

# 英大碳中和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：英大基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

2024 年 8 月

## 重要提示

英大碳中和混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）于2022年4月15日经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可〔2022〕802号文准予公开募集。

英大基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”或“管理人”）保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本基金经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者根据所持有的基金份额享受基金收益，同时承担相应的投资风险。投资人在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险、管理风险、合规风险、本基金的特有风险等。本基金属于混合型证券投资基金，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金，高于货币市场基金、债券型基金。投资有风险，投资人在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的基金合同、招募说明书及基金产品资料概要等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。

本基金将股指期货纳入到投资范围当中，股指期货采用保证金交易制度，由于保证金交易具有杠杆性，当出现不利行情时，股价、指数微小的变动就可能会使投资者权益遭受较大损失。股指期货采用每日无负债结算制度，如果没有在规定的时间内补足保证金，按规定将被强制平仓，可能给投资带来重大损失。

本基金将国债期货纳入到投资范围当中，国债期货是一种金融合约。投资于国债期货需承受市场风险、基差风险、流动性风险等。国债期货采用保证金交易制度，当相应期限国债收益率出现不利变动时，可能会导致投资人权益遭受较大损失。国债期货采用每日无负债结算制度，如果没有在规定的时间内补足保证金，按规定将被强制平仓，可能给投资带来较大损失。

本基金投资资产支持证券，资产支持证券是一种债券性质的金融工具，其向投资者支付的本息来自于基础资产池产生的现金流或剩余权益。与股票和一般债券不

同，资产支持证券不是对某一经营实体的利益要求权，而是对基础资产池所产生的现金流和剩余权益的要求权，是一种以资产信用为支持的证券，所面临的风险主要包括交易结构风险、各种原因导致的基础资产池现金流与对应证券现金流不匹配产生的信用风险、市场交易不活跃导致的流动性风险等，由此可能造成基金财产损失。

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

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，具体详见本招募说明书“侧袋机制”等章节。侧袋机制实施期间，基金管理人将对基金简称进行特殊标识，并不办理侧袋账户的申购赎回。请基金份额持有人仔细阅读相关内容并关注本基金启用侧袋机制时的特定风险。

基金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预示其未来表现。基金管理人所管理的其它基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过50%的除外。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。

本招募说明书所载内容截止日为2024年7月31日，有关财务数据和净值表现数据截止日为2024年6月30日（财务数据未经审计）。本招募说明书已经基金托管人复核。

## 目 录

第一部分 绪言.....	5
第二部分 释义.....	6
第三部分 基金管理人.....	12
第四部分 基金托管人.....	27
第五部分 相关服务机构.....	32
第六部分 基金的募集.....	42
第七部分 基金合同的生效.....	43
第八部分 基金份额的申购与赎回.....	44
第九部分 基金的投资.....	57
第十部分 基金的业绩.....	71
第十一部分 基金的财产.....	72
第十二部分 基金资产的估值.....	73
第十三部分 基金的收益与分配.....	80
第十四部分 基金的费用与税收.....	82
第十五部分 基金的会计与审计.....	85
第十六部分 基金的信息披露.....	86
第十七部分 侧袋机制.....	94
第十八部分 风险揭示.....	98
第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算.....	107
第二十部分 基金合同的内容摘要.....	109
第二十一部分 基金托管协议的内容摘要.....	147
第二十二部分 对基金份额持有人的服务.....	167
第二十三部分 其他应披露事项.....	170
第二十四部分 招募说明书的存放及其查阅方式.....	172
第二十五部分 备查文件.....	173

## 第一部分 绪言

《英大碳中和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”)依据《中华人民共和国民法典》(以下简称“《民法典》”)、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(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》”)及其他有关法律法规的规定以及《英大碳中和混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)编写。

本招募说明书阐述了英大碳中和混合型证券投资基金(以下简称“本基金”或“基金”)的投资目标、投资策略、风险、费率等与投资人投资决策有关的全部必要事项,投资者在做出投资决策前应当仔细阅读本招募说明书。

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

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

## 第二部分 释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

- 1、基金或本基金：指英大碳中和混合型证券投资基金
- 2、基金管理人：指英大基金管理有限公司
- 3、基金托管人：指交通银行股份有限公司
- 4、基金合同、《基金合同》或本基金合同：指《英大碳中和混合型证券投资基金基金合同》及对其的任何有效修订和补充
- 5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《英大碳中和混合型证券投资基金托管协议》及对其的任何有效修订和补充
- 6、招募说明书：指《英大碳中和混合型证券投资基金招募说明书》及对其的更新
- 7、基金份额发售公告：指《英大碳中和混合型证券投资基金基金份额发售公告》
- 8、基金产品资料概要：指《英大碳中和混合型证券投资基金基金产品资料概要》及其更新
- 9、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等
- 10、《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，经 2012 年 12 月 28 日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自 2013 年 6 月 1 日起实施，并经 2015 年 4 月 24 日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修正的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 11、《销售办法》：指中国证监会 2020 年 8 月 28 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 12、《信息披露办法》：指中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1 日实施的，并经 2020 年 3 月 20 日中国证监会《关于修改部分证券期货规章的决定》

修正的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

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

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

15、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

16、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行保险监督管理委员会

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

18、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

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

20、合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者境内证券期货投资管理办法》（包括对其的不时修订）及相关法律法规规定，经中国证监会批准，使用来自境外的资金进行境内证券期货投资的境外机构投资者，包括境外基金管理公司、商业银行、保险公司、证券公司、期货公司、信托公司、政府投资机构、主权基金、养老基金、慈善基金、捐赠基金、国际组织等中国证监会认可的机构

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

22、基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人

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

24、销售机构：指基金管理人以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他

条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务协议，办理基金销售业务的机构

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

26、登记机构：指办理登记业务的机构或基金份额登记机构。基金的登记机构为英大基金管理有限公司或接受英大基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构

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

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

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

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

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

32、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

33、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

34、T日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日

35、T+n日：指自T日起第n个工作日（不包含T日），n为自然数

36、开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

37、开放时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

38、《业务规则》：指《英大基金管理有限公司开放式基金业务规则》，是规

范基金管理人所管理的开放式证券投资基金登记方面的业务规则，由基金管理人、销售机构和投资人共同遵守

39、认购：指在基金募集期内，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

40、申购：指基金合同生效后，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

41、赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为

42、基金转换：指基金份额持有人按照本基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金基金份额的行为

43、转托管：指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基金份额销售机构的操作

44、定期定额投资计划：指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期申购日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及受理基金申购申请的一种投资方式

45、巨额赎回：指本基金单个开放日，基金净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一开放日基金总份额的 10%

46、元：指人民币元

47、基金收益：指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约

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

49、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

50、基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

51、基金资产估值：指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程

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

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

54、基金份额的类别：指根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同将基金份额分为不同的类别，各基金份额类别分别设置代码，分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值。本基金份额类别分为A类基金份额和C类基金份额

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

56、C类基金份额：指从本类别基金资产中计提销售服务费，并不收取认购/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

57、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以及法律法规或中国证监会规定的其他流动性受限资产，如未来法律法规变动，基金管理人在履行适当程序后，可对上述流动性受限资产范围进行调整

58、摆动定价机制：指在开放期内，当开放式基金遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资人的合法权益不受损害并得到公平对待，如未来法律法规变动，基金管理人在履行适当程序后，可对前述摆动定价机制的定义进行调整

59、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

60、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

61、不可抗力：指本基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件，包括但不限于地震、台风、水灾、火灾、战争、瘟疫、社会动乱、非一方过错情况下的电力和通讯故障、系统故障、设备故障、网络黑客攻击以及中国证监会、证券/期货交易所、中国证券业协会、中国证券投资基金业协会规定的其他情形

## 第三部分 基金管理人

### 一、基金管理人概况

公司名称：英大基金管理有限公司

公司住所：北京市朝阳区东三环中路1号环球金融中心西塔22楼2201

办公地址：北京市朝阳区东三环中路1号环球金融中心西塔22楼2201

邮政编码：100020

法定代表人：范育晖

联系人：顾诗

联系电话：400-890-5288、010-57835666

成立时间：2012年8月17日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监许可〔2012〕759号

组织形式：有限责任公司（法人独资）

注册资本：11.46亿元人民币

存续期间：持续经营

### 二、基金管理人基本情况

英大基金管理有限公司（以下简称“英大基金”）成立于2012年8月17日，注册资本金11.46亿元人民币，是国网英大国际控股集团有限公司的全资子公司。英大基金依托股东优势，坚持市场化发展方向，立足新发展阶段、贯彻新发展理念，根植主业、服务实业、坚持能源特色、努力创造价值，积极构建规模、速度、结构、质量、效益、安全“六统一”的新发展格局，致力于为客户提供卓越的资产管理服务。

公司依托高效的决策机制、专业的投研团队、严谨的风控体系，2023年先后荣获新浪财经致敬公募25周年评选“最具成长潜力基金公司”，2023东方财富风云际会“年度潜力电商团队”，在2023金融业高质量发展大会暨第九届金融企业社会责任论坛上，公司以“深化普惠金融，助力共同富裕”的一系列实践获评《金融企业社会责任蓝皮书（2022）》优秀案例等奖项。

截至2024年6月30日，本公司管理英大纯债债券型证券投资基金、英大领先

回报混合型发起式证券投资基金、英大现金宝货币市场基金、英大国企改革主题股票型证券投资基金、英大灵活配置混合型发起式证券投资基金、英大策略优选混合型证券投资基金、英大睿鑫灵活配置混合型证券投资基金、英大睿盛灵活配置混合型证券投资基金、英大通盈纯债债券型证券投资基金、英大安惠纯债债券型证券投资基金、英大安鑫 66 个月定期开放债券型证券投资基金、英大智享债券型证券投资基金、英大通惠多利债券型证券投资基金、英大稳固增强核心一年持有期混合型证券投资基金、英大中证 ESG120 策略指数证券投资基金、英大安盈 30 天滚动持有债券型发起式证券投资基金、英大安益中短债债券型证券投资基金、英大安悦纯债债券型证券投资基金、英大中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、英大通佑纯债一年定期开放债券型证券投资基金、英大延福养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、英大安昞纯债债券型证券投资基金、英大碳中和混合型证券投资基金、英大延福养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、英大延福养老目标日期 2055 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、英大延福养老目标日期 2060 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、英大延福养老目标日期 2045 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、英大延福养老目标日期 2050 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、英大安华纯债债券型证券投资基金、英大 CFETS0-3 年期政策性金融债指数证券投资基金 30 只开放式证券投资基金，同时，管理数十个特定客户资产投资组合。

基金管理人与股东之间实行业务隔离制度，股东并不直接参与基金财产的投资运作。

### 三、主要人员情况

#### 1、基金管理人董事会成员

乔发栋先生：董事长。自 2023 年 7 月 7 日起任职，研究生学历，博士学位，高级会计师。现任国网英大股份有限公司董事、总经理、党委副书记，国网英大国际控股集团有限公司党委委员。历任西北电网公司财务部基建财务处处长，西安凯信实业发展有限公司副总经理、总会计师、工会主席、党委委员，西安凯信实业发展有限公司总经理、党委委员，英大国际信托有限责任公司固有资产管理部主任、上海业务部总经理，英大国际信托有限责任公司总经理助理兼办公室（董监办）主任、

党组书记、总经理助理兼风险控制部筹备组组长，英大国际信托有限责任公司副总经理、总会计师、党委委员，国网英大股份有限公司副总经理、党委委员兼英大汇通商业保理有限公司董事长、党支部书记，国网雄安商业保理有限公司执行董事，英大证券有限责任公司董事，国网英大股份有限公司副总经理、党委委员。

范育晖先生：职工董事。自2020年12月28日起任职，研究生学历，硕士学位。现任英大基金管理有限公司总经理、党总支副书记。历任中国电力信托投资有限公司信贷部、证券部职员，天津证券营业部交易部副经理、经理，天津证券营业部副总经理，北京证券营业部副总经理，中国电力财务有限公司债券基金部副主任、投资银行部副主任，上海国电投资有限公司总经理，中国电力财务有限公司监察室主任、投资银行部主任、投资管理部主任，华北分公司总经理，英大基金副总经理、党总支委员，英大基金管理有限公司总经理、党总支副书记兼英大资本管理有限公司执行董事、代行英大基金管理有限公司董事长职责。

张彤宇先生：董事，自2019年8月25日起任职，本科学历，硕士学位，高级会计师。现任国网英大股份有限公司董监部高级总监。历任东北电业管理局第四工程公司财务科、东北电力集团公司财务部专项基金处、辽宁省电力公司财务部资产资金处、国家电力公司财务部综合处职员，国家电网公司财务部财务管理处副处长、预算处副处长、金融资产管理部稽审处副处长、处长，国网资产管理有限公司合规与风险处处长，英大国际控股集团有限公司法律合规部主任、风险管理部主任，国网英大国际控股集团有限公司风险管理部主任、资产管理业务部主任，国网英大股份资产管理业务部主任。

马涛先生：董事，自2020年12月28日起任职，研究生学历，硕士学位，高级经济师。现任国网英大国际控股集团有限公司资产管理业务部主任。历任渤海证券股份有限公司研究所行业研究员、广发证券股份有限公司发展研究中心行业研究员、国网英大国际控股集团有限公司投资管理部经理、高级经理，计划投资部高级经理、主任助理，发展策划部主任助理，发展策划部（引战与上市工作办公室）副主任、国网英大国际控股集团有限公司投资管理部副主任、主任。

马筱琳女士：独立董事，自2017年11月29日起任职，研究生学历，硕士学位，高级经济师。历任首钢公司自动化研究所技术贸易翻译，中国国际贸易中心管理部

部门经理，中国国际期货经纪有限公司国际交易员、客户经理，中国工商银行总行投资银行部、投行研究中心副处长、研究发展部资深经理。在银监会法规部借调期间，从事我国资产证券化法规制度的研究，参与完成我国首个资产证券化试点法规的编制与发布等相关工作。

贺强先生：独立董事，自2020年12月28日起任职，本科学历，学士学位，教授。现任中央财经大学金融学院教授、证券期货研究所所长。长期从事金融与证券的教学和研究工作，具有深厚的金融理论功底和丰富的资本市场实践经验。先后发表论文、论著500余篇，国家级、省部级与其他课题20余项，出版专著、教材50余部。参与了全国人大财经委《证券法》《基金法》的起草与修改工作。

宋国良先生：独立董事，自2020年12月28日起任职，研究生学历，经济学博士。现任对外经济贸易大学金融学院教授、对外经济贸易大学金融产品与投资研究中心主任。曾任司法部中国律师事务中心律师，瑞士信贷第一波士顿投资银行中国业务副总裁，中国金融学院副教授等职务。

## 2、基金管理人监事会成员

松芙蓉女士：监事会主席，自2020年12月28日起任职，本科学历，学士学位，正高级会计师。现任国网英大国际控股集团有限公司总会计师、党委委员。历任贵州省电力建设第一工程公司财务部出纳、核算主管，贵州省电力公司财务资产部资金、电价主管；贵州省贵阳市北供电局电费室主任，长安保险经纪有限公司财务部财务主管；国家电网人寿保险公司筹备组财务会计小组组员；英大泰和人寿保险股份有限公司财务会计部财务管理处处长、财务会计部主任助理；英大国际控股集团有限公司财务资产部职员、主任助理，国网英大国际控股集团有限公司财务资产部主任助理、审计部主任助理、审计部副主任、审计部主任、风险管理部主任，国网英大国际控股集团有限公司副总审计师兼审计部、风险管理部主任等职务。

李婷女士：职工监事，自2020年12月28日起任职，研究生学历，硕士学位。现任英大基金管理有限公司基金运营部总经理。曾任职英大证券计划财务部预算管理、会计核算，英大基金运营部资金清算、TA、基金会计，综合管理部财务负责人、副总经理兼财务负责人、副总经理，基金运营部副总经理、总经理、风险管理部总经理等职务。

李莉女士：职工监事，自 2022 年 8 月 3 日起任职，本科学历，学士学位。现任英大基金管理有限公司人力资源部副主任。曾任武汉吉隆过滤集团市场部市场内务、主管，泰康人寿湖北分公司营销服务部代理人、业务主任、兼职讲师，泰康人寿总公司员工福利计划事业部职场营销组长，泰康养老总公司人力资源部培训管理、招聘、员工关系、薪酬福利，英大财险北京分公司人事行政部薪酬福利、绩效考核、人资板块负责人，英大基金管理有限公司综合管理部（董监办）薪酬绩效、主任助理、人力资源部主任助理等职务。

### 3、公司高级管理人员

范育晖先生：总经理，自 2020 年 1 月 7 日起任职，研究生学历，硕士学位。兼任英大基金管理有限公司职工董事、党总支副书记。历任中国电力信托投资有限公司信贷部、证券部职员，天津证券营业部交易部副经理、经理，天津证券营业部副总经理，北京证券营业部副总经理，中国电力财务有限公司债券基金部副经理、投资银行部副主任，上海国电投资有限公司总经理，中国电力财务有限公司监察室主任、投资银行部主任、投资管理部主任，华北分公司总经理，英大基金副总经理、党总支委员，英大基金管理有限公司总经理、党总支副书记兼英大资本管理有限公司执行董事，代行英大基金管理有限公司董事长职责。

岳喜伟先生：副总经理，自 2020 年 12 月 8 日起任职，研究生学历，博士学位。现兼任英大基金管理有限公司财务负责人、党总支委员。历任中共山东省委党校《信息与资料》编辑部编辑，国家电网公司金融资产管理部合规与风险处四级职员，国网资产管理有限公司合规与风险处四级职员，英大国际控股集团有限公司风险管理部四级职员，国网英大国际控股集团有限公司风险管理部高级经理、风险管理部总监、风险管理部主任助理、审计部主任助理、审计部副主任，英大基金管理有限公司总经理助理兼财务总监，英大基金管理有限公司总经理助理兼财务总监、产品市场部总经理、工会主席，英大基金管理有限公司副总经理兼财务负责人、产品市场部总经理、工会主席。

张大铮先生：副总经理，自 2020 年 12 月 8 日起任职，研究生学历，硕士学位。现兼任英大基金管理有限公司党总支委员、基金经理。历任中银国际证券有限责任公司高级分析员，中国国际金融有限公司固定收益部副总经理、资产管理部副总经

理，摩根士丹利华鑫基金管理有限公司助理总经理、固定收益投资部总监，民生基金管理有限公司（筹）副总裁，英大基金管理有限公司总经理助理（投资总监）兼固定收益部总经理、基金经理，英大基金管理有限公司副总经理兼固定收益部总经理、基金经理。

党晶先生：副总经理，自 2022 年 3 月 11 日起任职，研究生学历，博士学位。现兼任英大基金管理有限公司党总支委员、北京分公司总经理、深圳分公司总经理，北京英大资本管理有限公司执行董事。历任国网资产管理有限公司发展策划部职员，国网英大国际控股集团有限公司投资管理部高级主管、经理，深圳英大资本管理有限公司能源及军工部副总经理（主持工作）、总经理，英大基金管理有限公司互联网金融部、销售服务部、机构业务部（电商业务部）、专户投资部总经理，北京英大资本管理有限公司总经理，英大基金管理有限公司总经理助理兼机构业务部总经理、总经理助理、总经理助理兼渠道业务部总经理、总经理助理，代行北京英大资本管理有限公司总经理职责、代行合规负责人职责。

#### 4、督察长

刘康喜先生：督察长。自 2019 年 10 月 14 日起任职，研究生学历，硕士学位。现兼任英大基金管理有限公司党总支委员、北京英大资本管理有限公司监事。曾任职于中共北京市怀柔区纪委、监察局，北京市法律援助中心，中国证监会北京监管局，英大基金管理有限公司监察稽核部副总经理（主持工作）、监察稽核部总经理、督察长兼监察稽核部总经理。

