

# 申万菱信基金管理有限公司

## 申万菱信全球新能源股票型发起式 证券投资基金（QDII） 更新招募说明书 （2024年第1号）

基金管理人：申万菱信基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

二〇二四年十二月

本基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，但不保证投资于本基金一定盈利，也不保证最低收益。

## 重要提示

申万菱信全球新能源股票型发起式证券投资基金（QDII）（以下简称“本基金”）经中国证监会 2023 年 9 月 11 日证监许可【2023】2136 号文注册募集。

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

本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本基金财产，但不保证投资于本基金一定盈利，也不保证最低收益。

本基金投资于境内外证券市场，基金净值会因为境内外证券市场波动及汇率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的收益，但同时也要承担相应的投资风险。在投资本基金前，投资者应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，获得基金投资收益，并承担基金投资中出现的风险，基金在投资运作过程中可能面临各种风险，既包括市场风险，也包括基金自身的管理风险、投资风险、交易对手风险、运作风险和合规与道德风险等。巨额赎回风险是开放式基金所特有的一种风险，对本基金而言，当单个开放日基金的净赎回申请超过上一工作日基金总份额的 10% 时，投资人将可能无法及时赎回持有的全部基金份额。本基金可能面临的主要风险详见招募说明书“风险揭示”章节。

若本基金投资内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”），会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有投资风险，包括市场联动风险（港股市场上外汇资金流动更为自由，海外资金的流动对港股价格的影响巨大，港股价格与海外资金流动表现出高度相关性）、港股市场股价波动较大的风险（港股市场实行 T+0 回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对基金的投资收益造成损失）、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险（在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险）、港股通业务额度限制及可投资标的范围调整等特殊风险。具体

风险请查阅本基金招募说明书的“风险揭示”章节的具体内容。本基金可根据投资策略需要或不同配置地区市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股，基金资产并非必然投资港股。

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

当本基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，基金管理人履行约定的程序后，可以依照约定启用侧袋机制，具体详见基金合同和招募说明书的“第十五部分 侧袋机制”等有关章节。侧袋机制实施期间，基金管理人将对基金简称进行特殊标识，并不得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。

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

投资有风险，投资者在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的招募说明书、基金合同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。投资者根据所持有份额享受基金的收益，但同时也需承担相应的投资风险。本基金为股票型基金，本基金主要投资于全球新能源主题相关公司的股票。其预期风险和预期收益水平高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。

本基金主要投资于境外证券市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还将面临汇率风险、境外证券市场风险等特殊投资风险。

在本基金存续期间，基金管理人不承担基金投资等运作环节中的任何汇率变动风险。

基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。基金的过往业绩并不预示其未来表现，基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金表现的保证。

本基金单一投资者（基金管理人、基金管理人高级管理人员或基金经理等人

员作为发起资金提供方除外）持有基金份额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% 的情形除外。法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

本次招募说明书为年度更新。本次招募说明书所载内容中有关财务数据和净值表现截止日为 2024 年 9 月 30 日（财务数据未经审计）。

## 目 录

第一部分	绪言.....	5
第二部分	释义.....	6
第三部分	风险揭示.....	12
第四部分	基金的投资.....	29
第五部分	基金管理人.....	51
第六部分	基金的募集.....	62
第七部分	基金合同的生效.....	69
第八部分	基金份额的申购与赎回.....	71
第九部分	基金费用与税收.....	85
第十部分	基金的财产.....	88
第十一部分	基金资产估值.....	90
第十二部分	基金的收益与分配.....	99
第十三部分	基金的会计与审计.....	101
第十四部分	基金的信息披露.....	102
第十五部分	侧袋机制.....	110
第十六部分	基金合同的变更、终止与基金财产清算.....	113
第十七部分	基金托管人.....	115
第十八部分	境外托管人.....	118
第十九部分	相关服务机构.....	122
第二十部分	基金合同的内容摘要.....	124
第二十一部分	基金托管协议的内容摘要.....	143
第二十二部分	对基金份额持有人的服务.....	161
第二十三部分	其他应披露事项.....	163
第二十三部分	招募说明书的存放及查阅方式.....	164
第二十四部分	备查文件.....	165

## 第一部分 绪言

《申万菱信全球新能源股票型发起式证券投资基金（QDII）招募说明书》（以下简称“招募说明书”或“本招募说明书”）依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》、《关于实施〈合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法〉有关问题的通知》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》、《申万菱信全球新能源股票型发起式证券投资基金（QDII）基金合同》（以下简称“基金合同”）及其他有关法律法规编写。

本招募说明书阐述了申万菱信全球新能源股票型发起式证券投资基金（QDII）的投资目标、策略、风险、费率等与投资者投资决策有关的全部必要事项，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

本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。

本招募说明书由本基金管理人根据基金合同编写，并经中国证监会注册，主要向投资者披露本基金及与本基金相关事项的信息，是投资者据以选择及决定是否投资于本基金的要约邀请文件。基金合同是规定基金合同当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资者自依据基金合同取得基金份额，即成为本基金份额持有人和基金合同的当事人，其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。投资者按照法律法规和基金合同的规定享有权利、承担义务。本基金投资者欲了解本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：指申万菱信全球新能源股票型发起式证券投资基金（QDII）
- 2、基金管理人：指申万菱信基金管理有限公司
- 3、基金托管人：指中国农业银行股份有限公司
- 4、境外托管人：指基金托管人委托的、负责基金境外财产的保管、存管、清算等业务的金融机构
- 5、基金合同：指《申万菱信全球新能源股票型发起式证券投资基金（QDII）基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充
- 6、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《申万菱信全球新能源股票型发起式证券投资基金（QDII）托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
- 7、招募说明书或本招募说明书：指《申万菱信全球新能源股票型发起式证券投资基金（QDII）招募说明书》及其更新
- 8、基金产品资料概要：指《申万菱信全球新能源股票型发起式证券投资基金（QDII）基金产品资料概要》及其更新
- 9、基金份额发售公告：指《申万菱信全球新能源股票型发起式证券投资基金（QDII）基金份额发售公告》
- 10、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、通知等以及颁布机关对其不时做出的修订
- 11、《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
- 12、《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

13、《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

14、《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

15、《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

16、《试行办法》：指《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》及颁布机关对其不时做出的修订

17、《通知》：指中国证监会 2007 年 6 月 18 日公布、自同年 7 月 5 日起实施的《关于实施〈合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法〉有关问题的通知》及颁布机关对其不时做出的修订

18、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

19、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或国家金融监督管理总局

20、国家外汇局、外管局：指国家外汇管理局或其授权的派出机构

21、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

22、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

23、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

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

25、基金份额持有人大会：指按照基金合同第八部分之规定召集、召开并由



基金份额持有人或其合法的代理人进行表决的会议

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

27、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

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

29、销售机构：指申万菱信基金管理有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务协议，办理基金销售业务的机构

30、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

31、登记机构：指办理登记业务的机构。基金的登记机构为申万菱信基金管理有限公司或接受申万菱信基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构

32、境外投资顾问：指符合法律法规规定的条件，为本基金境外证券投资提供证券买卖建议或投资组合管理等服务并取得收入的境外金融机构；境外投资顾问由基金管理人选择、更换和撤销

33、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

34、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、赎回等业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户

35、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

36、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

37、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

38、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

39、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

40、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

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

42、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

43、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

44、《业务规则》：指《申万菱信基金管理有限公司开放式基金业务规则》，是由申万菱信基金管理有限公司制定并不时修订的，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

45、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

46、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

47、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

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

49、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

50、销售服务费：指本基金用于持续销售和服务基金份额持有人的费用，该笔费用从基金财产中计提，属于基金的营运费用

51、基金份额分类：本基金根据认购费、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。在投资人认购/申购时，收取认购/申购费用，并不再从本类别基金财产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；不收取认购/申购费用，但从本类别基金财产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。

两类基金份额分设不同的基金代码，并分别计算并公布基金份额净值

52、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

53、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）超过上一工作日基金总份额的 10%

54、元：如无特指，指人民币元

55、美元：指美国法定货币及法定货币单位

56、汇率：如无特指，指中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价

57、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、证券持有期间的公允价值变动、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

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

59、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

60、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

61、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

62、流动性受限资产：指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等

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

64、规定媒介：指符合中国证监会规定条件的用以进行信息披露的全国性报刊及《信息披露办法》规定的互联网网站（包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介

65、不可抗力：指基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

66、中华人民共和国：就基金合同而言，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区

67、发起资金：指基金管理人的股东资金、基金管理人固有资金、基金管理人高级管理人员或基金经理（指基金管理人员中依法具有基金经理资格者，包括但不限于可能不限于本基金的基金经理，下同）等人员参与认购的资金

68、发起资金提供方：指以发起资金认购本基金且承诺以发起资金认购的基金份额持有期限自基金合同生效之日起不少于3年的基金管理人股东、基金管理人、基金管理人高级管理人员或基金经理等人员

69、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

70、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

71、港股通标的股票：指内地投资者委托内地证券公司，经由内地证券交易所设立的证券交易服务公司，向香港联合交易所进行申报，买卖规定范围内的香港联合交易所上市股票

以上释义中涉及法律法规、业务规则的内容，法律法规、业务规则修订后，如适用本基金，相关内容以修订后法律法规、业务规则为准。

## 第三部分 风险揭示

本基金投资于境内外证券市场，基金净值会因为境内外证券市场波动及汇率波动等因素产生波动。本基金投资中出现的风险主要有海外投资的特殊风险、基金运作风险、本基金特有的风险等。

### 一、海外投资的特殊风险

本基金直接投资于境外证券市场，境外证券市场在社会政治环境、法律法规、市场状况、经济发展趋势、市场敏感度等各个方面都存在较大的差异，这都会对本基金的收益水平产生影响。

#### 1、海外市场风险

市场风险是指金融工具或证券的价值对市场参数变化的敏感性，是基金资产运作中所不可避免地承受因市场任何波动而产生的风险。由于本基金主要投资于海外证券市场，因而会受到不同国家或地区特有的经济或非经济的政策、法律制度、经济周期、利率波动等基本因素的影响，从而导致本基金的收益面临波动和存在潜在损失的风险。

#### 2、政治风险

不同国家或地区的财政政策、货币政策、产业政策、地区发展政策等宏观政策发生变化，会导致市场波动进而影响基金资产的收益水平，产生风险；此外，基金资产所投资的国家/地区可能会不时采取某些管制措施，从而对基金资产的收益带来不利影响。

#### 3、法律和政府管制风险

由于各个国家/地区适用不同法律法规的原因，可能基金的某些投资行为在部分国家/地区受到限制或合同不能正常执行，或者由于税制、破产制度的改变等法律上的原因，给交易者带来损失的可能性。本基金主要投资全球新能源主题股票，且投资于境外市场的资产占基金资产的比例不低于 20%，境外的证券交易所对挂牌交易的股票的政策、规则或监管均可能随时修改，在执行方面也存在不明朗因素，可能会对本基金造成一定的法律风险。

#### 4、汇率及外汇管制风险

基金资产以人民币募集和计价，经过换汇后投资于全球市场以外币计价的金融工具。外币相对于人民币的汇率变化将会影响本基金以人民币计价的基金资

产价值，从而导致基金面临潜在风险。此外，部分国家/地区可能对外汇实施管制，从而带来一定的货币汇兑风险。

#### 5、会计核算风险

会计核算风险主要是指由于会计核算及会计管理上违规操作形成的风险或错误，通常是指基金管理人在计算、整理、制证、填单、登账、编表、保管及其相关业务处理中，由于客观原因与非主观故意所造成的行为过失，从而对基金收益造成影响的风险。

#### 6、税务风险

由于各个国家/地区在税务方面的法律法规存在一定差异，当投资某个国家/地区市场时，该国家/地区可能会要求基金就股息、利息、资本利得等收益向当地税务机关缴纳税金，该行为会使基金收益受到一定影响。此外，各个国家/地区的税收规定可能发生变化，或者实施具有追溯力的修订，从而导致基金向该国家/地区缴纳在基金财产销售、估值或者出售投资当日并未预计的额外税项。

本基金在投资境外证券市场时会实现了解清楚当地的税务法律法规，同时在境外托管人的协助下，完成投资所在国家或地区的税务扣缴工作。

#### 7、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。基金财产投资于债券和股票，其收益水平会受到利率变化的影响。同时，不同地区与国家的利率变动还将影响该地区的经济与汇率，可能给本基金投资带来潜在风险。

### 二、基金运作风险

#### 1、流动性风险

流动性风险包括两类。一是指在市场中的投资操作由于市场的深度限制或由于市场剧烈波动而导致投资交易无法实现或不能以当前合理的价格实现，从而可能为基金带来投资损失的风险。二是指开放式基金由于申购赎回要求可能导致流动资金不足的风险。

由于境外市场的交易日、交易时间、结算规则等与国内存在一定的差异、本基金有关申购、赎回的开放与交易确认的安排不同于国内一般开放式基金。本基金赎回款项到达投资者指定账户需要更长的时间。

### 1) 本基金拟投资市场及资产的流动性风险评估

本基金在严格控制组合风险的前提下，以基本面分析为立足点，重点投资于全球新能源主题相关上市公司，力争实现基金资产的长期稳健增值。

本基金基于分散投资原则，通过投资限制对各类资产的投资比例、集中度进行了控制，并严格的控制主动投资于流动性受限资产的比例上限，综合评估在正常市场环境下本基金的流动性风险适中。

### 2) 基金申购、赎回安排

投资人具体请参见招募说明书“第八部分 基金份额的申购与赎回”章节，详细了解本基金的申购以及赎回安排。

### 3) 巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

当基金出现巨额赎回情形时，为应对流动性风险，保障投资者得到公平对待，基金管理人可根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回、部分延期赎回还是延缓支付赎回款项；此外，基金管理人还可以在特定情形下暂停赎回。

具体请参见招募说明书“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。

### 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

在确保投资者得到公平对待的前提下，可依照法律法规及基金合同的约定，综合运用各类流动性风险管理工具，对赎回申请等进行适度调整，作为特定情形下基金管理人流动性风险管理的辅助措施，包括但不限于：

#### (1) 延期办理巨额赎回申请

具体请参见招募说明书“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。

#### (2) 暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项

具体请参见招募说明书“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。

#### (3) 暂停基金估值

具体请参见招募说明书“第十一部分 基金资产估值”中“七、暂停估值的情形”的相关内容。

#### (4) 摆动定价

当基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可采用摆动定价机制，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、自律规则规定。

#### （5）短期赎回费

本基金对持续持有期少于 7 日的投资者将收取 1.5% 的短期赎回费。

#### （6）实施侧袋机制

具体请参见招募说明书“第十五部分 侧袋机制”章节，详细了解本基金侧袋机制的情形及程序。

当本基金出现上述情形时，本基金可能无法及时满足所有投资者的申购和赎回申请，投资者收到赎回款项的时间也可能晚于预期或可能增加投资者申购和/或赎回的成本。

### 2、信用风险

指金融工具的一方到期无法履行约定义务致使本基金遭受损失的风险。本基金的信用风险主要来源于金融工具的发行者或是交易对手不能履行约定义务的行为。无论是整体市场投资者的信用偏好变化，还是基金具体投资债券的信用恶化，都会对本基金的回报带来负面影响。另外，信用评级调整也会带来相应风险。当信用评级机构调低本基金所持有的债券的信用级别时，债券的价格会下跌，从而导致本基金的收益下降。

### 3、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。

### 4、交易结算风险

在基金的投资交易中，因交易对手无法履行对一位或多位交易对手的义务而使得基金在投资交易中蒙受损失的可能性。

### 5、投资者申购失败的风险

基金管理人在特定情形下可以拒绝或暂停申购，则投资者可能会面临申购申



请失败的风险。具体规定详见招募说明书“第八部分 基金份额的申购与赎回”的“八、拒绝或暂停申购的情形”。

#### 6、基金进入清算期的相关风险

基金进入清算程序后，基金管理人将及时变现资产，但由于变现过程中的市场波动、流动受限证券无法及时变现而可能面临的进一步损失、清算费用等原因，基金份额持有人将可能面临最终收到的全部清算款偏离该基金最后运作日公告的资产净值的风险。此外，基金进入清算程序后，如因持有流动受限证券暂时无法全部变现的，基金将先以已变现基金资产为限进行分配，待该类流动受限证券全部变现后进行再次分配，因此，若该类流动受限证券一直无法变现，基金份额持有人将面临剩余清算款收取时间不确定的风险。

#### 7、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

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。

#### 8、其他风险

##### （1）技术风险

当计算机、通讯系统、交易网络等技术保障系统或信息网络支持出现异常情况，可能导致基金日常的申购赎回无法按正常时限完成、注册登记系统瘫痪、核算系统无法按正常时限显示产生净值、基金的投资交易指令无法及时传输等风险。

##### （2）道德风险

由于人员的机会主义行为等主观因素带来的风险，如内幕交易、欺诈、舞弊等行为可能给基金资产带来直接损失或损害基金管理人声誉从而损害本基金投资人利益。

##### （3）合规风险

由于操作疏忽、制度不健全或者外部法律法规环境变化等原因造成基金运作违反相关规定的风险。这种风险可能表现在基金整体的投资组合管理上，例如资产配置、类属配置不符合基金合同的要求；也可能表现在个券、个股的选择不符合本基金的投资风格和投资目标等。

#### （4）不可抗力风险

战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金资产遭受损失；同时，证券市场、基金管理人及基金销售机构可能因不可抗力无法正常工作，从而有影响基金正常申购和赎回的风险。

### 9、金融模型风险

基金管理人在有时会使用金融模型来进行资产定价、趋势判断、风险评估等辅助其作出投资决策。但在使用金融模型时可能会因为模型使用不恰当、模型参数的估计错误、数据录入错误等导致模型使用失败，面临出现错误结论的可能性，从而引起投资损失的风险。

### 10、操作风险

在基金的各种交易行为或者后台运作中，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或者导致投资者的利益受到影响。这种操作风险可能来自于基金管理公司、登记机构、销售机构、交易对手、托管行、证券交易所、证券登记结算机构等等。

## 三、本基金的特定风险

### 1、发起式基金特有的风险

本基金为发起式基金，在基金募集时，发起资金来源于基金管理人的股东资本、固有资金、以及基金管理人高级管理人员或基金经理等人员的资金。使用发起资金认购基金的金额不少于 1000 万元人民币。本基金发起资金提供方认购的基金份额持有期限自基金合同生效之日起不少于 3 年（基金合同生效不满 3 年提前终止的情况除外，下同）。发起资金提供方认购的基金份额持有期限满 3 年后，发起资金提供方将根据自身情况决定是否继续持有基金，届时发起资金提供方有可能赎回认购的本基金份额。另外，基金合同生效满 3 年之日（指自然日），如果本基金的资产净值低于 2 亿元，基金合同将自动终止，投资者将面临基金合同可能终止的不确定性风险。

## 2、基金合同自动终止的风险

本基金在基金合同生效满3年后继续存续的，连续50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，本基金将根据基金合同的约定进入清算程序并终止，而无需召开基金份额持有人大会审议。因此，投资者在前述情形下同样将面临基金合同可能终止的不确定性风险。

## 3、投资于境内资产支持证券的特定风险

（1）信用风险：基金所投资的资产支持证券之债务人出现违约，或在交易过程中发生交收违约，或由于资产支持证券信用质量降低导致证券价格下降，造成基金财产损失。

（2）利率风险：市场利率将随宏观经济环境的变化而波动，利率波动会导致资产支持证券的收益率和价格的变动，一般而言，如果市场利率上升，基金持有资产支持证券将面临价格下降、本金损失的风险，而如果市场利率下降，资产支持证券利息的再投资收益将面临下降的风险。

（3）流动性风险：受资产支持证券市场规模及交易活跃程度的影响，可能无法在合理的时间内以公允价格卖出较大数量的资产支持证券，存在一定的流动性风险。

（4）提前偿付风险：债务人可能会由于利率变化等原因进行提前偿付，从而使基金资产面临再投资风险。

（5）操作风险：在资产支持证券的投资过程中由于未能按照既有的操作流程进行操作或操作失误未能达到预期投资目标而形成的风险。

（6）法律风险：在资产支持证券的投资运作过程中，由于违反投资限制、信息披露的相关法律法规的规定或产品合同的约定，导致公司利益受损或受到监管处罚的风险。

## 4、境外衍生品和外汇衍生品的投资风险

本基金主要投资于为了有效管理金融风险而设计的衍生品工具，衍生品工具本身还具有杠杆风险、基差风险、保证金不足风险、成交不活跃带来的流动性风险、展期风险以及交割风险等。本基金投资衍生品的主要目的为通过衍生品降低个股和组合风险，规避外汇风险以及其他风险。本基金不会对外汇进行投机交易。

## 5、初级产品风险

初级产品风险是指以农业原材料、金属矿产品和石油等能源为代表的初级产品受供求关系影响使其价格大幅波动，对相关行业及产业链、全球经济、区域通货膨胀等产生影响，从而从宏观和微观方面引起基金资产波动，使基金资产面临系统性和非系统性的风险。

