含的交易所的交易天数（不含估值日当天）。

## 2、固定收益证券的估值办法

（1）证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘净价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

（2）证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息（自债券计息起始日或上一起息日至估值当日的利息）得到的净价进行估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按有交易的最近交易日所采用的净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

（3）未上市债券采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量的情况下，按成本估值。

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

（5）交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量。

（6）同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

### 3、权证估值：

#### （1）配股权证的估值：

因持有股票而享有的配股权，类同权证处理方式的，采用估值技术进行估值。

#### （2）认沽/认购权证的估值：

从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的认沽/认购权证按估值日的收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，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；未上市交易的认沽/认购权证采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量的情况下，按成本估值；因持有股票而享有的配股权、停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值。

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

5、本基金持有的银行存款和备付金余额以本金列示，按相应利率逐日计提利息。

6、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。

7、在任何情况下，基金管理人采用上述 1-6 项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人有着充足的理由认为按上述方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素的基础上与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

8、国家有最新规定的，按国家最新规定进行估值。

## 五、估值程序

基金日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行。各类基金份额的基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以书面形式报给基金托管人，基金托管人按《基金合同》规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

## 六、暂停估值的情形

- 1、基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；
- 3、当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上的，基金管理人经与基金托管人协商一致的；
- 4、中国证监会认定的其它情形。

## 七、基金份额净值的确认

用于基金信息披露的基金净值信息由基金管理人负责计算，基金托管人进行复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的各类基金份额的基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对外公布。

各类基金份额的基金份额净值的计算精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

## 八、估值错误的处理

- 1、当基金份额净值（含各类基金份额的基金份额净值，下同）小数点后 4 位以内（含第 4 位）发生差错时，视为基金份额净值错误。
- 2、基金管理人和基金托管人将采取必要、适当合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当计价错误达到或超过该类基金份额净值的 0.25%时，基金管理人应当报中国证监会备案；当计价错误达到或超过该类基



金份额净值的0.5%时，基金管理人应当公告，并同时报中国证监会备案。

3、前述内容如法律法规或监管机构另有规定的，按其规定处理。

## 九、特殊情形的处理

1、基金管理人按本条第四款有关估值方法规定的第7项条款进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

2、由于不可抗力原因，或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，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可以免除赔偿责任。但基金管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

## 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净值信息。

## 第十二部分 基金的收益与分配

### 一、收益的构成

- 1、基金收益包括：基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券差价、银行存款利息、证券持有期间产生的公允价值变动以及其他收入。
- 2、因运用基金财产带来的成本或费用的节约应计入收益。
- 3、期末可供分配利润指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

### 二、收益分配原则

- 1、基金收益分配采用现金方式，基金份额持有人可选择将现金红利按除息日的基金份额净值自动转为相应类别的基金份额进行再投资；
- 2、由于本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同；同一类别每一基金份额享有同等分配权；
- 3、在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年最多12次，每次收益分配最少不得低于期末可供分配利润的50%；
- 4、基金进行收益分配时，基金红利发放日距离收益分配基准日（即期末可供分配利润计算截至日）不得超过15个工作日；
- 5、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

### 三、收益分配方案

基金收益分配方案中载明基金期末可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式及有关手续费等内容。

### 四、收益分配方案的确定与公告

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后确定，基金管理人按法律法规的规定公告。

### 五、收益分配中发生的费用

- 1、基金份额持有人选择将现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份

额进行再投资时免收再投资的费用。

2、收益分配时发生的银行转账等手续费用由基金份额持有人自行承担；如果基金份额持有人所获现金红利不足支付前述银行转账等手续费用，份额登记机构可将该基金份额持有人的现金红利按除息日转为相应类别的基金份额。

## 六、实施侧袋机制期间的收益分配

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

## 第十三部分 基金的费用与税收

### 一、基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、C类基金份额的销售服务费；
- 4、因基金的证券交易或结算而产生的费用；
- 5、基金合同生效以后的信息披露费用（法律法规、中国证监会另有规定的除外）；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金合同生效以后的会计师费和律师费；
- 8、基金资产的资金汇划费用；
- 9、按照国家有关法律法规规定可以列入的其他费用。

### 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

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的1.20%年费率计提。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的1.20%年费率计提。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 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。

#### 2、基金托管人的基金托管费

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的0.20%年费率计提。

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

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

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。

### 3、销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费；

本基金 C 类基金份额的销售服务费每日按前一日 C 类基金份额基金资产净值的 0.40% 的年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

本基金 C 类基金份额的销售服务费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。基金管理人应于次月首日起 5 个工作日内向基金托管人发送销售服务费划款指令，基金托管人应在次月首日起 10 个工作日内完成复核，并从基金财产中一次性划出，由登记机构代收，登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构。

本条第一款第 4-9 项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，按费用发生的金额支付，列入或摊入当期基金费用。

### 三、不列入基金费用的项目

本条第一款约定以外的其他费用，以及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等不列入基金费用。

### 四、基金管理费、基金托管费和销售服务费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费、和基金托管费和销售服务费，无须召开基金份额持有人大会。

### 五、实施侧袋机制期间的基金费用

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

### 六、税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义

务。

## 第十四部分 基金的会计与审计

### 一、基金会计政策

1、基金的会计年度为公历每年1月1日至12月31日，如果基金在首次募集的会计年度，基金合同生效时间不足2个月，可以并入下一个会计年度。

2、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位。

3、会计核算制度按国家有关的会计核算制度执行。

4、本基金独立建账、独立核算。

5、本基金会计责任人为基金管理人。

6、基金管理人应保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关法律法规规定编制基金会计报表，基金托管人定期与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

### 二、基金审计

1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相独立的、具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师等对基金年度财务报表及其他规定事项进行审计；

2、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须经基金托管人同意，并应在更换会计师事务所后2日内公告；

3、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。

## 第十五部分 基金的信息披露

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指定媒介披露，并保证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。