#### 5、基金经理

张媛女士，博士学位，研究生学历。历任中国国际期货有限公司资产管理部高级量化策略研究员、投资经理助理。2016 年 9 月加入英大基金管理有限公司，历任公司权益投资部基金经理助理、基金经理。现任公司权益投资部总经理助理、基金经理，管理英大策略优选混合型证券投资基金、英大睿盛灵活配置混合型证券投资基金、英大国企改革主题股票型证券投资基金、英大中证 ESG120 策略指数证券投资基金、英大碳中和混合型证券投资基金。

#### 6、投资决策委员会委员名单

公司的投资决策委员会成员姓名及职务如下：

## (1) 公募基金固收业务投资决策委员会

主任委员：张大铮

一般委员：党晶、刘家睿、董大鹏、石茜虹、易祺坤、吕一楠、韩坪、张婧珣

秘 书：赵济民

上述人员之间无近亲属关系。

## (2) 公募基金权益业务投资决策委员会

主任委员：党晶

一般委员：刘家睿、董大鹏、石茜虹、刘宇斌、张媛、霍达

秘 书：鱼翔

上述人员之间无近亲属关系。

## 四、基金管理人的权利和义务

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

(1) 依法募集资金；

(2) 自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；

(3) 依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；

(4) 销售基金份额；

(5) 按照规定召集基金份额持有人大会；

(6) 依据《基金合同》及有关法律规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

(7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

(8) 选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；

(9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；

(10) 依据《基金合同》及有关法律规规定决定基金收益的分配方案；

- (11) 在《基金合同》约定的范围内,拒绝或暂停受理申购、赎回与转换申请;
- (12) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利,为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利;
- (13) 在法律法规允许的前提下,为基金的利益依法为基金进行融资;
- (14) 以基金管理人的名义,代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为;
- (15) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券/期货经纪商或其他为基金提供服务的外部机构;
- (16) 在符合有关法律、法规的前提下,制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、定期定额投资和非交易过户等的业务规则;
- (17) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

- (1) 依法募集资金,办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜;
- (2) 办理基金备案手续;
- (3) 自《基金合同》生效之日起,以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产;
- (4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策,以专业化的经营方式管理和运作基金财产;
- (5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度,保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立,对所管理的不同基金分别管理,分别记账,进行证券投资;
- (6) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外,不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取非法利益,不得委托第三人运作基金财产;
- (7) 依法接受基金托管人的监督;
- (8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定,按有关规定计算并公告基金资产净值,确定

基金份额申购、赎回的价格；

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(10) 编制季度报告、中期报告和年度报告；

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

(12) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露（但依法向监管机构、司法机关、交易所及审计、法律等外部专业顾问提供的除外）；

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

(14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议;

(26) 建立并保存基金份额持有人名册;

(27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## 五、基金管理人的承诺

1、基金管理人承诺不从事违反《中华人民共和国证券法》的行为, 并承诺建立健全的内部控制制度, 采取有效措施, 防止违反《中华人民共和国证券法》行为的发生。

2、基金管理人承诺不从事以下违反《基金法》、《运作办法》、《销售办法》的行为, 并承诺建立健全的内部风险控制制度, 采取有效措施, 防止下列行为的发生:

(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) 不公平地对待基金管理人管理的不同基金财产;

(3) 利用基金财产或者职务之便为基金份额持有人以外的第三人牟取利益;

(4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失;

(5) 侵占、挪用基金财产;

(6) 泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动;

(7) 玩忽职守, 不按照规定履行职责;

(8) 法律法规或中国证监会禁止的其他行为。

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

- (1) 承销证券;
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保;
- (3) 从事承担无限责任的投资;
- (4) 向其基金管理人、基金托管人出资;
- (5) 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;
- (6) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

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

法律、行政法规或监管部门取消或调整上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不受上述限制或按调整后的规定执行。

#### 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) 不利用基金财产或职务之便为自己、受雇人或任何第三者谋取利益;
- (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，不泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息;
- (4) 不协助、接受委托或以其它任何形式为其它组织或个人进行证券交易;
- (5) 不从事损害基金资产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

#### 六、基金管理人的风险管理和内部控制体系

##### 1、风险管理理念与目标

- (1) 确保合法合规经营;
- (2) 防范和化解风险;

- (3) 提高经营效率;
- (4) 保护投资者和股东的合法权益。

## 2、风险管理措施

- (1) 建立健全公司组织架构;
- (2) 树立监察稽核功能的权威性和独立性;
- (3) 加强内控培训, 培养全体员工的风险管理意识和监察文化;
- (4) 制定员工行为规范和纪律程序;
- (5) 建立岗位分离制度;
- (6) 建立危机处理和灾难恢复计划。

## 3、风险管理和内部控制的原则

(1) 全面性原则: 公司风险管理必须覆盖公司的所有部门和岗位, 渗透各项业务过程和业务环节;

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

(3) 相互制约原则: 公司及各部门在内部组织结构的设计上要形成一种相互制约机制, 建立不同岗位之间的制衡体系;

(4) 定性和定量相结合原则: 建立完备的风险管理指标体系, 使风险管理更具客观性和操作性;

(5) 防火墙原则: 基金财产、公司自有资产、其他资产的运作应当严格分开并独立核算。

## 4、内部控制体系

### (1) 内部控制的组织架构

1) 董事会风险管理与审计委员会: 负责对公司基金业务运作的合法性、合规性进行检查和评估; 及时发现公司经营过程中存在的问题及不规范的行为和事项, 按照公司章程的规定予以记录、评估及报告; 对公司监察稽核制度的有效性进行评价; 监督公司的财务状况, 审查公司的财务报表, 评估公司的财务表现, 保证公司的财务运作符合法律的要求和通行的会计标准; 对公司风险管理制度进行评价, 草拟公司风险管理战略, 对公司风险管理制度的实施进行检查, 评估公司风险管理状况;

董事会授予的其他职权。

2) 风险控制委员会：风险控制委员会贯彻执行公司内部风险控制制度，并对公司经营管理和运营过程中存在的风险隐患或出现的风险问题进行管理和控制。风险控制委员会的主要职责为：听取公司运营管理各业务条线的业务汇报，对公司各业务条线存在的风险事项进行讨论并提出解决意见建议，指导、协调和监督各职能部门和各业务条线开展风险控制工作；制订相关风险控制政策，审批风险控制重要流程和风险敞口管理体系，并与公司整体业务发展战略和风险承受能力相一致；识别公司各项业务所涉及各类重大风险，对重大事件、重大决策和重要业务流程的风险进行评估，制定重大风险的解决方案；识别和评估新产品、新业务的新增风险，并制定控制措施；重点关注内控机制薄弱环节和可能给公司带来重大损失的事件，提出控制措施和解决方案；根据公司风险控制总体策略和各职能部门与业务单元职责分工，组织实施风险应对方案。

3) 投资决策委员会：投资决策委员会是公司投资管理的最高决策机构，负责制定投资的投资目标、总体计划、投资策略等重大事项的决策，确定对基金经理/投资经理的授权，审批超过基金经理/投资经理投资权限的投资计划。投资决策委员会由公募基金投资决策委员会和私募资产管理业务投资决策委员会组成。公募基金投资决策委员会包括公募基金固收业务投资决策委员会、公募基金权益业务投资决策委员会、公募基金 FOF 业务投资决策委员会，分别是公司公募基金固收业务投资管理、公募基金权益业务投资管理、公募基金 FOF 业务投资管理的最高决策机构。私募资产管理业务投资决策委员会是公司私募资产管理业务的最高决策机构。

4) 督察长：督察长坚持原则、独立客观，以保护基金份额持有人利益为根本出发点，公平对待全体投资人。督察长的主要职责为：对公司经营和管理、基金运作遵纪守法、风险控制情况进行内部监控和检查；对公司各项制度的合法合规性及公司内部控制制度的执行情况进行监控和检查；就以上监控和检查中发现的问题向经营层通报并提出整改和处理意见；定期向董事会提交工作报告；审核监察稽核部的工作报告。

5) 监察稽核部、风险管理部：监察稽核部是公司内部负责监察稽核、内控合规、风险控制的部门，依照国家有关法律法规、监管精神和公司相关规章制度所规定的

职责、权限、方法和程序独立开展工作，负责对公司各部门和全体员工的监察稽核工作。监察稽核部独立于其它部门，对督察长负责，在督察长领导下进行监察稽核工作。风险管理部门独立于业务体系汇报路径，在督察长领导下进行风险控制工作。风险管理部门对公司的风险控制承担独立评估、监控、检查和报告职责。风险管理部门在其权限和职责范围内，在公司经营运作和投资管理的各个阶段、各个方面和各个环节上负责风险控制工作的具体实施。

## (2) 内部控制的原则

公司的内部控制遵循以下原则：

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

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

3) 独立性原则：公司设立独立的法律、监察稽核部，法律、监察稽核部保持高度的独立性和权威性，负责对公司各部门风险控制工作进行稽核和检查；

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。

公司制订内部控制制度遵循以下原则：

1) 合法合规性原则：公司内控制度应当符合国家法律、法规、规章和各项规定；

2) 全面性原则：内部控制制度涵盖公司管理的各个环节，不得留有制度上的空白或漏洞；

3) 审慎性原则：制定内部控制制度应当以审慎经营、防范和化解风险为出发点；

4) 适时性原则：内部控制制度的制定应当随着有关法律法规的调整和公司经营战略、经营方针、经营理念等内外部环境的变化进行及时的修改或完善。

## (3) 内部风险控制措施

建立科学合理、控制严密、运行高效的内部控制体系和完善的内部控制制度。

公司成立以来，根据中国证监会的要求，建立了科学合理的层次分明的内控组织架构、控制程序和控制措施以及控制职责在内的运行高效、严密的内部控制体系。通

过不断地对内部控制制度进行修改,公司已初步形成了较为完善的内部控制制度。

**建立健全了管理制度和业务规章:**公司建立了包括风险管理制度、投资管理制度、基金会计制度、信息披露制度、监察稽核制度、信息技术管理制度、公司财务制度等基本管理制度以及包括岗位设置、岗位职责、操作流程手册在内的业务流程、规章等,从基本管理制度和业务流程上进行风险控制。

**建立了岗位分离、相互制衡的内控机制:**公司在岗位设置上采取了严格的分离制度,实现了基金投资与交易,交易与清算,公司会计与基金会计等业务岗位的分离制度,形成了不同岗位之间的相互制衡机制,从岗位设置上减少和防范操作及操守风险。

**建立健全了岗位责任制:**公司通过建立健全了岗位责任制使每位员工都能明确自己的岗位职责和风险管理责任。

**构建风险管理系统:**公司通过建立风险评估、预警、报告和控制以及监督程序,并经过适当的控制流程,定期或实时对风险进行评估、预警、监督,从而确认、评估和预警与公司管理及基金运作有关的风险,通过顺畅的报告渠道,对风险问题进行层层监督、管理、控制,使部门和管理层及时把握风险状况并快速做出风险控制决策。**建立自动化监督控制系统:**公司启用了电子化投资、交易系统,对投资比例进行限制,将有效地防止合规性运作风险和操作风险。

**使用数量化的风险管理手段:**采用数量化、技术化的风险控制手段,建立数量化的风险管理模型,以便公司及时采取有效的措施,对风险进行分散、规避和控制,尽可能减少损失。

**提供足够的培训:**制定了完整的培训计划,为所有员工提供足够和适当的培训,使员工具有较高的职业水准,从培养职业化专业理财队伍角度控制职业化问题带来的风险。

##### 5、基金管理人关于内部合规控制声明书

本公司承诺以上关于内部控制的披露真实、准确;

本公司承诺根据市场变化和公司发展不断完善内部控制体系和内部控制制度。

## 第四部分 基金托管人

### 一、基金托管人基本情况

#### (一) 基金托管人概况

公司法定中文名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）

公司法定英文名称：BANK OF COMMUNICATIONS CO., LTD

法定代表人：任德奇

住 所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号

办公地址：上海市长宁区仙霞路 18 号

邮政编码：200336

注册时间：1987 年 3 月 30 日

注册资本：742.63 亿元

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]25 号

联系人：方圆

电 话：95559

交通银行始建于 1908 年，是中国历史最悠久的银行之一，也是近代中国的发钞行之一。1987 年重新组建后的交通银行正式对外营业，成为中国第一家全国性的国有股份制商业银行，总部设在上海。2005 年 6 月交通银行在香港联合交易所挂牌上市，2007 年 5 月在上海证券交易所挂牌上市。交通银行连续 14 年跻身《财富》（FORTUNE）世界 500 强，营业收入排名第 161 位；列《银行家》（The Banker）杂志全球千家大银行一级资本排名第 9 位。

截至 2024 年 3 月 31 日，交通银行资产总额为人民币 14.24 万亿元。2024 年一季度，交通银行实现净利润（归属于母公司股东）人民币 249.9 亿元。

交通银行总行设资产托管部（下文简称“托管部”）。现有员工具有多年基金、证券和银行的从业经验，具备基金从业资格，以及经济师、会计师、工程师和律师等中高级专业技术职称，员工的学历层次较高，专业分布合理，职业技能优良，职业道德素质过硬，是一支诚实勤勉、积极进取、开拓创新、奋发向上的资产托管从业人员队伍。

## (二) 主要人员情况

任德奇先生，董事长、执行董事，高级经济师。

任先生 2020 年 1 月起任本行董事长（其中：2019 年 12 月至 2020 年 7 月代为履行行长职责）、执行董事，2018 年 8 月至 2020 年 1 月任本行副董事长（其中：2019 年 4 月至 2020 年 1 月代为履行董事长职责）、执行董事，2018 年 8 月至 2019 年 12 月任本行行长；2016 年 12 月至 2018 年 6 月任中国银行执行董事、副行长，其中：2015 年 10 月至 2018 年 6 月兼任中银香港（控股）有限公司非执行董事，2016 年 9 月至 2018 年 6 月兼任中国银行上海人民币交易业务总部总裁；2014 年 7 月至 2016 年 11 月任中国银行副行长，2003 年 8 月至 2014 年 5 月历任中国建设银行信贷审批部副总经理、风险监控部总经理、授信管理部总经理、湖北省分行行长、风险管理部总经理；1988 年 7 月至 2003 年 8 月先后在中国建设银行岳阳长岭支行、岳阳市中心支行、岳阳分行，中国建设银行信贷管理委员会办公室、信贷风险管理部工作。任先生 1988 年于清华大学获工学硕士学位。

刘珺先生，副董事长、执行董事、行长，高级经济师。

刘先生 2020 年 7 月起担任本行行长；2016 年 11 月至 2020 年 5 月任中国投资有限责任公司副总经理；2014 年 12 月至 2016 年 11 月任中国光大集团股份公司副总经理；2014 年 6 月至 2014 年 12 月任中国光大（集团）总公司执行董事、副总经理（2014 年 6 月至 2016 年 11 月期间先后兼任光大永明人寿保险有限公司董事长、中国光大集团有限公司副董事长、中国光大控股有限公司执行董事兼副主席、中国光大国际有限公司执行董事兼副主席、中国光大实业（集团）有限责任公司董事长）；2009 年 9 月至 2014 年 6 月历任中国光大银行行长助理、副行长（期间先后兼任中国光大银行上海分行行长、中国光大银行金融市场中心总经理）；1993 年 7 月至 2009 年 9 月先后在中国光大银行国际业务部、香港代表处、资金部、投行业务部工作。刘先生 2003 年于香港理工大学获工商管理博士学位。

徐铁先生，资产托管部总经理。

徐铁先生 2022 年 4 月起任本行资产托管部总经理；2014 年 12 月至 2022 年 4 月任本行资产托管部副总经理；2000 年 7 月至 2014 年 12 月，历任交通银行资产托

管部客户经理、保险与养老金部副高级经理、高级经理、保险保障业务部高级经理、总经理助理。徐先生 2000 年于复旦大学获经济学硕士学位。

### (三) 基金托管业务经营情况

截至 2024 年 3 月 31 日, 交通银行共托管证券投资基金 879 只。此外, 交通银行还托管了基金公司特定客户资产管理计划、证券公司客户资产管理计划、银行理财产品、信托计划、私募投资基金、保险资金、全国社保基金、基本养老保险基金、划转地方国有股权充实社保基金、养老保障管理基金、企业年金基金、职业年金基金、期货公司资产管理计划、QFI 证券投资资产、QDII 证券投资资产、RQDII 证券投资资产、QDIE、QDLP 和 QFLP 等产品。

## 二、基金托管人的内部控制制度

### (一) 内部控制目标

交通银行严格遵守国家法律法规、行业规章及行内相关管理规定, 加强内部管理, 托管部业务制度健全并确保贯彻执行各项规章, 通过对各种风险的识别、评估、控制及缓释, 有效地实现对各项业务的风险管控, 确保业务稳健运行, 保护基金持有人的合法权益。

### (二) 内部控制原则

1、合法性原则: 托管部制定的各项制度符合国家法律法规及监管机构的监管要求, 并贯穿于托管业务经营管理活动始终。

2、全面性原则: 托管部建立各二级部自我监控和风险合规部风险管控的内部控制机制, 覆盖各项业务、各个部门和各级人员, 并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个经营环节, 建立全面的风险管理监督机制。

3、独立性原则: 托管部独立负责受托基金资产的保管, 保证基金资产与交通银行的自有资产相互独立, 对不同的受托基金资产分别设置账户, 独立核算, 分账管理。

4、制衡性原则: 托管部贯彻适当授权、相互制约的原则, 从组织架构的设置上确保各二级部和各岗位权责分明、相互制约, 并通过有效的相互制衡措施消除内部控制中的盲点。

5、有效性原则：托管部在岗位、业务二级部和风险合规部三级内控管理模式的基础上，形成科学合理的内部控制决策机制、执行机制和监督机制，通过行之有效的控制流程、控制措施，建立合理的内控程序，保障各项内控管理目标被有效执行。

6、效益性原则：托管部内部控制与基金托管规模、业务范围和业务运作环节的风险控制要求相适应，尽量降低经营运作成本，以合理的控制成本实现最佳的内部控制目标。

### （三）内部控制制度及措施

根据《证券投资基金法》、《中华人民共和国商业银行法》、《商业银行资产托管业务指引》等法律法规，托管部制定了一整套严密、完整的证券投资基金托管管理规章制度，确保基金托管业务运行的规范、安全、高效，包括《交通银行资产托管业务管理办法》、《交通银行资产托管业务风险管理办法》、《交通银行资产托管业务商业秘密管理规定》、《交通银行资产托管业务从业人员行为规范》、《交通银行资产托管业务运营档案管理办法》等，并根据市场变化和基金业务的发展不断加以完善。做到业务分工科学合理，技术系统管理规范，业务管理制度健全，核心作业区实行封闭管理，落实各项安全隔离措施，相关信息披露由专人负责。

托管部通过对基金托管业务各环节的事前揭示、事中控制和事后检查措施实现全流程、全链条的风险管理，聘请国际著名会计师事务所对基金托管业务运行进行国际标准的内部控制评审。

### 三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

交通银行作为基金托管人，根据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和有关证券法规的规定，对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金的申购资金的到账与赎回资金的划付、基金收益分配等行为的合规性进行监督和核查。

交通银行作为基金托管人，发现基金管理人违反《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关证券法规和《基金合同》的行为，及时通知基金管理人予以纠正，基金管理人收到通知后及时确认并进行调整。交通银行

有权对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对交通银行通知的违规事项未能及时纠正的，交通银行按规定报告中国证监会。

交通银行作为基金托管人，发现基金管理人有关重大违规行为，按规定报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