#### 6、大宗交易风险

大宗交易风险是指大宗交易的成交价格并非完全由市场供需关系形成，可能与市场价格存在一定差异，基金进行此类大宗交易可能导致基金资产面临的风险。

#### 7、小市值/新兴市场/高科技公司股票风险

小市值/新兴市场/高科技公司股票风险是指受市场、技术、竞争、管理、财务等多方面影响，小市值/新兴市场/高科技公司抗风险能力比较脆弱，市场价格波动剧烈，基金投资此类证券可能导致基金资产面临的风险。

#### 8、境外证券借贷/正回购/逆回购风险

证券借贷/正回购/逆回购风险是指基金在证券借贷、回购业务的费率、价格、交割等环节存在非完全市场化因素的影响，基金进行此类业务可能导致基金资产面临的风险。

#### 9、港股投资风险

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，除可通过合格境内机构投资者（QDII）境外投资额度投资于港股外，还可通过港股通机制下投资香港联合交易所（以下简称“香港联交所”或“联交所”）上市的港股通标的股票。除与其他投资于内地市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还面临因投资环境、投资者结构、投资标的构成、市场制度以及交易规则等差异所带来的特有风险，包括但不限于：

##### （1）市场联动的风险

与内地 A 股市场相比，港股市场上外汇资金流动更为自由，海外资金的流动对港股价格的影响巨大，港股价格与海外资金流动表现出高度相关性，本基金在参与港股市场投资时受到全球宏观经济和货币政策变动等因素所导致的系统风险相对更大。

##### （2）股价波动的风险

港股市场实行 T+0 回转交易机制（即当日买入的股票，在交收前可以于当

日卖出），同时对个股不设涨跌幅限制，加之香港市场结构性产品和衍生品种类相对丰富以及做空机制的存在；港股股价受到意外事件影响可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动，本基金持仓的波动风险可能相对较大。

### （3）汇率风险

在现行港股通机制下，港股的买卖是以港币报价，以人民币进行支付，并且资金不留港（港股交易后结算的净资金余额头寸以换汇的方式兑换为人民币），故本基金每日的港股买卖结算将进行相应的港币兑人民币的换汇操作，本基金承担港元对人民币汇率波动的风险，以及因汇率大幅波动引起账户透支的风险。

本基金对港股买卖每日结算中所采用的报价汇率可能存在报价差异，本基金可能需额外承担买卖结算汇率报价点差所带来的损失。

此外根据港股通的规则设定，本基金在通过港股通机制投资港股时，每日买卖港股申请时还将参考汇率买入/卖出价冻结相应的资金，该参考汇率买入价和卖出价设定上存在比例差异，以抵御该日汇率波动而带来的结算风险，本基金将因此而遭遇资金被额外占用进而降低基金投资效率的风险。

### （4）港股通额度限制

根据现行的港股通规则，对港股通设有每日额度上限的限制；本基金可能因为港股通市场每日额度不足，而不能通过港股通机制买入投资标的。

### （5）港股通可投资标的范围调整带来的风险

根据现行的港股通规则，对港股通下可投资的港股范围进行了限制，并定期或不定期根据范围限制规则对具体的可投资标的进行调整，对于调出在投资范围的港股，只能卖出不能买入。本基金可能因为港股通可投资标的范围的调整而不能通过港股通机制及时买入看好的投资标的。

### （6）港股通交易日设定的风险

根据现行的港股通规则，存在港股通交易日不连贯的情形（如内地市场因放假等原因休市而香港市场照常交易但港股通不能如常进行交易），而导致基金所持的港股组合在后续港股通交易日开市交易中集中体现市场反应而造成其价格波动骤然增大，进而导致本基金所持港股组合在资产估值上出现波动增大的风险。

### （7）交收制度带来的基金流动性风险

由于香港市场实行 T+2 日（T 日买卖股票，资金和股票在 T+2 日才进行交

收)的交收安排,本基金在T日(港股通交易日)卖出股票,T+2日(港股通交易日,即为卖出当日之后第二个港股通交易日)才能在香港市场完成清算交收,卖出的资金在T+3日才能回到人民币资金账户。因此交收制度的不同以及港股通交易日的设定原因,本基金可能面临卖出港股后资金不能及时到账,而造成支付赎回款日期比正常情况延后而给投资者带来流动性风险,同时也存在不能及时调整基金资产组合中A股和港股投资比例,造成比例超标的风险。

#### (8) 港股通下对公司行为的处理规则带来的风险

根据现行的港股通规则,本基金因所持港股通股票权益分派、转换、上市公司被收购等情形或者异常情况,所取得的港股通股票以外的香港联交所上市证券,只能通过港股通卖出,但不得买入;因港股通股票权益分派或者转换等情形取得的香港联交所上市股票的认购权利在联交所上市的,可以通过港股通卖出,但不得行权;因港股通股票权益分派、转换或者上市公司被收购等所取得的非联交所上市证券,可以享有相关权益,但不得通过港股通买入或卖出。本基金存在因上述规则,利益得不到最大化甚至受损的风险。

#### (9) 香港联合交易所停牌、退市等制度性差异带来的风险

香港联交所规定,在交易所认为所要求的停牌合理而且必要时,上市公司方可采取停牌措施。此外,不同于内地A股市场的停牌制度,联交所对停牌的具体时长并没有量化规定,只是确定了“尽量缩短停牌时间”的原则;同时与A股市场存在退市可能的上市公司根据其财务状况在证券简称前加入相应标记(例如,ST及\*ST等标记)以警示投资者风险的做法不同,在香港联交所市场没有风险警示板,联交所采用非量化的退市标准且在上市公司退市过程中拥有相对较大的主导权,使得联交所上市公司的退市情形较A股市场相对复杂。

因该等制度性差异,本基金可能存在因所持个股遭遇非预期性的停牌甚至退市而给基金带来损失的风险。

#### (10) 港股通规则变动带来的风险

本基金如在港股通机制和规则下参与香港联交所证券的投资,受港股通规则的限制和影响;本基金存在因港股通规则变动而带来基金投资受阻或所持资产组合价值发生波动的风险。

#### (11) 基金资产投资港股标的比例的风险

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

#### （12）其他可能的风险

除上述显著风险外，本基金参与港股通投资，还可能面临的其他风险，包括但不限于：

1) 除因股票交易而发生的佣金、交易征费、交易费、交易系统费、印花税、过户费等税费外，在不进行交易时也可能要继续缴纳证券组合费等项费用，本基金存在因费用估算不准而导致账户透支的风险；

2) 在香港市场，部分中小市值港股成交量则相对较少，流动较为缺乏，本基金投资此类股票可能因缺乏交易对手而面临个股流动性风险；

3) 本基金参与港股通交易时，若香港联交所与内地交易所的证券交易服务公司之间的报盘系统或者通信链路出现故障，可能导致 15 分钟以上不能申报和撤销申报的交易中断风险；

4) 存在港股通香港结算机构因极端情况下无法交付证券和资金的结算风险；另外港股通境内结算实施分级结算原则，本基金可能面临以下风险：a.因结算参与人未完成与中国结算的集中交收，导致本基金应收资金或证券被暂不交付或处置；b.结算参与人对本基金出现交收违约导致本基金未能取得应收证券或资金；c.结算参与人向中国结算发送的有关本基金的证券划付指令有误的导致本基金权益受损；d.其他因结算参与人未遵守相关业务规则导致本基金利益受到损害的情况；

5) 香港出现台风、黑色暴雨或者香港联合交易所规定的其他情形时，香港联合交易所将可能停市，投资者将面临在停市期间无法进行港股通交易的风险；出现上海证券交易所和深圳证券交易所的证券交易服务公司认定的交易异常情况时，证券交易服务公司可能暂停提供部分或者全部港股通服务，投资者将面临在暂停服务期间无法进行港股通交易的风险。

### 10、境内金融期货投资风险

#### （1）市场风险

本基金可按照基金合同的约定投资股指期货和国债期货。期货市场与现货市场不同，采取保证金交易，风险较现货市场更高。虽然本基金对期货的投资仅限

于现金管理和套期保值等用途，在极端情况下，期货市场波动仍可能对基金资产造成不良影响。期货业务的主要市场风险因素如下：

1) 股票市场证券指数价格和市场利率。指数价格和市场利率的波动将可能影响到各期货合约的价格波动；

2) 各期货合约的价格。该价格的波动将直接影响持仓期货合约价值；

3) 期货合约与现货价格差（基差风险）。基金财产可能因为金融期货合约与现货价格波动不一致而遭受基差风险。因存在基差风险，在进行金融期货合约展期的过程中，基金财产可能会承担金融期货合约之间的价差向不利方向变动而导致的展期风险；

4) 期货不同合约之间价格差。期货不同合约之间价格差的波动超过正常范围，将可能导致该业务特定策略组合在部分时间点上价值产生不利方向的波动。

## （2）流动性风险

金融期货投资面临的流动性风险较大，主要包括流通量风险和无法缴足保证金的资金流动性风险：

1) 流通量风险是指无法及时以合理价格建立或了结头寸的风险，这种风险在市况急剧走向某个极端或因进行了某种特殊交易但不能如愿处理资产时容易产生；

2) 无法缴足保证金的资金流动性风险是指当金融期货业务支付现金的义务大于投资组合现金头寸，且投资组合无力在规定时间内补足保证金而导致基金持有头寸面临强制平仓的风险。需要特别注意，与股指期货不同，国债期货采用梯度提高保证金的制度，越临近交割日，保证金比例要求越高。

## （3）交易对手风险

金融期货的交易对手风险来自于两方面：

1) 对手方风险：基金管理人运用基金资产投资于金融期货，会尽力选择资信状况优良、风险控制能力强的期货公司作为经纪商，但不能杜绝因所选择的期货公司在交易过程中存在违法、违规经营行为或破产清算导致基金资产遭受损失。

2) 连带风险：为基金资产进行结算的结算会员或该结算会员下的其他投资人出现保证金不足、又未能在规定的时间内补足，或因其他原因导致中金所对该结算会员下的经纪账户强行平仓时，基金资产的资产可能因被连带强行平仓而遭



受损失。

#### （4）国债期货交割风险

国债期货业务的交割风险主要有：

1) 对于国债期货交易的买方，在临近交割期由于融资成本提高而导致交割成本提高带来的损失。

2) 对于国债期货交易的卖方，在临近交割期由于最便宜可交割券流动性不足而导致该类券价格升高或者被迫使用次优券交割带来的损失。

3) 由于交割违约产生的损失。若国债期货的卖方未能在规定期限内如数交付可交割国债或者买方未能在规定期限内如数缴纳交割货款，就会构成交割违约，需按照中金所规定的标准支付补偿金和惩罚性违约金。

### 11、投资于股票期权的特定风险

#### （1）市场风险

期权定价模型较为复杂，其市值将会受到期权合约价格、标的物价格、标的物波动率、市场利率水平等多个因素影响。若期权标的价格波动导致期权不具行权价值，期权买方将损失付出的所有权利金；期权卖方由于需承担行权履约义务，因合约标的价格波动导致的损失可能远大于其收取的权利金。

#### （2）行权风险

1) 对于期权交易的买方（权利方），在合约到期时选择行权的，若行权资金（认购期权）或合约标的不足（认沽期权）将可能导致不足部分对应的行权申报失败的风险。

2) 对于期权交易的卖方（义务方），如果未能在规定期限内准备好足额的资金（认沽期权）或者证券（认购期权），就会构成行权资金交收违约或者行权证券交割违约，需按照交易所规定支付违约资金利息和违约金。

3) 由于行权日和证券交割后的可交易日的差异而导致行权后持有现货证券面临证券价格涨跌风险。

#### （3）流动性风险

期权业务的流动性风险主要包括流通量风险和无法缴足保证金（现金或现货）的流动性风险。

流通量风险是指无法及时以合理价格建立或了结头寸的风险，这种风险在市

况急剧走向某个极端或因进行了某种特殊交易但不能如愿处理资产时容易产生。

期权的卖方（义务方）具有行权义务，因此需要缴纳保证金（现金或现货）以防止出现卖方不能履约的情况。在交易过程中，若出现保证金不足，期权卖方未能及时追缴保证金的话，期权合约将遭到强制平仓。其中，特别需要注意，当进行认购期权备兑开仓策略，作为保证金的标的证券若因合约调整（合约标的发生分红、派息、送股、公积金转增股本、配股、份额拆分或者合并等情况时，交易所会对合约标的进行除权除息处理，进而对尚未到期的期权合约的合约单位、行权价格进行调整），导致备兑备用证券不足的，期权合约也将遭到强制平仓。

#### （4）时间价值风险

期权交易的买方（权利方）拥有期权的时间价值，时间价值随着期权到期日的临近而不断损耗。

### 12、投资于北交所股票的风险

#### （1）由于投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险

北京证券交易所是独立于沪深证券交易所之外的全国性证券交易所，其制度规则包括股票发行、交易、分层管理、投资者适当性等方面，与沪深证券交易所的制度规则存在一定差别，可能导致挂牌股票股价波动较大。

#### （2）流动性风险

北交所挂牌公司可能股权相对集中、投资者门槛较高，因此市场整体流动性可能弱于沪深证券交易所，基金存在无法及时变现及其他相关流动性风险。

#### （3）上市公司经营风险

北交所主要服务创新型中小企业，企业多处于成长期，抵御市场和行业风险的能力较弱，同时其规模也可能偏小，往往具有依赖核心技术人员和供应商、客户集中度高、应对外部冲击能力较弱等特点，企业上市后的持续创新能力、收入及盈利水平等仍具有较大不确定性。

#### （4）上市公司退市风险

北交所股票可能因触及退市情形被终止上市。因触及交易类情形被终止上市的北交所股票，不进入退市整理期；因触及财务类、规范类及重大违法类情形，会被实施退市风险警示。

### 13、存托凭证的投资风险

(1) 存托凭证由存托人签发、以证券为基础发行，代表基础证券权益。存托凭证持有人实际享有的权益与基础证券持有人的权益虽然基本相当，但并不能等同于直接持有基础证券。

(2) 基金买入或者持有红筹公司发行的存托凭证，即被视为自动加入存托协议，成为存托协议的当事人。存托协议可能通过红筹公司和存托人商议等方式进行修改，基金无法单独要求红筹公司或者存托人对存托协议作出额外修改。

(3) 基金持有红筹公司存托凭证，不是红筹公司登记在册的股东，不能以股东身份直接行使股东权利；基金仅能根据存托协议的约定，通过存托人享有并行使分红、投票等权利。

(4) 存托凭证存续期间，存托凭证项目内容可能发生重大、实质变化，包括但不限于存托凭证与基础证券转换比例发生调整、红筹公司和存托人可能对存托协议作出修改，更换存托人、更换托管人、存托凭证主动退市等。部分变化可能仅以事先通知的方式，即对基金生效。基金可能无法对此行使表决权。

(5) 存托凭证存续期间，对应的基础证券等财产可能出现被质押、挪用、司法冻结、强制执行等情形，基金可能存在失去应有权利的风险。

(6) 存托人可能向存托凭证持有人收取存托凭证相关费用。

(7) 存托凭证退市的，基金可能面临存托人无法根据存托协议的约定卖出基础证券，基金持有的存托凭证无法转到其他市场进行公开交易或者转让，存托人无法继续按照存托协议的约定为基金提供相应服务等风险。

#### 14、境内融资业务的主要风险

##### (1) 市场风险

1) 可能放大投资损失的风险：融资业务具有杠杆效应，在放大投资收益的同时也必然放大投资风险。将股票作为担保品进行融资交易时，既需要承担原有的股票价格变化带来的风险，又得承担融资买入股票带来的风险，同时还须支付相应的利息和费用，由此承担的风险可能远远超过普通证券交易。

2) 利率变动带来的成本加大风险：如果在从事融资交易期间，中国人民银行规定的同期贷款基准利率调高，证券公司将相应调高融资利率，投资成本也因为利率的上调而增加，将面临融资成本增加的风险。

3) 强制平仓风险：融资交易中，投资组合与证券公司间除了普通交易的委

托买卖关系外，还存在着较为复杂的债权债务关系，以及由于债权债务产生的信托关系和担保关系。证券公司为保护自身债权，对投资组合信用账户的资产负债情况实时监控，在一定条件下可以对投资组合担保资产执行强制平仓，且平仓的品种、数量、价格、时机将不受投资组合的控制，平仓的数额可能超过全部负债，由此给投资组合带来损失。

4) 外部监管风险：在融资交易出现异常或市场出现系统性风险时，监管部门、证券交易所和证券公司都将可能对融资交易采取相应措施，例如提高融资融券保证金比例、维持担保比例和强制平仓的条件等，以维护市场平稳运行。这些措施将可能给本金带来杠杆效应降低、甚至提前进入追加担保物或强制平仓状态等潜在损失。

#### （2）流动性风险

融资业务的流动性风险主要指当基金不能按照约定的期限清偿债务，或上市证券价格波动导致担保物价值与融资债务之间的比例低于平仓维持担保比例，且不能按照约定的时间追加担保物时面临强制平仓的风险。

#### （3）信用风险

信用风险主要指交易对手违约产生的风险。一方面，如果证券公司没有按照融资合同的要求履行义务可能带来风险；另一方面，若在从事融资交易期间，证券公司融资业务资格、融资业务交易权限被取消或被暂停，证券公司可能无法履约，则投资组合可能会面临一定的风险。

### 四、启用侧袋机制的风险

当本基金启用侧袋机制时，实施侧袋机制期间，侧袋账户份额将停止披露基金份额净值，并不得办理申购、赎回和转换。基金份额持有人可能面临无法及时获得侧袋账户对应部分的资金的流动性风险。因特定资产的变现时间具有不确定性，最终变现价格也具有不确定性并且有可能大幅低于启用侧袋机制时的特定资产的估值，基金份额持有人可能因此面临损失。

实施侧袋机制期间，因本基金不披露侧袋账户份额的净值，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，并根据相关规定对分割侧袋账户资产导致的基金净资产减少进行按投资损失处理，因此本基金披露的业绩指标不能反映特定资产的真实价值及变化情况。

## 第四部分 基金的投资

### 一、投资目标

本基金在严格控制组合风险的前提下，以基本面分析为立足点，重点投资于全球新能源主题相关上市公司，力争实现基金资产的长期稳健增值。

### 二、投资范围

#### 1、本基金在境外的投资范围如下：

针对境外投资，本基金可投资于银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股（包括港股通标的股票）、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证；在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金；与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品；远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品；法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

本基金还可进行境外证券借贷交易、境外正回购交易、逆回购交易。

本基金为对冲外币的汇率风险，可以投资于外汇远期合约、结构性外汇远期合约、外汇期权及外汇期权组合、外汇互换协议、与汇率挂钩的结构性投资产品等金融工具。

#### 2、本基金在境内的投资范围如下：

本基金境内可投资于具有良好流动性的金融工具，具体包括国内依法发行或上市的股票（包括主板、创业板及其他依法发行、上市的股票及存托凭证）、国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、地方政府债、公开发行的次级债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、可交换债券、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、现金、股指期货、国债期货、股票期权及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具（但必须符合中国证监会的相关规定）。

本基金可根据相关法律法规和基金合同的约定，参与境内融资业务。

本基金可通过合格境内机构投资者（QDII）境外投资额度或港股通机制投资香港股票市场。

3、基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的比例为 80% 以上，其中投资于全球新能源主题相关公司股票的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%。本基金投资于境外市场的股票占基金资产的比例不低于 20%，本基金投资于境内市场的股票占基金资产的比例不低于 20%。每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金以及股票期权合约需缴纳的现金保证金后，本基金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。

4、如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。如法律法规或中国证监会变更投资品种比例限制的，基金管理人在与基金托管人协商一致并履行相关程序后，可相应调整本基金的投资比例规定。

### 三、投资策略

本基金在严格控制风险的前提下，通过积极主动的资产配置，充分挖掘和利用市场中潜在的投资机会，力求为基金份额持有人获取超过业绩比较基准的收益。本基金采用多重投资策略，采取自上而下的资产配置和自下而上的证券选择相结合的方法进行投资管理。衍生品投资不作为本基金的主要投资品种，仅用于适当规避外汇风险及其他相关风险之目的。

#### 1、资产配置策略

##### （1）战略资产配置

本基金通过研究经济周期趋势，进行大类资产配置。本基金基于对宏观经济、政策面、市场面等因素的综合分析，结合对股票、债券、现金等大类资产的收益特征的前瞻性研究，形成对各类别资产未来表现的预判，在严格控制投资组合风险的前提下，确定和调整基金资产中股票、债券、货币市场工具以及其他金融工具的配置比例。