### 一、基金招募说明书、基金产品资料概要、基金合同、基金托管协议

基金募集申请经中国证监会核准后，基金管理人应当在基金份额发售的3日前，将招募说明书、基金合同摘要登载在指定报刊和网站上；基金管理人、基金托管人应当将基金合同、基金托管协议登载在各自公司网站上。

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，并登载在指定网站上，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。

### 二、基金份额发售公告

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

### 三、基金合同生效公告

基金管理人应当在基金合同生效的次日在指定媒体和网站上登载基金合同生效公告。

### 四、基金净值信息公告

基金合同生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和各类基金份额的基金份额净值。

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



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

## 五、定期报告

基金定期报告由基金管理人按照法律法规和中国证监会颁布的有关证券投资基金信息披露内容与格式的相关文件的规定单独编制，由基金托管人按照法律法规的规定对相关内容进行复核。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。

1、基金年度报告：基金管理人应当在每年结束之日起3个月内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载在指定网站上，并将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计。

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

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

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

法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定。

5、本基金持续运作过程中，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。

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

## 六、临时报告与公告

基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在两日内编制临时报告书，并登载在指定报刊和指定网站上。

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

- 1、基金份额持有人大会的召开；
- 2、基金合同终止、基金清算；
- 3、转换基金运作方式、基金合并；
- 4、更换基金管理人、基金托管人；
- 5、基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；
- 6、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- 7、基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、变更基金管理人的实际控制人；
- 8、基金募集期延长；
- 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 50%；
- 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 30%；
- 12、涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼或仲裁；
- 13、基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；
- 14、基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易事项，中国证监会另有规定的情形除外；
- 15、基金收益分配事项；
- 16、管理费、托管费、销售服务费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提

方式和费率发生变更；

- 17、基金份额净值计价错误达基金份额净值 0.5%；
- 18、基金改聘会计师事务所；
- 19、基金更换基金注册登记机构；
- 20、基金开始办理申购、赎回；
- 21、基金发生巨额赎回并延期办理；
- 22、基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；
- 23、基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；
- 24、基金份额上市交易；
- 25、基金份额持有人大会的决议；
- 26、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；
- 27、调整基金份额类别的设置；
- 28、基金信息披露义务人认为可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的其他事项或中国证监会规定的其他事项。

## 七、公开澄清

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

## 八、清算报告

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

## 九、实施侧袋机制期间的信息披露

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

## 十、信息披露事务管理

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

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

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

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

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。

## 十一、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公司住所，供社会公众查阅、复制。

## 第十六部分侧袋机制

### 一、侧袋机制的实施条件和实施程序

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

### 二、侧袋机制实施期间的基金运作安排

#### （一）基金份额的申购与赎回

##### 1、侧袋账户

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

##### 2、主袋账户

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

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

#### （二）基金份额的登记

侧袋机制实施期间，基金管理人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。侧袋账户份额的名称应以“基金简称+侧袋标识 S+侧袋账户建立日期”格式设定，同时主袋账户份额的名称增加大写字母 M 标识作为后缀。本基金所有侧袋账户注销后，应取消主袋账户份额名称中的 M 标识。

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

侧袋账户资产完全清算后，基金管理人应注销侧袋账户。

### （三）基金的投资及业绩

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

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

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。

### （四）基金的估值

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

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

### （五）基金的费用

侧袋机制实施期间，侧袋账户资产不收取管理费。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。

本基金实施侧袋机制的，基金管理人可以将与侧袋账户有关的费用从侧袋账户中列支，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，管理费以外的其他费用详见基金管理人届时发布的相关公告。

## （六）基金的收益分配

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

## （七）基金的信息披露

### 1、基金净值信息

侧袋机制实施期间，基金管理人应当暂停披露侧袋账户的基金净值信息。

### 2、定期报告

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

（1）侧袋账户的基金代码、基金名称、侧袋账户成立日期等基本信息；

（2）侧袋账户的初始资产、初始负债；

（3）特定资产的名称、代码、发行人等基本信息；

（4）报告期内的特定资产处置进展情况、与处置特定资产相关的费用情况及其他与特定资产状况相关的信息；

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

（6）可能对投资者利益存在重大影响的其他情况及相关风险提示。

### 3、临时报告

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

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。

#### （八）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。

#### （九）侧袋的审计

基金管理人应当在启用侧袋机制和终止侧袋机制后，及时聘请符合《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，具体如下：

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

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

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

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

三、本部分关于侧袋机制的相关规定，凡是直接引用法律法规或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，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。



## 第十七部分 风险揭示

投资于本基金的主要风险有以下几方面：

### 一、市场风险

证券市场价格因受各种因素的影响而引起的波动，将对本基金资产产生潜在风险，主要因素包括：

1、政策因素，如货币政策、财政政策、产业政策等国家政策的变化对证券市场产生一定的影响，导致市场价格波动，影响基金收益。

2、经济周期因素，经济运行具有周期性的特点，宏观经济运行状况将对证券市场的收益水平产生影响。基金投资于证券市场，其收益水平也会随之变化。

3、利率因素，金融市场利率波动会导致股票市场及债券市场的价格和收益率的变动，同时直接影响企业的融资成本和利润水平。基金投资于股票和债券，其收益水平会受到利率变化的影响。

4、上市公司的经营业绩，上市公司的经营业绩会对其证券价格产生影响，从而使基金投资收益受到影响。

### 二、管理风险

本基金可能因为基金管理人的管理水平、手段和技术等因素，而使基金收益水平受到影响。这种风险可能表现在基金整体的投资组合管理上，例如资产配置、类属配置不能达到预期收益目标；也可能表现在个券、个股的选择不能符合本基金的投资风格和投资目标等。

### 三、流动性风险

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巨额赎回的风险。目前中国股票市场波动性较大，在市场下跌时经常出现交易量急剧减少的情况，如果在此情况下出现较大规模的基金赎回申请，基金资产则可能变现困难，基金面临流动性风险。