## 第五部分 相关服务机构

### 一、销售机构

#### 1、直销机构

名称：英大基金管理有限公司

公司住所：北京市朝阳区东三环中路1号环球金融中心西塔22楼2201

办公地址：北京市朝阳区东三环中路1号环球金融中心西塔22楼2201

邮政编码：100020

法定代表人：范育晖

成立时间：2012年8月17日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监许可〔2012〕759号

组织形式：有限责任公司（法人独资）

注册资本：11.46亿元

存续期间：持续经营

电话：（010）57835666，400-890-5288

传真：（010）59112222

联系人：顾诗

网址：[www.ydamc.com](http://www.ydamc.com)

#### 2、代销机构：

##### （1）交通银行股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号

法定代表人：任德奇

电话：021-58781234

传真：021-58408483

联系人：高天

客服电话：95559

公司网址：[www.bankcomm.com](http://www.bankcomm.com)

(2) 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 号泛利大厦 10 层

办公地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

法定代表人：章知方

客户服务电话：400-920-0022

网址：[www.homeway.com.cn](http://www.homeway.com.cn)

(3) 江苏汇林保大基金销售有限公司

注册地址：南京市高淳区经济开发区古檀大道 47 号

办公地址：南京市鼓楼区中山北路 2 号绿地紫峰大厦 2005 室

法定代表人：吴言林

客户服务电话：025-66046166

网址：[www.huilinbd.com](http://www.huilinbd.com)

(4) 腾安基金销售(深圳)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：深圳市南山区海天二路 33 号腾讯滨海大厦 15 楼

法定代表人：谭广锋

客户服务电话：4000-890-555

网址：[www.tenganxinxi.com](http://www.tenganxinxi.com)

(5) 度小满科技(北京)有限公司

注册地址：北京市海淀区西北旺东路 10 号院西区 4 号楼 6 层 606 室

办公地址：北京市海淀区西北旺东路 10 号院西区 4 号楼 6 层 606 室

法定代表人：许冬亮

客户服务电话：95055

网址：[www.duxiaoman.com](http://www.duxiaoman.com)

(6) 诺亚正行基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 6 层

办公地址：上海市杨浦区长阳路 1687 号 2 号楼

法定代表人：吴卫国

客户服务电话：021-80358000

网址：www.noah-fund.com

(7) 深圳众禄基金销售股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区笋岗街道笋西社区梨园路 8 号 HALO 广场一期四层  
12-13 室

办公地址：深圳市罗湖区笋岗街道笋西社区梨园路 8 号 HALO 广场一期四层  
12-13 室

法定代表人：薛峰

客服电话：4006-788-887

网址：www.zlfund.cn

(8) 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区东大名路 501 号 6211 单元

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903~906 室

法定代表人：陶怡

客服电话：400-700-9665

网址：www.ehowbuy.com

(9) 上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 楼二层

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号

法定代表人：其实

客服电话：400-181-8188

网址：www.1234567.com.cn

(10) 蚂蚁(杭州)基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路 969 号 3 幢 5 层 599 室

办公地址：杭州市西湖区万塘路 18 号黄龙时代广场 B 座 6 楼

法定代表人：王珺

客服电话：4000-766-123

网址: [www.fund123.cn](http://www.fund123.cn)

(11) 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: 上海市浦东新区东方路 1267 号 11 层

法定代表人: 张跃伟

客服电话: 400-820-2899

网址: [www.e-richfund.com](http://www.e-richfund.com)

(12) 上海利得基金销售有限公司

注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区临港新片区海基六路 70 弄 1 号 208-36 室

办公地址: 中国(上海)自由贸易试验区临港新片区海基六路 70 弄 1 号 208-36 室

法定代表人: 李兴春

客户服务电话: 400-032-5885

网址: [www.leadfund.com.cn](http://www.leadfund.com.cn)

(13) 北京创金启富基金销售有限公司

注册地址: 北京市丰台区金泽路 161 号 1 号楼-4 至 43 层 101 内 3 层 09A

办公地址: 北京市西城区白纸坊东街 2 号经济日报社 A 座

法定代表人: 梁蓉

客户服务电话: 010-66154828

网址: [www.5irich.com](http://www.5irich.com)

(14) 宜信普泽(北京)基金销售有限公司

注册地址: 北京市朝阳区建国路乙 118 号 12 层 01D、02A—02F、03A—03C

办公地址: 北京市朝阳区建国路乙 118 号 12 层 01D、02A—02F、03A—03C

法定代表人: 汤蕾

客户服务电话: 400-609-9200

网址: [www.yixinfund.com](http://www.yixinfund.com)

(15) 南京苏宁基金销售有限公司

注册地址：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

办公地址：南京市玄武区苏宁大道 1 号

法定代表人：钱燕飞

客服电话：95177

网址：www.snjijin.com

(16) 北京中植基金销售有限公司

注册地址：北京市北京经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室

办公地址：北京市朝阳区建国路 91 号金地中心 A 座 28 层

法定代表人：武建华

客户服务电话：400-8180-888

网址：www.zzfund.com

(17) 北京汇成基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108

办公地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108

法定代表人：王伟刚

客服电话：400-619-9059

网址：www.hcjijin.com

(18) 北京新浪仓石基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期（西扩）N-1、N-2 地块  
新浪总部科研楼 5 层 518 室

办公地址：北京市海淀区中关村软件园二期新浪总部科研楼

法定代表人：李柳娜

客户服务电话：86-010-62675369

网址：www.xincai.com

(19) 泰信财富基金销售有限公司

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 10 层 1206

法定代表人：彭浩

客户服务电话：400-004-8821

网址：www.taixincf.com

(20) 上海基煜基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 488 号 1503 室

法定代表人：王翔

客户服务电话：400-820-5369

网址：www.jiyufund.com.cn

(21) 珠海盈米基金销售有限公司

注册地址：珠海市横琴新区琴朗道 91 号 1608、1609、1610 办公

办公地址：广州市珠海区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼 1201-1203

室

法定代表人：肖雯

客服电话：020-89629066

网址：www.yingmi.cn

(22) 中证金牛（北京）基金销售有限公司

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：北京市宣武门外大街甲 1 号新华社第三工作区 5F

法定代表人：吴志坚

客户服务电话：4008-909-998

网址：www.jnlc.com

(23) 大连网金基金销售有限公司

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 202 室

法定代表人：樊怀东

客服电话：4000-899-100

网址：www.yibaijin.com

(24) 北京雪球基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区创远路 34 号院 6 号楼 15 层 1501 室

办公地址：北京市朝阳区创远路 34 号院 6 号楼 15 层 1501 室

法定代表人：李楠

客户服务电话：400-159-9288

网址：www.danjuanapp.com

(25) 中信期货有限公司

注册地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层  
1301-1305 室、14 层

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：窦长宏

客服电话：400-990-8826

网址：www.citicsf.com

(26) 中信建投证券有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市东城区朝内大街 188 号

法定代表人：王常青

客户服务电话：95587/4008-888-108

网址：www.csc108.com

(27) 招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道福华一路 111 号

办公地址：深圳市福田区福田街道福华一路 111 号

法定代表人：霍达

客服电话：95565

网址：www.cmschina.com.cn

(28) 中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人：张佑君

客服电话：95548

网址：[www.cs.ecitic.com](http://www.cs.ecitic.com)

(29) 中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市丰台区西营街8号院1号楼7至18层101

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

客户服务电话：95551

网址：[www.chinastock.com.cn](http://www.chinastock.com.cn)

(30) 中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001

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：肖海峰

客户服务电话：95548

网址：[sd.citics.com](http://sd.citics.com)

(31) 中信证券华南股份有限公司

注册地址：广州市天河区临江大道395号901室1001室

办公地址：广州市天河区临江大道395号901室1001室

法定代表人：陈可可

客户服务电话：(020) 95396

网址：[www.gzs.com.cn](http://www.gzs.com.cn)

(32) 华源证券股份有限公司

注册地址：西宁市南川工业园区创业路108号

办公地址：北京市朝阳区安立路30号仰山公园东一门2号楼

法定代表人：邓晖

客户服务电话：010-57672000

网址：[www.jzsec.com](http://www.jzsec.com)

(33) 国金证券股份有限公司

注册地址：成都市青羊区东城根上街95号

办公地址：成都市青羊区东城根上街 95 号

法定代表人：冉云

客户服务电话：028-86690021

网址：[www.gjzq.com.cn](http://www.gjzq.com.cn)

(34) 中国人寿保险股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 16 号

办公地址：北京市西城区金融大街 16 号

法定代表人：白涛

客户服务电话：010-63633333

网址：[www.e-chinalife.com](http://www.e-chinalife.com)

(35) 浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市文二西路 1 号 903 室

法定代表人：吴强

网址：[www.5ifund.cn](http://www.5ifund.cn)

(36) 海通证券股份有限公司

住所：上海市广东路 689 号

办公地址：上海市广东路 689 号海通证券大厦

法定代表人：周杰

客户服务电话：95553

网址：[www.htsec.com](http://www.htsec.com)

(37) 南京招赢通科技有限公司

注册地址：西宁市南川工业园区创业路 108 号

法定代表人：邓晖

网址：[www.gzs.com.cn](http://www.gzs.com.cn)

基金管理人可根据有关法律、法规的要求，选择符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。

(二) 登记机构

名称：英大基金管理有限公司

住所：北京市朝阳区环球金融中心西塔 22 楼 2201

法定代表人：范育晖

办公地址：北京市朝阳区环球金融中心西塔 22 楼 2201

电话：010-57835666，400-890-5288

传真：010-59112222

联系人：王旭

(三) 出具法律意见书的律师事务所

名称：北京市中伦律师事务所

住所：北京市朝阳区金和东路 20 号院正大中心 3 号南塔 22-31 层

负责人：张学兵

电话：010-59572288

传真：010-65681022/1838

经办律师：刘洪蛟、谢茜

(四) 审计基金财产的会计师事务所

名称：毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)

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

负责人：邹俊

电话：010-85085000

传真：010-85185111

经办注册会计师：龚凯、张一帆

## 第六部分 基金的募集

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》、基金合同及其他有关规定募集，并经中国证监会 2022 年 4 月 15 日证监许可（2022）802 号文准予注册。

本基金为契约型开放式基金。基金存续期限为不定期。募集期自 2022 年 10 月 10 日至 2023 年 1 月 10 日止。经毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）验资，按照每份基金份额面值人民币 1.00 元计算，募集的基金份额及利息转份额共计 297,243,425.19 份基金份额，有效认购户数为 1,946 户。

## 第七部分 基金合同的生效

### 一、基金合同的生效

本基金《基金合同》于 2023 年 1 月 16 日正式生效。自《基金合同》生效日起，本基金管理人正式开始管理本基金。2023 年 8 月 14 日，本基金由于调整托管费率及基金管理人、基金托管人基本信息修订《基金合同》。

### 二、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

基金合同生效后,连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的,基金管理人应当在定期报告中予以披露;连续 60 个工作日出现前述情形的,基金管理人应当于 10 个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案,如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等,并于 6 个月内召开基金份额持有人大会进行表决。

法律法规或中国证监会另有规定时,从其规定。

## 第八部分 基金份额的申购与赎回

### 一、申购和赎回场所

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

本基金不同类别份额的申购、赎回的销售机构可能不同，具体详见招募说明书或相关公告。

### 二、申购和赎回的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。开放日的具体业务办理时间见招募说明书或相关公告。

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

#### 2、申购、赎回开始日及业务办理时间

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

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

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

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

赎回的价格。

### 三、申购与赎回的原则

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

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；

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

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

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

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

### 四、申购与赎回的程序

#### 1、申购和赎回的申请方式

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

#### 2、申购和赎回的款项支付

投资人申购基金份额时，必须在规定时间内全额交付申购款项，投资人全额交付申购款项，申购成立；基金份额登记机构确认基金份额时，申购生效。若资金在规定时间内未全额到账则申购不成立，申购款项将退回投资人账户，基金管理人、基金托管人和销售机构等不承担由此产生的利息等任何损失。

基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；基金份额登记机构确认赎回时，赎回生效。投资者赎回申请生效后，基金管理人将在T+7日（包括该日）内支付赎回款项。在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照本基金合同有关条款处理。

遇交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其他非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程，则赎回款顺延

至上述情形消除后的下一个工作日划出。在发生巨额赎回或本基金合同载明的延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付办法参照本基金合同有关条款处理。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，并按照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上提前公告。

### 3、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T日)，在正常情况下，本基金登记机构在T+1日内对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请，投资人应在T+2日后(包括该日)到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功，则申购款项退还给投资人。

销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表该申请一定生效，而仅代表销售机构确实接收到申购、赎回申请。申购与赎回申请的确认以登记机构的确认结果为准。对于申购、赎回申请及申购、赎回份额的确认情况，投资者应及时查询。

如未来法律法规或监管机构对上述内容另有规定，从其规定。

在法律法规允许的范围内，基金管理人或登记机构可根据相关业务规则，对上述业务办理时间进行调整，本基金管理人将于调整实施前按照有关规定予以公告。

## 五、申购和赎回的数额限制

### 1、申购的数额限制

(1) 投资人通过基金管理人网上交易系统申购时，每笔申购本基金的最低金额为1元，单笔追加申购最低金额为1元，直销柜台每个基金账户首次申购的最低限额为100元，单笔追加申购的最低限额为100元，已在直销中心有认购本基金记录的投资人不受首次申购最低金额的限制。在符合法律法规规定的前提下，各销售机构对申购限额及交易级差有其他规定的，需同时遵循该销售机构的相关规定。已在直销柜台有认购本基金记录的投资人不受首次申购最低金额的限制。投资人将当期分配的基金收益转购基金份额或采用定期定额投资计划时，不受最低申购金额的限制。

(2) 投资人可多次申购，对单个投资人累计持有基金份额不设上限限制。但对于可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或超过50%，或者变相规避50%集中

度的情形，基金管理人有权采取控制措施。

(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。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。具体见基金管理人相关公告。

## 2、赎回的数额限制

基金份额持有人可将其全部或部分基金份额赎回，单笔赎回或转换不得少于 1 份（如该账户在该销售机构托管的该类基金份额余额不足 1 份，则必须一次性赎回或转出该类基金全部份额）；若某笔赎回将导致投资人在该销售机构托管的该类基金份额余额不足 1 份时，基金管理人有权将投资人在该销售机构托管的该类基金剩余份额一次性全部赎回。在符合法律法规规定的前提下，各销售机构对赎回份额限制有其他规定的，需同时遵循该销售机构的相关规定。

3、基金管理人可以规定本基金的总规模限额、单日累计申购金额/净申购金额上限、单个账户单日累计申购金额/净申购金额上限、单笔申购金额上限，具体规定请参见招募说明书或相关公告。

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

## 六、申购和赎回的价格、费用及其用途

### (一) 申购费用和赎回费用

1、本基金基金份额分为 A 类和 C 类基金份额。投资人在申购 A 类基金份额时支付申购费用，申购 C 类基金份额不支付申购费用，而是从该类别基金资产中计提销售服务费。投资人可以多次申购本基金，申购费用按每笔申购申请单独计算。

本基金 A 类基金份额的申购费（率）如下表：

申购费率	申购金额 M（元）（含申购费）	申购费（率）
	M < 100 万	1.20%

	100 万 $\leq$ M<200 万	1.00%
	200 万 $\leq$ M<500 万	0.50%
	M $\geq$ 500 万元	1000 元/笔

本基金 A 类基金份额的申购费用由 A 类基金份额申购人承担,不列入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用。

2、赎回费率随投资人持有基金份额期限的增加而递减,具体赎回费率结构如下表所示:

份额类别	持有期限 (N)	赎回费率
A 类	N<7 日	1.50%
	7 日 $\leq$ N<30 日	0.75%
	30 日 $\leq$ N<6 个月	0.50%
	6 个月 $\leq$ N<12 个月	0.25%
	N $\geq$ 12 个月	0%
C 类	N<7 日	1.50%
	7 日 $\leq$ N<30 日	0.50%
	N $\geq$ 30 日	0%

本基金赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担,在基金份额持有人赎回基金份额时收取。

对于持续持有 A 类基金份额少于 30 日的投资者收取的赎回费,基金管理人将其全额计入基金财产。对于持续持有 A 类基金份额长于等于 30 日但少于 3 个月的投资者收取的赎回费,基金管理人将其总额的 75%计入基金财产。对于持续持有 A 类基金份额长于等于 3 个月但少于 6 个月的投资者收取的赎回费,基金管理人将其总额的 50%计入基金财产。对持续持有 A 类基金份额长于 6 个月的投资者收取的赎回费,基金管理人将赎回费总额的 25%计入基金财产。未计入基金财产的部分用于支付登记结算费和其他必要的手续费。

对持有 C 类基金份额的投资者收取的赎回费全额计入基金财产。

1 个月按 30 日计算。

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

4、基金管理人可以在不违反法律法规规定、基金合同约定和对存量基金份额持有人利益无实质性不利影响的情形下根据市场情况制定基金促销计划,定期或不定期

期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，按中国证监会要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率、赎回费率。

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

## (二) 申购份额和赎回金额的计算

### 1、申购份额的计算及余额的处理方式

申购本基金 A 类基金份额的申购费用采用前端收费模式（即申购基金时缴纳申购费），投资人的申购金额包括申购费用和净申购金额。本基金 C 类基金份额不收取申购费，但从该类别基金资产中计提销售服务费。

(1) 若投资者选择申购 A 类基金份额，则申购份额的计算公式为：

1) 申购费率适用比例费率时：

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

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

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{申购当日该类别基金份额净值}$$

2) 申购费用为固定费用时：

$$\text{申购费用} = \text{固定金额}$$

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

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{申购当日该类别基金份额净值}$$

(2) 若投资者选择申购 C 类基金份额，则申购份额的计算公式为：

$$\text{申购份额} = \text{申购金额} / \text{申购当日该类别基金份额净值}$$

申购份额计算结果按照四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

例：某投资者投资 50,000.00 元申购本基金的 A 类基金份额，假设申购当日 A 类基金份额净值为 1.0500 元，则可得到的 A 类基金份额为：

$$\text{净申购金额} = 50,000.00 / (1 + 1.20\%) = 49,407.11 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 50,000.00 - 49,407.11 = 592.89 \text{ 元}$$

申购份额=49,407.11/1.0500=47,054.39 份

即：投资者投资 50,000.00 元申购本基金的 A 类基金份额，假设申购当日 A 类基金份额净值为 1.0500 元，则其可得到 47,054.39 份 A 类基金份额。

例：某投资者投资 50,000.00 元申购本基金的 C 类基金份额，假设申购当日 C 类基金份额净值为 1.0500 元，则可得到的申购份额为：

申购份额=50,000.00/1.0500=47,619.05 份

即：投资者投资 50,000.00 元申购本基金的 C 类基金份额，假设申购当日 C 类基金份额净值为 1.0500 元，则其可得到 47,619.05 份 C 类基金份额。

## 2、基金赎回金额的计算及处理方式

赎回金额的计算方法如下：

赎回价格=赎回当日 A/C 类基金份额净值

赎回总额=赎回份额×赎回价格

赎回费用=赎回总额×赎回费率

净赎回金额=赎回总额-赎回费用

例：某基金份额持有人赎回本基金 10,000 份 A 类基金份额，持有时间为 30 日，对应的赎回费率为 0.50%，假设赎回当日基金份额净值是 1.0500 元，则其可得到的赎回金额为：

赎回总额=10,000×1.0500=10,500 元

赎回费用=10,500×0.50%=52.50 元

净赎回金额=10,500-52.50=10,447.50 元

即：基金份额持有人赎回 10,000 份 A 类基金份额，持有时间为 30 日，假设赎回当日基金份额净值是 1.0500 元，则其可得到的净赎回金额为 10,447.50 元。