#### 2、股票投资策略

本基金主要结合定量和定性分析，分析其投资价值，结合风险控制模型，对

股票组合进行优化，力求获得长期稳定的超额收益。

#### （1）全球新能源主题相关范畴的界定

本基金对全球新能源相关行业的定义包括：

- 1) 新型能源、再生能源生产和利用相关行业（包括太阳能、光伏、水能、海洋能、风能、生物质能、核能、氢能、地热能的生产和利用）；
- 2) 新能源汽车产业链相关行业（包括新能源汽车整车制造、汽车电子以及关键零部件、热管理组件和子系统、通信模组、通信终端、物联网终端、充电桩运营及相关技术服务）；
- 3) 动力电池、锂电池相关行业（包括动力电池、装备、原材料及上游矿产资源的生产和制造）；

同时，本基金必须对全球新能源主题相关产业的发展进行密切跟踪，随着产业结构的不断升级，全球新能源主题相关公司的范围也会相应改变。本基金将根据实际情况调整全球新能源主题概念投资范围的认定。

#### （2）个股选择

从估值、股票质量及趋势三个维度在相关上市公司股票中进行筛选，估值方面主要考虑基于市盈率、自由现金流收益率和其他相关价值衡量指标，横向对比选取估值相对便宜的股票；股票质量方面主要考虑企业盈利的可持续性、企业资本的运用配置情况及实际盈利能力，选取拥有可持续利润及严谨的资本管理的盈利公司；股票趋势方面，通过跟踪公司盈利公告、订单及产品计划，选取正处于正面盈利趋势及正面价格趋势双支撑的股票。除前述三个维度外，本基金还将综合分析企业的财务状况、商业模式以及公司管理层三个方面，从中筛选出优秀的上市公司。

#### （3）投资组合构建

根据上述精选出的个股，结合各项定量和定性指标挑选出最具上涨潜力的标的自下而上构建投资组合。

### 3、债券投资策略

在债券投资部分，将根据当前宏观经济形势、金融市场环境，通过有效的投资组合体现债券市场战略投资与战术投资的结合，并积极运用基于债券研究的各种投资分析技术，寻找有利的市场投资机会。通过债券品种的动态配置与优化配



比，动态调整固定收益证券组合的久期、银行间市场和交易所市场的投资比重，并相应调整不同债券品种间的配比，以期在较低风险条件下获得稳定投资收益。

#### 4、境内股指期货投资策略

基金管理人可运用股指期货以提高投资效率，从而更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在严控风险的前提下，本着谨慎原则，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。此外，本基金还将运用股指期货来对冲特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理，如在基金出现巨额或较大申购赎回时，通过股指期货及时进行加仓或减仓，迅速的进行仓位调整，以达成申购赎回对基金运作带来的影响最小化的目的。

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

#### 5、境内国债期货投资策略

本基金将按照相关法律法规的规定，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平等指标进行跟踪监控。

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

#### 6、资产支持证券投资策略

在严格控制投资风险的前提下，本基金将从信用风险、流动性风险、利率风险、税收因素和提前还款因素等方面综合评估资产支持证券的投资品种，选择低估的品种进行投资。

#### 7、可转换债券与可交换债券投资策略

##### （1）可转换债券投资策略

可转换债券兼具权益类证券与固定收益类证券的特性，具有抵御下行风险、分享股票价格上涨收益的特点。本基金将利用数量化方法对可转换债券的纯债部分价值、正股的股权部分价值以及内嵌的期权价值进行综合评估，选择具有较高投资价值的可转换债券进行投资。

##### （2）可交换债券投资策略

可交换债券的价值取决于其股权价值、债券价值以及内嵌期权价值。其中其债券价值与可转换债券相同，即选择持有可交换债券至到期以获取票面价值和票面利息；而其股权价值则需要关注发行人持有的其他上市公司（目标公司）的股票价值。本基金将利用数量化方法对可交换债券的纯债部分价值以及对目标公司的股票价值的综合评估，选择具有较高投资价值的可交换债券进行投资。

#### 8、境内股票期权投资策略

本基金将按照风险管理的原则参与股票期权交易。本基金将结合投资目标、比例限制、风险收益特征以及法律法规的相关限定和要求，以套期保值为主要目的，确定参与股票期权交易的投资时机和投资比例。

若相关法律法规发生变化时，基金管理人将对股票期权投资管理从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。未来如法律法规或监管机构允许基金投资其他期权品种，本基金将在履行适当程序后，纳入投资范围并制定相应投资策略。

#### 9、境内融资投资策略

本基金将在充分考虑风险和收益特征的基础上，审慎参与境内融资交易。本基金将基于对市场行情和组合风险收益的分析，确定投资时机、标的证券以及投资比例。若相关融资业务法律法规发生变化，本基金将从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。

#### 10、现金管理策略

现金管理主要包含现金流预测、现金资产配置和现金收益管理三个方面。基金管理人将合理把握因基金申购赎回、基金投资标的物波动增大等因素带来的现金流变化，对未来若干交易日现金流动制定相应计划。基金管理人将严格遵守法律法规要求，执行战略和战术资产配置方案，保持相应比例的现金资产。对于现金资产，在保证基金流动性需求的前提下，提高现金资产使用效率，尽可能提高现金资产的收益率。

#### 11、境外衍生品投资策略

衍生品不是本基金的主要投资方向。本基金在充分调研验证衍生品投资策略的基础上，可以通过衍生品投资降低个股和组合风险，规避外汇风险及其他相关风险。基金管理人可以使用远期合约和其他工具来进行外汇风险的套期保值，合

理减小外汇市场波动对投资表现的负面影响。套期保值部分的比例应遵守相关法律法规和基金合同的规定，在充分考虑投资需要和境外投资仓位后予以确定。本基金将不会对外汇进行投机交易。

## 12、存托凭证投资策略

本基金将采取自上而下与自下而上相结合的方式，挖掘具有长期价值的存托凭证进行投资，主要分析维度包括存托凭证所属公司的宏观经济状况、行业景气度、自身竞争优势、估值水平、治理结构等。具体而言，将通过分析所处市场的经济增速和前景、财政货币汇率产业等政策，所处行业的发展阶段、竞争格局、政策友好度等，通过分析公司的收入增速、净利润增速、毛利率变化等成长性指标，PE、PB、PE/G、EV/EBITDA、PS、股息率、DCF 等估值指标，资产周转率、存货周转率等营运指标，资产负债率、利息保障倍数等偿债能力指标，收现比、净现比、自由现金流等现金流量指标，选出成长性良好、竞争优势突出、经营质量高、现金流稳定、有一定估值吸引力的公司作为备选品种。然后再通过与市场整体估值水平、行业估值水平、自身历史估值水平及国际市场估值水平进行比较，评估其投资价值。

## 四、投资限制

### 1、组合限制

A.基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金股票投资占基金资产的比例为 80% 以上；

（2）本基金投资于全球新能源主题相关公司股票的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%；本基金投资于境外市场的资产占基金资产的比例不低于 20%，本基金投资于境内市场的资产占基金资产的比例不低于 20%；

（3）每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金以及股票期权合约需缴纳的现金保证金后，本基金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；

（4）本基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

除上述（3）外，因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资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况除外。

**B. 本基金境内投资应遵循以下限制：**

（1）本基金持有一家公司发行的证券，其市值（同一家公司在境内和境外同时上市的，持股比例合并计算）不超过基金资产净值的 10%；本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券（同一家公司在境内和境外同时上市的，持股比例合并计算），不超过该证券的 10%，完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金品种可以不受此条款规定的比例限制；

（2）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%；完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述比例限制；

（3）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%；

（4）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%；

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

（6）本基金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%；

（7）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；

（8）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；

（9）债券正回购资金余额或逆回购资金余额不得超过其上一日基金净值的 40%。债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

（10）本基金参与股指期货、国债期货交易：

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

2) 在任何交易日日终，持有的买入股指期货、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；

3) 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%；

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

5) 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%；

6) 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%；

7) 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%；

8) 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；

9) 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%；

(11) 本基金参与股票期权交易依据下列标准建构组合：

1) 因未平仓的股票期权合约支付和收取的权利金总额不得超过基金资产净值的 10%；

2) 开仓卖出认购股票期权的，应持有足额标的证券；开仓卖出认沽期权的，应持有合约行权所需的全额现金或交易所规则认可的可冲抵期权保证金的现金等价物；

3) 未平仓的股票期权合约面值不得超过基金资产净值的 20%。其中，合约面值按照行权价乘以合约乘数计算；

(12) 本基金参与融资的，在任何交易日日终，本基金融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；

（13）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的 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本基金不符合该比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

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

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

（16）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（7）、（13）、（14）项外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并或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。

C. 本基金境外投资应遵循以下限制：

（1）本基金持有同一家银行的存款不得超过基金净值的 20%。银行应当是中资商业银行在境外设立的分行或在最近一个会计年度达到中国证监会认可的信用评级机构评级的境外银行，但在基金托管账户的存款不受此限制；

（2）本基金持有同一机构（政府、国际金融组织除外）发行的证券市值不得超过基金净值的 10%；

（3）本基金持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不得超过基金资产净值的 10%，其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的 3%；

（4）基金不得购买证券用于控制或影响发行该证券的机构或其管理层。本基金管理人管理的全部基金不得持有同一机构 10% 以上具有投票权的证券发行总量。

前项投资比例限制应当合并计算同一机构境内外上市的总股本，同时应当一并计算全球存托凭证和美国存托凭证所代表的基础证券，并假设对持有的股本权证行使转换；

(5) 本基金持有非流动性资产市值不得超过基金净值的 10%。

前项非流动性资产是指法律或基金合同规定的流通受限证券以及中国证监会认定的其他资产；

(6) 本基金持有境外基金的市值合计不得超过基金净值的 10%（持有货币市场基金可以不受上述限制）；

(7) 本基金管理人管理的全部基金、集合计划持有任何一只境外基金，不得超过该境外基金总份额的 20%；

(8) 为应付赎回、交易清算等临时用途借入现金的比例不得超过基金净值的 10%；

(9) 金融衍生品投资

本基金投资衍生品应当仅限于投资组合避险或有效管理，不得用于投机或放大交易，同时应当严格遵守下列规定：

1) 本基金的金融衍生品全部敞口不得高于基金资产净值的 100%。

2) 本基金投资期货支付的初始保证金、投资期权支付或收取的期权费、投资柜台交易衍生品支付的初始费用的总额不得高于基金资产净值的 10%。

3) 本基金投资于远期合约、互换等柜台交易金融衍生品，应当符合以下要求：

①所有参与交易对手方（中资商业银行除外）应当具有不低于中国证监会认可的信用评级机构评级；

②交易对手方应当至少每个工作日对交易进行估值，并且本基金可在任何时候以公允价值终止交易；

③任一交易对手方的市值计价敞口不得超过基金资产净值的 20%。

4) 基金管理人应当在本基金会会计年度结束后 60 个工作日内向中国证监会提交包括衍生品头寸及风险分析年度报告。

5) 本基金不得直接投资与实物商品相关的衍生品。

(10) 本基金可以参与证券借贷交易，并且应当遵守下列规定：

1) 所有参与交易对手方（中资商业银行除外）应当具有中国证监会认可的信用评级机构评级；

2) 应当采取市值计价制度进行调整以确保担保物市值不低于已借出证券市

值的 102%；

3) 借方应当在交易期内及时向本基金支付已借出证券产生的所有股息、利息和分红。一旦借方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留和处置担保物以满足索赔需要；

4) 除中国证监会另有规定外，担保物可以是以下金融工具或品种：

①现金；

②存款证明；

③商业票据；

④政府债券；

⑤中资商业银行或由不低于中国证监会认可的信用评级机构评级的境外金融机构（作为交易对手方或其关联方的除外）出具的不可撤销信用证。

5) 本基金有权在任何时候终止证券借贷交易并在正常市场惯例的合理期限内要求归还任一或所有已借出的证券；

6) 本基金管理人将对基金参与证券借贷交易中发生的任何损失负相应责任。

(11) 基金可以根据正常市场惯例参与正回购交易、逆回购交易，并且应当遵守下列规定：

1) 所有参与正回购交易对手方（中资商业银行除外）应当具有中国证监会认可的信用评级机构信用评级；

2) 参与正回购交易，应当采取市值计价制度对卖出收益进行调整以确保现金不低于已售出证券市值的 102%。一旦买方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留或处置卖出收益以满足索赔需要；

3) 买方应当在正回购交易期内及时向本基金支付售出证券产生的所有股息、利息和分红；

4) 参与逆回购交易，应当对购入证券采取市值计价制度进行调整以确保已购入证券市值不低于支付现金的 102%。一旦卖方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留或处置已购入证券以满足索赔需要；

5) 本基金管理人将对基金参与证券正回购交易、逆回购交易中发生的任何损失负相应责任。

(12) 本基金参与证券借贷交易、正回购交易，所有已借出而未归还证券总



市值或所有已售出而未回购证券总市值均不得超过基金总资产的 50%。前项比例限制计算，基金因参与证券借贷交易、正回购交易而持有的担保物、现金不得计入基金总资产。

（13）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。

因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合上述规定投资比例的，针对第（1）-（7）项，基金管理人应当在 30 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情况除外。

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

法律法规或监管部门取消或调整上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按照调整后的规定执行，且该等事项无需召开基金份额持有人大会。

## 2. 禁止行为

除中国证监会另有规定外，基金在境外投资时不得有下列行为：

- （1） 购买不动产。
- （2） 购买房地产抵押按揭。
- （3） 购买贵金属或代表贵金属的凭证。
- （4） 购买实物商品。
- （5） 除应付赎回、交易清算等临时用途以外，借入现金。该临时用途借入现金的比例不得超过基金资产净值的 10%。
- （6） 利用融资购买证券，但投资金融衍生品除外。
- （7） 参与未持有基础资产的卖空交易。
- （8） 从事证券承销业务。
- （9） 不公平对待不同客户或不同投资组合。
- （10） 除法律法规规定以外，向任何第三方泄露客户资料。
- （11） 违反规定向他人贷款或者提供担保。
- （12） 从事承担无限责任的投资。

- (13) 向其基金管理人、基金托管人出资。
- (14) 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。
- (15) 法律、行政法规和中国证监会禁止的其他行为。

除中国证监会另有规定外，基金在境内投资时不得有下列行为：

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

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

如法律、行政法规或监管部门取消或变更上述禁止性规定，如适用于本基金，在履行适当程序后，本基金可不受上述规定的限制或按变更后的规定执行，且该等事项无需召开基金份额持有人大会。

## 五、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：纳斯达克清洁先进绿色能源指数（NASDAQ Clean Edge Green Energy Index）\*90% + 银行人民币活期存款利率(税后)\* 10%

纳斯达克清洁先进绿色能源指数追踪与新兴清洁能源技术的制造、开发、分销和安装相关上市公司的表现。新兴清洁能源技术包括太阳能光伏、先进电池、混能和电动汽车以及可再生材料。

如果今后法律法规发生变化，或者证券市场中有其他代表性更强或者更科学

客观的业绩比较基准适用于本基金时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，与基金托管人协商一致，并按监管部门要求履行适当程序以后变更业绩比较基准并及时公告，该等变更无需召开基金份额持有人大会。

## 六、风险收益特征

本基金为股票型基金，本基金主要投资于全球新能源主题相关公司的股票。其预期风险和预期收益水平高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。

本基金主要投资于境外证券市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还将面临汇率风险、境外证券市场风险等特殊投资风险。

## 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、有利于基金财产的安全与增值；
- 2、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使相关权利，保护基金份额持有人的利益；
- 3、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；
- 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“第十五部分 侧袋机制”章节的规定。

## 九、基金投资组合报告

本投资组合报告所载数据截止日为 2024 年 9 月 30 日，本报告中所列财务数据未经审计。

### 1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	42,294,929.82	70.54
	其中：普通股	41,856,970.82	69.81
	存托凭证	437,959.00	0.73
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	11,790,912.20	19.67
8	其他各项资产	5,870,579.42	9.79
9	合计	59,956,421.44	100.00

**2 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布**

国家（地区）	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例（%）
美国	28,913,748.26	53.76
中国	12,159,707.00	22.61
中国香港	1,221,474.56	2.27
合计	42,294,929.82	78.64

注：（1）国家（地区）类别根据其所在的证券交易所确定。

（2）ADR、GDR 按照存托凭证本身挂牌的证券交易所确定。

（3）此处股票包括普通股和优先股

**3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合**

行业类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例（%）
原材料	4,509,850.59	8.39
非日常生活消费品	2,409,568.99	4.48
日常消费品	-	-
能源	-	-
金融	1,629,374.80	3.03
医疗保健	-	-
工业	25,820,887.05	48.01
信息技术	5,201,663.39	9.67
通讯业务	-	-
公用事业	2,723,585.00	5.06
房地产	-	-
合计	42,294,929.82	78.64

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

**4 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及存托凭证投资明细**

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
----	----------	----------	------	--------	----------	-------	------------	--------------

				场				
1	GE Vernova Inc	通用电气 Vernova 股份有限公司	GEV US	纽约 证券 交易 所	美国	1,838.00	3,284,040. 71	6.11
2	Johnson Controls, Inc.	江森自 控国际 有限公 司	JCI US	纽约 证券 交易 所	美国	4,393.00	2,389,108. 07	4.44
3	Enphase Energy Inc	Enphase 能源股 份有限 公司	ENPH US	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	2,847.00	2,254,756. 66	4.19
4	Huaneng Lancang River Hydropower Inc.	华能水 电	600025 CH	上海 证券 交易 所	中国	193,400.0 0	2,233,770. 00	4.15
5	Sempra	桑普拉 能源股 份有限 公司	SRE US	纽约 证券 交易 所	美国	3,666.00	2,148,381. 81	3.99
6	XJ Electric Co.,Ltd.	许继电 气	000400 CH	深圳 证券 交易	中国	62,500.00	2,136,875. 00	3.97

				所				
7	First Solar Inc	福思第一太阳能公司	FSLR US	纳斯达克证券交易所	美国	1,221.00	2,134,217.47	3.97
8	Regal Rexnord Corp	Regal Rexnord 公司	RRX US	纽约证券交易所	美国	1,794.00	2,085,323.20	3.88
9	Fluence Energy Inc	Fluence 能源股份有限公司	FLNC US	纳斯达克证券交易所	美国	12,878.00	2,049,379.86	3.81
10	NEXTracker Inc	NEXTracker 公司	NXT US	纳斯达克证券交易所	美国	7,675.00	2,015,741.68	3.75

注：此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

#### 5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

#### 9 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基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

### 10 投资组合报告附注

10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有受到监管部门立案调查；在报告编制日前一年内没有受到监管部门公开谴责或/及处罚。

10.2 基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

#### 10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	5,236.95
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	37,154.92
4	应收利息	-
5	应收申购款	5,817,626.84
6	其他应收款	10,560.71
7	其他	-
8	合计	5,870,579.42

#### 10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 10.6 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。

## 十、基金的业绩

本基金的过往业绩不代表未来表现。

净值增长率与业绩比较基准收益率比较：

#### 申万菱信全球新能源股票型发起式 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	①—③	②—④



				④		
2023年11月16日(基金合同生效日)至2023年12月31日	0.09%	0.01%	13.90%	2.13%	-13.81%	-2.12%
2024年1月1日至2024年9月30日	19.73%	0.93%	-13.05%	2.01%	32.78%	-1.08%
自基金合同生效日至2024年09月30日	19.84%	0.85%	-0.96%	2.03%	20.80%	-1.18%

## 申万菱信全球新能源股票型发起式 C:

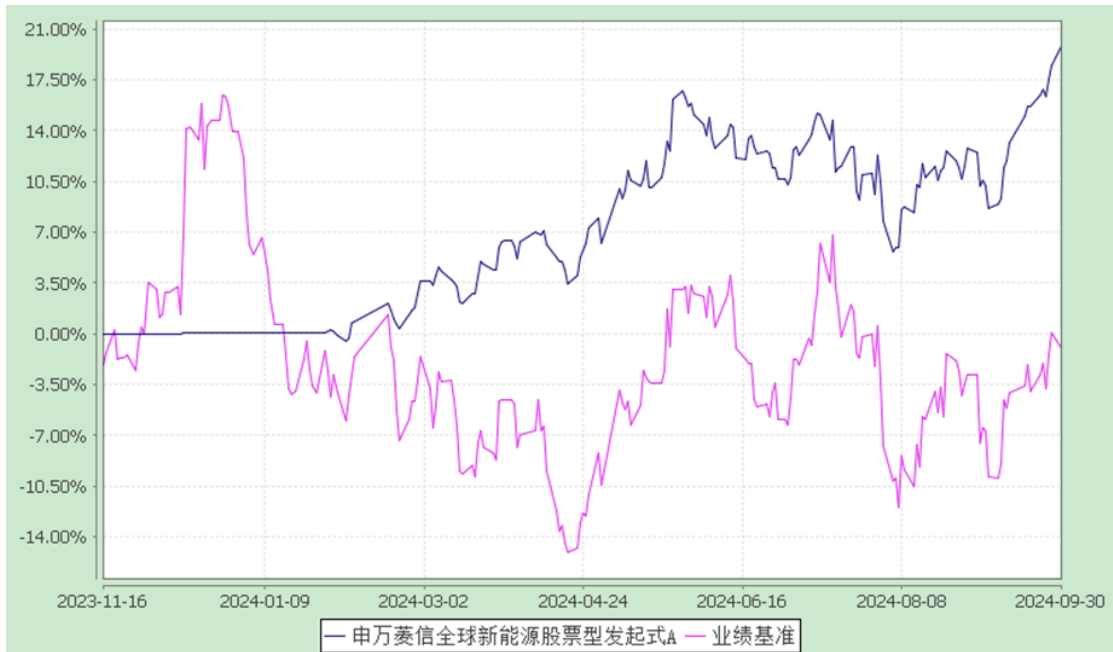
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差 ②	业绩比较基 准收益率③	业绩比 较基准 收益率 标准差 ④	①-③	②-④
2023年11月16日(基金合同生效日)至2023年12月31日	0.07%	0.01%	13.90%	2.13%	-13.83%	-2.12%
2024年1月1日至2024年9月30日	19.52%	0.93%	-13.05%	2.01%	32.57%	-1.08%