### 四、启用侧袋机制的风险

当本基金启用侧袋机制时，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。

## 五、特定风险

本基金为混合型基金，与其他同类基金类似，面临上述风险。此外，由于本基金采用“核心-卫星”投资策略，分别构建“核心”与“动力”两个投资组合进行股票投资，使得本基金面临特定的风险。

本基金核心组合选择以沪深300指数的成分股和备选成份股为投资对象，且核心组合的投资比例控制在股票资产的70%以上，当沪深300指数成份股和备选股以外其他股票大幅上涨时，本基金核心组合表现可能落后于市场的综合指数表现，本基金整体的投资收益率将有可能低于市场的综合指数表现。

本基金的核心组合与卫星组合均采用主动选股、积极投资的方式，这增加了投资组合的风险度。在基金投资组合的风险度高于指数的情况下，其投资收益率可能高于指数收益率，但也有可能低于指数收益率，其中存在一定的不确定性。

本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他可投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与中国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；存托协议自动约束存托凭证持有人的风险；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；存托凭证退市的风险；因地上市造成存托凭证价格差异以及受境外市场影响交易价格大幅波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；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等。

## 六、其他风险

1、信用风险：指基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资债券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失，影响基金收益水平，从而带来风险。

2、操作或技术风险：指相关当事人在业务各环节操作过程中，因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险。

3、法律风险：指基金管理或运作过程中，违反国家法律、法规，或者基金投资违反法规及基金合同有关规定的风险。

4、战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致基金资产的损失，影响基金收益水平，从而带来风险。

5、根据交易所就资金前端额度控制的相关要求，基金管理人（交易参与者）按照前一交易日日终的相关产品的合计资产总额作为每个交易日申报的最高额度，并与基金托管人（结算参与者）明确约定额度申报事项。由于交易所就资金前端额度控制的规定，从而可能存在影响本基金财产收益的风险。

6、其他意外导致的风险。

## 七、声明

本基金由基金管理人依照《基金法》、本基金合同和其他有关法律法规规定募集，并经中国证监会核准。中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

本基金投资于证券市场，基金份额净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的招募说明书、基金产品资料概要和基金合同，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性及自身的风险承受能力，并对认购（或申购）本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资者基金投资要承担相应风险，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化导致的投资风险，由投资者自行承担。

基金管理人建议投资者根据自身的风险收益偏好，选择适合自己的基金产品，并且中长期持有。

本基金未经任何一级政府、机构及部门担保。基金投资者自愿投资于本基金，

须自行承担投资风险。

除基金管理人直接办理本基金的销售外，本基金还通过基金其他销售机构销售，但是，基金资产并不是其他销售机构的存款或负债，也没有经基金其他销售机构担保收益，其他销售机构并不能保证其收益或本金安全。

## 第十八部分 基金的终止与清算

### 一、基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止；
- 2、因重大违法、违规行为，被中国证监会责令终止的；
- 3、基金管理人、基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金管理人、基金托管人承接的；
- 4、法律法规和基金合同规定的其他情形。

基金合同终止后，基金管理人和基金托管人有权依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关法律法规的规定，行使请求给付报酬、从基金财产中获得补偿的权利。

### 二、基金财产的清算

1、基金合同终止，基金管理人应当按法律法规和本基金合同的有关规定组织清算组对基金财产进行清算。

#### 2、基金财产清算组

（1）自基金合同终止事由之日起30个工作日内由基金管理人组织成立基金财产清算组，在基金财产清算组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

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

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

#### 3、清算程序

- （1）基金合同终止情形发生后，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- （2）基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；
- （3）基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；
- （4）对基金财产进行评估和变现；

(5) 制作清算报告；

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

(7) 将清算报告报中国证监会备案并公告；

(8) 对基金财产进行分配。

#### 4、清算费用

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

#### 5、基金剩余财产的分配

基金财产按下列顺序清偿：

(1) 支付清算费用；

(2) 交纳所欠税款；

(3) 清偿基金债务；

(4) 按各类基金份额持有人持有的该类基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款（1）、（2）、（3）项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

对于基金缴存于中国证券登记结算有限责任公司的最低结算备付金和交易席位保证金等，在中国证券登记结算有限责任公司对其进行调整后方可收回。

#### 6、基金财产清算的公告

基金财产清算组做出的清算报告经具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并公告。

7、基金财产清算账册及文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 第十九部分 基金合同的内容摘要

### 一、基金合同当事人权利及义务

#### （一）基金管理人的权利与义务

##### 1、基金管理人的权利

- （1）依法募集基金，办理基金备案手续；
- （2）依照法律法规和基金合同独立管理运用基金财产；
- （3）根据法律法规和基金合同的规定，制订、修改并公布有关基金认购、申购、赎回、转托管、基金转换、非交易过户、冻结、收益分配等方面的业务规则；
- （4）根据法律法规和基金合同的规定决定本基金的相关费率结构和收费方式，获得基金管理费，收取认购费、申购费、赎回费及其他事先核准或公告的合理费用以及法律法规规定的其他费用；
- （5）根据法律法规和基金合同的规定销售基金份额；
- （6）在本合同的有效期限内，在不违反公平、合理原则以及不妨碍基金托管人遵守相关法律法规及其行业监管要求的基础上，基金管理人有权对基金托管人履行本合同的情况进行必要的监督。如认为基金托管人违反了法律法规或基金合同规定对基金财产、其他基金合同当事人的利益造成重大损失的，应及时呈报中国证监会和中国银监会，以及采取其他必要措施以保护本基金及相关基金合同当事人的利益；
- （7）根据基金合同的规定选择适当的基金其他销售机构并有权依照其他销售协议和有关法律法规对基金其他销售机构行为进行必要的监督和检查；
- （8）自行承担基金份额登记机构或选择、更换基金注册登记代理机构，办理基金份额登记业务，并按照基金合同规定对基金注册登记代理机构进行必要的监督和检查；
- （9）在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回的申请；
- （10）在法律法规允许的前提下，为基金份额持有人的利益依法为基金进行融资、融券；
- （11）依据法律法规和基金合同的规定，制订基金收益分配方案；
- （12）按照法律法规，代表基金对被投资企业行使股东权利，代表基金行使因投资于其他证券所产生的权利；