例：某基金份额持有人赎回 10,000 份 C 类基金份额，持有时间为 5 日，对应的赎回费率为 1.50%，假设赎回当日基金份额净值是 1.0500 元，则其可得到的赎回金额为：

赎回总额=10,000×1.0500=10,500 元

赎回费用=10,500×1.50%=157.5 元

净赎回金额=10,500-157.5=10,342.50 元

即：基金份额持有人赎回 10,000 份 C 类基金份额，持有时间为 5 日，假设赎回当日 C 类基金份额净值是 1.0500 元，则其可得到的净赎回金额为 10,342.50 元。

### 3、基金份额净值计算

基金份额净值计算公式：

$T$  日各类基金份额净值 =  $T$  日该类基金资产净值 /  $T$  日该类基金份额总数。

本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，由此产生的收益或损失由基金财产承担。 $T$  日的基金份额净值在当天收市后计算，并在  $T+1$  日内公告。遇特殊情况，经履行适当程序，可以适当延迟计算或公告。为保护基金份额持有人利益，基金管理人与基金托管人协商一致，可阶段性调整基金份额净值计算精度并进行相应公告，无需召开基金份额持有人大会审议。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值。

## 七、申购与赎回的登记

1、投资人  $T$  日申购基金成功后，基金登记机构在  $T+1$  日为投资人登记权益并办理登记手续，投资者自  $T+2$  日（含该日）后有权赎回基金份额。

2、投资人  $T$  日赎回基金成功后，基金登记机构在  $T+1$  日为投资人扣除权益并办理相应的登记手续。

3、基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述登记办理时间进行调整，并最迟于调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

## 八、拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

1、因不可抗力导致基金无法正常运作。

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时。

3、证券/期货交易所或银行间债券交易市场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。

4、基金管理人接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益或对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时。

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

6、基金管理人、基金托管人、基金销售机构或登记机构的技术故障等异常情况导致基金销售系统、基金销售支付结算系统、基金登记系统或基金会计系统无法正常运行。

7、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过 50%，或者通过一致行动人等方式变相规避使单一投资者持有本基金份额占本基金总份额的比例达到或超过 50%集中度的情形时。

8、当一笔新的申购申请被确认成功，使本基金总规模超过基金管理人规定的本基金总规模上限时；或使本基金单日申购金额或净申购比例超过基金管理人规定的当日申购金额或净申购比例上限时；或该投资人累计持有的份额超过单个投资人累计持有的份额上限时；或该投资人当日申购金额超过单个投资人单日或单笔申购金额上限时。

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

10、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第 1、2、3、5、6、9、10 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在规定媒介上刊登暂停申购公告。发生上述第 7、8 项情形时，基金管理人可以采取比例确认等方式对该投资人的申购申请进行限制，基金管理人有权拒绝该等全部或者部分申购申请。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

九、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时。

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

4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

5、发生继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时，基金管理人可暂停接受基金份额持有人的赎回申请。

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

7、基金管理人、基金托管人、登记机构、销售机构、支付结算机构等因异常情况导致基金销售系统、基金销售支付结算系统、基金登记系统、基金会计系统等无法正常运行。

8、本基金的资产组合中的重要部分发生暂停交易或其他重大事件，继续接受赎回可能会影响或损害基金份额持有人利益时。

9、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

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

## 十、巨额赎回的情形及处理方式

### 1、巨额赎回的认定

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

### 2、巨额赎回的处理方式

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

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

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

若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额 10% 的，基金管理人有权对该单个基金份额持有人超出该比例的赎回申请实施延期办理；对该单个基金份额持有人剩余赎回申请，基金管理人可以根据前款“（1）全额赎回”或“（2）部分延期赎回”约定的方式与其他账户的赎回申请一并办理。

如下一开放日，该单个基金份额持有人剩余未赎回部分仍旧超出前一开放日基金总份额的 10% 时，继续按前述规则处理，直至该单个基金份额持有人单个开放日内申请一并办理赎回的基金份额占前一开放日基金总份额的比例低于 10%。

基金管理人在履行适当程序后，有权根据当时市场环境调整前述比例及处理规则，并在规定媒介上进行公告。

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

### 3、巨额赎回的公告

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

### 十一、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

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

2、上述暂停申购或赎回情况消除的，基金管理人应根据暂停申购或赎回的具体情形，于重新开放日公布最近 1 个估值日的各类基金份额净值。

3、基金管理人可以根据暂停申购或赎回的时间，最迟于重新开放日在规定媒介上刊登重新开放申购或赎回的公告；也可以根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间，届时不再另行发布重新开放的公告。

## 十二、基金转换

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

## 十三、基金份额的转让

在法律法规允许且条件具备的情况下，基金管理人在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，履行适当程序后可受理基金份额持有人通过中国证监会认可的交易场所或者交易方式进行份额转让的申请并由登记机构办理基金份额的过户登记。

## 十四、基金的非交易过户

基金的非交易过户是指基金登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资人。

继承是指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；捐赠指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体；司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人或非法人组织。办理非交易过户必须提供基金登记机构要求提供的相关资料，对于符合条件的非交易过户申请按基金登记机构的规定办理，并按基金登记机构规定的标准收费。

## 十五、基金的转托管

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

#### 十六、定期定额投资计划

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

#### 十七、基金份额的冻结和解冻

基金登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻，以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。

基金账户或基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益一并冻结，被冻结部分份额仍然参与收益分配。法律法规或监管机构另有规定的除外。

#### 十八、实施侧袋机制期间本基金的申购与赎回

本基金实施侧袋机制的，本基金的申购和赎回安排详见招募说明书或相关公告。

十九、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。

二十、基金管理人可在法律法规允许的范围内，在不影响基金份额持有人实质利益的前提下，根据市场情况对上述申购和赎回的安排进行补充和调整并提前公告。

## 第九部分 基金的投资

### 一、投资目标

本基金在严格控制风险的前提下,通过对股票与债券等资产进行合理配置,充分利用研究与投资优势,深入挖掘“碳中和”主题所带来的投资机会,力争实现基金资产的长期稳健增值。

### 二、投资范围

本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券(含可分离交易可转债)、可交换债券、证券公司短期公司债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

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

本基金的投资组合比例为:股票投资比例为基金资产的60%-95%。本基金投资碳中和相关的股票的比例不低于非现金基金资产的80%。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金保留的现金(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不低于基金资产净值的5%。

如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

### 三、投资策略

#### 1、大类资产配置策略

本基金采取积极的大类资产配置策略,通过对宏观经济、微观经济运行态势、政策环境、利率走势、证券市场走势及证券市场现阶段的系统性风险以及未来一段

时期内各大类资产的风险和预期收益率进行分析评估,实现投资组合动态管理最优化。

## 2、股票投资策略

### (1) 碳中和主题的界定

根据联合国政府间气候变化专门委员会(Intergovernmental Panel on Climate Change, IPCC)的定义,碳中和也称为净零二氧化碳排放,是指在特定时期内全球人为二氧化碳排放量与二氧化碳消除量相等(如自然碳汇、碳捕获与封存、地球工程等)。本基金将根据国务院印发的《2030年前碳达峰行动方案》,投资标的将围绕“构建清洁低碳安全高效的能源体系”、“工业领域要推进绿色制造”、“交通领域要加快形成绿色低碳运输方式”、“强化科技创新,推动绿色低碳技术实现重大突破,加快推广应用减污降碳技术”、“倡导绿色低碳生活”五大重点领域进行投资。

1)“构建清洁低碳安全高效的能源体系”,提升新能源在我国能源结构的比例,是我国实现碳中和的重要举措。电力设备、公用事业与环保行业通过新型能源替代传统化石能源,减少化石能源燃烧产生的碳排放。

电力设备行业主要关注风电、光伏为主的新能源设备(多晶硅、硅片、组件);提升用电效率的电网设备领域(大电网、配电网建设);新型电力系统相关领域;新能源汽车电池、电机领域(动力电池、电池电机)。

公用事业行业主要关注清洁能源(风电、核电、水电、氢能源)的电力运营商、新能源电站建设。

环保行业主要关注环卫新能源装备及可再生能源、再生资源循环利用。

2)“工业领域要推进绿色制造”将是我国实现碳中和的关键一步。钢铁、化工、有色金属、机械设备行业作为传统碳排大户,通过生产环节技术改造显著减少碳排放。

钢铁行业主要关注使用电炉炼钢的特种钢铁,短流程电炉炼钢,氢能炼钢。

化工行业主要关注生物燃料、生物基材料,可降解塑料、新能源上游材料、轻量化材料(碳纤维、高分子材料)。

有色金属主要关注新能源电池上游核心能源金属包括镍、钴、锂、稀土。

机械设备主要关注有利于电气化推广的生产线设备（光伏设备，锂电设备）、能量装换设备（泵、风机、压缩机）、轨道交通装备、节油发动机、天然气产业链相关设备和自动化装置（电机、变频器、电控）。

3) “交通领域要加快形成绿色低碳运输方式”，是我国实现碳中和的应有之义。汽车与交通运输行业通过交通工具电气化，减少道路运输中的碳排放。

汽车行业主要关注电动车整车制造、电动车零部件、电动车热管理系统、动力电池产业链。

交通运输行业主要关注公路交通电气化（电动汽车、电动卡车）、铁路运输（高铁运输系统）、海运和新能源船舶、节能降低成本的物流服务公司。

4) “强化科技创新，推动绿色低碳技术实现重大突破，加快推广应用减污降碳技术”是达成碳中和的重要措施。计算机、电子行业通过运用工业互联网新技术，革新传统碳排行业，降低自身行业能源消耗，大幅减少企业碳排放。

计算机行业主要关注通过大数据、工业互联网、工业软件技术提升集中化运算而达到减碳的集成式计算机设备、数据中心设备。

电子行业主要关注能耗更低的第三代半导体技术领域，降低能量损失。

5) “倡导绿色低碳生活”是碳中和目标实现的重要组成部分。家电、轻工、建筑装饰行业通过节能减排、生活设施新能源改造方式，显著减少居民生活碳排放。

家用电器主要关注节能房屋照明设施。

轻工制造主要关注固碳领域（林业碳汇）。

建筑装饰行业主要关注新技术绿色建筑（光伏建筑一体化）、园林固碳（园林工程）。

在符合法律法规或监管机构要求并履行适当程序的前提下，基金管理人有权适时对上述定义进行补充和修订。

## （2）行业配置策略

碳中和主题根据所提供的产品与服务类别不同，可划分为不同的细分子行业。本基金将综合考虑经济、政策、技术和估值等因素，进行股票资产在碳中和主题各细分子行业间的动态配置。

1) 经济因素：碳中和主题各细分子行业受宏观经济形势影响，在经济周期各个

阶段的表现不同,预期收益率存在较大差异。本基金将重点配置景气度较高、生产或商业模式前景良好的子行业。

2) 政策因素:本基金将密切关注国家产业政策和行业政策,分析各项政策对碳中和主题各细分子行业的影响,重点配置受益于当时政策或者未来政策变化预期的子行业。

3) 技术因素:技术的发展变革将对碳中和和相关产业产生深远的影响,可能会决定碳中和主题各上市公司的兴衰成败,本基金将关注各细分子行业的技术水平变化及其发展趋势,重点配置整体技术水平提高较快且发展趋势良好的子行业。

4) 估值因素:动态分析各细分领域的相对估值水平,提高被市场低估的子领域配置比例,降低被市场高估的子行业配置比例。

### (3) 个股精选策略

使用定量与定性相结合的方法,从技术能力、市场前景以及公司治理结构等方面对上市公司的基本情况进行分析。

在定量研究方面,本基金基于公司财务指标和运营数据分析公司基本面价值,主要从行业景气度、财务和资产状况、盈利能力以及估值水平等方面考量。主要考察指标具体包括:

1) 成长性指标:主营业务收入增长率、息税折旧前利润增长率、现金流;

2) 盈利指标:毛利率、净资产收益率、投资回报率、企业净利润率等指标。结合相关财务模型的分析,形成对标的股票的初步判断;

3) 估值指标:市盈增长比率(PEG)、市盈率(P/E)、市净率(P/B)、企业价值/息税前利润(EV/EBIT)、企业价值/息税、折旧、摊销前利润(EV/EBITDA)、自由现金流贴现(DCF);

4) 财务指标:净资产收益率(ROE)、毛利率;

5) 研究投入规模指标:研发投入与营业收入比率、科研人员及高学历人员数量及占比、人力投入占比。

在定性研究方面,公司投资研究人员将通过案头研究和实地调研等基本面研究方法深入剖析影响公司未来投资价值的驱动因素,重点关注上市公司在环境友好、社会责任和公司治理等方面的实际履行情况,具体从以下几个方面进行研究。

1) 在技术能力方面,选择研发团队技术实力强、技术的发展与应用前景广阔并且在技术上具有一定护城河的公司;

2) 在市场前景方面,需要考量的因素包括市场的广度、深度、政策扶持的强度以及上市公司利用科技创新能力取得竞争优势、进而开拓市场、创造利润增长的能力;

3) 在公司治理结构方面,将从上市公司的管理层评价、战略定位和管理制度体系等方面进行评价。

### 3、固定收益类资产投资策略

#### (1) 债券投资策略

本基金可投资于国债、央行票据、金融债券、公司债券、企业债券、可转换债券(含可分离交易可转换债券)、可交换债券、次级债券、地方政府债券等债券品种,基金经理通过对收益率、流动性、信用风险和风险溢价等因素的综合评估,合理分配固定收益类证券组合中投资于国债、金融债券、企业债券、短期金融工具等的投资比例,构造债券投资组合。

1) 在选择国债等品种时,本基金将重点分析国债等品种所蕴含的利率风险和流动性风险,根据利率预测模型构造最佳期限结构的国债等投资组合。

2) 在选择金融债券、企业债券等品种时,本基金将重点分析债券的市场风险以及发行人的资信品质。资信品质主要考察发行机构及担保机构的财务结构安全性、历史违约/担保纪录等。

#### 3) 可转换债券及可交换债券投资策略

可转换债券和可交换债券的价值主要取决于其股权价值、债券价值和内嵌期权价值,本基金管理人将对可转换债券和可交换债券的价值进行评估,选择具有较高投资价值的可转换债券、可交换债券进行投资。此外,本基金还将根据新发可转债和可交换债券的预计中签率、模型定价结果,积极参与可转债和可交换债券新券的申购。

#### (2) 资产支持证券投资策略

本基金投资资产支持证券将采取自上而下和自下而上相结合的投资策略。自上而下投资策略指本公司在平均久期配置策略与期限结构配置策略基础上,运用数量

化或定性分析方法对资产支持证券的利率风险、提前偿付风险、流动性风险溢价、税收溢价等因素进行分析，对收益率走势及其收益和风险进行判断。自下而上投资策略指本公司运用数量化或定性分析方法对资产池信用风险进行分析和度量，选择风险与收益相匹配的更优品种进行配置。

### (3) 证券公司短期公司债券投资策略

本基金将根据内部的信用分析方法对可选的证券公司短期公司债券品种进行筛选，并严格控制单只证券公司短期公司债券的投资比例。此外，由于证券公司短期公司债券整体流动性相对较差，本基金将对拟投资或已投资的证券公司短期公司债券进行流动性分析和监测，尽量选择流动性相对较好的品种进行投资，保证本基金的流动性。

### (4) 银行存款、同业存单投资策略

本基金根据宏观经济指标分析各类资产的预期收益率水平，并据此制定和调整资产配置策略。当银行存款、同业存单投资具有较高投资价值时，本基金将提高银行存款、同业存单投资比例。

### (5) 杠杆投资策略

本基金将对资金面进行综合分析的基础上，比较债券收益率、存款利率和融资成本，判断利差空间，力争通过杠杆操作提高组合收益。

## 4、衍生品投资策略

### (1) 股指期货投资策略

在股指期货投资上，本基金以避险保值和有效管理为目标，在控制风险的前提下，谨慎适当参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。

### (2) 国债期货投资策略

本基金可基于谨慎原则，以套期保值为主要目的，运用国债期货对基本投资组合进行管理，提高投资效率。本基金主要采用流动性好、交易活跃的国债期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

## 5、折价和套利策略

本基金可在充分保障流动性需求的情况下，挖掘一些长期投资的机会，在资产

价值低估或者有折价机会的时候介入，将价值回归转化为投资收益。具体包括大宗交易策略、定向增发投资策略等。

#### 四、投资限制

##### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

(1) 本基金股票投资比例为基金资产的 60%-95%。本基金投资碳中和相关的股票的比例不低于非现金基金资产的 80%；

(2) 本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等；

(3) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；

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

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

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

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

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

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

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

(11) 基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

(12) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

(13) 本基金参与股指期货交易和国债期货交易，应当遵循下列要求：

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

2) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值，不得超过基金持有的股票总市值的 20%；在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合《基金合同》关于股票投资比例的有关约定；

3) 本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的 15%；在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值，不得超过基金持有的债券总市值的 30%；在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 30%；本基金所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定；

(14) 本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 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股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 30%；

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

(16) 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；

(17) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述第(2)、(9)、(15)、(16)条外,因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的,基金管理人应当在10个交易日内进行调整,但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的,从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内,本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

如果法律法规或监管部门对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,基金管理人在履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或者活动:

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

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

法律、行政法规或监管部门取消或调整上述限制,如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后,则本基金投资不受上述限制或按调整后的规定执行。

## 五、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：中证环保产业指数收益率×75%+中债综合全价（总值）指数收益率×25%。

其中，中证环保产业指数由中证指数公司编制，该指数从沪深市场中选取100只业务涉及资源管理、清洁技术和产品、污染管理等领域的上市公司，以反映环保产业上市公司证券的走势。

中债综合全价（总值）指数由中央国债登记结算有限责任公司编制，样本债券涵盖的范围全面，具有广泛的市场代表性，涵盖主要交易市场（银行间市场、交易所市场等）、不同发行主体（政府、企业等）和期限（长期、中期、短期等），能够很好地反映中国债券市场总体价格水平和变动趋势，具有良好的债券市场代表性。

如果今后法律法规发生变化，或者上述业绩比较基准停止发布或变更名称，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，基金管理人可以根据本基金的投资范围和投资策略，确定变更基金的比较基准或其权重构成。业绩比较基准的变更需经基金管理人与基金托管人协商一致报中国证监会备案后及时公告，并在更新的招募说明书中列示，无需召开基金份额持有人大会。

## 六、风险收益特征

本基金为混合型证券投资基金，其预期风险和预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金。

## 七、基金管理人代表基金行使相关权利的处理原则及方法

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

2、不谋求对上市公司的控股；

3、有利于基金财产的安全与增值；

4、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

## 八、侧袋机制的实施和投资运作安排

当基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，根据最大限度保护基金份

额持有人利益的原则，基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制，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招募说明书的规定。

## 九、基金的投资组合报告

本投资组合报告所载数据截至 2024 年 6 月 30 日，本报告所列财务数据未经审计。

### 1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	46,008,272.40	87.60
	其中：股票	46,008,272.40	87.60
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	5,977,470.24	11.38
8	其他资产	534,654.43	1.02
9	合计	52,520,397.07	100.00

### 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	2,136,400.00	4.10
B	采矿业	5,848,609.00	11.23
C	制造业	26,773,817.60	51.42

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,062,811.00	15.48
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	222,824.00	0.43
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	800,074.80	1.54
J	金融业	2,163,736.00	4.16
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	46,008,272.40	88.36