月 30 日						
自基金 合同生 效日至 2024 年 09 月 30 日	19.60%	0.85%	-0.96%	2.03%	20.56%	-1.18%

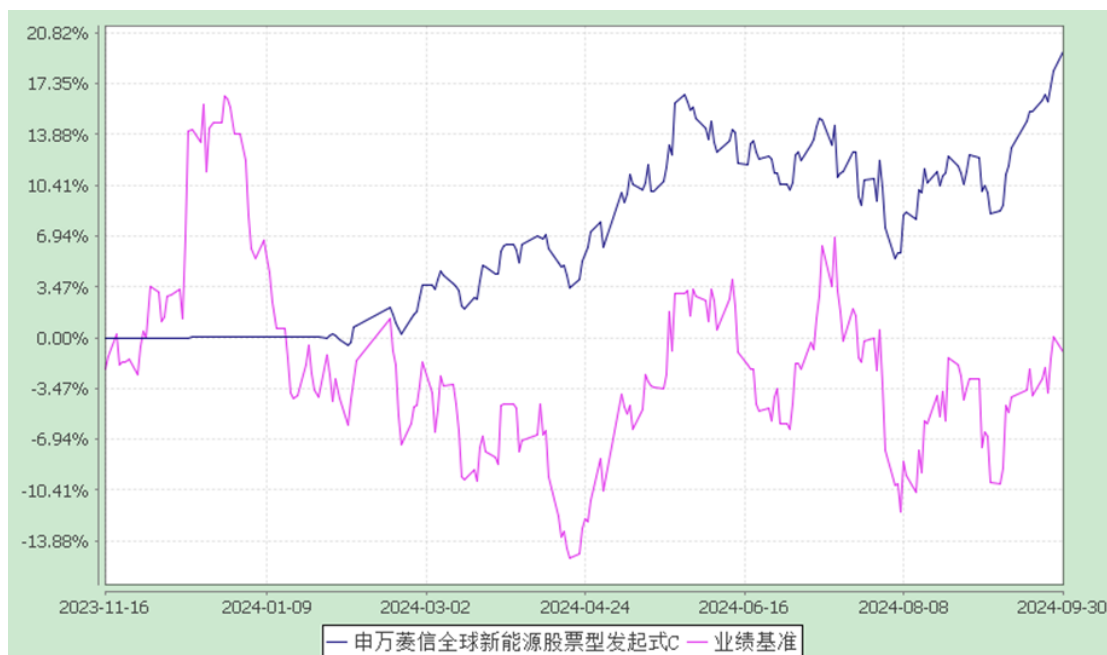
**2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较**

申万菱信全球新能源股票型发起式证券投资基金  
 累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
 (2023 年 11 月 16 日至 2024 年 9 月 30 日)

1. 申万菱信全球新能源股票型发起式 A:



2. 申万菱信全球新能源股票型发起式 C:



注：（1）本基金合同生效日为2023年11月16日，截至本报告期末本基金合同生效未  
满一年。

（2）本基金在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

## 第五部分 基金管理人

### 一、基金管理人概况

名称：申万菱信基金管理有限公司

注册地址：上海市中山南路 100 号 11 层

办公地址：上海市中山南路 100 号 11 层

法定代表人：陈晓升

设立日期：2004 年 01 月 15 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会，证监基金字【2003】144 号文

组织形式：有限责任公司

注册资本：壹亿伍仟万元人民币

联系电话：（021）23261188

联系人：蔡琳娜

股权结构：申万宏源证券有限公司持有 67%的股权，三菱 UFJ 信托银行株式会社持有 33%的股权

### 二、主要人员情况

#### 1、董事会成员

陈晓升先生，董事长，硕士研究生。1994 年起从事金融相关工作，曾任上海申银万国证券研究所有限公司总经理、申万宏源证券有限公司总经理助理等职。2021 年 6 月加入申万菱信基金管理有限公司，现任公司党委委员、书记、董事长。

王慧晶女士，董事，硕士研究生。2007 年起从事金融相关工作，曾任职于宏源证券，现任申万宏源证券有限公司机构客户总部党支部书记、总经理。

金杰先生，董事，大学本科。1994 年起从事金融相关工作，曾任职于万国证券、申银万国证券等，现任申万宏源证券有限公司财富管理事业部副总经理兼运营管理部总经理。

川上丰先生，董事，日本籍，大学学历。1990 年 4 月至今任职于三菱 UFJ 信托银行株式会社（原三菱信托银行），曾任职于海外资产管理事业部、受托财产企划部、全资子公司 First Sentier Investors 等，现任三菱 UFJ 信托银行株

式会社常务执行役員、受托财产副部门长、资产管理事业长。

四宫大辅先生，董事，日本籍，大学学历。1997年4月至今任职三菱UFJ信托银行株式会社（原三菱信托银行），曾任职于市场国际部、纽约分行、全资子公司三菱UFJ资产管理株式会社等，现任三菱UFJ信托银行株式会社资产管理事业部次长兼全球资产管理室副室长。

汪涛先生，董事，硕士研究生。2003年起从事金融相关工作，曾任职于汇丰银行、新加坡华侨银行、渣打银行、宁波银行、永赢基金管理有限公司、平安基金管理有限公司等。2020年3月加入申万菱信基金管理有限公司，现任公司总经理，兼任申万菱信（上海）资产管理有限公司董事长。

杨晔女士，独立董事，博士研究生。2005年9月起任职于上海财经大学，曾任职于上海财经大学财经研究所副研究员、公共经济与管理学院投资系副研究员，现任公共经济与管理学院投资系教授。

马晨光女士，独立董事，硕士研究生。曾任职于上海怡东建设发展有限公司，现任上海市协力律师事务所高级合伙人。

余卫明先生，独立董事，大学本科学历。曾任职于湖南省民政干部中等专业学校、中南工业大学，现任中南大学法学院教授。

## 2、监事会成员

刘震先生，监事会主席，博士研究生。1997年7月起从事金融相关工作，曾任职于申万宏源证券有限公司（原申银万国证券股份有限公司）研发中心、计统部、办公室，现任申万宏源证券有限公司审计总部/监事会办公室党支部副书记、副总经理，兼任申万菱信基金管理有限公司监事会主席和申万菱信（上海）资产管理有限公司监事会主席。

增田义之先生，监事，日本籍，硕士研究生。1989年4月至今任职于三菱UFJ信托银行株式会社（原三菱信托银行），曾任职于资产运用部、股票运用部、指数战略运用部、受托财产企划部等，现任资产管理事业部特聘专家职务。

葛诚亮先生，职工监事，硕士研究生。2011年2月加入申万菱信基金管理有限公司，从事风险管理工作，现任风险管理部负责人。

葛菲斐女士，职工监事，大学本科学历，2006年加入申万菱信基金管理有限

公司，曾任职于行政管理总部，主要从事行政管理、人力资源相关工作，曾任人力资源总部总监助理，现任组织与人力资源部负责人。

### 3、高级管理人员

汪涛先生，相关介绍见董事会成员部分。

史莉珠女士，大学本科学历。曾任职于中国住总集团建设总公司、香港佳勇国际有限公司，1994年起从事金融相关工作，曾任职于北京京华信托有限责任公司、申银万国证券股份有限公司北京分公司、申万宏源证券有限公司、申万宏源证券承销保荐有限责任公司等。2022年2月加入申万菱信基金，现任公司副总经理兼财务负责人，兼任申万菱信（上海）资产管理有限公司董事。

王菲萍女士，硕士研究生。曾在申银万国证券股份有限公司总裁办任法律顾问等职务。2004年加入申万菱信基金管理有限公司，曾任监察稽核总部总监，现任公司督察长，兼任申万菱信（上海）资产管理有限公司监事。

钟瑜阳先生，硕士研究生。曾任江西科益高新技术有限公司系统工程师，上海天玑科技股份有限公司技术服务工程师，2011年起从事金融相关工作，曾任财通基金管理有限公司信息技术部经理、高级经理、总监助理、副总监（主持工作）等职。2021年11月加入申万菱信基金管理有限公司，现任公司首席信息官，兼任申万菱信（上海）资产管理有限公司董事。

### 4、基金经理

现任基金经理

陈晨先生，硕士研究生。2013年起从事金融相关工作，曾任职于中国工商银行股份有限公司、花旗银行（中国）有限公司、上投摩根基金管理有限公司，2021年9月加入申万菱信基金，现任申万菱信全球新能源股票型发起式证券投资基金（QDII）基金经理。

### 5、投资决策委员会委员名单

本委员会由以下人员组成：公司总经理、分管投资的副总经理、宏观策略分

析师、法律合规与审计部门负责人和 risk 管理部门负责人等。

总经理为本委员会主席，分管投资的副总经理为会议召集人，宏观策略分析师为本委员会秘书，负责协调统筹本委员会的各项事宜。

督察长作为非执行委员，有权列席本委员会的任何会议，但不参与投票表决。

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

### 三、基金管理人的职责

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

（2）办理基金备案手续；

（3）自基金合同生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；

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

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

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

（7）依法接受基金托管人的监督；

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

（9）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

（10）编制季度报告、中期报告和年度报告；

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

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

顾问提供服务需要提供的情况除外；

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

（14）按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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

（16）按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料不少于法定最低期限；

（17）确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照基金合同规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的条件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。

#### 四、基金管理人的承诺

1、本基金管理人于此承诺将遵守适用的法律法规和基金合同。

2、本基金管理人承诺禁止用本基金财产从事以下行为：

- (1) 将其固有财产或者他人财产混同于本基金财产从事证券投资；
- (2) 不公平地对待其管理的不同基金财产；
- (3) 利用本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) 向本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、中国证监会及基金合同规定禁止从事的其他行为。

3、本基金基金经理承诺

- (1) 依照有关法律法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为本基金份额持有人谋取最大利益；
- (2) 不为自己、其代理人、代表人、受雇人或任何第三人牟取非法利益；
- (3) 不违反现行有效的有关法律法规、基金合同和中国证监会的有关规定，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，利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
- (4) 不协助、接受委托或以其他任何形式为除本基金管理人以外的其他组织或个人进行证券交易。

#### 五、基金管理人的内部控制制度概述

##### 1、内控体系设计依据

本基金管理人内控体系的设计基于满足国家有关法律法规的要求，以及本基金管理人对相关法律法规精神的深入理解，结合本基金管理人对基金管理业务的理解和规划并借鉴股东单位在资产管理业务领域长期的实践经验。

## 2、内控体系设计原则

（1）健全性原则：内部控制覆盖公司的各项业务、部门或机构和各级人员，并贯穿到决策、执行、监督、反馈等各个环节。

（2）有效性原则：本基金管理人内控体系注重于建立不同层次的风险控制和监察程序，同时各业务部门和岗位均设立并遵循合理的管理制度和有效率的工作流程。本基金管理人内部控制体系的建立在各项业务的运行过程中将发挥事前防范风险、事中监控和事后稽核的作用。

（3）独立性原则：本基金管理人各机构、部门和岗位职责应当保持相对独立，公司旗下基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离。设立独立于各业务和管理部门的风险管理部对各部门、岗位进行流程监控和风险管理。此外，更具独立性的督察长和法律合规与审计部，对各部门的业务开展进行合规监察，并代表董事会对公司的运营进行独立的稽核。

（4）相互制约原则：公司内部部门和岗位的设置权责分明、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，通过合理的成本控制达到最佳的内部控制效果。

## 3、风险管理及内部风险控制的组织结构

为满足业务发展中风险控制的要求，本公司建立了董事会、经营管理层、内部风险控制部门、各职能部门的四级风险管理及内部风险控制组织结构，并明确了相应的风险管理职能。

（1）董事会对有效的风险管理承担最终责任，董事会下设风险控制委员会与督察长。风险控制委员会负责监督和核实公司作出的与其所管理的基金有关的重大投资决策是否符合该基金的一般投资政策；检查和监督公司存在或潜在的各种风险以及公司遵守法律的情况。督察长负责独立监督检查基金和公司运作的合法、合规情况及公司内部风险控制情况，依法向中国证监会和公司董事会报告。

（2）经营管理层对有效的风险管理承担直接责任，经营管理层下设风险管理委员会，负责指导、协调和监督各职能部门和各业务单元开展风险管理工作，审核公司的风险控制制度和风险管理流程，确保对公司整体风险进行风险评估的识别、监控与管理，对公司存在的风险隐患或出现的风险问题进行研究、提出解决方法，组织实施风险应对方案等。

(3) 法律合规与审计部和风险管理部是公司内部风险控制部门，负责对投资组合市场风险、流动性风险、信用风险、合规风险、操作风险、声誉风险、子公司管控风险等的风险管理进行独立评估、监控、检查和报告。

(4) 各职能部门负责执行风险管理的基本制度流程，具体制定、组织实施并持续完善本部门业务相关的风险管理制度和相关应对措施、控制流程、监控指标等，将风险管理的原则与要求贯穿业务开展的全过程并对其风险管理的有效性负责。

## 六、基金管理人内部控制要素

### 1、内部控制环境

(1) 内部控制环境包括经营理念和内控文化，公司治理结构、组织结构、员工道德素质等内容；

(2) 本基金管理人致力于营造一个强调内控和风险管理文化氛围；

(3) 本基金管理人按现代企业制度的要求，建立了符合公司发展需要的组织结构和运行机制，充分发挥独立董事、监事会对公司管理层和经营活动的监督，通过在董事会、监事会层面建立专业化、民主、透明的决策程序和管理、议事规则，防止不正当的关联交易、利益输送和公司内部人控制的现象并确保基金份额持有人的利益不受侵犯；

(4) 本基金管理人建立了科学的聘用、培训、评估考核、晋升、淘汰等人力资源管理制度，建立了健全的激励与约束机制，确保公司职员具备和保持良好的职业操守和专业素养；

(5) 本基金管理人建立了贯穿于公司整体的、层次明晰、权责统一、监管明确的四层内部控制防线，包括：

第一层：员工的自律与岗位之间的相互制衡与监督；

第二层：严格的授权管理及等级监督制度；

第三层：独立于各部门、服务于公司高级管理层的由风险管理部对各业务部门实施的日常常规风险检查；

第四层：服务于董事会的独立的合规监察与稽核；

(6) 本基金管理人建立了重要业务处理凭据传递和信息沟通制度，有关部门和岗位之间相互监督、相互制衡。

## 2、风险评估

(1) 风险评估，包括风险鉴别和风险测算两大部分，是风险控制管理的前提；

(2) 风险鉴别指公司需要确认并了解它所面临风险的特征；

(3) 风险测算则在风险鉴别的基础上进一步对风险可能产生的损失作出较为科学和准确的估测；

(4) 风险管理委员会需要从风险损失的领域进行划分，确认某项风险将导致公司承担相应法律责任、社会和公众责任、经济损失或是在以上三个领域的任何组合损失；

(5) 各部门应负责落实其相关的风险控制措施；

(6) 风险管理部需要在预期风险损失发生的情景下，评估风险对各方面产生的冲击效应。

## 3、控制活动

(1) 严格的流程控制是公司进行有效的内部控制的基础。

1) 本基金管理人各项业务操作均应严格遵守公司制定的相应流程，主要的基本业务流程包括：销售和基金募集管理流程、客户开户和注册登记管理流程、客户服务与客户关系处理流程、投资决策管理流程、投资交易管理流程、基金清算与基金会计管理流程、产品开发流程、信息披露管理流程、信息技术管理与操作流程、紧急应变程序、绩效评估与考核程序、授权管理程序、风险控制流程和监察稽核程序等；

2) 在主要基本业务流程体系的基础上，各部门结合基本业务流程和其部门、岗位的职责进一步制定具体的、涵盖操作细节的操作流程；在销售、注册登记、投资、交易、基金清算及授权管理等重要操作流程设计与执行中应产生和保留详细的书面记录；

3) 风险管理部在日常业务运行过程中对操作流程的遵守情况进行全面监督和记录；

4) 各部门主管负责对本部门的流程运作进行实时监控以保证本部门的工作严格遵守相关业务流程；

5) 法律合规与审计部以定期稽核的方式检查各业务部门对相关流程运作与

遵守情况，并对该流程的合理性、可操作性以及得到遵守的实际状况进行评估；

（2）严格的分级授权是公司内部控制的基本方式；

（3）建立完善的资产分离制度，基金资产与公司资产、不同基金的资产和其他委托资产实行独立运作，分别核算；

（4）严格执行岗位分离制度，明确制定了岗位职责；

（5）建立科学的业绩评估和考核体系，定期对各项业务开展作出综合评价并对各部门和岗位人员的业绩进行评估、考核；

（6）制定切实有效的紧急应变制度，建立危机处理的机制，明确危机处理的程序。

#### 4、信息沟通

（1）建立公司内部的信息沟通渠道，保障信息的及时、准确的传递，并且维护渠道的畅通；

（2）建立清晰的报告系统；

（3）如果遇到紧急情况无法联络上级主管，可以越级汇报。

#### 5、内部监控

本基金管理人建立了有效的内部监控体系，设置督察长和独立的法律合规与审计部，对公司内控制度的执行情况进行持续的监督，保证内控制度落实。

（1）设督察长，对董事会负责，经董事会聘任。根据公司监察稽核工作的需要和董事会授权开展工作；

（2）设独立于公司运营管理部门的法律合规与审计部，法律合规与审计部通过定期稽核计划以及不定期的抽查稽核实现对公司的内部风险监控；

（3）设独立于各业务部门的风险管理部，该部门的工作主要对公司管理层负责；

（4）各部门主管负责本部门对于内控制度的执行和监督；在具体的业务运营中，授权管理、岗位间相互监督与相互制衡以及业务流程中跨部门之间的相互校验与会签制度的执行将赋予各岗位具体的监督职能；

（5）督察长、风险管理部和投资总监有权对整个投资交易过程实施全程跟踪的在线监控；信息技术部在信息技术方面对这项实时监控提供充分的技术支持。监控者根据其授权范围和监控领域对于投资交易过程中的控制参数进行预设置；

（6）各部门在发现任何有违反内控原则的行为时，应立即根据报告流程逐级上报，遇到紧急情况可以越级上报；

（7）对于员工个人违反法律法规和有关规定，视其给公司造成的损失及影响程度进行处理。对各项规定制度完善、风险防范工作积极主动并卓有成效的部门，公司将给予适当表彰与鼓励。由于部门制度不合适或管理不完善而造成较大风险并给公司带来损失的，公司将追究部门主要负责人的责任。

#### 七、基金管理人内部控制制度声明

- 1、本基金管理人承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确；
- 2、本基金管理人承诺根据市场变化和基金管理人发展不断完善内部合规控制。

## 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》、《试行办法》、《通知》、基金合同及其他有关规定募集，本次募集经中国证监会证监许可【2023】2136号文注册。

### 一、基金基本情况

#### 1、基金名称

申万菱信全球新能源股票型发起式证券投资基金（QDII）

#### 2、基金的类别

股票型发起式证券投资基金（QDII）

#### 3、基金的运作方式

契约型开放式

#### 4、基金发起资金的来源

基金发起资金来自于基金管理人的股东资金、基金管理人固有资金、基金管理人高级管理人员或基金经理等人员参与认购的资金。

#### 5、发起资金的认购金额和认购份额的锁定期

本基金为发起式基金。使用发起资金认购基金的金额不少于 1000 万元人民币，且持有期限自基金合同生效之日起不少于 3 年（基金合同生效不满 3 年提前终止的情况除外，下同），法律法规和监管机构另有规定的除外。

#### 6、销售币种

人民币。在不违反法律法规的情况下，基金管理人可以增加新的销售币种，或者调整现有基金销售币种设置、或者停止现有币种的销售等，调整前基金管理人需公告并报中国证监会备案。

#### 7、基金存续期限

不定期

基金合同生效满 3 年之日（指自然日），若基金资产净值低于 2 亿元，基金合同自动终止，无需召开基金份额持有人大会审议，且同时不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。若届时的法律法规或中国证监会规定发生变化，上述终止规定被取消、更改或补充时，则本基金可以参照届时有效的法律法规或中国证监会规定执行。

如本基金在基金合同生效满 3 年后继续存续的，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 50 个工作日出现前述情形的，本基金将根据基金合同的约定进入清算程序并终止，而无需召开基金份额持有人大会审议。