- (13) 在基金托管人职责终止时，提名新的基金托管人；
- (14) 依据法律法规和基金合同的规定，召集基金份额持有人大会；
- (15) 选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构并确定有关费率；
- (16) 法律法规、基金合同规定的其他权利。

## 2、基金管理人的义务

- (1) 依法募集基金，办理或者委托经国务院证券监督管理机构认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、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、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；
- (4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；
- (5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和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) 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；
- (7) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；
- (8) 进行基金会计核算并编制基金的财务会计报告；
- (9) 依法接受基金托管人的监督；
- (10) 编制季度报告、中期报告和年度报告；
- (11) 采取适当合理的措施使计算开放式基金份额认购、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；
- (12) 计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回价格；
- (13) 严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
- (14) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、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以保密，不得



向他人泄露；

（15）按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

（16）保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表、代表基金签订的重大合同及其他相关资料；

（17）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；

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

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

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

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

（22）法律法规、基金合同及中国证监会规定的其他义务。

## （二）基金托管人的权利与义务

### 1、基金托管人的权利

（1）依据法律法规和基金合同的规定安全保管基金财产；

（2）依照基金合同的约定获得基金托管费；

（3）监督基金管理人对本基金的投资运作；

（4）在基金管理人职责终止时，提名新的基金管理人；

（5）依据法律法规和基金合同的规定召集基金份额持有人大会；

（6）法律法规、基金合同规定的其他权利。

### 2、基金托管人的义务

（1）安全保管基金财产；

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

（3）按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；

（4）除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得以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) 对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整和独立；  
(6) 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；  
(7) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；  
(8) 按照基金合同的约定，根据基金管理人的指令，及时办理清算、交割事宜；

(9) 保守基金商业秘密。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予以保密，不得向他人泄露；

(10) 根据法律法规及本合同的约定，办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

(11) 对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告的相关内容出具意见，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；

(12) 建立并保存基金份额持有人名册；

(13) 复核审查基金管理人计算的基金资产净值、各类基金份额净值和基金份额申购、赎回价格；

(14) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

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

(16) 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；

(17) 按照法律法规监督基金管理人的投资运作；

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

(19) 基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿；

(20) 法律法规、基金合同及中国证监会规定的其它义务。

(三) 基金份额持有人的权利与义务

1、基金份额持有人的权利

(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；
- (5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- (6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- (7) 监督基金管理人的投资运作；
- (8) 对基金管理人、基金托管人、基金份额销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；
- (9) 法律法规、基金合同规定的其他权利。

## 2、基金份额持有人的义务

- (1) 遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；
- (2) 缴纳基金认购、申购款项及基金合同规定的费用；
- (3) 在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；
- (4) 不从事任何有损基金、其他基金份额持有人及其他基金合同当事人合法利益的活动；
- (5) 执行基金份额持有人大会的决议；
- (6) 返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人及基金管理人的代理人、基金托管人、其他销售机构、其他基金份额持有人处获得的不当得利；
- (7) 遵守基金管理人、销售机构和份额登记机构的相关交易及业务规则；
- (8) 法律法规及基金合同规定的其他义务。

## 二、基金份额持有人大会

基金份额持有人大会由基金份额持有人、合法代理人及授权代表共同组成。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。

### （一）召开事由

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

- (1) 终止基金合同；
- (2) 转换基金运作方式；
- (3) 变更基金类别；
- (4) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略；
- (5) 变更基金份额持有人大会程序和表决方式；
- (6) 更换基金管理人、基金托管人；
- (7) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准或销售服务费率，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准或销售服务费率的除外；
- (8) 本基金与其他基金的合并；
- (9) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响，须召开基金份额持有人大会的变更基金合同等其他事项；
- (10) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

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

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

## （二）召集人和召集方式

1、除法律法规或本基金合同另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集，开会时间、地点、方式和权益登记日由基金管理人选择确定。基金管理人未按规定召集或者不能召集时，由基金托管人召集。

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

并确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

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

4、代表基金份额10%以上的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，代表基金份额10%以上的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会，但应当至少提前30日向中国证监会备案。

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

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

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

2、采用通讯方式开会并进行表决的情况下，由召集人决定通讯方式和书面表决方式，并在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表达意见的寄交和收取方式、投票表决的截止日以及表决票的送达地址等内容。

3、如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。

#### （四）基金份额持有人出席会议的方式

##### 1、会议方式

（1）基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会。

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

（3）通讯方式开会指按照本基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。

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

##### 2、召开基金份额持有人大会的条件

###### （1）现场开会方式

在同时符合以下条件时，现场会议方可举行：

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

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

###### （2）通讯开会方式

在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

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

②召集人在基金托管人（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和统计基金份额持有人的书面表决意见，基金管理人或基金托管人经通知拒不参加收取书面表决意见的，不影响表决效力；

③本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额应占权益登记日基金总份额的50%以上；

④直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的其他代表，同时提交的持有基金份额的凭证符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与登记注册机构记录相符；

⑤会议通知公布前报中国证监会备案。

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

#### （五）议事内容与程序

##### 1、议事内容及提案权

（1）议事内容为本基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容以及召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

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

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

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

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

（4）基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后，如果需要对原有提案进行修改，应当最迟在基金份额持有人大会召开日前 30 日公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有 30 日的间隔期。

## 2、议事程序

### （1）现场开会

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

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

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

### （2）通讯方式开会

在通讯表决开会的方式下，首先由召集人提前 30 天公布提案，在所通知的表决截止日期后第 2 个工作日在公证机构监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。