## 2. 2报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金于本报告期末未持有港股通股票。

## 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

### 3.1报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	603986	兆易创新	36,600	3,499,692.00	6.72
2	603228	景旺电子	81,847	2,602,734.60	5.00
3	600795	国电电力	426,900	2,557,131.00	4.91
4	600900	长江电力	86,900	2,513,148.00	4.83
5	002876	三利谱	100,600	2,426,472.00	4.66
6	300750	宁德时代	12,200	2,196,366.00	4.22
7	601966	玲珑轮胎	117,800	2,163,986.00	4.16
8	601166	兴业银行	122,800	2,163,736.00	4.16
9	002714	牧原股份	49,000	2,136,400.00	4.10
10	002273	水晶光电	121,600	2,064,768.00	3.97

## 4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金于本报告期末未持有债券。

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

本基金于本报告期末未持有债券。

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

本基金于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

本基金于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

本基金于本报告期末未持有权证。

#### 9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金于本报告期内未参与股指期货投资，报告期末无股指期货持仓。

##### 9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金于本报告期末无股指期货投资。

#### 10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 10.1 本期国债期货投资政策

本基金于本报告期末无国债期货投资。

##### 10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金于报告期内未参与国债期货投资，报告期末无国债期货持仓。

##### 10.3 本期国债期货投资评价

本基金于报告期内未参与国债期货投资，报告期末无国债期货持仓。

#### 11 投资组合报告附注

##### 11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期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

基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

**11.2基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库**

本期内本基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定，也均在基金的备选股票池之内。

**11.3其他资产构成**

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	23,949.91
2	应收证券清算款	510,404.88
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	299.64
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	534,654.43

**11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金于本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

**11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金于本报告期末未持有存在流通受限情况的股票。

**11.6投资组合报告附注的其他文字描述部分**

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## 第十部分 基金的业绩

基金管理人承诺以恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不向投资者保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金合同生效日为2023年1月16日，基金合同生效以来（截至2024年6月30日）的投资业绩及同期基准的比较如下表所示：

英大碳中和混合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
2023.1.16-2023.12.31	-15.88%	0.85%	-26.30%	0.92%	10.42%	-0.07%
2024.1.1-2024.6.30	-2.28%	1.04%	-7.24%	1.10%	4.96%	-0.06%
2023.1.16-2024.6.30	-17.80%	0.92%	-31.64%	0.98%	13.84%	-0.06%

英大碳中和混合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
2023.1.16-2023.12.31	-16.21%	0.85%	-26.30%	0.92%	10.09%	-0.07%
2024.1.1-2024.6.30	-2.48%	1.05%	-7.24%	1.10%	4.76%	-0.05%
2023.1.16-2024.6.30	-18.29%	0.92%	-31.64%	0.98%	13.35%	-0.06%

注：同期业绩比较基准为中证环保产业指数收益率×75%+中债综合全价（总值）指数收益率×25%。

## 第十一部分 基金的财产

### 一、基金资产总值

基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券、期货合约、资产支持证券及票据价值、银行存款本息和基金应收款项以及其他投资所形成的价值总和。

### 二、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### 三、基金财产的账户

基金托管人根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立资金账户、证券账户以及投资所需的其他专用账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

### 四、基金财产的保管和处分

本基金财产独立于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人、基金登记机构和基金销售机构以其自有的财产承担其自身的法律责任，其债权人不得对本基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。除依法律法规和《基金合同》的规定处分外，基金财产不得被处分。

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

## 第十二部分 基金资产的估值

### 一、估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券/期货交易场所的交易日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非交易日。

### 二、估值对象

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

### 三、估值原则

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

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

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

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

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

#### 四、估值方法

##### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

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

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

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

(4) 交易所上市交易的可转换债券以每日收盘价作为估值全价;

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

##### 2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理:

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

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

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

(4) 对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券,对于存在活跃市场的情况下,应以活跃市场上未经调整的报价作为计量日的公允价值进行估值;对于活跃市场报价未能代表计量日公允价值的情况下,应对市场报价进行调整,确认计量日

的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，则采用估值技术确定公允价值。

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

4、同一证券同时在两个或两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。

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

6、本基金投资股指期货合约、国债期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。如法律法规今后另有规定的，从其规定。

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

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

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

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

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

理人对基金资产净值信息的计算结果对外予以公布,对于由此引致的任何结果基金托管人不承担责任。

## 五、估值程序

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

基金管理人每个工作日计算基金资产净值及各类基金份额净值,并按规定公告。

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

## 六、估值错误的处理

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

本基金合同的当事人应按照以下约定处理:

### 1、估值错误类型

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

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

### 2、估值错误处理原则

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

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

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

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

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

(5) 按法律法规规定的其他原则处理估值错误。

### 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

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

### 4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

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

(2) 错误偏差达到基金份额净值的 0.25% 时，基金管理人应当通报基金托管人

并报中国证监会备案;错误偏差达到基金份额净值的0.5%时,基金管理人应当公告,并报中国证监会备案。

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

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

### 七、暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券/期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;

2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时;

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

4、法律法规规定、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

### 八、基金净值的确认

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

### 九、特殊情况的处理方法

1、基金管理人、基金托管人按估值方法的第7项进行估值时,所造成的误差不得作为基金资产估值错误处理。

2、由于不可抗力,或证券/期货交易所、登记结算公司、存款银行等第三方机构发送的数据错误等原因,基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查,但未能发现错误的,由此造成的基金资产估值错误,基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施减轻由此造成的影响。

### 十、实施侧袋机制期间的基金资产估值

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

## 第十三部分 基金的收益与分配

### 一、基金利润的构成

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

### 二、基金可供分配利润

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

### 三、基金收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可根据实际情况进行基金收益分配，具体分配方案以届时的公告为准，若基金合同生效不满3个月则可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；若投资人选择红利再投资方式进行收益分配，收益的计算以权益除权日当日收市后计算的各类基金份额净值为基准转为相应类别的基金份额进行再投资；本基金不同份额类别基金份额，其分红方式相互独立、互不影响；投资者不同基金交易账户设置的基金分红方式相互独立、互不影响；

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

4、本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；如本基金在未来条件成熟时，增减基金份额类别，则同一类别内每一基金份额享有同等分配权。由于本基金各类基金份额收取费用情况不同，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规且对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人、登记机构可对基金收益分配原则和支付方式进行调整，并及时公告，且无需召开基金份额持有人大会。

### 四、收益分配方案

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

#### 五、收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

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

#### 六、基金收益分配中发生的费用

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

#### 七、实施侧袋机制期间的收益分配

本基金实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配，详见招募说明书的规定。

## 第十四部分 基金的费用与税收

### 一、基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、C类基金份额的销售服务费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、审计费、律师费、仲裁费、财产保全费和诉讼费等费用；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券/期货交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、基金的开户费用、账户维护费用；
- 10、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

### 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.2%年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，支付日期顺延。

#### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.2%的年费率计提。托管费的计算方

法如下:

$$H=E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提, 逐日累计至每月月末, 按月支付, 经基金管理人与基金托管人双方核对无误后, 基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等, 支付日期顺延。

### 3、销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费, C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%, 按前一日 C 类基金资产净值的 0.40% 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

基金销售服务费每日计提, 逐日累计至每月月末, 按月支付, 经基金管理人与基金托管人双方核对无误后, 基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内, 从基金财产中一次性支付。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等。若遇法定节假日、公休日等, 支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类”中第 4—10 项费用, 根据有关法规及相应协议规定, 按费用实际支出金额列入当期费用, 由基金托管人从基金财产中支付。

### 三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

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

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;

3、《基金合同》生效前的相关费用;

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

#### 四、实施侧袋机制期间的基金费用

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

#### 五、基金税收

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

## 第十五部分 基金的会计与审计

### 一、基金会计政策

- 1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；
- 2、基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日；基金首次募集的会计年度按如下原则：如果《基金合同》生效少于2个月，可以并入下一个会计年度；
- 3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
- 4、会计制度执行国家有关会计制度；
- 5、本基金独立建账、独立核算；
- 6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；
- 7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以托管协议约定的方式确认。

### 二、基金的年度审计

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

## 第十六部分 基金的信息披露

一、本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《流动性风险管理规定》、《基金合同》及其他有关规定。相关法律法规关于信息披露的规定发生变化时，本基金从其最新规定。

### 二、信息披露义务人

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

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

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

三、本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

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

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

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

### 五、公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

- (一) 基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议、基金产品资料概要

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

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

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

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

基金募集申请经中国证监会注册后，基金管理人在基金份额发售的三日前，将基金份额发售公告、基金招募说明书提示性公告、《基金合同》提示性公告登载在规定报刊上，将基金份额发售公告、基金招募说明书、基金产品资料概要、《基金合同》和基金托管协议登载在规定网站上，并将基金产品资料概要登载在基金销售机构网站或营业网点；基金托管人应当同时将《基金合同》、基金托管协议登载在规定网站上。

## （二）基金份额发售公告

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

## （三）《基金合同》生效公告

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

#### (四) 基金净值信息

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

在开始办理基金份额申购或者赎回后, 基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日, 通过规定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日的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, 在规定网站披露半年度和年度最后一日的基金份额净值和基金份额累计净值。

遇特殊情况, 经履行适当程序, 可以适当延迟计算或公告。

#### (五) 基金份额申购、赎回价格

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

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

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

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

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

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

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

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

法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定。

#### (七) 临时报告

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

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

- 1、基金份额持有人大会的召开及决定的事项；
- 2、终止《基金合同》、基金清算；
- 3、转换基金运作方式、基金合并；
- 4、更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；
- 5、基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；
- 6、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- 7、基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人的实际控制人变更；
- 8、基金募集期延长或提前结束募集；
- 9、基金管理人的高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；
- 10、基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十；
- 11、基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十；
- 12、涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁；
- 13、基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；
- 14、基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实

际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易事项，但中国证监会另有规定的除外；

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百分之零点五；

18、本基金开始办理申购、赎回；

19、本基金发生巨额赎回并延期办理；

20、本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；

21、本基金暂停接受申购、赎回申请或者重新接受申购、赎回申请；

22、新增或调整本基金份额类别设置；

23、基金推出新业务或服务；

24、发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；

25、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；

26、基金信息披露义务人认为可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的其他事项或中国证监会规定的其他事项。

#### （八）澄清公告

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

#### （九）清算报告

《基金合同》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。清算报告应当经过符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计，并由律师事务所出具法律意见书。基金财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

#### （十）基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

#### (十一) 实施侧袋机制期间的信息披露

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

#### (十二) 投资股指期货的信息披露

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

#### (十三) 投资国债期货相关公告

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

#### (十四) 投资资产支持证券的信息披露

基金管理人应在基金年报及中期报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细。

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

#### (十五) 中国证监会规定的其他信息。

本基金投资证券公司短期公司债券将进行临时公告, 并在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书(更新)等文件中披露证券公司短期公司债券的投资情况。

### 六、信息披露事务管理

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

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

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

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

为强化投资者保护,提升信息披露服务质量,基金管理人应当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,基金销售机构应当按照中国证监会规定做好信息传递工作。

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

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

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

## 七、信息披露文件的存放与查阅

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

## 八、暂停或延迟信息披露的情形

当出现下述情况时,基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金相关信息:

- 1、不可抗力;
- 2、基金投资所涉及的证券/期货交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;
- 3、当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上的,经与基金托管人协商一

致，基金管理人暂停估值的；

4、法律法规规定、中国证监会或基金合同认定的其他情形。

## 第十七部分 侧袋机制

### 一、侧袋机制的实施条件、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。基金管理人应当在启用侧袋机制后及时发布临时公告，并及时聘请符合《证券法》规定的会计师事务所进行审计并披露专项审计意见。

### 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份额的，该申购、赎回或转换申请将被拒绝。

2、当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上的，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停基金估值，并暂停接受基金申购赎回申请或延缓支付赎回款项。

3、基金管理人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，具体事项届时由基金管理人在相关公告中规定。

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以“基金简称+

侧袋标识 S+侧袋账户建立日期”格式设定,同时主袋账户份额的名称增加大写字母 M 标识作为后缀。基金所有侧袋账户注销后,将取消主袋账户份额名称中的 M 标识。

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

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

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

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

### (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。如法律法规对于侧袋账户资产托管费的收取另有规定的,以法律法规最新要求为准。因启用侧袋机制产生的咨询、审计费用等由基金管理人承担。

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

### (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。侧袋账户份额不再适用基金合同的收益与分配条款。

### (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份额净值和基金份额累计净值。

#### 2、定期报告

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

- (1) 侧袋账户的基金代码、基金名称、侧袋账户成立日期等基本信息;
- (2) 侧袋账户的初始资产、初始负债;
- (3) 特定资产的名称、代码、发行人等基本信息;
- (4) 报告期内的特定资产处置进展情况、与处置特定资产相关的费用情况及其他与特定资产状况相关的信息;
- (5) 可根据特定资产处置进展情况披露特定资产的可变现净值或净值参考区间,该净值或净值区间并不代表特定资产最终的变现价格,不作为基金管理人对特定资产最终变现价格的承诺;
- (6) 可能对投资者利益存在重大影响的其他情况及相关风险提示。

#### 3、临时报告

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

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

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

#### (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。

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

#### (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。

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

## 第十八部分 风险揭示

基金管理人秉承“审慎投资，追求收益、风险、流动性三者之间的有机平衡”的投资管理原则。在保证资产风险可控的情况下，追求稳健、持续的超额收益。为此，英大基金根据行业的风险管理经验，并结合本基金特点建立了一套系统的风险管理体系，综合外部支持与内部研究，定性研判与定量解析，人工经验归纳总结与计算机智能辅助识别等，从多维度对基金资产风险进行识别和管理。

以下对基金可能面临的各项主要风险及对应的防范措施加以陈述：

### 一、市场风险

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

#### 1、政策风险

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

#### 2、经济周期风险

随着经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化，基金投资的收益水平也会随之变化，从而产生风险。

#### 3、利率风险

金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着债券的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。基金投资于债券，其收益水平可能会受到利率变化的影响。

#### 4、上市公司经营风险

上市公司的经营状况受多种因素的影响，如管理能力、行业竞争、市场前景、技术更新、财务状况、新产品研究开发等都会导致公司盈利发生变化。如果基金所投资的上市公司经营不善，其股票价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，使基金投资收益下降。上市公司还可能出现难以预见的变化。虽然基金可以通过投资多样化来分散这种非系统风险，但不能完全避免。特别地，如果上市公司涉嫌财

务操纵、内幕交易、关联交易等情形,或被监管部门处罚,将严重损害持有人利益。

#### 5、购买力风险

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

6、信用风险。基金所投资企业债券的发行人如出现违约、无法支付到期本息,或由于企业债券发行人信用等级降低导致债券价格下降,将造成基金资产损失。

### 二、管理风险

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

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

### 三、杠杆放大风险

本基金或采用杠杆操作、息差放大的投资策略,市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险均会相应增加,特别是当收益率的实际走势与预期走势相反的情况下,市场出现融资的成本高于买入的债券的收益率,杠杆放大从而导致委托资产净值出现较大的损失。

### 四、流动性风险

流动性风险是指因证券市场交易量不足,导致证券不能迅速、低成本地转变为现金的风险。流动性风险还包括由于本基金出现投资者巨额赎回,致使本基金没有足够的现金应付基金赎回支付的要求所引致的风险。

#### 1、基金申购、赎回安排

本基金申购、赎回安排详见本招募说明书“第八部分 基金份额的申购与赎回”章节。

#### 2、拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具(包括国内依法发行上市的股票、债券、资产支持证券、货币市场工具、股指期货等)。本基金投资的债券资产为在银行间市场或交易所市场有连续定价的标准化债券。通常情况下,本基金投资标的的流动性较好;而对于流动性相对较差的金融工具,本基金将根据产品本身的流动性安排,严格控制相应品种的投资比例。

本基金管理人在进行基金投资标的的筛选及投资时会充分考虑被投资标的的流动性,但是在特殊市场环境下本基金仍有可能出现流动性不足的情形。本基金管理人将根据历史经验和现实条件,制定出现金持有量的上下限计划,在该限制范围内进行现金比例调控或现金与证券的转化。同时,本基金管理人会进行标的的分散化投资并结合对各类标的资产的预期流动性合理进行资产配置,以防范流动性风险。同时,每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金持有现金或者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%。现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

综上所述,本基金投资市场、行业及资产的流动性良好,流动性风险相对可控。

### 3、巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

基金出现巨额赎回情形下,基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况或巨额赎回份额占比情况决定全额赎回或部分延期赎回。同时,如本基金单个基金份额持有人在单个开放日申请赎回基金份额超过基金总份额一定比例以上的,基金管理人有权对其采取延期办理赎回申请的措施。

### 4、实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响

在市场大幅波动、流动性枯竭等极端情况下发生无法应对投资者巨额赎回的情形时,基金管理人经与基金托管人协商一致,在确保投资者得到公平对待的前提下,可依照法律法规及基金合同的约定,综合运用各类流动性风险管理工具,对赎回申请进行适度调整,作为特定情形下基金管理人流动性风险管理的辅助措施,包括但不限于:

#### (1) 延期办理巨额赎回申请

具体措施详见招募说明书“第八部分 基金份额的申购与赎回”中“十、巨额赎回的情形及处理方式”的相关内容。

在此情形下，投资人完成基金赎回时的基金份额净值可能与其提交赎回申请时的基金份额净值不同。

#### (2) 暂停接受赎回申请

具体措施详见招募说明书“第八部分 基金份额的申购与赎回”中“九、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形”的相关内容。

在此情形下，投资人的部分或全部赎回申请可能会被拒绝。

#### (3) 延缓支付赎回款项

具体措施详见招募说明书“第八部分 基金份额的申购与赎回”中“九、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形”的相关内容。

在此情形下，投资人接收赎回款项的时间将可能比一般正常情况下有所延迟。

#### (4) 收取短期赎回费

本基金对持续持有期少于7日的投资者收取不低于1.50%的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产。

#### (5) 暂停基金估值

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

在此情形下，投资人没有可供参考的基金份额净值，同时赎回申请可能被暂停接受，或被延期支付赎回款项。

#### (6) 摆动定价

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

当基金采用摆动定价时，投资者申购或赎回基金份额时的基金份额净值，将会根据投资组合的市场冲击成本而进行调整，使得市场的冲击成本能够分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待。

#### (7) 实施侧袋机制

侧袋机制是一种流动性风险管理工具，是将特定资产分离至一个专门的侧袋账

户进行处置清算，并以处置变现后的款项向基金份额持有人进行支付，目的在于有效隔离并化解风险。

当本基金启用侧袋机制后，侧袋账户份额将停止披露基金份额净值，并不得办理申购、赎回和转换，仅主袋账户份额正常开放赎回，因此启用侧袋机制时持有基金份额的持有人将在启用侧袋机制后同时持有主袋账户份额和侧袋账户份额，侧袋账户份额不能赎回，其对应特定资产的变现时间具有不确定性，最终变现价格也具有不确定性并且有可能大幅低于启用侧袋机制时的特定资产的估值，基金份额持有人可能因此面临损失。

实施侧袋机制期间，因本基金不披露侧袋账户份额的净值，即便基金管理人在基金定期报告中披露报告期末特定资产可变现净值或净值区间的，也不作为特定资产最终变现价格的承诺，因此对于特定资产的公允价值和最终变现价格，基金管理人不承担任何保证和承诺的责任。基金管理人将根据主袋账户运作情况合理确定申购政策，因此实施侧袋机制后主袋账户份额存在暂停申购的可能。启用侧袋机制后，基金管理人计算各项投资运作指标和基金业绩指标时仅需考虑主袋账户资产，基金业绩指标应当以主袋账户资产为基准，因此本基金披露的业绩指标不能反映特定资产的真实价值及变化情况。