法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

#### 8、基金份额的类别

本基金根据认购费、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。

在投资人认购/申购时，收取认购/申购费用，并不再从本类别基金财产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；不收取认购/申购费用，但从本类别基金财产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。相关费率及费率水平在招募说明书中具体列示。

本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算并公告基金份额净值。

投资者可自行选择认购、申购的基金份额类别。

基金管理人可调整认/申购各类基金份额的最低金额限制及规则。在不违反法律法规、基金合同的规定以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，经与基金托管人协商一致，基金管理人可增加、减少或调整基金份额类别设置、对基金份额分类办法及规则进行调整，或调整本基金的申购费率、变更收费方式或调低赎回费率等，无需召开基金份额持有人大会，但基金管理人必须在开始调整实施之日前依照《信息披露办法》的规定在规定媒介上刊登公告。

#### 二、募集方式和募集场所

本基金通过各销售机构的基金销售网点公开发售，各销售机构的具体名单见基金份额发售公告以及基金管理人网站的公示信息。

#### 三、募集期

募集期限为自基金份额发售之日起不超过 3 个月，具体募集时间以基金份额发售公告为准，请投资者就募集和认购事宜仔细阅读本基金的基金份额发售公告。

#### 四、募集对象

符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、合



格境外投资者和发起资金提供方以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。

## 五、募集目标

本基金可根据中国证监会和国家外汇局核准的额度（美元额度需折算为人民币）或本基金的实际情况设定基金募集上限，并在招募说明书以及相关公告中列示；募集期内超过募集目标上限时采取比例配售的方式进行确认，具体办法参见基金份额发售公告。

基金合同生效后，基金的资产规模不受上述限制，但基金管理人有权根据基金的外汇额度控制基金申购规模并暂停基金的申购。

## 六、认购时间

投资人可在募集期内前往本基金销售机构的销售网点办理基金份额认购手续，具体的业务办理时间详见本基金的基金份额发售公告或各销售机构相关业务办理规则。

## 七、认购手续

### 1、投资人认购本基金份额应提交的文件和办理的手续

投资者认购本基金基金份额，应开立申万菱信基金管理有限公司开放式基金账户。募集期内，投资者可通过基金管理人及其他销售机构的营业网点办理开户和认购手续。

在募集期间，投资者认购本基金基金份额应当按照基金管理人及其他销售机构销售网点的规定，到相应的销售网点填写认购申请书，并按照其规定的方式全额缴纳认购款。

投资者认购本基金份额应提交的文件和办理的手续详见本基金的基金份额发售公告。

### 2、认购申请的确认

投资者按照基金合同的约定提交认购申请并交纳认购基金份额的款项时，基金合同成立，基金管理人按照规定办理完毕基金募集的备案手续并取得中国证监会书面确认，基金合同生效；基金销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购申请的确认以登记机构的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况，投资者应及时查询并妥善

行使合法权利，否则，由此产生的投资者任何损失由投资者自行承担。

## 八、认购方式

1、本基金基金份额初始发售面值为人民币 1.00 元。

2、基金份额的认购费用

(1) 本基金对通过基金管理人直销中心认购 A 类基金份额的养老金客户与除此之外的其他投资者实施差别的认购费率，对通过直销中心认购 A 类基金份额的养老金客户实施特定认购费率。

养老金客户指基本养老基金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金等，包括全国社会保障基金、可以投资基金的地方社会保障基金、企业年金单一计划以及集合计划、企业年金理事会委托的特定客户资产管理计划、企业年金养老金产品、职业年金计划、养老目标基金。如将来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，基金管理人将在招募说明书更新时或发布临时公告将其纳入养老金客户范围。非养老金客户指除通过基金管理人直销中心认购的养老金客户外的其他投资者。

A 类基金份额的认购费用由认购 A 类基金份额的投资人承担，不列入基金财产，主要用于基金的市场推广、销售、登记等基金募集期间发生的各项费用。

本基金 A 类基金份额的认购费率如下表：

认购金额（元）	特定认购费率	认购费率
100 万以下	0.24%	0.80%
100 万（含）～500 万	0.15%	0.50%
500 万（含）以上	300 元/笔	1,000 元/笔

(2) 本基金 C 类基金份额不收取认购费。

3、认购份额的计算

(1) A 类基金份额的认购份额计算

本基金 A 类基金份额的认购费用采用前端收费模式，即投资人在认购 A 类基金份额时缴纳认购费。登记机构根据单次认购的实际确认金额确定每次认购所适用的费率并分别计算。

当认购费用适用比例费率时，认购份额的计算方法如下：

净认购金额 = 认购金额 / (1 + 认购费率)

认购费用 = 认购金额 - 净认购金额

认购份额 = (净认购金额 + 认购资金利息) / 基金份额初始发售面值

当认购费用为固定金额时，认购份额的计算方法如下：

认购费用=固定金额

净认购金额=认购金额-认购费用

认购份额=（净认购金额+认购资金利息）/基金份额初始发售面值

净认购金额和认购份额的计算结果保留到小数点后两位，小数点两位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

举例说明：

假设某投资人（非养老金客户）认购本基金 A 类基金份额，认购金额人民币 10,000 元，认购费率为 0.80%，假定募集期间认购资金所得利息为 35.50 元且该笔认购全部予以确认，则其可得到的 A 类基金份额计算如下：

净认购金额=10,000/（1+0.80%）=9,920.63 元

认购费用=10,000-9,920.63=79.37 元

认购份额=（9,920.63+35.50）/1.00=9,956.13 份

即：该投资人（非养老金客户）投资人民币 10,000 元认购本基金 A 类基金份额，认购费率为 0.80%，假定募集期间认购资金所得利息为 35.50 元且该笔认购全部予以确认，在基金合同生效后，其所获得的 A 类基金份额为 9,956.13 份。

## （2）C 类基金份额的认购份额计算

认购本基金 C 类基金份额不收取认购费用，登记机构根据单次认购的实际确认金额计算认购份额。

认购份额=（认购金额+认购资金利息）/基金份额初始面值

认购份额计算结果按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

举例说明：

假设某投资人认购本基金 C 类基金份额，认购金额 10,000 元，假定募集期间认购资金所得利息为 35.50 元且该笔认购全部予以确认，则其可得到的 C 类基金份额计算如下：

认购份额=（10,000+35.50）/1.00=10,035.50 份

即：该投资人投资 10,000 元认购本基金 C 类基金份额，假定募集期间认购资金所得利息为 35.50 元且该笔认购全部予以确认，在基金合同生效后，其所获

得的 C 类基金份额为 10,035.50 份。

#### 九、基金份额的认购原则

1、投资人在募集期内可以多次认购本基金份额，A 类基金份额的认购费按每笔 A 类基金份额的认购申请单独计算。认购申请一经受理不得撤销。

2、投资人在其他销售机构首次单笔认购最低金额为 1 元人民币（含认购费，下同），追加认购的单笔认购最低金额为 1 元人民币。投资人在直销中心首次单笔认购最低金额为 10 元人民币，追加认购的单笔认购最低金额为 10 元人民币。

基金管理人对于募集期间的单个投资者的累计认购金额不设上限限制。但是如本基金单一投资者累计认购的基金份额数达到或者超过基金总份额的 50%（基金管理人、基金管理人高级管理人员或基金经理等人员作为发起资金提供方除外），基金管理人可以采取比例确认等方式对该投资者的认购申请进行限制。基金管理人接受某笔或者某些认购申请有可能导致单一投资者变相规避前述 50% 比例要求的，基金管理人有权拒绝该等全部或者部分认购申请。投资人认购的基金份额数以基金合同生效后登记机构的确认为准。

3、基金管理人可根据有关法律法规的规定和市场情况，调整认购的数额限制，基金管理人最迟应于调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上予以公告。

4、投资者认购时，须按照销售机构规定的方式备足全额缴纳认购的金额的款项。

5、具体规则请参照申万菱信基金管理有限公司直销中心和各基金销售机构的规定。

#### 十、募集资金利息的处理方式

本基金的有效认购款项在基金募集期间产生的利息将折算为基金份额，归基金份额持有人所有。利息转份额的具体数额以登记机构的记录为准。

#### 十一、募集资金的保管

基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专用账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。

#### 十二、发起资金的认购

发起资金提供方认购金额不低于 1000 万元人民币，认购的基金份额持有期

限自基金合同生效之日起不少于 3 年，法律法规和监管机构另有规定的除外。

本基金发起资金的认购情况见基金管理人届时发布的公告。

## 第七部分 基金合同的生效

### 一、基金备案的条件

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

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

### 二、基金合同不能生效时募集资金的处理方式

如果募集期限届满，未满足基金备案条件，基金管理人应当承担下列责任：

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

### 三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

基金合同生效满 3 年之日（指自然日），若基金资产净值低于 2 亿元，基金合同自动终止，无需召开基金份额持有人大会审议，且同时不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。若届时的法律法规或中国证监会规定发生变化，上述终止规定被取消、更改或补充时，则本基金可以参照届时有效的法律法规或中国证监会规定执行。

本基金在基金合同生效满三年后继续存续的，基金存续期内，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 50 个工作日出现前述情形的,本基金将根据基金合同的约定进入清算程序并终止,而无需召开基金份额持有人大会审议。

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

### 二、申购和赎回的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

投资者在开放日办理基金份额的申购和赎回，本基金的开放日为上海证券交易所、深圳证券交易所以及本基金投资的主要境外市场同时开放交易的工作日，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。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，若出现新的证券交易市场或期货市场、证券交易所或期货交易所交易时间变更、其他特殊情况或根据业务需要，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告，具体时间以基金管理人届时公告为准。

#### 2、申购、赎回开始日及业务办理时间

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

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

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

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



基准进行计算；

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销，在当日的开放时间结束后不得撤销；

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

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

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

#### 四、申购与赎回的程序

##### 1、申购和赎回的申请方式

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

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

##### 2、申购和赎回的款项支付

投资人申购基金份额时，必须在规定的时间内全额交付申购款项，投资人在规定的时间内全额交付申购款项，申购成立；基金份额登记机构确认基金份额时，申购生效。基金份额持有人在提交赎回申请时，必须有足够的份额余额，则赎回成立，基金份额登记机构确认赎回时，赎回生效。

投资人 T 日的赎回申请经本基金的登记机构确认生效后，基金管理人将在 T +10 日（包括该日）内支付赎回款项。国家外汇管理相关规定有变更或本基金所投资市场的交易清算规则有变更时，赎回款项支付时间将相应调整；当基金投资的主要交易市场休市、外汇市场休市或暂停交易、港股通非交收日导致延迟交收、登记公司系统故障、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它非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程时，赎回款项支付日期可相应顺延。在发生巨额赎回或基金合同载明的

其他暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。

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+2日（包括该日）内对该交易的有效性进行确认。投资人应在T+3日后（包括该日）及时到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成立或无效，则申购款项本金退还给投资人，基金管理人及基金托管人不承担该退回款项产生的利息等损失。因投资者未及时进行查询而造成的后果由其自行承担。

销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购、赎回申请的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资者应及时查询并妥善行使合法权利，否则如因申请未得到登记机构的确认而产生的后果，由投资人自行承担。

基金管理人可以在法律法规允许的范围内对上述申购和赎回申请的确认时间进行调整，并必须在调整实施日前按照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

## 五、申购和赎回的数量限制

### 1、申购金额的限制

投资人在其他销售机构办理基金份额申购时，首次申购单笔最低金额为1元人民币（含申购费，下同），追加申购的单笔申购最低金额为1元人民币。投资人在直销中心首次单笔申购最低金额为10元人民币，追加申购的单笔申购最低金额为10元人民币。

投资人将当期分配的基金收益转购相应类别的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。

其他销售机构销售网点的投资人欲转入直销中心进行交易要受直销中心最低金额的限制。

投资人可多次申购，对单个投资人累计持有份额不设上限限制，但单一投资

者（基金管理人、基金管理人高级管理人员或基金经理等人员作为发起资金提供方除外）持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的 50%（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% 的情形除外）。法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

## 2、赎回份额的限制

基金份额持有人在销售机构（网点）赎回时，每笔赎回申请不得低于 1 份基金份额（但交易账户内剩余基金份额不足 1 份的除外）；基金份额持有人在销售机构（网点）的某一交易账户内基金份额不足 1 份的，应一次性全部赎回。

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

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

## 六、申购费用与赎回费用

### 1、基金份额的申购费用

（1）本基金对通过基金管理人直销中心申购 A 类基金份额的养老金客户与除此之外的其他投资者实施差别的申购费率，对通过直销中心申购 A 类基金份额的养老金客户实施特定申购费率。

养老金客户指基本养老基金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金等，包括全国社会保障基金、可以投资基金的地方社会保障基金、企业年金单一计划以及集合计划、企业年金理事会委托的特定客户资产管理计划、企业年金养老金产品、职业年金计划、养老目标基金。如将来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，基金管理人将在招募说明书更新时或发布临时公告将其纳入养老金客户范围。非养老金客户指除通过基金管理人直销中心申购的养老金客户外的其他投资者。

A 类基金份额的申购费用由申购 A 类基金份额的投资人承担，不列入基金财

产，用于基金的市场推广、销售、登记等各项费用。

本基金 A 类基金份额的申购费率如下表：

申购金额（元）	特定申购费率	申购费率
100 万以下	0.30%	1.00%
100 万（含）~500 万	0.18%	0.60%
500 万（含）以上	300 元/笔	1,000 元/笔

（2）本基金 C 类基金份额不收取申购费。

## 2、基金份额的赎回费用

本基金 A 类、C 类基金份额均收取赎回费，赎回费用由赎回相应类别基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回各类基金份额时收取；对持续持有期少于 30 日的投资人收取的赎回费，将全额计入基金财产；对持续持有期不少于 30 日但少于 3 个月的投资人收取的赎回费，将赎回费总额的 75% 计入基金财产；对持续持有期不少于 3 个月但少于 6 个月的投资人收取的赎回费，将赎回费总额的 50% 计入基金财产，未归入基金财产的部分用于支付市场推广、销售、登记费和其他必要的手续费。（注：1 个月按 30 日计算）

本基金 A 类基金份额的赎回费率如下表：

持有期限	赎回费率
7 日以内	1.50%
7 日（含）-30 日	0.75%
30 日（含）-180 日	0.50%
180 日（含）以上	0.00%

本基金 C 类基金份额的赎回费率如下表：

持有期限	赎回费率
7 日以内	1.50%
7 日（含）-30 日	0.50%
30 日（含）以上	0.00%

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

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

5、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定以及对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，定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金销售费率，并进行公告。

## 七、申购份额与赎回金额的计算

### 1、申购份额计算

#### (1) A类基金份额的申购份额计算

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A类基金份额时缴纳申购费）。申购金额包括申购费用和净申购金额。登记机构根据单次申购的实际确认金额确定每次申购所适用的费率并分别计算。

当申购费用适用比例费率时，申购份额的计算方法如下：

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

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

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

当申购费用为固定金额时，申购份额的计算方法如下：

$$\text{申购费用} = \text{固定金额}$$

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

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

净申购金额及申购份额的计算以四舍五入方式保留到小数点后两位，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

举例说明：

某投资人（非养老金客户）投资10,000元申购本基金A类基金份额，对应费率为1.00%，假设申购当日A类基金份额净值为1.1320元，则其可得到的A类基金份额为：

$$\text{净申购金额} = 10,000 / (1 + 1.00\%) = 9,900.99 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 10,000 - 9,900.99 = 99.01 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 9,900.99 / 1.1320 = 8,746.46 \text{ 份}$$

即：该投资人（非养老金客户）投资10,000元申购A类基金份额，假设申购当日的A类基金份额净值为1.1320元，则可得到8,746.46份A类基金份额。

## （2）C类基金份额的申购份额计算

申购本基金 C 类基金份额不收取申购费用，登记机构根据单次申购的实际确认金额计算申购份额。

申购份额=申购金额/T 日 C 类基金份额净值

申购份额计算结果按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

举例说明：

某投资人投资 10,000 元申购 C 类基金份额，假设申购当日 C 类基金份额的基金份额净值为 1.1320 元，则其可得到的申购份额为：

申购份额=10,000/1.1320=8,833.92 份

即：该投资人投资 10,000 元申购 C 类基金份额，假设申购当日 C 类基金份额的基金份额净值为 1.1320 元，则可得到 8,833.92 份 C 类基金份额。

## 2、赎回金额计算

基金份额持有人在赎回基金份额时可能需按照约定缴纳一定的赎回费用。计算公式如下：

### （1）A类基金份额的赎回金额计算

赎回总金额=赎回份额×T 日 A 类基金份额净值

赎回费=赎回总金额×赎回费率

净赎回金额=赎回总金额-赎回费

赎回金额单位为人民币元，上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产享有或承担。

举例说明：

某基金份额持有人持有 10,000 份本基金 A 类基金份额超过 30 日但不满 180 日内决定赎回，对应的赎回费率为 0.50%，假设赎回当日的 A 类基金份额净值是 1.1320 元，则可得到的净赎回金额为：

赎回总金额=10,000×1.1320=11,320.00 元

赎回费=11,320.00×0.50%=56.60 元

净赎回金额=11,320.00-56.60=11,263.40 元

即：该基金份额持有人持有 10,000 份 A 类基金份额超过 30 日但不满 180 日

内赎回，对应的赎回费率为 0.50%，假设赎回当日的 A 类基金份额净值是 1.1320 元，则可得到的净赎回金额为 11,263.40 元。

#### （2）C 类基金份额的赎回金额计算

赎回总金额=赎回份额×T 日 C 类基金份额净值

赎回费=赎回总金额×赎回费率

净赎回金额=赎回总金额-赎回费

赎回金额单位为人民币元，上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产享有或承担。

举例说明：

某基金份额持有人持有 10,000 份 C 类基金份额 30 日后决定赎回，对应的赎回费率为 0.00%，假设赎回当日 C 类基金份额的基金份额净值是 1.1320 元，则可得到的净赎回金额为：

赎回总金额=10,000×1.1320=11,320.00 元

赎回费=11,320.00×0.00%=0.00 元

净赎回金额=11,320.00-0.00=11,320.00 元

即：该基金份额持有人持有 10,000 份 C 类基金份额 30 日后赎回，对应的赎回费率为 0.00%，假设赎回当日 C 类基金份额的基金份额净值是 1.1320 元，则可得到的净赎回金额为 11,320.00 元。

### 3、基金份额净值计算

本基金分为 A 类和 C 类两类基金份额，两类基金份额单独设置基金代码，分别计算和公告基金份额净值。本基金各类基金份额净值的计算，均保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。但如遇特殊情况，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。T 日的各类基金份额净值在 T+1 日计算，并在 T+2 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。

### 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，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。

3、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，继续接受申购可能会影响或损害其他基金份额持有人利益时。

4、基金投资的主要证券、期货交易所或外汇市场交易时间非正常停市，或基金参与港股通交易且港股通暂停交易，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

5、基金投资的主要证券、期货交易市场或外汇市场的公众节假日，并可能影响本基金正常估值时。

6、接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。

7、因基金收益分配、基金投资组合内某个或某些证券进行权益分派等原因，使基金管理人认为短期内继续接受申购可能会影响或损害现有基金份额持有人利益的。

8、基金管理人、基金托管人、基金销售机构、支付结算机构或登记机构的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。

9、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。

10、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者（基金管理人、基金管理人高级管理人员或基金经理等人员作为发起资金提供方除外）持有基金份额的比例达到或者超过 50%，或者变相规避 50%集中度的情形。

11、申请超过基金管理人设定的基金总规模（基金管理人可根据外管局的审批及市场情况进行调整）、单日净申购比例上限、单一投资者单日或单笔申购金额上限的。

12、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。

13、本基金基金管理人 QDII 额度不足、或因港股通交易当日额度使用完毕而暂停或停止接受买入申报，或者发生证券交易服务公司等机构认定的交易异常



情况并决定暂停提供部分或者全部港股通服务，或者发生其他影响通过内地与香港股票市场交易互联互通机制进行正常交易的情形。

#### 14、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 至 5、7、8、9、12、13、14 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在规定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的，被拒绝的申购款项本金将退还给投资人。基金管理人及基金托管人不承担该退回款项产生的利息的损失。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。当发生上述第 10、11 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。如果法律法规、监管要求调整导致上述第 10 项内容取消或变更的，基金管理人在履行适当程序后，有权修改或取消上述限制，而无须召开基金份额持有人大会，并在招募说明书或相关公告中明确。

#### 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，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。
- 3、基金投资的主要证券、期货交易所或外汇市场交易时间非正常停市，或基金参与港股通交易且港股通暂停交易，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
- 4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。
- 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、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其他基金份额持有人利益时。
- 7、基金销售机构、支付结算机构或登记机构的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。

8、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。

9、发生证券交易服务公司等机构认定的交易异常情况并决定暂停提供部分或者全部港股通服务，或者发生其他影响通过内地与香港股票市场交易互联互通机制进行正常交易的情形。

10、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述除第 4 项以外的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）超过前一工作日的基金总份额的 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、部分延期赎回或延缓支付赎回款项。