## 2、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。

### （六）决议形成的条件、表决方式、程序

#### 1、基金份额持有人所持每一基金份额享有平等的表决权。

#### 2、基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

##### （1）一般决议

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



一般决议的方式通过；

## （2）特别决议

特别决议须经出席会议的基金份额持有人及代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方为有效；涉及更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式、终止基金合同等重大事项必须以特别决议通过方为有效。

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

4、基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

## （七）计票

### 1、现场开会

（1）如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，则基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举3名基金份额持有人担任监票人。

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

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

### 2、通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（如果基金托管人为召集人，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。

如基金管理人拒绝按照上述规定对基金份额持有人表决后的计票程序进行监督或配合，则基金托管人应当指派授权代表完成计票程序；如基金托管人拒绝按

照上述规定对基金份额持有人表决后的计票程序进行监督或配合，则基金管理人应当指派授权代表完成计票程序；如基金管理人、基金托管人经通知仍拒绝派代表监督计票的，不影响大会会议决议的效力。

（八）基金份额持有人大会决议报中国证监会核准或备案后的公告时间、方式

1、基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议，召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决议自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效执行。

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

3、基金份额持有人大会决议应自生效之日起2日内在指定媒介公告。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。

（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书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所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。

### 三、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

#### （一）基金合同的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本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。

2、变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案，并自中国证监会核准或出具无异议意见之日起生效。

3、但如因相应的法律法规发生变动并属于本基金合同必须遵照进行修改的情形，或者基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化或对基金份额持有人利益无实质性不利影响的，可不经基金份额持有人大会决议，而经基金管理人和基金托管人同意修改后公布，并报中国证监会备案。

#### （二）基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止；
- 2、因重大违法、违规行为，被中国证监会责令终止的；
- 3、基金管理人、基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金管理人、基金

托管人承接的；

4、法律法规和基金合同规定的其他情形。

基金合同终止后，基金管理人和基金托管人有权依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关法律法规的规定，行使请求给付报酬、从基金财产中获得补偿的权利。

### （三）基金财产的清算

1、基金合同终止，基金管理人应当按法律法规和本基金合同的有关规定组织清算组对基金财产进行清算。

#### 2、基金财产清算组

（1）自基金合同终止事由之日起 30 个工作日内由基金管理人组织成立基金财产清算组，在基金财产清算组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应依照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

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

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

#### 3、清算程序

- （1）基金合同终止情形发生后，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- （2）基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；
- （3）基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；
- （4）对基金财产进行评估和变现；
- （5）制作清算报告；
- （6）聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- （7）将清算报告报中国证监会备案并公告；
- （8）对基金财产进行分配。

#### 4、清算费用

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

## 5、基金剩余财产的分配

基金财产按下列顺序清偿：

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

基金财产未按前款（1）、（2）、（3）项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

对于基金缴存于中国证券登记结算有限责任公司的最低结算备付金和交易席位保证金等，在中国证券登记结算有限责任公司对其进行调整后方可收回。

## 6、基金财产清算的公告

基金财产清算组做出的清算报告经具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并公告。

7、基金财产清算账册及文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 四、争议的处理

（一）本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

（二）本基金合同的当事人之间因本基金合同产生的或与本基金合同有关的争议可通过友好协商解决，但若自一方书面提出协商解决争议之日起 60 日内争议未能以协商方式解决的，则任何一方可将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会，按照其时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。

（三）除争议所涉内容之外，本基金合同的其他部分应当由本基金合同当事人继续履行。

## 五、基金合同存放地和投资者取得合同的方式

本基金合同可印制成册并对外公开散发或存放在基金管理人和基金托管人的营业场所供投资者免费查阅；投资者也可按工本费购买本基金合同印制件或复印件；如涉及争议事项须协商、仲裁或诉讼的，基金合同条款及内容应以基金合同正本为准。

## 第二部分 托管协议内容摘要

### 一、托管协议当事人

#### 1、基金管理人

名称：东方基金管理股份有限公司

住所：北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层

办公地址：北京市丰台区金泽路 161 号院 1 号楼远洋锐中心 26 层

法定代表人：崔伟

成立时间：2004 年 6 月 11 日

批准设立机关：中国证监会

批准设立文号：证监基金字[2004]80 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：叁亿叁仟叁佰叁拾叁万元人民币

营业期限：2004 年 6 月 11 日至长期

经营范围：基金募集；基金销售；资产管理；从事境外证券投资管理业务；  
中国证监会许可的其他业务

#### 2、基金托管人

名称：中国银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：葛海蛟

成立时间：1983 年 10 月 31 日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]24 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整

存续期间：持续经营

经营范围：吸收人民币存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理  
票据贴现；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；  
从事同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保  
险箱服务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇兑换；国际结算；同业外汇拆  
借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；发行和代理发

行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代客外汇买卖；外汇信用卡的发行和代理国外信用卡的发行及付款；资信调查、咨询、见证业务；组织或参加银团贷款；国际贵金属买卖；海外分支机构经营与当地法律许可的一切银行业务；在港澳地区的分行依据当地法令可发行或参与代理发行当地货币；经中国人民银行批准的其他业务。

## 二、基金托管人与基金管理人之间的业务监督与核查

### 1、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

(1) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督。主要包括以下方面：

①对基金的投资范围、投资对象进行监督。基金管理人应将拟投资的股票库（包括存托凭证）、债券库等各投资品种的具体范围提供给基金托管人。基金管理人可以根据实际情况的变化，对各投资品种的具体范围予以更新和调整，并通知基金托管人。基金托管人根据上述投资范围对基金的投资进行监督；

②对基金投融资比例进行监督；

③根据《流动性风险管理规定》，对以下投资进行监督：

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

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

c. 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。本基金管理人承诺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与本基金合同约定的投资范围保持一致，并承担由于不一致所导致的风险或损失。