(8) 中国证监会认定的其他措施。

当实施上述备用的流动性风险管理工具时，投资者将可能面临其赎回申请被拒绝或延期办理、赎回款项延缓支付，或面临赎回成本或申购成本较高等风险。

## 五、合规风险

### 1、合规风险识别

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

### 2、合规风险防范措施

基金管理人严格按照经注册的《英大碳中和混合型证券投资基金基金合同》等相关要求，开展本基金的申请、成立及报备、日常投资管理等业务。

基金管理人的风险管理部和其他部门设有专人跟踪研究、分析有关政策的最新动态。根据政策法规的变化和公司内控制度的规定，定期或不定期地梳理风险控制

流程和修订风险控制制度。

基金管理人的监察稽核部、风险管理部和其他相关部门负责对基金中各种相关合同进行事前实质性审核，并在投资交易系统中设置和维护法律法规中有关投资限制的各项风控指标以及基金经理的投资权限等。

交易系统设有“预警”、“拒绝接受交易指令”两道风险防线，一旦有关指标接近或达到风险警戒线时，系统会自动发出警告信号或限制投资经理的违规行为，确保基金的合规性。

## 六、信用风险及违约风险

### 1、信用风险识别

基金在交易过程中可能发生对手交收违约或者所投资债券的发行人违约、拒绝支付到期本息的情况，称为交易对手信用风险。债券发行人信用等级降低导致债券价格下降或者上市公司信息披露不真实、不完整导致计划持有的债券价格下跌，称为交易品种的信用风险。

### 2、信用风险防范措施

本基金管理人参考国际大型金融机构推荐的内部风险评级法，结合国内的资信评级公司的成果建立独特的量化信用风险管理模型。对投资证券的违约率（PD），违约风险暴露（EAD）及违约损失率（LGD）等指标进行估算，并最终得出内部参考信用等级。封闭期内，如本基金持有债券的信用风险显著增加时，为减少信用损失，本基金将对该债券进行处置。

## 七、技术风险

### 1、技术风险识别

在基金的日常交易中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致基金份额持有人利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理人、基金托管人、证券交易所、证券登记结算机构、登记机构及销售机构等。

### 2、技术风险防范措施

严格按照金融行业监管部门要求配置各种技术系统，实现了双网络通信，双电源供电，重要技术系统均实现双机冷备份或热备份。

同时，建立各种技术支持系统，从技术层面对投资风险进行控制。建立有效的

内部监控技术系统,如电脑预警系统、投资监控系统等,对可能出现的各种风险进行全面和实时的监控。

## 八、操作风险

### 1、操作风险识别

操作风险包括:基金管理人、证券交易所、注册登记机构等在业务操作过程中,因操作失误或违反操作规程而引起的风险;因人为因素而产生的风险、如内幕交易、欺诈行为等产生的风险;因制度建设、人员配备、内控制度建立等方面不完善而产生的风险;对主要业务人员如投资主办人员的依赖而可能产生的风险。

### 2、操作风险管理

建立完善科学的投资、风险评估和风控制度,在制度层面对操作风险进行防范和控制。具体包括:建立和健全公司的投资制度、流程,明确投资过程中各风险控制点关键指标及责任人员;建立和完善研究向投资转化的各项制度;对日常投资过程中采取适当的程序和方法分析和评估与本基金运作有关的风险;建立有效的风险控制制度等。

建立独立的财务管理制度,对不同的基金账户进行分账管理、独立核算,减少手工操作,在技术上实现后台业务流程的全部计算机化。同时加强在后台不同部门之间,以及销售机构、注册登记机构间数据的交叉核对。

## 九、本基金的特有风险

1、本基金为混合型证券投资基金,存在大类资产配置风险,有可能因为受到经济周期、市场环境或管理人能力等因素的影响,导致基金的大类资产配置比例偏离最优化水平,给基金投资组合的绩效带来风险。

2、本基金可投资于股指期货,股指期货作为一种金融衍生品,主要存在以下风险:

- (1) 市场风险:是指由于股指期货价格变动而给投资者带来的风险。
- (2) 流动性风险:是指由于股指期货合约无法及时变现所带来的风险。
- (3) 基差风险:是指股指期货合约价格和指数价格之间的价格差的波动所造成的风险。
- (4) 保证金风险:是指由于无法及时筹措资金满足建立或者维持股指期货合约

头寸所要求的保证金而带来的风险。

(5) 信用风险：是指期货经纪公司违约而产生损失的风险。

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

### 3、国债期货投资风险

本基金的投资范围包括国债期货，国债期货的投资可能面临市场风险、基差风险、流动性风险。市场风险是因期货市场价格波动使所持有的期货合约价值发生变化的风险。基差风险是期货市场的特有风险之一，是指由于期货与现货间的价差的波动，影响套期保值或套利效果，使之发生意外损益的风险。流动性风险可分为两类：一类为流通量风险，是指期货合约无法及时以所希望的价格建立或了结头寸的风险，此类风险往往是由市场缺乏广度或深度导致的；另一类为资金量风险，是指资金量无法满足保证金要求，使得所持有的头寸面临被强制平仓的风险。

4、资产支持证券的风险：本基金的投资范围包括资产支持证券，投资于资产支持证券的风险主要包括信用风险、利率风险、流动性风险、提前偿付风险等，信用风险指发行主体违约的风险，是资产支持证券最大的风险。利率风险指由于利率发生变化和波动使得资产支持证券价格和利息产生波动，从而影响到基金业绩。流动性风险是由于资产支持证券交易不活跃导致的风险。提前偿付风险指由于发行方提前偿还所导致的收益率下降的风险。

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

6、本基金可投资流通受限证券，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值，本基金的基金净值可能由于估值方法的原因偏离所持有证券的收盘价所对应的净值，因此，投资者在申购赎回时，需考虑估值方法对基金净值的影响。另外，本基金可能由于投资流通受限证券而面临流动性风险以及流通受限期间内证券价格大幅下跌的风险。

以上所述因素可能会给本基金投资带来特殊交易风险。

## 十、基金财产投资运营过程中的增值税

鉴于基金管理人为本基金的利益投资、运用基金财产过程中,可能因法律法规、税收政策的要求而成为纳税义务人,就归属于基金的投资收益、投资回报和/或本金承担纳税义务。因此,本基金运营过程中由于上述原因发生的增值税等税负,仍由本基金财产承担,届时基金管理人与基金托管人可能通过本基金财产账户直接缴付,或划付至基金管理人账户并由基金管理人依据税务部门要求完成税款申报缴纳。

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

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

## 十二、其他风险

基金管理人因停业、解散、撤销、破产或者被中国证监会撤销相关业务许可、责令停业整顿等原因不能履行职责,可能导致基金的损失,从而带来风险。

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

其他风险防范措施,在基金的运作过程中如出现以上重大事项时,基金管理人将及时发布公告,并向基金管理人住所地中国证监会派出机构报告。

## 十三、声明

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

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

## 第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### 一、《基金合同》的变更

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

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

### 二、《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：

1、基金份额持有人大会决定终止的；

2、基金管理人、基金托管人职责终止，在6个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；

3、《基金合同》约定的其他情形；

4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### 三、基金财产的清算

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

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

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

4、基金财产清算程序：

(1) 《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；

(2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；

- (3) 对基金财产进行估值和变现;
- (4) 制作清算报告;
- (5) 聘请符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所对清算报告进行外部审计, 聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书;
- (6) 将清算报告报中国证监会备案并公告;
- (7) 对基金剩余财产进行分配。

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

#### 四、清算费用

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

#### 五、基金财产清算剩余资产的分配

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

#### 六、基金财产清算的公告

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

#### 七、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 第二十部分 基金合同的内容摘要

### 一、基金管理人、基金托管人和基金份额持有人的权利、义务

#### (一) 基金管理人的权利与义务

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

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

提供服务的外部机构;

(16) 在符合有关法律、法规的前提下,制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、定期定额投资和非交易过户等的业务规则;

(17) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

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

(2) 办理基金备案手续;

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

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

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

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

(7) 依法接受基金托管人的监督;

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

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;

(10) 编制季度报告、中期报告和年度报告;

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

(12) 保守基金商业秘密,不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前应予保密,不向

他人泄露（但依法向监管机构、司法机关、交易所及审计、法律等外部专业顾问提供的除外）；

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

（14）按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

- (25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议;
- (26) 建立并保存基金份额持有人名册;
- (27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## (二) 基金托管人的权利与义务

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

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

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

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

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

(5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

(6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

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

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

(4) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产

为自己及任何第三人谋取非法利益，不得委托第三人托管基金财产；

(5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

(6) 按规定开设基金财产的资金账户、证券账户和期货结算账户(如有)等投资所需账户，按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

(7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露(但向监管机构、司法机关等有权机关、基金托管人上市的证券交易所或因审计、法律等向外部专业顾问提供的情况除外)；

(8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购、赎回价格；

(9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

(10) 对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行；如果基金管理人未执行《基金合同》规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

(11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；

(12) 从基金管理人或其委托的登记机构处接收并保存基金份额持有人名册；

(13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

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

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

(16) 按照《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；

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

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

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

(20) 基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时, 应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿;

(21) 执行生效的基金份额持有人大会的决议;

(22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

### (三) 基金份额持有人的权利与义务

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

同一类别每份基金份额具有同等的合法权益。

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

(1) 分享基金财产收益;

(2) 参与分配清算后的剩余基金财产;

(3) 根据基金合同的约定, 依法转让或者申请赎回其持有的基金份额;

(4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会;

(5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会, 对基金份额持有人大会审议事项行使表决权;

(6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料;

(7) 监督基金管理人的投资运作;

(8) 对基金管理人、基金托管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁;

(9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

(1) 认真阅读并遵守《基金合同》、招募说明书等信息披露文件;

- (2) 了解所投资基金产品,了解自身风险承受能力,自主判断基金的投资价值,自主做出投资决策,自行承担投资风险;
- (3) 关注基金信息披露,及时行使权利和履行义务;
- (4) 交纳基金认购、申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用;
- (5) 在其持有的基金份额范围内,承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任;
- (6) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动;
- (7) 执行生效的基金份额持有人大会的决议;
- (8) 返还在基金交易过程中因各种原因获得的不当得利;
- (9) 提供基金管理人和监管机构依法要求提供的信息,以及不时的更新和补充,并保证其真实性;
- (10) 遵守基金管理人、基金托管人、销售机构和登记机构的相关交易及业务规则;
- (11) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## 二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成,基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。除法律法规另有规定或基金合同另有约定外,基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

本基金不设立基金份额持有人大会的日常机构,如将来设立基金份额持有人大会的日常机构,日常机构的设立按照相关法律法规的要求执行。

### (一) 召开事由

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

- (1) 终止《基金合同》;
- (2) 更换基金管理人;
- (3) 更换基金托管人;
- (4) 转换基金运作方式;
- (5) 调整基金管理人、基金托管人的报酬标准;

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

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

- (1) 法律法规要求增加的基金费用的收取;
- (2) 在法律法规和基金合同规定的范围内增加或调整本基金的基金份额类别、对基金份额分类办法及规则进行调整、停止现有基金份额类别的销售、调整申购费率、调低赎回费率或销售服务费、变更收费方式;
- (3) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改;
- (4) 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生重大变化;
- (5) 基金管理人、销售机构、登记机构在法律法规规定的范围内调整有关基金认购、申购、赎回、转换、基金交易、非交易过户、转托管、转让、质押等业务的规则;
- (6) 在法律法规或中国证监会允许的范围内推出新业务或服务;
- (7) 按照本基金合同的约定,变更业绩比较基准;
- (8) 按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

## (二) 会议召集人及召集方式

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

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。

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

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

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

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

## (三) 召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前30日，在规定报刊和规定

网站公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

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

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

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

#### (四) 基金份额持有人出席会议的方式

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

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

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

(2) 经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效

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

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式或基金合同约定的其他方式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式或基金合同约定的其他方式进行表决。

在同时符合以下条件时,通讯开会的方式视为有效:

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

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

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

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

3、在不与法律法规和监管机构的规定相冲突的前提下,本基金份额持有人大会亦可采用网络、电话、短信等其他非现场方式或者以非现场方式与现场方式相结合的方式召开,会议程序参照现场开会或通讯开会的程序进行。基金份额持有人可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式进行表决,由会议召集人确定并在会议通知中列明。

4、在法律法规和监管机关允许的情况下,本基金的基金份额持有人也可以采用其他书面或非书面方式授权其代理人出席基金份额持有人大会并行使表决权,授权方式可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式,具体方式在会议通知中列明。

#### (五) 议事内容与程序

##### 1、议事内容及提案权

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

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

##### 2、议事程序

###### (1) 现场开会

在现场开会的方式下,首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人,然后由大会主持人宣读提案,经讨论后进行表决,并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表,在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下,由基金托管人授权其出席会议的代表主持;如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会,则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的50%以上(含50%)选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会,不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名(或

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

## (2) 通讯开会

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

## (六) 表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议:

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

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

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

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

## (七) 计票

### 1、现场开会

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

人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

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

(3) 如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有怀疑，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

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

## 2、通讯开会

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

### (八) 生效与公告

基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

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

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

### (九) 实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定

若本基金实施侧袋机制，则相关基金份额或表决权的比例指主袋份额持有人和

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

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

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

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

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

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

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

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

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，同一类别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上文相关规定。

（十）本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人与基金托管人协商一致并提前公

告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

### 三、基金的收益与分配、执行方式

#### (一) 基金利润的构成

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

#### (二) 基金可供分配利润

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

#### (三) 基金收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可根据实际情况进行基金收益分配，具体分配方案以届时的公告为准，若基金合同生效不满3个月则可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；若投资人选择红利再投资方式进行收益分配，收益的计算以权益除权日当日收市后计算的各类基金份额净值为基准转为相应类别的基金份额进行再投资；本基金不同份额类别基金份额，其分红方式相互独立、互不影响；投资者不同基金交易账户设置的基金分红方式相互独立、互不影响；

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

4、本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；如本基金在未来条件成熟时，增减基金份额类别，则同一类别内每一基金份额享有同等分配权。由于本基金各类基金份额收取费用情况不同，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规且对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人、登记机构可对基金收益分配原则和支付方式进行调整，并及时公告，且无需召开基金份额持有人大会。

#### (四) 收益分配方案

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

#### (五) 收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

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

#### (六) 基金收益分配中发生的费用

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

#### (七) 实施侧袋机制期间的收益分配

本基金实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配，详见招募说明书的规定。

### 四、与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例

#### (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、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、审计费、律师费、仲裁费、财产保全费和诉讼费等费用；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券/期货交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、基金的开户费用、账户维护费用；
- 10、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费

用。

## (二) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.2% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，支付日期顺延。

### 2、基金托管人的托管费

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，支付日期顺延。

### 3、销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%，按前一日 C 类基金资产净值的 0.40% 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

基金销售服务费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付,经基金管理人与基金托管人双方核对无误后,基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内,从基金财产中一次性支付。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等。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类”中第 4—10 项费用,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

(三) 不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

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

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;

3、《基金合同》生效前的相关费用;

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

(四) 实施侧袋机制期间的基金费用

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

(五) 基金税收

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

## 五、基金财产的投资方向和投资限制

(一) 投资目标

本基金在严格控制风险的前提下,通过对股票与债券等资产进行合理配置,充分利用研究与投资优势,深入挖掘“碳中和”主题所带来的投资机会,力争实现基金资产的长期稳健增值。

(二) 投资范围

本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券、证券公司短期公司债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

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

本基金的投资组合比例为：股票投资比例为基金资产的 60%-95%。本基金投资碳中和相关的股票的比例不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金（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不低于基金资产净值的 5%。

如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

### （三）投资策略

#### 1、大类资产配置策略

本基金采取积极的大类资产配置策略，通过对宏观经济、微观经济运行态势、政策环境、利率走势、证券市场走势及证券市场现阶段的系统性风险以及未来一段时期内各大类资产的风险和预期收益率进行分析评估，实现投资组合动态管理最优化。

#### 2、股票投资策略

##### （1）碳中和主题的界定

根据联合国政府间气候变化专门委员会（Intergovernmental Panel on Climate Change, IPCC）的定义，碳中和也称为净零二氧化碳排放，是指在特定时期内全球人为二氧化碳排放量与二氧化碳消除量相等（如自然碳汇、碳捕获与封存、地球工

程等)。本基金将根据国务院印发的《2030年前碳达峰行动方案》，投资标的将围绕“构建清洁低碳安全高效的能源体系”、“工业领域要推进绿色制造”、“交通领域要加快形成绿色低碳运输方式”、“强化科技创新，推动绿色低碳技术实现重大突破，加快推广应用减污降碳技术”、“倡导绿色低碳生活”五大重点领域进行投资。

1)“构建清洁低碳安全高效的能源体系”，提升新能源在我国能源结构的比例，是我国实现碳中和的重要举措。电力设备、公用事业与环保行业通过新型能源替代传统化石能源，减少化石能源燃烧产生的碳排放。

电力设备行业主要关注风电、光伏为主的新能源设备（多晶硅、硅片、组件）；提升用电效率的电网设备领域（大电网、配电网建设）；新型电力系统相关领域；新能源汽车电池、电机领域（动力电池、电池电机）。

公用事业行业主要关注清洁能源（风电、核电、水电、氢能源）的电力运营商、新能源电站建设。

环保行业主要关注环卫新能源装备及可再生能源、再生资源循环利用。

2)“工业领域要推进绿色制造”将是我国实现碳中和的关键一步。钢铁、化工、有色金属、机械设备行业作为传统碳排大户，通过生产环节技术改造显著减少碳排放。

钢铁行业主要关注使用电炉炼钢的特种钢铁，短流程电炉炼钢，氢能炼钢。

化工行业主要关注生物燃料、生物基材料，可降解塑料、新能源上游材料、轻量化材料（碳纤维、高分子材料）。

有色金属主要关注新能源电池上游核心能源金属包括镍、钴、锂、稀土。

机械设备主要关注有利于电气化推广的生产线设备（光伏设备，锂电设备）、能量装换设备（泵、风机、压缩机）、轨道交通装备、节油发动机、天然气产业链相关设备和自动化装置（电机、变频器、电控）。

3)“交通领域要加快形成绿色低碳运输方式”，是我国实现碳中和的应有之义。汽车与交通运输行业通过交通工具电气化，减少道路运输中的碳排放。

汽车行业主要关注电动车整车制造、电动车零部件、电动车热管理系统、动力电池产业链。

交通运输行业主要关注公路交通电气化(电动汽车、电动卡车)、铁路运输(高铁运输系统)、海运和新能源船舶、节能降低成本的物流服务公司。

4)“强化科技创新,推动绿色低碳技术实现重大突破,加快推广应用减污降碳技术”是达成碳中和的重要措施。计算机、电子行业通过运用工业互联网新技术,革新传统碳排行业,降低自身行业能源消耗,大幅减少企业碳排放。

计算机行业主要关注通过大数据、工业互联网、工业软件技术提升集中化运算而达到减碳的集成式计算机设备、数据中心设备。

电子行业主要关注能耗更低的第三代半导体技术领域,降低能量损失。

5)“倡导绿色低碳生活”是碳中和目标实现的重要组成部分。家电、轻工、建筑装饰行业通过节能减排、生活设施新能源改造方式,显著减少居民生活碳排放。

家用电器主要关注节能房屋照明设施。

轻工制造主要关注固碳领域(林业碳汇)。

建筑装饰行业主要关注新技术绿色建筑(光伏建筑一体化)、园林固碳(园林工程)。

在符合法律法规或监管机构要求并履行适当程序的前提下,基金管理人有权适时对上述定义进行补充和修订。

## (2) 行业配置策略

碳中和主题根据所提供的产品与服务类别不同,可划分为不同的细分子行业。本基金将综合考虑经济、政策、技术和估值等因素,进行股票资产在碳中和主题各细分子行业间的动态配置。

1)经济因素:碳中和主题各细分子行业受宏观经济形势影响,在经济周期各个阶段的表现不同,预期收益率存在较大差异。本基金将重点配置景气度较高、生产或商业模式前景良好的子行业。