（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工作日基金总份额的 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，确定当日受理该单个账户的赎回份额；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。部分顺延赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

若基金发生巨额赎回，在出现单个基金份额持有人赎回申请超过上一工作日基金总份额 20%（“大额赎回申请人”）的情形下，基金管理人应当对大额赎回申请人的赎回申请延期办理，即按照保护其他赎回申请人（“小额赎回申请人”）利益的原则，基金管理人应当优先确认小额赎回申请人的赎回申请，具体为：如小额赎回申请人的赎回申请在当日被全部确认，则基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一工作日基金总份额的 10%的前提下，在仍可接受赎回申请的范围内对大额赎回申请人的赎回申请按比例确认，对大额赎回申请人未予确认的赎回申请延期办理；如小额赎回申请人的赎回申请在当日未被全部确认，则基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一工作日基金总份额的 10%的前提下，在可接受赎回申请的范围内对小额赎回申请人的赎回申请按比例确认，对全部未确认的赎回申请（含小额赎回申请人的其余赎回申请与大额赎回申请人的全部赎回申请）延期办理。延期办理的具体程序，按照本条规定的延期赎回或取消赎回的方式办理；同时，基金管理人应当对延期办理的事宜在规定媒介上刊登公告。

（3）暂停赎回：连续 2 个开放日以上（含 2 个开放日）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，并在 2 日内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、如发生暂停的时间为 1 日，基金管理人应于重新开放日，在规定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近 1 个工作日的各类基金份额净值。

3、如发生暂停的时间超过 1 日，基金管理人可以根据暂停申购或赎回的时间，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，并公告最近一个工作日的各类基金份额净值；也可以根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间，届时可不再另行发布重新开放的公告。

## 十二、基金转换

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

## 十三、基金份额的转让

在法律法规允许且条件具备的情况下，基金管理人可受理基金份额持有人通过中国证监会认可的交易场所或者交易方式进行份额转让的申请并由登记机构办理基金份额的过户登记。基金管理人拟受理基金份额转让业务的，将提前公告，基金份额持有人应根据基金管理人公告的业务规则办理基金份额转让业务。

## 十四、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；司法强制执行是指依据生效司法文书和协助执行通知书要求登记机构将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供基金登记机构要求提供的相关资料，对于符合条件的非交易过户申请按基金登记机构的规定办理，并按基金登记机构规定的标准收费。

## 十五、基金的转托管

基金份额持有人可办理已持有基金份额在不同销售机构之间的转托管，基金

销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。

#### 十六、定期定额投资计划

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

#### 十七、基金份额的冻结、解冻和质押

基金登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻，以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。基金账户或基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益一并冻结，被冻结部分份额仍然参与收益分配与支付。法律法规或监管部门另有规定的除外。

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

#### 十八、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“第十五部分 侧袋机制”章节或相关公告的规定。

十九、在不违反相关法律法规规定和基金合同约定且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人可根据具体情况对上述申购和赎回以及相关业务的安排进行补充和调整并提前公告，无需召开基金份额持有人大会审议。

## 第九部分 基金费用与税收

### 一、基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费，含境外投资顾问的投资顾问费（如有）；
- 2、基金托管人的托管费，含境外托管人的托管费；
- 3、基金销售服务费；
- 4、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用，法律法规、中国证监会另有规定的除外；
- 5、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费、仲裁费和税务顾问费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券、期货等交易费用及在境外市场的交易、清算、登记等过程中实际发生的费用；
- 8、基金的银行汇划费用和外汇兑换交易的相关费用；
- 9、账户开户费用和账户维护费；
- 10、基金依照有关法律法规应当缴纳的、购买或处置证券有关的任何税收、征费、关税、印花税、交易及其他税收及预扣提税（以及与前述各项有关的任何利息、罚金及费用）以及相关手续费、汇款费、基金的税务代理费等；
- 11、为应付赎回和交易清算而进行临时借款所发生的费用；
- 12、因投资港股通标的股票而产生的各项费用；
- 13、按照国家有关规定和基金合同约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

### 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费自基金合同生效日次日起每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后

于次月首日起 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、公休日等，支付日期顺延。

## 2、基金托管人的托管费

如基金托管人委托境外托管人，托管费包括向境外托管人支付的相应服务费。

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费自基金合同生效日次日起每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，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 0.20%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务，基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。销售服务费计提的计算公式如下：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

基金销售服务费自基金合同生效日次日起每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付。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—13 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

## 三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

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

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、基金合同生效前的相关费用；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

#### 四、实施侧袋机制期间的基金费用

本基金实施侧袋机制的，与侧袋账户有关的费用可以从侧袋账户中列支，但应待侧袋账户资产变现后方可列支，有关费用可酌情收取或减免，但不得收取管理费，详见招募说明书“第十五部分 侧袋机制”章节的规定或相关公告。

#### 五、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家或投资市场所在国家或地区的税收法律、法规执行。除因基金管理人或基金托管人疏忽、故意行为导致基金在税收方面的损失外，基金管理人和基金托管人不承担责任。

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。



## 第十部分 基金的财产

### 一、基金资产总值

基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券及票据价值、银行存款本息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在境内开立人民币和外汇资金账户，在境外开立外币资金账户及证券账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、境外托管人、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、境外托管人和基金服务机构的财产，并由基金托管人和境外托管人保管。基金管理人、基金托管人、境外托管人、基金登记机构和基金服务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、境外托管人因依法解散、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。

在符合基金合同和托管协议有关资产保管的要求下，对境外托管人的破产而产生的损失，基金托管人应采取措施进行追偿，基金管理人配合基金托管人进行追偿。

除非基金管理人、基金托管人及其境外托管人存在过失、疏忽、欺诈或故意不当行为，基金管理人、基金托管人将不保证基金托管人或境外托管人所接收基金财产中的证券的所有权、合法性或真实性（包括是否以良好形式转让）及其他效力瑕疵。基金管理人、基金托管人不对境外托管人依据当地法律法规、证券、

期货交易所规则、市场惯例的作为或不作为承担责任。

基金托管人和境外托管人应妥善保存基金管理人基金财产汇入、汇出、兑换、收汇、现金往来及证券交易的记录、凭证等相关资料，并按规定的期限保管，但境外托管人持有的与境外托管人账户相关的资料的保管应按照境外托管人的业务惯例保管。

基金份额持有人购买本基金份额，即视为已理解并接受在全球托管模式下，资金账户中的现金由基金托管人或其境外托管人以银行身份持有，现金存入资金账户时构成境外托管人的等额债务，基金份额持有人不对该现金资产享有优先求偿权，除非法律法规及撤销或清盘程序明文规定该等现金不归于清算财产外。

## 第十一部分 基金资产估值

### 一、估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券、期货交易场所的交易日且同时为本基金主要境外投资市场的正常交易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、基金、权证、债券、存托凭证、衍生品种合约和银行存款本息、应收款项、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、已上市流通的权益类证券的估值

交易所上市流通的权益类证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化以及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、处于未上市期间的权益类证券应区分如下情况处理

（1）送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；

（2）首次发行未上市的股票，按发行价格估值；

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

##### 3、债券等固定收益品种

境内债券等固定收益品种：

（1）交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（基金合同另有约定的除外），选取估值日第三方估值机构提供的相应品种对应的估值净价估值，具体估值机构由基金管理人与基金托管人另行协商约定；

（2）对在交易所上市交易的公开发行的可转换债券等有活跃市场的含转股权的债券，按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息（税后）得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行人未发生影响证券价格的重大事件，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息（税后）得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

（3）交易所上市实行全价交易的债券（公开发行的可转债除外），选取第

三方估值机构提供的估值全价减去估值全价中所含的债券应收利息（税后）得到的净价进行估值；

（4）对已发行未上市或未挂牌转让且不存在活跃市场的固定收益品种，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定其公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

境外债券等固定收益品种：

（1）交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值。

如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

（2）交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

（3）对于非上市债券，参照主要做市商或其他行业通用权威的报价系统提供的报价进行估值，未能取得上述报价的，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、存托凭证估值方法

公开挂牌的存托凭证按其所在证券交易所的最近交易日的收盘价估值。估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。

本基金投资境内发行的存托凭证的估值核算，依照境内上市交易的股票执行。

6、基金的估值

（1）上市流通的基金按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值。

如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

(2) 非上市流通的基金以其公布的估值日净值进行估值，未公布估值日净值的，以估值日前最新的净值进行估值。

#### 7、衍生品估值方法

(1) 上市流通衍生品按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。

(2) 未上市衍生品采用估值技术确定公允价值；若衍生品价格无法通过公开信息取得，由基金管理人负责从其经纪商处取得，并及时告知基金托管人。

8、基金持有的其他有价证券，从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的有价证券投资按估值日在证券交易所挂牌的该证券投资的收盘价估值；估值日没有交易的，按最近交易日的收盘价估值；未上市交易的其他有价证券投资按公允价估值。

9、在任何情况下，基金管理人如采用上述方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。

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

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

12、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。

#### 13、外汇汇率

估值计算中涉及主要货币对人民币汇率的，将依据下列信息提供机构所提供的汇率为基准：当日中国人民银行或其授权机构公布的人民币与主要货币的中间价。主要外汇种类以中国人民银行或其授权机构最新公布为准；中国人民银行或其授权机构未公布人民币汇率的币种，采用美元作为中间货币进行换算，与美元的汇率则以估值日彭博（伦敦时间）16:00 报价数据为准。若无法取得上述汇率价格信息时，以基金托管人或境外托管人所提供的合理公开外汇市场交易价格为准。

#### 14、税收

对于按照中国法律法规和基金投资所在地的法律法规规定应交纳的各项税

金，本基金将按权责发生制原则进行估值；对于因税收规定调整或其他原因导致基金实际交纳税金与估算的应交税金有差异的，基金将在相关税金调整日或实际支付日进行相应的估值调整。

对于非代扣代缴的税收，基金管理人可以聘请税收顾问对相关投资市场的税收情况给予意见和建议。境外托管人具体协调基金在海外税务的申报、缴纳及索取税收返还等相关工作。

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

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

## 五、估值程序

1、各类基金份额净值是按照每个估值日各类基金资产净值除以当日该类基金份额的余额数量计算，均精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。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。如遇特殊情况，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。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人于每个工作日计算前一估值日基金资产净值及各类基金份额净值，并按规定公告。

2、基金管理人应于每个工作日对前一估值日的基金资产进行估值。但基金管理人根据法律法规或基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将各类基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人按约定对外公布。

## 六、估值错误的处理

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

估值错误时，视为该类基金份额净值错误。

基金合同的当事人应按照以下约定处理：

### 1、估值错误类型

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

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

### 2、估值错误处理原则

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

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

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

（4）估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

### 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：



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

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

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

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

#### 4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

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

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

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

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

② 若基金管理人计算的基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告，而且基金托管人未对计算过程提出疑义或要求基金管理人书面说明，基金份额净值出错且造成基金份额持有人损失的，应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金额，就实际向基金份额持有人或基金支付的赔偿金额，基金管理人与基金托管人按照管理费和托管费的比例承担相应责任。

③ 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，基金托管人予以免责。

④由于一方当事人提供的信息错误，另一方当事人在采取了必要合理的措施后仍不能发现该错误，进而导致基金份额净值计算错误而引起的基金份额持有人的损失，以及由此造成以后交易日净值计算顺延错误而引起的基金份额持有人的损失，由提供错误信息的当事人负责赔偿。

（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交易市场、期货交易市场或外汇市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人、境外托管人、境外投资顾问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、中国证监会或基金合同认定的其他情形。

### 八、基金净值的确认

用于基金信息披露的基金资产净值和各类基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个工作日计算前一个估值日的基金资产净值和各类基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人按约定对基金净值予以公布。

### 九、特殊情形的处理

1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 10 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

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

3、对于因税收规定调整或其他原因导致基金实际交纳税金与基金按照权责发生制进行估值的应交税金有差异的，相关估值调整不作为基金资产估值错误处理。

4、由于时差、通讯或其他非可控的客观原因，在基金管理人和基金托管人协商一致的时间点前无法确认的交易，导致的对基金资产净值的影响，不作为基金资产估值错误处理。

#### 十、实施侧袋机制期间的基金资产估值

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

## 第十二部分 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、汇兑损益、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、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；

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

3、由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同，本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

4、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

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

### 四、收益分配方案

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

### 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，按照《信息披露办法》的规定在规定媒介公告。

### 六、基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当

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

#### 七、实施侧袋机制期间的收益分配

本基金实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配，详见招募说明书“第十五部分 侧袋机制”章节的规定。

## 第十三部分 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为基金合同生效日至当年12月31日，若基金合同生效少于2个月，可以并入下一个会计年度披露；
- 3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
- 4、会计制度执行国家有关会计制度；
- 5、本基金独立建账、独立核算；
- 6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；
- 7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

### 二、基金的年度审计

- 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人、境外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依照《信息披露办法》的规定在规定媒介公告。

## 第十四部分 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。

### 二、信息披露义务人

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

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

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过符合中国证监会规定条件的全国性报刊（以下简称规定报刊）及《信息披露办法》规定的互联网网站（以下简称规定网站）等媒介披露，并保证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指定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。

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

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

基金募集申请经中国证监会注册后，基金管理人在基金份额发售的3日前，将基金份额发售公告、基金招募说明书提示性公告和基金合同提示性公告登载在指定报刊上，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指定网站上，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指定网站上。

## （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指定媒介上。

## （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指定媒介上登载基金合同生效公告。基金合同生效公告中还应当说明基金募集情况及基金管理人、基



金管理人高级管理人员、基金经理等人员以及基金管理人股东持有的基金份额、承诺持有的期限等情况。

#### （四）基金净值信息

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

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后二个估值日，通过规定网站、基金销售机构网站或者营业网点，披露开放日的各类基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的后二个估值日，在规定网站披露半年度和年度最后一日的各类基金份额净值和基金份额累计净值。

#### （五）基金份额申购、赎回价格

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

#### （六）基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告

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

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

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

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

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

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

#### （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按照《信息披露办法》规定编制临时报告书，并登载在规定报刊和规定网站上。

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

- 1、基金份额持有人大会的召开及决定的事项；
- 2、基金合同终止、基金清算；
- 3、转换基金运作方式、基金合并；
- 4、更换基金管理人、基金托管人、境外托管人、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、境外托管人或境外投资顾问的法定名称、住所发生变更；
- 7、基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人的实际控制人变更；
- 8、基金募集期延长或提前结束募集；
- 9、基金管理人的高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；
- 10、基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十，基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十；
- 11、涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼或仲裁；
- 12、基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人、境外托管人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；
- 13、基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、

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

14、基金收益分配事项；

15、管理费、托管费、销售服务费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；

16、任一类基金份额净值估值错误达该类基金份额净值百分之零点五；

17、本基金开始办理申购、赎回；

18、本基金发生巨额赎回并延期办理；

19、本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；

20、本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；

21、发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；

22、本基金变更份额类别设置；

23、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；

24、基金运作期间如遇投资顾问主要负责人员变动，基金管理人认为该事件有可能对基金投资产生重大影响；

25、本基金在基金合同生效满三年后继续存续的，基金存续期内，本基金连续 30、40、45 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；

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。

#### （九）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）清算报告

基金合同终止情形出现时，基金管理人应当依法组织清算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。清算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。

#### （十一）参与境内融资交易的信息披露

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

#### （十二）参与境内资产支持证券的信息披露

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

#### （十三）发起资金认购份额报告

基金管理人应当按照相关法律法规的规定，在基金年度报告、中期报告、季度报告中分别披露基金管理人固有资金、基金管理人股东、基金管理人高级管理人员、基金经理等人员持有基金的份额、期限及期间的变动情况。

#### （十四）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“第十五部分 侧袋机制”章节的规定。

#### （十五）投资境内股指期货和国债期货的信息披露

基金管理人应在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露股指期货和国债期货交易情况，包括交易政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示股指期货和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交易政策和交易目标等。

#### （十六）投资境内股票期权的信息披露

基金参与股票期权交易的，基金管理人应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期信息披露文件中披露参与股票期权交易的有关情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标、估值方法等，并充分揭示股票期权交易对基金总

体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标。

#### （十七）参与港股通交易的信息披露

基金管理人应在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露参与港股通交易的相关情况。

#### （十八）中国证监会规定的其他信息

### 六、信息披露事务管理

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

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

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

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

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。

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

### 七、信息披露文件的存放与查阅

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

### 八、暂停或延迟披露基金信息的情形

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

2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金

资产价值时；

3、当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上的，经与基金托管人协商确认后决定暂停估值的；

4、法律法规规定、中国证监会或基金合同认定的其他情形。

## 第十五部分 侧袋机制

### 一、侧袋机制的实施条件、实施程序和特定资产范围

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

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

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

### 二、侧袋机制实施期间的基金运作安排

#### （一）基金份额的申购与赎回

##### 1、侧袋账户

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

2、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。

##### 3、主袋账户

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

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

工作日主袋账户总份额的 10% 认定。

## （二）基金的投资

本基金侧袋机制实施期间，基金的各项投资运作指标和基金业绩指标应当以主袋账户资产为基准。

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

基金管理人不得在侧袋账户中进行除特定资产处置变现以外的其他投资操作。

## （三）基金的费用

侧袋机制实施期间，管理费和托管费等费用按主袋账户基金资产净值作为基数计提，侧袋账户资产不收取管理费。

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。

## （四）基金的收益分配

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

## （五）基金的信息披露

### 1、基金净值信息

基金管理人应按照招募说明书“基金的信息披露”部分规定的基金净值信息披露方式和频率披露主袋账户份额的基金净值信息。本基金侧袋机制实施期间，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

基金管理人应当在基金定期报告中披露报告期内特定资产处置进展情况。基金管理人披露报告期末特定资产可变现净值或净值区间的，该净值或净值区间并不代表特定资产最终变现价格，不作为基金管理人对该特定资产最终变现价格的承诺。

### 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。

#### （六）特定资产处置变现和支付

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。

#### （七）侧袋的审计

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

三、本部分关于侧袋机制的相关规定，凡是直接引用法律法规或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，或将来法律法规或监管规则针对侧袋机制的内容有进一步规定的，基金管理人经与基金托管人协商一致并履行适当程序后，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。

## 第十六部分 基金合同的变更、终止与基金财产清算

### 一、基金合同的变更

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

2、关于基金合同变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，并自决议生效后按照《信息披露办法》的规定在规定媒介公告。

### 二、基金合同的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，基金合同应当终止：

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

### 三、基金财产的清算

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

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

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

#### 4、基金财产清算程序：

- (1) 基金合同终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金财产；
- (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。

#### 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、基金剩余财产的分配

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，保存期限不少于法定最低期限。

## 第十七部分 基金托管人

### （一）托管人基本情况

名称：中国农业银行股份有限公司

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座

法定代表人：谷澍

成立时间：2009 年 01 月 15 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：34,998,303.4 万元人民币

存续期间：持续经营

批准设立机关和设立文号：中国银监会银监复[2009]13 号

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]23 号

联系人：任航

联系电话：010-66060069

传真：010-68121816

网址：www.95599.cn

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分,总行设在北京。经国务院批准,中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于 2009 年 1 月 15 日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡,成为国内网点最多、业务辐射范围最广,服务领域最广,服务对象最多,业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外,中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉,每年位居《财富》世界 500 强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行,中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念,坚持审慎稳健经营、可持续发展,立足县域和城市两大市场,实施差异化竞争策略,着力打造“伴你成长”服务品牌,依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品,致力为广大客户提供优质的金融服务,与广大客户共创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行,经验丰富,服务

优质，业绩突出，2004 年被英国《全球托管人》评为中国“最佳托管银行”。2007 年中国农业银行通过了美国 SAS70 内部控制审计，并获得无保留意见的 SAS70 审计报告。自 2010 年起中国农业银行连续通过托管业务国际内控标准（ISAE3402）认证，表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设，品牌声誉进一步提升，在 2010 年首届“‘金牌理财’TOP10 颁奖盛典”中成绩突出，获“最佳托管银行”奖。2010 年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的“最佳资产托管奖”。2012 年荣获第十届中国财经风云榜“最佳资产托管银行”称号；2013 年至 2017 年连续荣获上海清算所授予的“托管银行优秀奖”和中央国债登记结算有限责任公司授予的“优秀托管机构奖”称号；2015 年、2016 年荣获中国银行业协会授予的“养老金业务最佳发展奖”称号；2018 年荣获中国基金报授予的公募基金 20 年“最佳基金托管银行”奖；2019 年荣获证券时报授予的“2019 年度资产托管银行天玑奖”称号；2020 年被美国《环球金融》评为中国“最佳托管银行”；2021 年荣获全国银行间同业拆借中心首次设立的“银行间本币市场优秀托管行”奖；2022 年在权威杂志《财资》年度评选中首次荣获“中国最佳保险托管银行”。