因证券市场波动、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第 a 项规定投资比例的，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。

④对基金投资禁止行为进行监督。为对基金禁止从事的关联交易进行监督，基金管理人和基金托管人应相互提供与本机构有控股关系的股东或与本机构有其他重大利害关系的公司名单；

⑤对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。基金管理人向基金托管人提供其银行间债券市场交易的交易对手库，交易对手库由银行间交易会员中财务状况较好、实力雄厚、信用等级高的交易对手组成。基金管理人可以根据实际情况的变化，及时对交易对手库予以更新和调整，并通知基金托管人。基金管理人参与银行间债券市场交易的交易对手应符合交易对手库的范围。基金托管人对基金管理人参与银行间债券市场交易的交易对手是否符合交易对手库进行监督；

⑥基金托管人对银行间市场交易的交易方式的控制按如下约定进行监督。

基金管理人在银行间市场交易的交易方式主要包括以下几种：

- a. 银行间现券买卖，买入时实行见券付款、卖出时实行见款付券；
- b. 银行间回购交易，正回购时实行见款押券，逆回购时实行先押券后付款；
- c. 如遇特殊情况无法按照以上方式执行交易，基金经理需报本基金管理人的投资总监批准。

⑦基金如投资银行存款，基金管理人应根据法律法规的规定及基金合同的约定，事先确定符合条件的所有存款银行的名单，并及时提供给基金托管人，基金托管人据以对基金投资银行存款的交易对手是否符合上述名单进行监督；

⑧对法律法规规定及《基金合同》约定的基金投资的其他方面进行监督。

(2) 基金托管人应根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金资产净值计算、各类基金份额的基金份额净值计算、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。

(3) 基金托管人在上述第 (1)、(2) 款的监督和核查中发现基金管理人违反法律法规的规定、《基金合同》及本协议的约定，应及时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改正。在限期内，基金托管人有



权随时对通知事项进行复查。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，基金托管人应及时向中国证监会报告。

（4）基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律法规、《基金合同》及本协议的规定，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律法规和其他有关规定，或者违反《基金合同》、本协议约定的，应当立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。

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

（6）基金托管人对基金管理人监督的权利、义务及职责自合同生效之日起履行。

（7）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。

## 2、基金管理人对于基金托管人的业务核查

（1）在本协议的有效期限内，在不违反公平、合理原则以及不妨碍基金托管人遵守相关法律法规及其行业监管要求的基础上，基金管理人有权对基金托管人履行本协议的情况进行必要的核查，核查事项包括但不限于基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和各类基金份额的基金份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

（2）基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、无正当理由未执行或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法律法规、《基金合同》及本协议有关规定时，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正，基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金管理人发出回函。在限期内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应报告中国证监会。

（3）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、基金财产保管

#### 1、基金财产保管的原则

(1) 基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。

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

(3) 基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户。

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

(5) 除依据《基金法》、《运作办法》、《基金合同》及其他有关法律法规规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

#### 2、基金合同生效前募集资金的验资和入账

(1) 基金募集期满或基金管理人宣布停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定的，由基金管理人在法定期限内聘请具有从事相关业务资格的会计师事务所对基金进行验资，并出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的2名以上（含2名）中国注册会计师签字方为有效。

(2) 基金管理人应将属于本基金财产的全部资金划入在基金托管人处为本基金开立的基金银行账户中，并确保划入的资金与验资确认金额相一致。

#### 3、基金的银行账户的开设和管理

(1) 基金托管人应负责本基金的银行账户的开设和管理。

(2) 基金托管人以本基金的名义开设本基金的银行账户。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。本基金的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益、收取申购款，均需通过本基金的银行账户进行。

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

（4）基金银行账户的管理应符合法律法规的有关规定。

#### 4、基金进行定期存款投资的账户开设和管理

基金托管人根据基金管理人的指令以基金名义在基金托管人认可的存款银行的指定营业网点开立存款账户，并负责该账户的日常管理以及银行预留印鉴的保管和使用。基金管理人应派专人协助办理开户事宜。在上述账户开立和账户相关信息变更过程中，基金管理人应提前向基金托管人提供开户或账户变更所需的相关资料，并对基金托管人给予积极配合和协助。

#### 5、基金证券账户和资金账户的开设和管理

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

（2）本基金证券账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借或转让本基金的证券账户，亦不得使用本基金的证券账户进行本基金业务以外的活动。

（3）基金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，用于办理基金托管人所托管的包括本基金在内的全部基金在证券交易所进行证券投资所涉及的资金结算业务。结算备付金的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

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

#### 6、债券托管专户的开设和管理

基金合同生效后，基金管理人负责以基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表基金进行交易；基金托管人负责以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司开设银行间债券市场债券托管账户，并代表基金进行银行间债券市场债券和资金的清算。在上述手续办理完毕之后，由基金托管人负责向中国人民银行报备。

#### 7、基金财产投资的有关有价凭证的保管

基金财产投资的实物证券、银行定期存款存单等有价凭证由基金托管人负责妥善保管。基金托管人对其以外机构实际有效控制的有价凭证不承担责任。

#### 8、与基金财产有关的重大合同及有关凭证的保管

基金托管人按照法律法规保管由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同及有关凭证。基金管理人代表基金签署有关重大合同后应在收到合同正本后 30 日内将一份正本的原件提交给基金托管人。除本协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时应当保证基金一方持有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。重大合同由基金管理人与基金托管人按规定各自保管至少 15 年。

#### 四、基金资产净值计算与复核

1、基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。各类基金份额的基金份额净值是指计算日各类基金资产净值除以计算日该类基金份额总数后的价值。

2、基金管理人应每开放日对基金财产估值。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。用于基金信息披露的基金净值信息由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个开放日结束后计算得出当日的各类基金份额的基金份额净值，并在盖章后以传真方式发送给基金托管人。基金托管人应在收到上述传真后对净值计算结果进行复核，并在盖章后以传真方式将复核结果传送给基金管理人，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