2)政策因素:本基金将密切关注国家产业政策和行业政策,分析各项政策对碳中和主题各细分子行业的影响,重点配置受益于当时政策或者未来政策变化预期的子行业。

3)技术因素:技术的发展变革将对碳中和和相关产业产生深远的影响,可能会决定碳中和主题各上市公司的兴衰成败,本基金将关注各细分子行业的技术水平变化

及其发展趋势，重点配置整体技术水平提高较快且发展趋势良好的子行业。

4) 估值因素：动态分析各细分领域的相对估值水平，提高被市场低估的子领域配置比例，降低被市场高估的子行业配置比例。

### (3) 个股精选策略

使用定量与定性相结合的方法，从技术能力、市场前景以及公司治理结构等方面对上市公司的基本情况进行分析。

在定量研究方面，本基金基于公司财务指标和运营数据分析公司基本面价值，主要从行业景气度、财务和资产状况、盈利能力以及估值水平等方面考量。主要考察指标具体包括：

1) 成长性指标：主营业务收入增长率、息税折旧前利润增长率、现金流；

2) 盈利指标：毛利率、净资产收益率、投资回报率、企业净利润率等指标。结合相关财务模型的分析，形成对标的股票的初步判断；

3) 估值指标：市盈增长比率（PEG）、市盈率（P/E）、市净率（P/B）、企业价值/息税前利润（EV/EBIT）、企业价值/息税、折旧、摊销前利润（EV/EBITDA）、自由现金流贴现（DCF）；

4) 财务指标：净资产收益率（ROE）、毛利率；

5) 研究投入规模指标：研发投入与营业收入比率、科研人员及高学历人员数量及占比、人力投入占比。

在定性研究方面，公司投资研究人员将通过案头研究和实地调研等基本面研究方法深入剖析影响公司未来投资价值的驱动因素，重点关注上市公司在环境友好、社会责任和公司治理等方面的实际履行情况，具体从以下几个方面进行研究。

1) 在技术能力方面，选择研发团队技术实力强、技术的发展与应用前景广阔并且在技术上具有一定护城河的公司；

2) 在市场前景方面，需要考量的因素包括市场的广度、深度、政策扶持的强度以及上市公司利用科技创新能力取得竞争优势、进而开拓市场、创造利润增长的能力；

3) 在公司治理结构方面，将从上市公司的管理层评价、战略定位和管理制度体系等方面进行评价。

### 3、固定收益类资产投资策略

#### (1) 债券投资策略

本基金可投资于国债、央行票据、金融债券、公司债券、企业债券、可转换债券(含可分离交易可转换债券)、可交换债券、次级债券、地方政府债券等债券品种,基金经理通过对收益率、流动性、信用风险和风险溢价等因素的综合评估,合理分配固定收益类证券组合中投资于国债、金融债券、企业债券、短期金融工具等的投资比例,构造债券投资组合。

1) 在选择国债等品种时,本基金将重点分析国债等品种所蕴含的利率风险和流动性风险,根据利率预测模型构造最佳期限结构的国债等投资组合。

2) 在选择金融债券、企业债券等品种时,本基金将重点分析债券的市场风险以及发行人的资信品质。资信品质主要考察发行机构及担保机构的财务结构安全性、历史违约/担保纪录等。

#### 3) 可转换债券及可交换债券投资策略

可转换债券和可交换债券的价值主要取决于其股权价值、债券价值和内嵌期权价值,本基金管理人将对可转换债券和可交换债券的价值进行评估,选择具有较高投资价值的可转换债券、可交换债券进行投资。此外,本基金还将根据新发可转债和可交换债券的预计中签率、模型定价结果,积极参与可转债和可交换债券新券的申购。

#### (2) 资产支持证券投资策略

本基金投资资产支持证券将采取自上而下和自下而上相结合的投资策略。自上而下投资策略指本公司在平均久期配置策略与期限结构配置策略基础上,运用数量化或定性分析方法对资产支持证券的利率风险、提前偿付风险、流动性风险溢价、税收溢价等因素进行分析,对收益率走势及其收益和风险进行判断。自下而上投资策略指本公司运用数量化或定性分析方法对资产池信用风险进行分析和度量,选择风险与收益相匹配的更优品种进行配置。

#### (3) 证券公司短期公司债券投资策略

本基金将根据内部的信用分析方法对可选的证券公司短期公司债券品种进行筛选,并严格控制单只证券公司短期公司债券的投资比例。此外,由于证券公司短期

公司债券整体流动性相对较差，本基金将对拟投资或已投资的证券公司短期公司债券进行流动性分析和监测，尽量选择流动性相对较好的品种进行投资，保证本基金的流动性。

#### (4) 银行存款、同业存单投资策略

本基金根据宏观经济指标分析各类资产的预期收益率水平，并据此制定和调整资产配置策略。当银行存款、同业存单投资具有较高投资价值时，本基金将提高银行存款、同业存单投资比例。

#### (5) 杠杆投资策略

本基金将对资金面进行综合分析的基础上，比较债券收益率、存款利率和融资成本，判断利差空间，力争通过杠杆操作提高组合收益。

### 4、衍生品投资策略

#### (1) 股指期货投资策略

在股指期货投资上，本基金以避险保值和有效管理为目标，在控制风险的前提下，谨慎适当参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。

#### (2) 国债期货投资策略

本基金可基于谨慎原则，以套期保值为主要目的，运用国债期货对基本投资组合进行管理，提高投资效率。本基金主要采用流动性好、交易活跃的国债期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

### 5、折价和套利策略

本基金可在充分保障流动性需求的情况下，挖掘一些长期投资的机会，在资产价值低估或者有折价机会的时候介入，将价值回归转化为投资收益。具体包括大宗交易策略、定向增发投资策略等。

## (四) 投资限制

### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

(1) 本基金股票投资比例为基金资产的 60%-95%。本基金投资碳中和相关的股票的比例不低于非现金基金资产的 80%；

(2) 本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等;

(3) 本基金持有一家公司发行的证券,其市值不超过基金资产净值的 10%;

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

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

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

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

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

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

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

(11) 基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%;

(12) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为 1 年,债券回购到期后不得展期;

(13) 本基金参与股指期货交易和国债期货交易,应当遵循下列要求:

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

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

持有的股票总市值的 20%；在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合《基金合同》关于股票投资比例的有关约定；

3) 本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的 15%；在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值，不得超过基金持有的债券总市值的 30%；在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 30%；本基金所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定；

(14) 本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股股票，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股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；

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

(16) 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；

(17) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述第（2）、（9）、（15）、（16）条外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

如果法律法规或监管部门对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,基金管理人在履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或者活动:

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

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

法律、行政法规或监管部门取消或调整上述限制,如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后,则本基金投资不受上述限制或按调整后的规定执行。

### (五) 业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:中证环保产业指数收益率 $\times$ 75%+中债综合全价(总值)指数收益率 $\times$ 25%。

其中,中证环保产业指数由中证指数公司编制,该指数从沪深市场中选取100只业务涉及资源管理、清洁技术和产品、污染管理等领域的上市公司,以反映环保产业上市公司证券的走势。

中债综合全价(总值)指数由中央国债登记结算有限责任公司编制,样本债券

涵盖的范围全面，具有广泛的市场代表性，涵盖主要交易市场（银行间市场、交易所市场等）、不同发行主体（政府、企业等）和期限（长期、中期、短期等），能够很好地反映中国债券市场总体价格水平和变动趋势，具有良好的债券市场代表性。

如果今后法律法规发生变化，或者上述业绩比较基准停止发布或变更名称，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，基金管理人可以根据本基金的投资范围和投资策略，确定变更基金的比较基准或其权重构成。业绩比较基准的变更需经基金管理人与基金托管人协商一致报中国证监会备案后及时公告，并在更新的招募说明书中列示，无需召开基金份额持有人大会。

#### （六）风险收益特征

本基金为混合型证券投资基金，其预期风险和预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金。

#### （七）基金管理人代表基金行使相关权利的处理原则及方法

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

2、不谋求对上市公司的控股；

3、有利于基金财产的安全与增值；

4、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

#### （八）侧袋机制的实施和投资运作安排

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

## 六、基金资产估值

### (一) 估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券/期货交易场所的交易日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非交易日。

### (二) 估值对象

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

### (三) 估值原则

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

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

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

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

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

### (四) 估值方法

## 1、证券交易所上市的有价证券的估值

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

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

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

(4) 交易所上市交易的可转换债券以每日收盘价作为估值全价;

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

## 2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理:

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

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

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

(4) 对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券,对于存在活跃市场的情况下,应以活跃市场上未经调整的报价作为计量日的公允价值进行估值;对于活跃市场报价未能代表计量日公允价值的情况下,应对市场报价进行调整,确认计量日的公允价值;对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下,则采用估值技术确定

公允价值。

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

4、同一证券同时在两个或两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。

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

6、本基金投资股指期货合约、国债期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。如法律法规今后另有规定的，从其规定。

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

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

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

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

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

托管人不承担责任。

#### (五) 估值程序

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

基金管理人每个工作日计算基金资产净值及各类基金份额净值，并按规定公告。

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

#### (六) 估值错误的处理

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

本基金合同的当事人应按照以下约定处理：

##### 1、估值错误类型

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

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

##### 2、估值错误处理原则

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

务的当事人有足够的时间进行更正而未更正, 则其应当承担相应赔偿责任。估值错误责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认, 确保估值错误已得到更正。

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

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

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

(5) 按法律法规规定的其他原则处理估值错误。

### 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后, 有关的当事人应当及时进行处理, 处理的程序如下:

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

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

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

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

### 4、基金份额净值估值错误处理的方法如下:

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

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

并报中国证监会备案。

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

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

#### (七) 暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券/期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;

2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时;

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

4、法律法规规定、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

#### (八) 基金净值的确认

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

#### (九) 实施侧袋机制期间的基金资产估值

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

#### (十) 特殊情况的处理

1、基金管理人、基金托管人按估值方法的第 7 项进行估值时,所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

2、由于不可抗力,或证券/期货交易所、登记结算公司、存款银行等第三方机构发送的数据错误等原因,基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查,但未能发现错误的,由此造成的基金资产估值错误,基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措

施减轻由此造成的影响。

## 七、基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

### (一) 基金合同的变更

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

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

### (二) 基金合同的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：

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

### (三) 基金财产的清算

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

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

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

#### 4、基金财产清算程序：

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

- (3) 对基金财产进行估值和变现;
- (4) 制作清算报告;
- (5) 聘请符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所对清算报告进行外部审计, 聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书;
- (6) 将清算报告报中国证监会备案并公告;
- (7) 对基金剩余财产进行分配。

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

#### (四) 清算费用

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

#### (五) 基金财产清算剩余资产的分配

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

#### (六) 基金财产清算的公告

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

#### (七) 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。

### 八、争议解决方式

因本基金合同产生或与之相关的争议, 各方当事人应通过协商、调解解决, 协商、调解不能解决的, 任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会, 仲裁地点为北京市, 按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的, 对仲裁各方当事人均有约束力。除非仲裁裁决另有裁定,

仲裁费用和律师费用由败诉方承担。

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

本基金合同适用中华人民共和国（就本基金合同而言，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区）法律并从其解释。

#### **九、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式**

《基金合同》正本一式六份，除上报有关监管机构一式二份外，基金管理人、基金托管人各持有二份，每份具有同等的法律效力。《基金合同》可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅，但应以基金合同正本为准。

## 第二十一部分 基金托管协议的内容摘要

### 一、基金托管协议当事人

#### (一) 基金管理人

名称：英大基金管理有限公司

住所：北京市朝阳区东三环中路1号环球金融中心西塔22楼2201

法定代表人：范育晖

成立时间：2012年8月17日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监许可〔2012〕759号

组织形式：有限责任公司（法人独资）

注册资本：11.46亿元人民币

经营期限：持续经营

联系电话：010-57835666、400-890-5288

#### (二) 基金托管人

名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）

住所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号

办公地址：上海市长宁区仙霞路18号

法定代表人：任德奇

成立时间：1987年3月30日

批准设立机关及批准设立文号：国务院国发〔1986〕字第81号文和中国人民银行银发〔1987〕40号文

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字〔1998〕25号

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项业务；提供保管箱服务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务；经营结汇、售汇业务。

注册资本：742.63亿元

组织形式：股份有限公司

存续期间：持续经营

## 二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

### (一) 基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权

1. 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》和托管协议的约定，对基金的投资范围、投资对象进行监督。

本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券、证券公司短期公司债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

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

本基金的投资组合比例为：股票投资比例为基金资产的 60%-95%。本基金投资碳中和相关的股票的比例不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金（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不低于基金资产净值的 5%。

如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

2. 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》和托管协议的约定，对基金投资、融资比例进行监督。

根据《基金合同》的约定，本基金投资组合比例应符合以下规定：

(1) 本基金股票投资比例为基金资产的 60%-95%。本基金投资碳中和相关的股票的比例不低于非现金基金资产的 80%；

(2) 本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等;

(3) 本基金持有一家公司发行的证券,其市值不超过基金资产净值的 10%;

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

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

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

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

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

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

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

(11) 基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%;

(12) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为 1 年,债券回购到期后不得展期;

(13) 本基金参与股指期货交易和国债期货交易,应当遵循下列要求:

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

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

持有的股票总市值的 20%；在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合《基金合同》关于股票投资比例的有关约定；

3) 本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的 15%；在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值，不得超过基金持有的债券总市值的 30%；在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 30%；本基金所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定；

(14) 本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 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股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 30%；

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

(16) 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；

(17) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述第（2）、（9）、（15）、（16）条外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

如果法律法规或监管部门对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,基金管理人在履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制。

基金托管人依照上述规定对本基金的投资组合限制及调整期限进行监督。

3. 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同和托管协议的约定,对基金投资禁止行为进行监督。基金财产不得用于下列投资或者活动。

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

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

在基金合同生效后,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者与本机构有其他重大利害关系的公司名单,以上名单发生变化的,应及时予以更新并通知对方。

法律、行政法规或监管部门取消或调整上述限制,如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后,则本基金投资不受上述限制或按调整后的规定执行。

4. 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同和托管协议的约定,对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。

- (1) 基金托管人依据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定对于基金管理

人参与银行间市场交易时面临的交易对手资信风险进行监督。

基金管理人应向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的银行间市场交易对手的名单。基金托管人在收到名单后2个工作日内电话或回函确认收到该名单。基金管理人应定期和不定期对银行间市场现券及回购交易对手的名单进行更新。基金托管人在收到名单后2个工作日内电话或书面回函确认,新名单自基金托管人确认当日生效。新名单生效前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易,仍应按照协议进行结算。

(2) 基金管理人参与银行间市场交易时,有责任控制交易对手的资信风险,由于交易对手资信风险引起的损失,基金管理人应当负责向相关责任人追偿。

5. 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同和托管协议的约定,对基金管理人银行存款业务进行监督。

本基金投资银行存款应符合如下规定:

(1) 基金管理人、基金托管人应当与存款银行建立对账机制,确保基金银行存款业务账目及核算的真实、准确。

(2) 基金管理人与基金托管人应根据相关规定,就本基金银行存款业务另行签订书面协议,明确双方在相关协议签署、账户开设与管理、投资指令传达与执行、资金划拨、账目核对、到期兑付,以及存款证实书的开立、传递、保管等流程中的权利、义务和职责,以确保基金财产的安全,保护基金份额持有人的合法权益。

(3) 基金托管人应加强对基金银行存款业务的监督与核查,严格审查、复核相关协议、账户资料、投资指令、存款证实书等有关文件,切实履行托管职责。

(4) 基金管理人与基金托管人在开展基金存款业务时,应严格遵守《基金法》、《运作办法》等有关法律法规,以及国家有关账户管理、利率管理、支付结算等的各项规定。

6. 基金托管人对基金投资流通受限证券的监督。

(1) 基金投资流通受限证券,应遵守《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。

(2) 流通受限证券,包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券,

不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。

(3) 基金管理人应在基金首次投资流通受限证券前,向基金托管人提供经基金管理人董事会批准的有关基金投资流通受限证券的投资决策流程、风险控制制度。基金投资非公开发行股票,基金管理人还应提供基金管理人董事会批准的流动性风险处置预案。上述资料应包括但不限于基金投资流通受限证券的投资额度和投资比例控制情况。基金管理人应至少于首次执行投资指令之前两个工作日将上述资料书面发至基金托管人,保证基金托管人有足够的时间进行审核。基金托管人应在收到上述资料后两个工作日内,以书面或其他双方认可的方式确认收到上述资料。

(4) 基金投资流通受限证券前,基金管理人应向基金托管人提供符合法律法规要求的有关书面信息,包括但不限于拟发行证券主体的中国证监会批准文件、发行证券数量、发行价格、锁定期,基金拟认购的数量、价格、总成本、总成本占基金资产净值的比例、已持有流通受限证券市值占资产净值的比例、资金划付时间等。基金管理人应保证上述信息的真实、完整,并应至少于拟执行投资指令前两个工作日将上述信息书面发至基金托管人,保证基金托管人有足够的时间进行审核。

(5) 基金托管人应对基金管理人提供的有关书面信息进行审核,基金托管人认为上述资料可能导致基金投资出现风险的,有权要求基金管理人在投资流通受限证券前就该风险的消除或防范措施进行补充书面说明,并保留查看基金管理人风险管理部门就基金投资流通受限证券出具的风险评估报告等备查资料的权利。否则,基金托管人有权拒绝执行有关指令。因拒绝执行该指令造成基金财产损失的,基金托管人不承担任何责任,并有权报告中国证监会。

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

7. 基金托管人根据法律法规的规定及《基金合同》和托管协议的约定,对基金投资其他方面进行监督。

(二) 基金托管人应根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定,对基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确认、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。如果基金管理人未经基金托管人的审核擅自将不实的业绩表现数据印制在宣传推介材料上,则基金托管人对此不承担任何责任,并有权在发现后报告中国证监会。

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

基金托管人发现基金管理人的投资指令或实际投资运作违反《基金法》及其他有关法规、《基金合同》和托管协议规定的行为,应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正,基金管理人收到通知后应及时核对,并以电话或书面形式向基金托管人反馈,说明违规原因及纠正期限,并保证在规定期限内及时改正。在限期内,基金托管人有权随时对通知事项进行复查,督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的,基金托管人有权报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人有关重大违规行为,应立即报告中国证监会,同时通知基金管理人在限期内纠正。

基金托管人发现基金管理人的指令违反法律、行政法规和其他有关规定,或者违反《基金合同》约定的,应当拒绝执行,立即通知基金管理人,并有权向中国证监会报告。

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、行政法规和其他有关规定,或者违反《基金合同》约定的,应当立即通知基金管理人,并有权向中国证监会报告。

### 三、基金管理人有关基金托管人的业务核查

根据《基金法》及其他有关法规、《基金合同》和托管协议规定,基金管理人有关基金托管人履行托管职责的情况进行核查,核查事项包括但不限于基金托管人是否安全保管基金财产、开立基金财产的资金账户、证券账户及债券托管账户等投资所需账户,是否及时、准确复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值,是否根据基金管理人指令办理清算交收,是否按照法规规定和《基金合同》规定进行相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

基金管理人定期和不定期地对基金托管人保管的基金资产进行核查。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，在规定时间内答复并改正。

基金管理人发现基金托管人未对基金资产实行分账管理、擅自挪用基金资产、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、《基金合同》、托管协议及其他有关规定的，应及时以书面形式通知基金托管人在限期内纠正，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。对基金管理人按照法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的，基金托管人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金托管人在限期内纠正。

#### 四、基金财产的保管

##### (一) 基金财产保管的原则

1. 基金托管人应安全保管基金财产，未经基金管理人的指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何资产，非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