中国农业银行证券投资基金托管部于 1998 年 5 月经中国证监会和中国人民银行批准成立，2004 年更名为中国农业银行托管业务部。目前内设风险合规部/综合管理部、业务管理部、客户一部、客户二部、客户三部、客户四部、系统与信息管理部、营运管理部、营运一部、营运二部，拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

## 2、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工 302 名，其中具有高级职称的专家 60 名，服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强，高级管理层均有 20 年以上金融从业经验和高级技术职称，精通国内外证券市场的运作。

## 3、基金托管业务经营情况

截止到 2024 年 9 月 30 日，中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共 898 只。

### （二）、基金托管人的内部风险控制制度说明

#### 1、内部控制目标

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

## 2、内部控制组织结构

风险管理委员会总体负责中国农业银行的风险管理与内部控制工作，对托管业务风险管理和内部控制工作进行监督和评价。托管业务部专门设置了风险管理处，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，独立行使监督稽核职权。

## 3、内部控制制度及措施

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

### （三）、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

基金托管人通过参数设置将《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议规定的投资比例和禁止投资品种输入监控系统，每日登录监控系统监督基金管理人的投资运作，并通过基金资金账户、基金管理人的投资指令等监督基金管理人的其他行为。

当基金出现异常交易行为时，基金托管人应当针对不同情况进行以下方式的处理：

- 1、电话提示。对媒体和舆论反映集中的问题，电话提示基金管理人；
- 2、书面警示。对本基金投资比例接近超标、资金头寸不足等问题，以书面方式对基金管理人进行提示；
- 3、书面报告。对投资比例超标、清算资金透支以及其他涉嫌违规交易等行为，书面提示有关基金管理人并报中国证监会。

## 第十八部分 境外托管人

### （一）基本情况

名称：花旗银行（Citibank N.A.）（简称“花旗银行”）

注册地址：701 East 60th Street North, Sioux Falls, SD57104, USA

成立时间：1812年6月16日

组织形式：股份有限公司

存续期间：持续经营

所有者权益（Common Shareholder's Equity）：2,027 亿美元\*

实收资本（Paid-in Capital）：1080 亿美元\*

托管资产规模：26.97 万亿美元\*

\*以上数据截止到 2022 年 1 季度

花旗集团是一家在纽约证券交易所上市的公司，是国际大型的金融服务集团，业务范围广泛的国际银行。花旗集团的前身为纽约市银行（City Bank of New York），成立于 1812 年。其业务为个人、企业、政府和机构提供广泛而专注的金融产品和服务，包括零售银行和信贷、企业和投资银行、证券经纪、贸易和证券服务和财富管理。花旗拥有约 2 亿客户，业务遍及 160 多个国家和地区。

花旗银行是花旗集团的全资子公司，其经营活动由美国联邦储备银行（FEB）和美国联邦储蓄保险公司（FDIC）监管。花旗银行经过两个世纪的发展、收购，已经成为美国以资产计第三大银行，也是一间在全球近 160 多个国家及地区设有分支机构的国际级银行。

花旗银行资本金雄厚，信用评级稳健。花旗银行拥有全球广泛自有专属托管网络，其托管资产规模在全球行业排名前列。截至 2021 年末，花旗银行的证券服务拥有 27.8 万亿美元的托管资产，是一家全球领先的托管机构。2021 年底，资本充足率为 16.40%，一级核心资本充足率是 13.93%。

### （二）主要人员情况

花旗职员都是经验丰富的证券专业人士，多数有大学文凭或同等经验，并受益于花旗持续提供的员工培训，涵盖产品、流程和证券业趋势，以及管理问题和流程。许多人还有其他资格证书，比如硕士学位、CPA、C.C.M.认证及其他行业

认证。

平均而言，花旗的全球托管管理人员从业超过 20 年，员工从业达 10 年。

#### 1、人员配置

截至 2021 年底，花旗在全球共有 231,349 名员工。花旗在全球共有 7,466 名员工为托管和基金服务提供支持，其中 3,326 名员工位于亚太地区。

#### 2、工作年限

花旗的业务管理人员均长期任职于花旗和证券业，坚持履行对托管业务的承诺，并且一直是推进花旗客户关系的重要组成部分。

花旗全球托管管理团队平均工作年限为 15 年，全球托管员工平均工作年限为 12 年。

亚太地区客户的业务支持是依托于花旗银行在香港的运营机构，花旗香港从 80 年代中期开始提供全方位的全球托管服务。花旗香港全球托管中心已有 30 多年的全球托管操作经验，无论在人力专才，托管操作系统发展，客户服务及处理问题的熟练深度和专业程度都处于行业前列，从而保障了高效率、高质量的服务。

花旗拥有健全的公司治理制度，内部控制和风险管理制，并得到有效地贯彻执行。多年来经营管理有序，未发生过财务状况恶化等重大经营风险情形。花旗银行具备安全保管资产的条件以及安全、高效的清算、交割能力。在最近 3 年内没有受到过所在国家或地区监管机构的重大处罚，无重大事项正在接受司法部门、监管机构立案调查。

### （三）基金托管业务经营情况

花旗银行是值得信赖的托管银行，托管资产规模达到 31.3 万亿美元。作为全球最大的托管服务提供商之一，花旗为全球投资者提供金融资源、国际拓展、运营基础设施和专业知识。

花旗以统一方式提供交易结算、保管、资产服务、管理和投资报告。凭借自营网络、全球运营和客户服务，以及先进的处理技术，花旗在市场上脱颖而出，能够提供量身定制的服务，满足企业、金融机构、国际政府组织、银行、经纪自营商、投资管理人、全球托管人、共同基金、养老基金和保险公司的需求。

#### 1、业务历史

花旗的托管业务可以追溯到 1929 年，当时花旗与农民信托公司合并。自 1980



年以来，花旗一直提供全球托管服务。从 1980 年到 1984 年，花旗建立起托管网络，由分行、子公司和代理行组成，继续打造高度本地化服务。此外，花旗还形成全球最大的专用通信网络之一，供其自营分行之间传送托管相关数据。

## 2、亚洲业务历史 / 经验

自 1980 年以来，花旗一直在亚洲主要市场提供全球托管服务。从 1980 年到 1984 年，花旗建立起托管网络，由分行、子公司和代理行组成，继续打造高度本地化服务。此外，花旗还形成全球最大的专用通信网络之一，供其自营分行之间传送托管相关数据。

## 3、网络

其他机构的自营分支网络在深度、广度和覆盖面上无一能及花旗。迄今，花旗的全球托管网络覆盖 104 个市场，其中 63 个是花旗自营终端。花旗在全球 160 多个国家和司法管辖区开展业务。花旗的客户可以更快速、准确、直接地获取服务信息和本地市场情报。花旗深谙经营所在管辖区市场，且具有很大影响力，能够确保为客户提供更高水平的服务。凭借该等规模、实地运营和专业知识，连同在其中许多国家超过百年的服务经验，使得花旗作为全球托管人具备无与伦比之能力。

### （四）信用等级 (2022 年 7 月)

花旗集团在标普评级（高级）为 BBB+，短期为 A-2。花旗银行（高级）为 A+，短期为 A-1。

	Moody's	Standard & Poor's	Fitch
花旗集团（高级）	A3	BBB+	A
花旗集团（短期）	P-2	A-2	F1
花旗银行（高级）	Aa3	A+	A+
花旗银行（短期）	P-1	A-1	F1

### （五）境外托管人的职责

- 1、安全保管受托财产；
- 2、计算境外受托资产的资产净值；
- 3、按照相关合同的约定，及时办理受托资产的清算、交割事宜；
- 4、按照相关合同的约定和所适用国家、地区法律法规的规定，开设受托资

产的资金账户以及证券账户等投资所需账户；

5、按照相关合同的约定，提供与受托资产业务活动有关的会计记录、交易信息；

6、保存受托资产托管业务活动的记录、账册以及其他相关资料；

7、其他由基金托管人委托其履行的职责。

## 第十九部分 相关服务机构

### 一、基金份额发售机构

#### 1、直销机构

名称：申万菱信基金管理有限公司直销中心

办公地址：上海市中山南路 100 号 11 层

法定代表人：陈晓升

电话：+86 21 23261188

传真：+86 21 23261199

联系人：张芸茜

客户服务电话：400 880 8588（免长途话费）或 +86 21 962299

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

电子邮件：[service@swsmu.com](mailto:service@swsmu.com)

#### 2、其他销售机构

具体名单详见基金管理人网站的公示。

基金管理人可根据有关法律、法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金或变更销售机构，并在基金管理人网站公示。具体请以各发售机构实际情况为准。

### 二、登记机构

名称：申万菱信基金管理有限公司

住所：上海市中山南路 100 号 11 层

办公地址：上海市中山南路 100 号 11 层

邮政编码：200010

法定代表人：陈晓升

电话：（021）23261188

传真：（021）23261199

联系人：徐越

### 三、出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：韩炯

经办律师：黎明、陈颖华

电话：021-31358666

传真：021-31358600

#### 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）

注册地址：北京市东城区东长安街 1 号东方广场 2 座办公楼 8 层

办公地址：上海静安区南京西路 1266 号恒隆广场二期 16 楼

法定代表人：邹俊

电话：（010）8508 5000

传真：（010）8508 5111

联系人：虞京京

经办注册会计师：王国蓓、虞京京

## 第二十部分 基金合同的内容摘要

### 第一部分 基金管理人、基金托管人及基金份额持有人的权利与义务

#### 一、基金管理人

##### （一）基金管理人简况

名称：申万菱信基金管理有限公司

住所：上海市中山南路 100 号 11 层

法定代表人：陈晓升

成立日期：2004 年 1 月 15 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会，中国证监会证监基金字【2003】144 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：壹亿伍仟万元人民币

存续期限：持续经营

联系电话：+86-21-23261188

##### （二）基金管理人的权利与义务

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

（1）依法募集资金；

（2）自基金合同生效之日起，根据法律法规和基金合同独立运用并管理基金财产；

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

（4）销售基金份额；

（5）按照规定召集基金份额持有人大会；

（6）依据基金合同及有关法律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决定基金收益的分配方案；

（11）在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；

（12）依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于被投资基金、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，并确定相关的费率；

（16）选择、更换或撤销境外投资顾问；

（17）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业务规则；

（18）法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他权利。

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

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

（2）办理基金备案手续；

（3）自基金合同生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；

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

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

（6）除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得利用基金财产

为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

（7）依法接受基金托管人的监督；

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

（9）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

（10）编制季度报告、中期报告和年度报告；

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

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

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

（14）按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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

（16）按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料不少于法定最低期限；

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

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

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

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

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

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

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

(24) 基金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

### (一) 基金托管人简况

名称：中国农业银行股份有限公司

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

邮政编码：100031

法定代表人：谷澍

成立时间：2009 年 1 月 15 日

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]23 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：34,998,303.4 万元人民币

批准设立机关和设立文号：中国银监会银监复[2009]13 号

存续期间：持续经营

### (二) 基金托管人的权利与义务

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

(1) 自基金合同生效之日起，依法律法规和基金合同的规定安全保管基金



财产；

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

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

（4）根据相关市场规则，为基金开设资金账户、证券账户等投资所需账户，为基金办理证券、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）选择、更换或撤销境外托管人并为之签署有关协议；

（8）法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他权利。

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

（1）以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

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

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

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

（5）保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

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

（7）保守基金商业秘密，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露，但向监管机构、司法机关等有权机关的要求，或因审计、法律等外部专业顾问提供服务需要提供的情况

况除外；

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

（9）办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

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

（11）保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料不少于法定最低期限；

（12）从基金管理人或其委托的登记机构处接收并保存基金份额持有人名册；

（13）按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

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

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

（16）按照法律法规和基金合同的规定监督基金管理人的投资运作；

（17）参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

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

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

（20）按规定监督基金管理人按法律法规和基金合同规定履行自己的义务，基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿；

（21）执行生效的基金份额持有人大会的决议；

（22）选择符合《试行办法》第十九条规定的境外托管人。对基金的境外财产，基金托管人可授权境外托管人代为履行其承担的职责。境外托管人依据基金

财产投资地法律法规、监管要求、证券交易所规则、市场惯例以及其与基金托管人之间的主次托管协议持有、保管基金财产，并履行资金清算等职责。境外托管人在履行职责过程中，因本身过错、疏忽原因而导致的基金财产受损的，基金托管人承担相应责任；在决定境外托管人是否存在过错、疏忽等不当行为，应根据基金托管人与境外托管人之间的协议适用法律及当地的法律法规、证券市场规则与惯例决定；

（23）每月结束后在法律法规规定的时限内，向中国证监会和外管局报告基金管理人境外投资情况，并按相关规定进行国际收支申报；

（24）办理基金管理人就管理本基金的有关结汇、售汇、收汇、付汇和人民币资金结算业务；

（25）基金托管人就管理本基金的资金汇出、汇入、兑换、收汇、付汇、资金往来、委托及成交记录等相关资料，其保存的时间应当不少于法律法规规定的最低期限；

（26）及时将公司行为信息通知基金管理人；

（27）法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

### 三、基金份额持有人

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

同一类别的每份基金份额具有同等的合法权益。

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

（1）分享基金财产收益；

（2）参与分配清算后的剩余基金财产；

（3）依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；

（4）按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会；

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

- (6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- (7) 监督基金管理人的投资运作；
- (8) 对基金管理人、基金托管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他权利。

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

- (1) 认真阅读并遵守基金合同、招募说明书、业务规则等信息披露文件；
- (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) 发起资金提供方认购的基金份额持有期限自基金合同生效之日起不少于3年，法律法规或监管机构另有规定的除外；
- (10) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

## 第二部分 基金份额持有人大会召集、议事规则及表决的程序和规则

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

本基金份额持有人大会不设日常机构，如今后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，但

法律法规、中国证监会另有规定的除外：

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

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

- （1）法律法规要求增加的基金费用的收取；
- （2）调整本基金的申购费率、变更收费方式、调低赎回费率、调低销售服务费率或调整基金份额类别设置、对基金份额分类办法及规则进行调整，或开通其它销售币种的申购赎回业务；
- （3）因相应的法律法规、登记机构的相关业务规则发生变动而应当对基金合同进行修改；
- （4）对基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生重大变化；
- （5）基金管理人、登记机构、基金销售机构调整有关认购、申购、赎回、转换、基金交易、非交易过户、转托管等业务规则；

- (6) 基金管理人在履行适当程序后，基金推出新业务或服务；
- (7) 按照法律法规和基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

## 二、会议召集人及召集方式

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

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。

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

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

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

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

### 三、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

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

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

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

### 四、基金份额持有人出席会议的方式

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

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

- （1）亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、基金合同

和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；

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

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以会议通知载明的形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会议通知载明的形式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

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

（3）本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的，有效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）的基金份额持有人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见；

（4）上述第（3）项中直接出具表决意见的基金份额持有人或受托代表他人出具表决意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具表决意见的



代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与基金登记机构记录相符。

3、在不与法律法规冲突的前提下，经会议通知载明，基金份额持有人可以采用网络、电话或其他方式进行表决，或者采用网络、电话或其他方式授权他人代为出席会议并表决，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。在会议的召开方式上，本基金亦可采用其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开基金份额持有人大会，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。

## 五、议事内容与程序

### 1、议事内容及提案权

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

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

### 2、议事程序

#### （1）现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

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

姓名（或单位名称）和联系方式等事项。

## （2）通讯开会

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

## 六、表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

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

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

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

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

## 七、计票

### 1、现场开会

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

后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

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

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

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

## 2、通讯开会

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

## 八、生效与公告

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

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起按照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。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、当参与基金份额持有人大会投票的基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日相关基金份额的二分之一，召集人在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内就原定审议事项重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）相关基金份额的持有人参与或授权他人参与基金份额持有人大会投票；

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

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

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

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

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

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，凡与将来颁布的涉及基金份额持有人大会规定的法律法规不一致的，基金管理人、基金托管人协商一致并履行适当程序后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

### 第三部分 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方可执行，并自决议生效后按照《信息披露办法》的规定在规定媒介公告。

#### 二、基金合同的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，基金合同应当终止：

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

#### 三、基金财产的清算

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

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

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

#### 4、基金财产清算程序：

- (1) 基金合同终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金财产；
- (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。

#### 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、基金剩余财产的分配

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，保存期限不少于法定最低期限。

### 第四部分 争议的处理和适用的法律

各方当事人同意，因基金合同而产生的或与基金合同有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照该机构届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。除非仲裁裁决另有决定，仲裁费用由败诉方承担。

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

基金合同受中国法律（不含港澳台立法）管辖并从其解释。

#### **第五部分 基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式**

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

## 第二十一部分 基金托管协议的内容摘要

### 第一部分 托管协议当事人

#### （一）基金管理人

名称：申万菱信基金管理有限公司

注册地址：上海市中山南路 100 号 11 层

办公地址：上海市中山南路 100 号 11 层

邮政编码：200010

法定代表人：陈晓升

成立日期：2004 年 1 月 15 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会，证监基金字【2003】144 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：壹亿伍仟万元人民币

存续期限：持续经营

经营范围：基金管理业务、发起设立基金及中国证券监督管理委员会批准的其他业务。

#### （二）基金托管人

名称：中国农业银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9

邮政编码：100031

法定代表人：谷澍

成立时间：2009 年 1 月 15 日

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]23 号

批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复[2009]13 号

组织形式：股份有限公司

注册资金：34,998,303.4 万元人民币

存续期间：持续经营

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买



卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；结汇、售汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；代理资金清算；各类汇兑业务；代理政策性银行、外国政府和国际金融机构贷款业务；贷款承诺；组织或参加银团贷款；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇借款；发行、代理发行、买卖或代理买卖股票以外的外币有价证券；外汇票据承兑和贴现；自营、代客外汇买卖；外币兑换；外汇担保；资信调查、咨询、见证业务；企业、个人财务顾问服务；证券公司客户交易结算资金存管业务；证券投资基金托管业务；企业年金托管业务；产业投资基金托管业务；合格境外机构投资者境内证券投资托管业务；代理开放式基金业务；电话银行、手机银行、网上银行业务；金融衍生产品交易业务；经国务院银行业监督管理机构等监管部门批准的其他业务。

## 第二部分 基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

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

1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。

1) 本基金在境外的投资范围如下：

针对境外投资，本基金可投资于银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股（包括港股通标的股票）、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证；在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金；与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品；远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品；法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

本基金还可进行境外证券借贷交易、境外正回购交易、逆回购交易。

本基金为对冲外币的汇率风险，可以投资于外汇远期合约、结构性外汇远期

合约、外汇期权及外汇期权组合、外汇互换协议、与汇率挂钩的结构性投资产品等金融工具。

2) 本基金在境内的投资范围如下：

本基金境内可投资于具有良好流动性的金融工具，具体包括国内依法发行或上市的股票（包括主板、创业板及其他依法发行、上市的股票及存托凭证）、国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、地方政府债、公开发行的次级债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、可交换债券、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、现金、股指期货、国债期货、股票期权及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具（但必须符合中国证监会的相关规定）。

本基金可根据相关法律法规和基金合同的约定，参与境内融资业务。

本基金可通过合格境内机构投资者（QDII）境外投资额度或港股通机制投资香港股票市场。

3) 基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的比例为 80% 以上，其中投资于全球新能源主题相关公司股票的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%。本基金投资于境外市场的股票占基金资产的比例不低于 20%，本基金投资于境内市场的股票占基金资产的比例不低于 20%。每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金以及股票期权合约需缴纳的现金保证金后，本基金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。

4) 如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。如法律法规或中国证监会变更投资品种比例限制的，基金管理人在与基金托管人协商一致并履行相关程序后，可相应调整本基金的投资比例规定。

2、对基金投融资比例进行监督，基金托管人按下述比例和调整期限进行监督。

A. 基金的投资组合应遵循以下限制：

(1) 本基金股票投资占基金资产的比例为 80% 以上；

(2) 本基金投资于全球新能源主题相关公司股票的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%；本基金投资于境外市场的资产占基金资产的比例不低于 20%，

本基金投资于境内市场的资产占基金资产的比例不低于 20%；

(3) 每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金以及股票期权合约需缴纳的现金保证金后，本基金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；

(4) 本基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

除上述 (3) 外，因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资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况除外。

**B. 本基金境内投资应遵循以下限制：**

(1) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值（同一家公司在境内和境外同时上市的，持股比例合并计算）不超过基金资产净值的 10%；本基金管理人管理的、且由本基金托管人托管的全部基金持有一家公司发行的证券（同一家公司在境内和境外同时上市的，持股比例合并计算），不超过该证券的 10%，完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金品种可以不受此条款规定的比例限制；

(2) 基金管理人管理的、且由本基金托管人托管的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；基金管理人管理的、且由本基金托管人托管的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述比例限制；