3、当相关法律法规或《基金合同》规定的估值方法不能客观反映基金财产公允价值时，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

4、基金管理人、基金托管人发现基金估值违反《基金合同》订明的估值方法、程序以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，双方应及时进行协商和纠正。

5、当基金资产的估值导致基金份额净值（含各类基金份额的基金份额净值，下同）小数点后四位内发生差错时，视为基金份额净值估值错误。当基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当计价错误达到该类基金份额净值的 0.25% 时，基金管理人应当报中国证监会备案；当计价错误达到该类基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应当在报中国证监会备案的同时并及时进行公告。如法律法规或监管机关对前述内容另有规定的，按其规定处理。

6、由于基金管理人对外公布的任何基金净值数据错误，导致该基金财产或基金份额持有人的实际损失，基金管理人应对此承担责任。若基金托管人计算的净值数据正确，则基金托管人对该损失不承担责任；若基金托管人计算的净值数据也不正确，则基金托管人也应承担部分未正确履行复核义务的责任。如果上述错误造成了基金财产或基金份额持有人的不当得利，且基金管理人及基金托管人已各自承担了赔偿责任，则基金管理人应负责向不当得利之主体主张返还不当得利。如果返还金额不足以弥补基金管理人及基金托管人已承担的赔偿金额，则双方按照各自赔偿金额的比例对返还金额进行分配。

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

8、如果基金托管人的复核结果与基金管理人的计算结果存在差异，且双方经协商未能达成一致，基金管理人可以按照其对基金份额净值的计算结果对外予以公布，基金托管人可以将相关情况报中国证监会备案。

## 五、基金份额持有人名册的登记与保管

### 1、基金份额持有人名册的内容

基金份额持有人名册的内容包括但不限于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包括以下几类：

- （1）基金募集期结束时的基金份额持有人名册；
- （2）基金权益登记日的基金份额持有人名册；
- （3）基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册；
- （4）每半年度最后一个交易日的基金份额持有人名册。

### 2、基金份额持有人名册的提供

对于每半年度最后一个交易日的基金份额持有人名册，基金管理人应在每半年度结束后5个工作日内定期向基金托管人提供。对于基金募集期结束时的基金份额持有人名册、基金权益登记日的基金份额持有人名册以及基金份额持有人大

会登记日的基金份额持有人名册，基金管理人应在相关的名册生成后5个工作日内向基金托管人提供。

### 3、基金份额持有人名册的保管

基金托管人应妥善保管基金份额持有人名册。如基金托管人无法妥善保存持有人名册，基金管理人应及时向中国证监会报告，并代为履行保管基金份额持有人名册的职责。基金托管人应对基金管理人由此产生的保管费给予补偿。

## 六、适用法律与争议解决方式

1、本协议适用中华人民共和国法律并从其解释。

2、基金管理人与基金托管人之间因本协议产生的或与本协议有关的争议可通过友好协商解决。但若自一方书面提出协商解决争议之日起60日内争议未能以协商方式解决的，则任何一方可将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会，并按其时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。

3、除争议所涉的内容之外，本协议的当事人仍应履行本协议的其他规定。

## 七、托管协议的修改与终止

### 1、托管协议的变更

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行变更。变更后的新协议，其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突。变更后的新协议应当报中国证监会核准。

### 2、托管协议的终止

发生以下情况，本托管协议应当终止：

- （1）《基金合同》终止；
- （2）本基金更换基金托管人；
- （3）本基金更换基金管理人；
- （4）发生《基金法》、《运作办法》或其他法律法规规定的终止事项。

## 第二十一部分 对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务。以下是主要的服务内容，基金管理人将根据基金份额持有人的需要和市场的变化，增加或变更服务项目。主要服务内容如下：

### 一、开户确认

基金管理人为投资者提供开户信息的短信确认及网上查询确认服务，投资者可通过接收公司的开户确认短信或者登陆公司网站了解相关的开户信息。

### 二、资料发送

#### 1、基金投资者对账单

基金管理人为基金份额持有人提供季度对账单寄送服务。

为保证基金份额持有人获得方便、快捷、私密性较强的对账单信息，基金管理人同时为基金份额持有人提供电子对账单发送服务。基金份额持有人在开户后可通过公司网站、客服电话、客服邮箱留下本人的电子邮件地址及相关信息，我们将按投资者的选择定期为其发送电子对账单。

#### 2、其他资料

基金管理人将根据客户的定制要求和相应的客户类别，寄送公司期刊及各类研究报告，动态地向客户提供时效性强的财经资讯。

### 三、呼叫中心服务

东方呼叫中心已经开通并能为客户提供安全高效的信息查询服务及人工咨询服务。客户可以通过自动语音系统进行交易信息查询、账户信息查询与修改以及基金信息的查询，在这过程中客户有任何需要帮助的地方，均可以转接人工或在语音信箱中留言；系统同时受理 E-Mail 等多样化服务，为客户提供便捷多样的交流方式。

### 四、网上交易业务

本基金已开通网上交易业务，个人投资者可通过本公司网上交易平台办理基金的开户、申购、赎回等各项业务，本公司在遵循法律法规的前提下开展网上交

易申购费率优惠活动，个人投资者通过本公司网上交易平台办理基金申购业务时可享受申购费率优惠，详情可登陆本公司网站 [www.orient-fund.com](http://www.orient-fund.com) 或 [www.df5888.com](http://www.df5888.com) 查阅本公司旗下基金开通网上交易业务的公告。