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

3. 基金托管人按照规定开立基金财产的银行存款账户、证券账户和债券托管账户等投资所需账户，基金管理人和基金托管人按照规定开立期货资金账户。

4. 基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，与基金托管人的其他业务和其他基金的托管业务实行严格的分账管理，独立核算，确保基金财产的完整和独立。

5. 对于因为基金投资产生的应收资产和基金申购过程中产生的应收资产，应由

基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金资产没有到达基金银行存款账户的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失。基金托管人对此不承担任何责任。

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

## (二) 基金募集资产的验证

基金募集期满或基金提前结束募集之日起 10 日内，由基金管理人聘请符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所进行验资，出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的 2 名以上（含 2 名）中国注册会计师签字有效。验资完成，基金管理人应将募集到的全部资金存入基金托管人为基金开立的基金银行存款账户中，基金托管人在收到资金当日出具相关证明文件。

## (三) 基金的银行存款账户的开立和管理

1. 基金托管人应负责本基金银行存款账户的开立和管理。

2. 基金托管人以本基金的名义在其营业机构开立基金的银行存款账户，并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。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，均需通过本基金的银行存款账户进行。

3. 本基金银行存款账户的开立和使用，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存款账户；亦不得使用基金的任何银行存款账户进行本基金业务以外的活动。

4. 基金托管人可以通过申请开通本基金银行账户的企业网上银行业务进行资金支付，并使用交通银行企业网上银行（简称“交通银行网银”）办理托管资产的资金结算汇划业务。

5. 基金银行存款账户的管理应符合银行业监督管理机构的有关规定。

## (四) 基金证券交收账户、资金交收账户的开立和管理

基金托管人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立证券账户。

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和未经对方同意擅自转让基金的任何证券账户;亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

基金管理人不得对基金证券交收账户、资金交收账户进行证券的超卖或超买。基金证券账户资产的管理和运用由基金管理人负责。

基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户即资金交收账户,用于证券交易资金的结算。基金托管人以本基金的名义在托管人处开立基金的证券交易资金结算的二级结算备付金账户。

#### (五) 债券托管账户的开立和管理

1. 基金合同生效后,基金管理人负责向中国人民银行进行报备,基金托管人在备案通过后在中央国债登记结算有限责任公司及银行间市场清算所股份有限公司以本基金的名义开立债券托管账户,并由基金托管人负责基金的债券及资金的清算。基金管理人负责申请基金进入全国银行间同业拆借市场进行交易,由基金管理人在中国外汇交易中心开设同业拆借市场交易账户。

2. 基金管理人代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议,协议正本由基金管理人保存。

#### (六) 期货相关账户的开立和管理

基金管理人、基金托管人应当按照相关规定开立期货资金账户,在中国金融期货交易所获取交易编码。期货资金账户名称及交易编码对应名称应按照规定设立。

基金托管人已取得期货保证金存管银行资格,基金管理人授权基金托管人办理相关银期转账业务。

#### (七) 基金投资银行存款账户的开立和管理

存款账户必须以基金名义开立,账户名称为基金名称,存款账户开户文件上加盖预留印鉴(须包括托管人印章)及基金管理人公章。

本基金投资银行存款时,基金管理人应当与存款银行签订具体存款协议/存款确认单据,明确存款的类型、期限、利率、金额、账号、对账方式、支取方式、存款到期指定收款账户等细则。

为防范特殊情况下的流动性风险，存款协议中应当约定提前支取条款。

#### (八) 其他账户的开立和管理

若中国证监会或其他监管机构在本托管协议订立日之后允许基金从事其他投资品种的投资业务，涉及相关账户的开立、使用的，由基金管理人协助基金托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定，开立有关账户。该账户按有关规则使用并管理。

#### (九) 基金财产投资的有关实物证券、银行存款定期存单等有价凭证的保管

实物证券由基金托管人存放于基金托管人的保管库。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。基金托管人对由基金托管人以外机构实际有效控制的本基金资产不承担保管责任。

银行存款定期存单等有价凭证由基金托管人负责保管。

基金托管人只负责对存款证实书进行保管，不负责对存款证实书真伪的辨别，不承担存款证实书对应存款的本金及收益的安全保管责任。

#### (十) 与基金财产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同的原件分别由基金托管人、基金管理人保管，相关业务程序另有限制除外。除托管协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时，应尽可能保证持有二份以上的正本，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，基金管理人应及时将正本送达基金托管人处。合同的保管期限按照国家有关规定执行。

对于无法取得二份以上的正本的，基金管理人应向基金托管人提供加盖授权业务章的合同传真件，未经双方协商或未在合同约定范围内，合同原件不得转移。

### 五、基金资产净值计算和会计核算

#### (一) 基金资产净值及基金份额净值的计算与复核

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

基金管理人应每工作日对基金资产估值。估值原则应符合《基金合同》、《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及其他法律、法规的规定。用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。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资产

净值和基金份额净值，以约定方式发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核后，将复核结果反馈给基金管理人，由基金管理人就基金份额净值予以公布。

本基金按以下方法估值：

#### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

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

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

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

(4) 交易所上市交易的可转换债券以每日收盘价作为估值全价；

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

#### 2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

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

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

(4) 对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对于存在活跃市场的情

况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为计量日的公允价值进行估值；对于活跃市场报价未能代表计量日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整，确认计量日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，则采用估值技术确定公允价值。

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

4、同一证券同时在两个或两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。

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

6、本基金投资股指期货合约、国债期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。如法律法规今后另有规定的，从其规定。

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

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

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

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

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承

担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对于基金资产净值信息的计算结果对外予以公布。

## (二) 净值差错处理

当发生净值计算错误时，由基金管理人负责处理，由此给基金份额持有人和基金造成损失的，由基金管理人对于基金份额持有人或者基金先行支付赔偿金。基金管理人和基金托管人应根据实际情况界定双方承担的责任，经确认后按以下条款进行赔偿。

1. 如采用托管协议第八章“基金资产净值及基金份额净值的计算与复核”中估值方法的第1—8、12、13进行处理时，若基金管理人净值计算出错，基金托管人在复核过程中没有发现，且造成基金份额持有人损失的，应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金，就实际向投资者或基金支付的赔偿金额，由基金管理人与基金托管人按照管理费率与托管费率的比例各自承担相应的责任；

2. 如基金管理人和基金托管人对基金份额净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对，尚不能达成一致时，为避免不能按时公布基金份额净值的情形，以基金管理人的计算结果对外公布，由此给基金份额持有人和基金造成的损失以及因该交易日基金资产净值计算顺延错误而引起的损失，由基金管理人负责赔付，基金托管人不负赔偿责任；

3. 基金管理人、基金托管人按估值方法的第9项进行估值时，所造成的误差不得作为基金资产估值错误处理。

由于不可抗力原因，或由于证券、期货交易所或登记结算公司等机构发送的数据错误等原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

针对净值差错处理，如果法律法规或证监会有新的规定，则按新的规定执行；如果行业有通行做法，在不违背法律法规且不损害投资者利益的前提下，双方应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则重新协商确定处理原则。

#### 4. 实施侧袋机制期间的基金资产估值

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

##### (三) 基金会计制度

按国家有关部门制定的会计制度执行。

##### (四) 基金账册的建立

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

##### (五) 会计数据和财务指标的核对

双方应每个交易日核对账目,如发现双方的账目存在不符的,基金管理人和基金托管人必须及时查明原因并纠正,确保核对一致。若当日核对不符,暂时无法查找到错账的原因而影响到基金资产净值的计算和公告的,以基金管理人的账册为准。

##### (六) 基金定期报告的编制和复核

基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。月度报表的编制,应于每月终了后5个工作日内完成。定期报告文件应按中国证监会的要求公告。季度报表的编制,应于每季度终了后15个工作日内完成;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3个工作日内,更新基金招募说明书和基金产品资料概要并登载在规定网站上;基金招募说明书、基金产品资料概要的其他信息发生变更的,基金管理人至少每年更新一次。中期报告在基金会计年度前6个月结束后的2个月内公告;年度报告在会计年度结束后3个月内公告。如果基金合同生效不足2个月的,基金管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。

基金管理人在月初3个工作日内完成上月度报表的编制,以约定方式将有关报表提供基金托管人;基金托管人收到后在2个工作日内进行复核,并将复核结果及时书面或以双方约定的其他方式通知基金管理人。对于季度报告、中期报告、年度报告、更新招募说明书、基金产品资料概要等,基金管理人和基金托管人应在上述监管部

门规定的时间内完成编制、复核及公告。基金托管人在复核过程中,发现双方的报表存在不符时,基金管理人和基金托管人应共同查明原因,进行调整,调整以双方认可的账务处理方式为准。如果基金管理人与基金托管人不能于应当发布公告之日前就相关报表达成一致,基金管理人有权按照其编制的报表对外发布公告,基金托管人有权就相关情况报证监会备案。

基金托管人对上述报告复核完毕后,可以出具复核确认书(盖章)或以其他双方约定的方式确认,以备有权机构对相关文件审核检查。

#### 六、基金份额持有人名册的保管

基金份额持有人名册至少应包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。基金份额持有人名册由基金登记机构根据基金管理人的指令编制和保管,基金管理人和基金托管人应分别保管基金份额持有人名册,基金登记机构保存期不低于法律法规规定的最低期限,法律法规另有规定或有权机关另有要求的除外。如不能妥善保管,则按相关法规承担责任。

在基金托管人要求或编制中期报告和年度报告前,基金管理人应将有关资料送交基金托管人,不得无故拒绝或延误提供,并保证其的真实性、准确性和完整性。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途,并应遵守保密义务。

#### 七、争议解决方式

双方当事人同意,因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议,应通过友好协商解决。托管协议当事人不愿通过协商解决或者协商不成的,任何一方当事人均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会,根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁,仲裁的地点在北京市,仲裁裁决是终局的,并对相关各方当事人均有约束力。除非仲裁裁决另有决定,仲裁费用、律师费由败诉方承担。

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

托管协议受中华人民共和国法律(为托管协议之目的,在此不包括香港、澳门特别行政区和台湾地区法律)管辖。

## 八、基金托管协议的效力

(一) 基金管理人在向中国证监会申请募集注册时提交的基金托管协议草案, 应经托管协议当事人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字或盖章, 协议当事人双方根据中国证监会的意见修改托管协议草案。托管协议以报中国证监会注册的文本为正式文本。

(二) 基金托管协议自《基金合同》成立之日起成立, 自《基金合同》生效之日起生效。基金托管协议的有效期自其生效之日起至基金财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止。

(三) 基金托管协议自生效之日起对托管协议当事人具有同等的法律约束力。

(四) 基金托管协议正本一式六份, 除上报有关监管机构一式二份外, 基金管理人和基金托管人各持有二份, 每份具有同等的法律效力。

## 九、基金托管协议的变更、终止与基金财产的清算

### (一) 基金托管协议的变更

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

### (二) 基金托管协议的终止

1. 《基金合同》终止;

2. 基金托管人解散、依法被撤销、破产, 被依法取消基金托管资格或因其他事由造成其他基金托管人接管基金财产;

3. 基金管理人解散、依法被撤销、破产, 被依法取消基金管理资格或因其他事由造成其他基金管理人接管基金管理权;

4. 发生《基金法》、《销售办法》、《运作办法》或其他法律法规规定的终止事项。

### (三) 基金财产的清算

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

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

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

4. 基金财产清算程序：

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

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

6. 清算费用

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

7. 基金财产清算剩余资产的分配

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

8. 基金财产清算的公告

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

在规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

#### 9. 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存，保存年限不低于法律法规规定的最低期限。

## 第二十二部分 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,同时,根据基金份额持有人的需要和市场的变化,在符合法律法规的前提下,基金管理人有权增加或变更相关服务项目。如因系统、第三方或其他不可抗力等原因导致下述服务无法提供,基金管理人不承担任何责任。对基金份额持有人的服务主要由基金管理人、销售机构提供,以下为基金管理人提供的主要服务内容:

### 一、账户开立与交易服务

投资者可通过英大基金官方网站网上交易平台、微信公众号“英大基金”、直销柜台或非直销销售机构,实现账户开立及交易操作。

基金管理人根据在直销网点进行交易的基金份额持有人要求提供成交确认;非直销销售机构基金份额持有人确认服务参照各销售机构业务流程及规定。

### 二、定期定额投资计划

基金管理人为投资者提供定期定额投资的服务。通过定期定额投资计划,投资者可以通过固定的渠道,定期定额申购基金份额。

定期定额投资计划的具体实施办法详见相关公告及管理人官方网站相关业务规则。

### 三、电子化交易服务及查询服务

公司官方网站、官方微信公众号“英大基金”为客户提供电子化交易系统自助办理基金交易服务,包括:基金认购/申购、赎回、转换、撤单、分红方式变更、定期定额投资等业务办理服务。

公司官方网站、官方微信公众号“英大基金”为持有人提供账户查询、产品信息查询、产品净值查询、公告信息查询、交易状态查询等服务。

### 四、持有人对账单服务

1、基金份额持有人可登录官方微信公众号“英大基金”,自助订阅月度电子邮件对账单。

2、基金份额持有人可拨打基金管理人客服热线(400-890-5288或010-57835666)或发送邮件到基金管理人客服邮箱(ydamc@ydamc.com),订阅月度、

季度、年度电子邮件对账单或索取传真对账单。其中：

(1) 电子邮件对账单：电子对账单是通过基金份额持有人预留的电子邮箱向其提供份额及交易对账的一种电子化的账单形式。电子邮件对账单的内容包括但不限于：期末基金份额余额、期末资产净值、期间交易明细等；发送对象为订阅电子邮件对账单且在对应期间内有交易或最后一个交易日仍持有份额的投资人；发送时间为每月、季度、年度结束后十个工作日内。

(2) 传真对账单：基金份额持有人若需传真对账单，可致电基金管理人客户热线或发送邮件到基金管理人客服邮箱（ydamc@ydamc.com）索取。

3、投资者提供的电子邮箱或传真号码不详、错误、未及时变更或通讯故障、延误等原因有可能造成对账单无法按时或准确送达。因上述原因无法正常收取对账单的基金份额持有人，敬请及时通过登录本人账户或拨打客服热线查询、核对、变更您的预留联系方式。

#### 五、手机短信服务

基金管理人通过短信为投资者提供账户信息确认、基金交易确认等信息服务。

基金管理人定期或不定期向基金份额持有人的预留手机号及邮箱发送基金分红、生日祝福、个人预留信息不全提示、调查问卷、活动推广等信息。

如基金份额持有人不希望接收到此类信息，可以通过英大基金官方客服热线或客服邮箱取消该类服务。

#### 六、客户服务热线电话服务

投资者想要了解交易情况、基金账户信息查询、基金产品与服务咨询、业务规则解答或进行投诉等，可拨打英大基金管理有限公司客户服务热线电话：400-890-5288（免长途费）或 010-57835666。

1、人工服务：周一至周五（节假日除外）8:30-11:30，13:00-17:30。

2、语音留言：基金份额持有人可通过公司客服热线（按指定键）进行语音留言，告知事项及联系方式，基金管理人接收基金份额持有人需求后给予回复。

3、自助服务：基金管理人提供 24 小时自助语音服务，基金份额持有人可通过客服热线自助查询基金净值、基金份额、基金交易等信息。

#### 七、基金份额持有人意见、建议或投诉

基金份额持有人可以通过本公司客户服务热线电话、书信、电子邮件、传真等渠道对基金管理人和销售网点所提供的服务提出意见、建议或投诉。

对于工作日期间受理的投诉，原则上是及时回复，对于非工作日提出的投诉，将在顺延的工作日进行处理。

## 第二十三部分 其他应披露事项

- 1、2023年8月11日发布英大碳中和混合型证券投资基金基金合同(修订版)
- 2、2023年8月11日发布英大碳中和混合型证券投资基金(英大碳中和混合A份额)基金产品资料概要更新
- 3、2023年8月11日发布英大碳中和混合型证券投资基金(英大碳中和混合C份额)基金产品资料概要更新
- 4、2023年8月11日发布英大碳中和混合型证券投资基金托管协议(修订版)
- 5、2023年8月11日发布英大碳中和混合型证券投资基金招募说明书(更新)(2023年第1号)
- 6、2023年8月11日发布关于调整四只公开募集证券投资基金费率及相关文件中基金管理人、托管人基本信息公告
- 7、2023年8月14日发布英大基金管理有限公司关于增加海通证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告
- 8、2023年8月16日发布关于英大基金直销网上交易系统银联通支付功能需重新签约的提示
- 9、2023年8月30日发布英大碳中和混合型证券投资基金2023年中期报告
- 10、2023年8月30日发布英大基金管理有限公司旗下基金2023年中期报告提示性公告
- 11、2023年10月12日发布英大基金管理有限公司关于提醒客户及时更新证件有效期的公告
- 12、2023年10月24日发布英大碳中和混合型证券投资基金2023年第3季度报告
- 13、2023年10月24日发布英大基金管理有限公司旗下基金2023年第3季度报告提示性公告
- 14、2023年10月25日发布英大基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增招商银行股份有限公司招赢通平台为销售机构的公告
- 15、2023年11月28日发布英大基金管理有限公司关于增加浙江同花顺基金销

售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告

16、2023年12月29日发布英大基金管理有限公司公募基金风险等级评价说明(2023年12月)

17、2023年12月30日发布英大基金管理有限公司关于提醒投资者持续完善身份信息资料的公告

18、2024年1月20日发布英大碳中和混合型证券投资基金2023年第4季度报告

19、2024年1月20日发布英大基金管理有限公司旗下基金2023年第4季度报告提示性公告

20、2024年3月30日发布英大碳中和混合型证券投资基金2023年年度报告

21、2024年3月30日发布英大基金管理有限公司旗下基金2023年年报提示性公告

22、2024年4月22日发布英大碳中和混合型证券投资基金2024年第1季度报告

23、2024年4月22日发布英大基金管理有限公司旗下基金2024年第1季度报告提示性公告

24、2024年6月20日发布英大碳中和混合型证券投资基金(A类份额)基金产品资料概要(更新)

25、2024年6月20日发布英大碳中和混合型证券投资基金(C类份额)基金产品资料概要(更新)

26、2024年6月29日发布英大基金管理有限公司公募基金风险等级评价说明(2024年6月)

27、2024年7月12日发布英大基金管理有限公司关于提醒投资者持续完善身份信息资料的公告

28、2024年7月19日发布英大碳中和混合型证券投资基金2024年第2季度报告

29、2024年7月19日发布英大基金管理有限公司旗下基金2024年第2季度报告提示性公告

## 第二十四部分 招募说明书的存放及其查阅方式

本招募说明书存放在本基金管理人、基金托管人、代销机构和注册登记人的办公场所，投资人可在办公时间免费查阅；也可按工本费购买基金招募说明书复制件或复印件，但应以基金招募说明书正本为准。投资人也可以直接登录基金管理人的网站 [www.ydamc.com](http://www.ydamc.com) 进行查阅。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

## 第二十五部分 备查文件

一、本基金备查文件包括下列文件

- 1、中国证监会准予本基金募集的文件；
- 2、基金合同；
- 3、托管协议；
- 4、基金产品资料概要；
- 5、法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 8、中国证监会要求的其他文件。

二、备查文件的存放地点和投资人查阅方式

基金合同、托管协议、招募说明书或更新后的招募说明书、年度报告、中期报告、季度报告和基金份额净值公告等文本文件在编制完成后，将存放于基金管理人所在地、基金托管人所在地，供公众查阅。投资人在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。

投资人也可在基金管理人指定的网站上进行查阅。本基金的信息披露事项将在规定媒介上公告。本基金的信息披露将严格按照法律法规和基金合同的规定进行。

英大基金管理有限公司

2024年8月9日