(3) 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%；

(4) 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%；

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

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

(7) 本基金应投资于信用评级为 **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；

（8）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；

（9）债券正回购资金余额或逆回购资金余额不得超过其上一日基金净值的40%。债券回购最长期限为1年，债券回购到期后不得展期；

（10）本基金参与股指期货、国债期货交易：

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

2）在任何交易日日终，持有的买入股指期货、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；

3）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%；

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

5）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%；

6）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%；

7）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%；

8）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；

9）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%；

（11）本基金参与股票期权交易依据下列标准建构组合：

1）因未平仓的股票期权合约支付和收取的权利金总额不得超过基金资产净

值的 10%；

2) 开仓卖出认购股票期权的，应持有足额标的证券；开仓卖出认沽期权的，应持有合约行权所需的全额现金或交易所规则认可的可冲抵期权保证金的现金等价物；

3) 未平仓的股票期权合约面值不得超过基金资产净值的 20%。其中，合约面值按照行权价乘以合约乘数计算；

(12) 本基金参与融资的，在任何交易日日终，本基金融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；

(13) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的 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本基金不符合该比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

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

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

(16) 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（7）、（13）、（14）项外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并或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。

C. 本基金境外投资应遵循以下限制：

(1) 本基金持有同一家银行的存款不得超过基金净值的 20%。银行应当是中资商业银行在境外设立的分行或在最近一个会计年度达到中国证监会认可的信用评级机构评级的境外银行，但在基金托管账户的存款不受此限制；

(2) 本基金持有同一机构（政府、国际金融组织除外）发行的证券市值不得超过基金净值的 10%；

(3) 本基金持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不得超过基金资产净值的

10%，其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的 3%；

（4）基金不得购买证券用于控制或影响发行该证券的机构或其管理层。本基金管理人管理的全部基金不得持有同一机构 10% 以上具有投票权的证券发行总量。

前项投资比例限制应当合并计算同一机构境内外上市的总股本，同时应当一并计算全球存托凭证和美国存托凭证所代表的基础证券，并假设对持有的股本权证行使转换；

（5）本基金持有非流动性资产市值不得超过基金净值的 10%。

前项非流动性资产是指法律或基金合同规定的流通受限证券以及中国证监会认定的其他资产；

（6）本基金持有境外基金的市值合计不得超过基金净值的 10%（持有货币市场基金可以不受上述限制）；

（7）本基金管理人管理的、且由本基金托管人托管的全部基金、集合计划持有任何一只境外基金，不得超过该境外基金总份额的 20%；

（8）为应付赎回、交易清算等临时用途借入现金的比例不得超过基金净值的 10%；

（9）金融衍生品投资

本基金投资衍生品应当仅限于投资组合避险或有效管理，不得用于投机或放大交易，同时应当严格遵守下列规定：

1) 本基金的金融衍生品全部敞口不得高于基金资产净值的 100%。

2) 本基金投资期货支付的初始保证金、投资期权支付或收取的期权费、投资柜台交易衍生品支付的初始费用的总额不得高于基金资产净值的 10%。

3) 本基金投资于远期合约、互换等柜台交易金融衍生品，应当符合以下要求：

①所有参与交易的对手方（中资商业银行除外）应当具有不低于中国证监会认可的信用评级机构评级；

②交易对手方应当至少每个工作日对交易进行估值，并且本基金可在任何时候以公允价值终止交易；

③任一交易对手方的市值计价敞口不得超过基金资产净值的 20%。

4) 基金管理人应当在本基金会会计年度结束后 60 个工作日内向中国证监会提

交包括衍生品头寸及风险分析年度报告。

5) 本基金不得直接投资与实物商品相关的衍生品。

(10) 本基金可以参与证券借贷交易，并且应当遵守下列规定：

1) 所有参与交易对手方（中资商业银行除外）应当具有中国证监会认可的信用评级机构评级；

2) 应当采取市值计价制度进行调整以确保担保物市值不低于已借出证券市值的 102%；

3) 借方应当在交易期内及时向本基金支付已借出证券产生的所有股息、利息和分红。一旦借方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留和处置担保物以满足索赔需要；

4) 除中国证监会另有规定外，担保物可以是以下金融工具或品种：

①现金；

②存款证明；

③商业票据；

④政府债券；

⑤中资商业银行或由不低于中国证监会认可的信用评级机构评级的境外金融机构（作为交易对手方或其关联方的除外）出具的不可撤销信用证。

5) 本基金有权在任何时候终止证券借贷交易并在正常市场惯例的合理期限内要求归还任一或所有已借出的证券；

6) 本基金管理人将对基金参与证券借贷交易中发生的任何损失负相应责任。

(11) 基金可以根据正常市场惯例参与正回购交易、逆回购交易，并且应当遵守下列规定：

1) 所有参与正回购交易对手方（中资商业银行除外）应当具有中国证监会认可的信用评级机构信用评级；

2) 参与正回购交易，应当采取市值计价制度对卖出收益进行调整以确保现金不低于已售出证券市值的 102%。一旦买方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留或处置卖出收益以满足索赔需要；

3) 买方应当在正回购交易期内及时向本基金支付售出证券产生的所有股息、利息和分红；

4) 参与逆回购交易，应当对购入证券采取市值计价制度进行调整以确保已

购入证券市值不低于支付现金的 102%。一旦卖方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留或处置已购入证券以满足索赔需要；

5) 本基金管理人将对基金参与证券正回购交易、逆回购交易中发生的任何损失负相应责任。

(12) 本基金参与证券借贷交易、正回购交易，所有已借出而未归还证券总市值或所有已售出而未回购证券总市值均不得超过基金总资产的 50%。前项比例限制计算，基金因参与证券借贷交易、正回购交易而持有的担保物、现金不得计入基金总资产。

(13) 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。

因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合上述规定投资比例的，针对第（1）-（7）项，基金管理人应当在 30 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情况除外。

### 3、投资组合比例调整

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

法律法规或监管部门取消或调整上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按照调整后的规定执行，且该等事项无需召开基金份额持有人大会。

4、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资禁止行为进行监督的内容、标准和程序。

除中国证监会另有规定外，基金在境外投资时不得有下列行为：

- (1) 购买不动产。
- (2) 购买房地产抵押按揭。
- (3) 购买贵金属或代表贵金属的凭证。
- (4) 购买实物商品。
- (5) 除应付赎回、交易清算等临时用途以外，借入现金。该临时用途借入现金的比例不得超过基金资产净值的 10%。
- (6) 利用融资购买证券，但投资金融衍生品除外。



- (7) 参与未持有基础资产的卖空交易。
- (8) 从事证券承销业务。
- (9) 不公平对待不同客户或不同投资组合。
- (10) 除法律法规规定以外，向任何第三方泄露客户资料。
- (11) 违反规定向他人贷款或者提供担保。
- (12) 从事承担无限责任的投资。
- (13) 向其基金管理人、基金托管人出资。
- (14) 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。
- (15) 法律、行政法规和中国证监会禁止的其他行为。

除中国证监会另有规定外，基金在境内投资时不得有下列行为：

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

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

如法律、行政法规或监管部门取消或变更上述禁止性规定，如适用于本基金，在履行适当程序后，本基金可不受上述规定的限制或按变更后的规定执行，且该等事项无需召开基金份额持有人大会。

5、根据法律法规有关基金从事的关联交易的规定，基金管理人和基金托管人事先相互提供与本机构有控股关系的股东、与本机构有其他重大利害关系的公

司名单，并邮件发送。本托管协议任何一方均有责任确保本方关联交易名单的真实性、准确性、完整性，并负责及时将更新后的名单发送给另一方。

6、对法律法规规定及基金合同约定的基金投资的其他方面进行监督。

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

（三）基金托管人发现基金管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作中违反法律法规、基金合同及本托管协议的规定，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确认，就基金托管人的疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。

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

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

### **第三部分 基金管理人 对基金托管人的业务核查**

（一）基金管理人 对基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括但不限于基金托管人安全保管基金财产、开设和管理基金财产的资金账户和证券账户等投资所需账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和各类基金份额净值、

根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

（二）基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、《试行办法》、基金合同、本托管协议及其他有关规定时，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正。基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金管理人发出回函，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应报告中国证监会。

（三）基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复基金管理人并改正。

#### **第四部分 基金财产的保管**

##### **（一）基金财产保管的原则**

- 1、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人、境外托管人的固有财产。
- 2、基金托管人应安全保管基金财产，未经基金管理人的合法合规指令或法律法规、基金合同及本托管协议另有规定，不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。
- 3、基金托管人应按照规定开立或变更基金财产的资金账户和证券账户等投资所需账户。
- 4、基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立。
- 5、基金托管人根据基金管理人和经基金管理人授权的境外投资顾问的指令，按照基金合同和本托管协议的约定保管基金财产，如有特殊情况双方可另行协商解决。

##### **（二）基金募集期间及募集资金的验资**

- 1、基金募集期间的资金应存于基金管理人在具有托管资格的商业银行开设的基金认购专户。该账户由基金管理人开立并管理。
- 2、基金募集期满或基金停止募集时，发起资金认购金额、发起资金提供方

承诺的基金份额持有期限符合基金合同及其他有关规定后，基金管理人应在规定时间内，聘请符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所进行验资，出具验资报告，验资报告需对发起资金提供方及其持有份额进行专门说明。出具的验资报告由参加验资的 2 名或 2 名以上中国注册会计师签字方为有效。验资完成后，基金管理人应将属于基金财产的全部资金划入基金托管账户中，并确保划入的资金与验资确认金额相一致。

3、若基金募集期限届满，未能达到基金备案的条件，由基金管理人按规定办理退款等事宜，基金托管人应提供充分协助。

### （三）基金资金账户的开立和管理

1、基金托管人以本基金、基金托管人或其境外托管人的名义（视当地法律或市场规则而定）在其营业机构或其境外托管人开立基金的资金账户，并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。

2、基金资金账户的开立和使用，限于满足开展基金业务的需要。基金托管人、基金管理人不得假借基金的名义开立任何其他银行账户；亦不得使用基金的任何账户进行基金业务以外的活动。

3、基金资金账户的开立和管理应符合账户所在国家或地区相关监管机构的有关规定。

### （四）基金证券账户和结算备付金账户的开立和管理

1、基金托管人在基金所投资市场的证券交易所或登记结算机构处或境外托管人，按照该交易所或登记结算机构的业务规则以本基金、基金托管人或其境外托管人的名义为基金开立证券账户。基金托管人或其境外托管人负责办理与开立证券账户有关的手续。

2、基金证券账户的开立和使用，仅限于满足开展基金业务的需要。基金托管人和基金管理人、境外托管人以及各自委托代理人均不得出借或未经基金托管人、基金管理人双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基金业务以外的活动。

3、基金证券账户的开立和证券账户相关证明文件的保管由基金托管人负责，账户资产的管理和运用由基金管理人负责。

证券账户开户费由本基金财产承担。此项开户费由基金管理人先行垫付，待

本基金起始运营后，基金管理人可向基金托管人发送划款指令，将代垫开户费从本基金托管资金账户中扣还基金管理人。账户开立后，基金托管人应及时将证券账户开通信息通知基金管理人。

4. 基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户，并代表所托管的基金完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级法人清算工作，基金管理人应予以积极协助。结算备付金、结算保证金、交收资金等的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定及基金管理人与基金托管人签订的《托管银行证券资金结算协议》执行。

5、基金管理人投资于合法合规、符合基金合同的其他非交易所市场的投资品种时，在基金合同生效后，基金托管人或境外托管人根据投资所在市场以及国家或地区的相关规定，开立进行基金的投资活动所需要的各类证券和结算账户，并协助办理与各类证券和结算账户相关的投资资格。

6、基金证券账户的开立和管理应符合账户所在国家或地区有关法律的规定。

#### （五）债券托管账户的开设和管理

《基金合同》生效后，基金管理人负责以基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表基金进行交易；基金托管人根据中国人民银行、银行间市场登记结算机构的有关规定，在银行间市场登记结算机构开立债券托管账户，持有人账户和资金结算账户，并代表基金进行银行间市场债券的结算。基金管理人代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议。

#### （六）其他账户的开立和管理

1、因业务发展需要而开立的其他账户，可以根据投资市场所在国家或地区法律法规和基金合同的规定，由基金托管人或其境外托管人负责开立。

2、投资市场所在国家或地区法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

#### （七）基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的境内有关实物证券、银行存款开户证实书等有价凭证由基金托管人存放于基金托管人保管库，境外实物证券、银行存款开户证实书等有价凭证根据投资另行约定。境内实物证券、银行定期存款证实书等有价凭证的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。属于基金托管人及境外托管人实际有效控制下的实物证券在基金托管人保管期间的损坏、灭失，由此产

生的责任应由基金托管人承担。基金托管人对基金托管人及其境外托管人以外机构实际有效控制的证券不承担保管责任。

#### （八）与基金财产有关的重大合同的保管

基金托管人按照法律法规保管由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同及有关凭证。基金管理人代表基金签署有关重大合同后应在收到合同正本后 30 日内将一份正本的原件提交给基金托管人。除另有规定外，基金管理人或其委托的第三方机构在代表基金签署与基金财产有关的重大合同时一般应保证基金一方有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本原件。重大合同的保管期限不低于法律法规规定的最低年限。

### 第五部分 基金资产净值的计算与复核

#### 1、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的金额。各类基金份额净值是指各类基金资产净值除以该类基金份额总额所得的基金份额的价值，各类基金份额净值的计算均精确到 0.0001 元，小数点后第五位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。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。如遇特殊情况，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。国家另有规定的，从其规定。

#### 2、复核程序

基金管理人应于每个工作日对前一估值日的基金资产进行估值，估值原则应符合基金合同及其他法律法规的规定。基金管理人于每个工作日将前一日基金估值结果发送基金托管人经基金托管人复核无误后，由基金管理人依据基金合同和相关法律法规的规定对外公布。

3、在法律法规和中国证监会允许的情况下，基金管理人与基金托管人可以各自委托第三方机构进行基金资产估值，但不改变基金管理人与基金托管人对基金资产估值各自承担的责任，同时，须按照有关规定在基金定期报告中披露。

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

价值的价格估值。

5、基金管理人、基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序以及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，双方应及时进行协商和纠正。

6、当基金资产的估值导致任一类基金份额净值小数点后4位内发生差错时，视为该类基金份额净值估值错误。基金管理人和基金托管人将采取必要、适当的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金估值出现影响基金份额净值的错误时，基金管理人应当立即纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；错误偏差达到该类基金份额净值的0.25%时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到该类基金份额净值0.5%时，基金管理人应当公告、通报基金托管人并报中国证监会备案。如法律法规或监管机关对前述内容另有规定的，按其规定处理。

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

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

9、由于证券交易所、期货交易所、外汇交易市场、登记结算公司、第三方估值机构、存款银行等第三方机构发送的数据错误等非基金管理人与基金托管人原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

## 第六部分 基金份额持有人名册的保管

本基金的基金管理人和基金托管人须分别妥善保管的基金份额持有人名册，包括基金合同生效日、基金合同终止日、基金权益登记日、基金份额持有人大会权益登记日、每年 6 月 30 日、12 月 31 日的基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容至少应包括持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册由登记机构编制，由基金管理人审核并提交基金托管人保管。基金托管人有权要求基金管理人提供任意一个交易日或全部交易日的基金份额持有人名册，基金管理人应及时提供，不得拖延或拒绝提供。

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

基金管理人和基金托管人应妥善保管基金份额持有人名册，保存期限不低于法律法规要求的最低年限。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。若基金管理人或基金托管人由于自身原因无法妥善保管基金份额持有人名册，应按有关法规规定各自承担相应的责任。

## 第七部分 争议解决方式

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

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，各自继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和本托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本托管协议受中国法律（为本协议之目的，不包括香港特别行政区、澳门特



别行政区和台湾地区法律）管辖并从其解释。

## 第八部分 托管协议的变更、终止

### （一）托管协议的变更程序

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

### （二）基金托管协议终止出现的情形

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

## 第二十二部分 对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为本基金份额持有人提供一系列的服务。以下是主要的服务内容，基金管理人根据本基金份额持有人的需要和市场的变化，有权增加、修改这些服务项目。

### 一、为基金份额持有人提供的服务

投资人通过基金管理人网站等平台可享有基金交易查询、账户查询和基金管理人依法披露的各类基金信息等服务，包括基金产品基本信息（包括但不限于基金名称、基金代码、风险等级、持有份额、单位净值、收益情况等）、基金的法律文件、基金公告、定期报告和基金管理人最新动态等各类资料。

基金管理人可根据法律法规及投资者需求不定期通过电话、短信、邮件、微信等任一或多种方式为投资人提供与投资人相关的账户服务通知、交易确认通知、重要公告通知、活动消息、营销信息、客户关怀等资讯及增值服务，投资本基金前请详阅申万菱信基金官网服务介绍和隐私政策。如需取消相应资讯服务，可通过基金管理人客户服务中心热线 400-880-8588、在线服务等人工服务方式退订。

### 二、服务渠道

#### （一）客服中心电话服务

1、自助语音服务（7×24 小时）：提供 7×24 小时自动语音查询服务，基金份额持有人可查询基金余额、交易情况、基金产品与服务等相关信息。

2、人工服务：在每一交易日提供不少于 8 小时的人工咨询服务。基金份额持有人可通过基金管理人全国统一客服热线：400-880-8588（免长途话费）或 021-962299 享受业务咨询、信息查询、投诉建议等服务。

#### （二）在线服务

1、智能客服服务（7×24 小时）：提供 7×24 小时智能客服服务，业务规则、常见问题等自助咨询服务。

2、人工服务：在每一交易日提供不少于 8 小时的在线人工咨询服务，提供基金份额持有人可查询基金余额、交易情况、基金产品与服务等相关信息。

3、留言服务（7×24 小时）：提供客户留言平台，客服中心一般在 T+2 个工作日内处理完成。

### （三）互联网服务

基金份额持有人可以通过基金管理人网站（[www.swsmu.com](http://www.swsmu.com)）、微信公众号“申万菱信基金（SW\_SMU）”和官方 APP“申万菱信基金”享受理财资讯、信息披露、账户信息、交易信息、在线咨询等多项服务。基金份额持有人也可以通过上述渠道中的“网上交易”办理开户、交易及查询等业务。有关基金网上交易的协议文本请参见基金管理人网站。

三、如本招募说明书存在任何您/贵机构无法理解的内容，请通过上述方式联系本公司。请确保投资前，您/贵机构已经全面理解了本招募说明书。

## 第二十三部分 其他应披露事项

公告事项	信息披露方式	公告日期
申万菱信全球新能源股票型发起式证券投资基金（QDII） 2024 年第 3 季度报告	规定报刊及规 定网站	2024/10/25
申万菱信全球新能源股票型发起式证券投资基金（QDII） 2024 年中期报告	规定报刊及规 定网站	2024/8/30
申万菱信全球新能源股票型发起式证券投资基金（QDII） 2024 年第 2 季度报告	规定报刊及规 定网站	2024/7/19
申万菱信全球新能源股票型发起式证券投资基金（QDII）（申 万菱信全球新能源股票型发起式 A）产品资料概要更新	规定报刊及规 定网站	2024/6/25
申万菱信全球新能源股票型发起式证券投资基金（QDII）（申 万菱信全球新能源股票型发起式 C）产品资料概要更新	规定报刊及规 定网站	2024/6/25
申万菱信全球新能源股票型发起式证券投资基金（QDII） 2024 年第 1 季度报告	规定报刊及规 定网站	2024/4/22
申万菱信全球新能源股票型发起式证券投资基金（QDII）开 放日常申购、赎回及定期定额投资业务公告	规定报刊及规 定网站	2024/1/23
关于申万菱信全球新能源股票型发起式证券投资基金 （QDII）2024 年境外主要投资市场节假日暂停申购、赎回、 定期定额投资等业务的公告	规定报刊及规 定网站	2024/1/13
申万菱信全球新能源股票型发起式证券投资基金（QDII）（申 万菱信全球新能源股票型发起式 C）产品资料概要更新	规定报刊及规 定网站	2023/12/28
申万菱信全球新能源股票型发起式证券投资基金（QDII）（申 万菱信全球新能源股票型发起式 A）产品资料概要更新	规定报刊及规 定网站	2023/12/28
申万菱信全球新能源股票型发起式证券投资基金（QDII）更 新招募说明书（2023 年第 1 号）	规定报刊及规 定网站	2023/12/28

注：上述公告更新至 2024 年 12 月 23 日。

## 第二十四部分 招募说明书的存放及查阅方式

招募说明书公布后，应当分别置备于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的住所，供公众查阅、复制。投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

## 第二十五部分 备查文件

（一）中国证监会准予申万菱信全球新能源股票型发起式证券投资基金（QDII）募集注册的文件

（二）《申万菱信全球新能源股票型发起式证券投资基金（QDII）基金合同》

（三）《申万菱信全球新能源股票型发起式证券投资基金（QDII）托管协议》

（四）《法律意见书》

（五）基金管理人业务资格批件和营业执照

（六）基金托管人业务资格批件和营业执照

（七）中国证监会要求的其他文件

存放地点：上述备查文件存放在基金管理人、基金托管人的办公场所。

查阅方式：投资者可以在办公时间免费查询；也可按工本费购买本基金备查文件复制件或复印件，但应以基金备查文件正本为准。