为方便个人投资者或基金份额持有人，未来在各项技术条件和准备完备的情况下，本基金管理人将酌情丰富网上交易渠道。

## 五、网上查询服务

通过本公司网站，客户还可获得如下服务：

### 1、查询服务

所有东方开放式基金的持有人均可通过公司网站实现基金交易查询、账户信息查询和基金信息查询。

### 2、信息资讯服务

客户可以利用公司网站获取基金和公司的各类信息，包括基金的法律文件、业绩报告及公司最新动态等各类最新资料。

## 六、短信服务

本公司已经开通短信服务，通过短信向投资者发送本公司基金、公司活动等内容的的相关信息。

## 七、资讯服务

投资者如果想了解申购与赎回的交易情况、基金账户余额、基金产品与服务等信息，可拨打本公司如下电话：

电话呼叫中心：010-66578578 或 400-628-5888，该电话可转人工座席。

传真：010-66578700

## 八、定期定额投资业务

为方便投资者或基金份额持有人，本基金已在部分销售机构开通定期定额投资业务，具体内容详见基金管理人和其他其他销售机构有关基金定期定额投资的公告。未来在各项技术条件和准备完备的情况下，将在其它销售渠道酌情增加本基金的定期定额投资业务。



## 九、基金转换

为方便基金份额持有人，本公司已在部分销售机构开通本基金和旗下各只基金的基金转换业务。基金转换的数额限制、转换费率等具体规定以基金管理人对外发布的公告为准。

## 十、客户投诉受理服务

投资者可以通过客户服务热线（010-66578578）（400-628-5888）、公司网站（[www.orient-fund.com](http://www.orient-fund.com)）（[www.df5888.com](http://www.df5888.com)）、电子邮件（[services@orient-fund.com](mailto:services@orient-fund.com)）、传真（010-66578700）、信件等方式对我们的工作提出建议或意见。我们将用心倾听投资者的需求和意见，并按照“客户投诉和建议”流程处理，在规定的时间内予以反馈。

## 第二十二部分 其他应披露事项

一、在本基金存续期内，本基金管理人的内部机构设置、职能划分可能会发生变化，职能也会相应地做出调整，但不会影响本基金的投资理念、投资目标、投资范围和投资运作。

二、基金管理人和基金份额持有人应遵守《东方基金管理股份有限公司公开募集开放式证券投资基金登记业务规则》等有关规定（包括本基金管理人对上述规则的任何修订和补充）。上述规则由本基金管理人制定，并由其解释与修改，但规则的修改若实质性地修改了本基金合同，应召开基金份额持有人大会，对基金合同的修改达成决议。

三、本《招募说明书》将按中国证监会有关规定进行更新；《招募说明书》解释与基金合同不一致时，以基金合同为准。

四、从上次《招募说明书（更新）》截止日2023年6月24日至本次《招募说明书（更新）》截止日2024年6月24日之间的信息披露事项。

公告名称	公告日期
关于提醒投资者防范金融诈骗的公告	2023-06-30
2023年二季度报告	2023-07-21
东方核心动力混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	2023-08-07
东方核心动力混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2023年第1号）	2023-08-07
关于增加海通证券股份有限公司为公司旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告	2023-08-24
东方核心动力混合型证券投资基金托管协议（2023年8月修订）	2023-08-24
东方核心动力混合型证券投资基金基金合同（2023年8月修订）	2023-08-24
东方基金管理股份有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告	2023-08-25
东方核心动力混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	2023-08-29
东方核心动力混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2023年第2号）	2023-08-29
2023年中期报告	2023-08-31
东方基金管理股份有限公司关于终止凤凰金信（海口）基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	2023-09-01
关于增加甬兴证券有限公司为公司旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务并参与申购费率优惠活动的公告	2023-09-14
2023年三季度报告	2023-10-25
东方基金管理股份有限公司关于恢复乾道基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	2023-11-03

东方基金管理股份有限公司关于公司旗下部分开放式基金参加平安银行股份有限公司转换费率优惠活动的公告	2023-11-16
关于旗下部分基金参与深圳市前海排排网基金销售有限责任公司申购费率优惠活动的公告	2023-11-24
关于旗下部分基金参与东兴证券股份有限公司申购费率优惠活动的公告	2023-11-28
东方基金管理股份有限公司旗下部分基金改聘会计师事务所公告	2024-01-02
关于增加东莞证券股份有限公司为东方核心动力混合型证券投资基金 C 类销售机构同时开通定投及转换业务的公告	2024-01-11
2023 年四季度报告	2024-01-20
关于增加上海大智慧基金销售有限公司为公司旗下部分基金销售机构同时参与申购费率优惠活动的公告	2024-02-05
东方基金管理股份有限公司关于终止和合期货有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	2024-02-23
关于提醒投资者防范不法分子仿冒我司名义从事诈骗活动的公告	2024-02-23
关于增加江苏银行股份有限公司为公司旗下部分基金销售机构并参加申购费率优惠活动的公告	2024-03-14
关于旗下部分基金参与玄元保险代理有限公司申购费率优惠活动的公告	2024-03-15
关于旗下部分基金参与华福证券有限责任公司等两家机构申购费率优惠活动的公告	2024-03-27
2023 年年度报告	2024-03-30
东方基金管理股份有限公司关于调整旗下部分基金持有的停牌股票估值方法的提示性公告	2024-04-02
东方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资北交所股票及相关风险提示的公告	2024-04-10
东方核心动力混合型证券投资基金 2024 年一季度报告	2024-04-20
关于增加海通证券股份有限公司等两家机构为东方基金旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告	2024-05-29

## 第二十三部分 招募说明书的存放及查阅方式

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公司住所，供社会公众查阅、复制。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与公告的内容完全一致。

## 第二十四部分 备查文件

以下备查文件分别置备于基金管理人、基金托管人的住所，供公众查阅、复制。

- 一、中国证监会批准东方核心动力混合型证券投资基金募集的文件
- 二、《东方核心动力混合型证券投资基金基金合同》
- 三、《东方核心动力混合型证券投资基金托管协议》
- 四、《东方核心动力股票型开放式证券投资基金法律意见书》
- 五、基金管理人业务资格批件和营业执照
- 六、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 七、中国证监会要求的其他文件

东方基金管理股份有限公司

2024年8月