路博迈锐翼量化选股股票型证券投资基金
招募说明书

基金管理人：路博迈基金管理（中国）有限公司

基金托管人：广发证券股份有限公司

二〇二六年十一月

重要提示

路博迈锐翼量化选股股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）已于 2026 年 7 月 3 日获得中国证监会准予注册的批复（证监许可〔2026〕1768 号《关于准予路博迈锐翼量化选股股票型证券投资基金注册的批复》）。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的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。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资本基金风险详见招募说明书“风险揭示”章节，包括：因证券市场价格波动产生的市场风险，由于基金投资者连续大量赎回基金产生的流动性风险，由于交易对手违约产生的信用风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特定风险等等。

投资有风险，投资者认购（或申购）基金前，应认真阅读本招募说明书、基金合同、基金产品资料概要等信息披露文件，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，自主判断基金的投资价值，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断本基金是否和自身的风险承受能力相适；投资者应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，亦自行承担基金投资中出现的各类风险。

本基金为股票型基金，其预期风险及预期收益水平理论上高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

为对冲信用风险，本基金可能投资于信用衍生品，信用衍生品的投资可能面临流动性风险、偿付风险以及价格波动风险等。

本基金可投资国债期货、股指期货和股票期权等金融衍生品，国债期货的投资可能面临市场风险、基差风险、流动性风险等，股指期货的投资可能面临因保证金交易制度、每日无负债结算制度带来的相关风险，股票期权的投资可能面临市场风险、管理风险、交易对手风险、流动性风险、操作风险等。

本基金可投资于科创板，若本基金投资于科创板股票，会面临科创板机制下

因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于科创板上市公司股票价格波动较大的风险、流动性风险、退市风险等。

本基金通过量化模型构建的股票组合不用于高频交易。在实际运作过程中，本基金的量化模型或存在失效并导致基金亏损的风险，此外宏观经济环境、股票市场环境、交易规则等发生重大变化也可能会影响模型的有效性，无法达到预期的投资效果。

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

基金管理人依据相关法律、法规等，经尽职调查、进行了充分的评估论证、履行了必要的决策程序，现将份额登记、估值核算等业务委托给基金服务机构——国泰海通证券股份有限公司负责日常运营；基金管理人需定期了解基金服务机构的人员配备情况、业务操作的专业能力、业务隔离措施、软硬件设施等基本运作情况，以保证满足业务发展的实际需求；如前述提供份额登记、估值核算的基金服务机构以独资或者控股方式成立具有独立法人资格的基金服务机构，经基金管理人同意，可直接由该新设立的基金服务机构担任本基金的服务机构，但基金管理人应发布相关公告。除前述另有规定外，基金服务机构发生变更的，基金管理人需另行发布相关公告。若基金份额持有人不同意基金管理人变更基金服务机构的，自公告之日起 10 日内可以赎回其持有的全部基金份额，若基金份额持有人自公告之日起 10 日后继续持有全部或部分基金份额的，视为其同意基金管理人变更基金服务机构。

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新基金业绩表现的保证。基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金管理人提醒投资者基金投资的“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，由投资者自行负责。

《基金合同》生效后，连续 50 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人

或基金资产净值低于5000万元情形时，本基金将根据基金合同第十九部分的约定进行基金财产清算并终止，而无须召开基金份额持有人大会审议。基金合同可能面临自动终止的风险。

本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的 50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等基金管理人无法予以控制的情形导致被动达到或超过50%的除外。法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

基金投资者及基金份额持有人承诺其知悉《中华人民共和国反洗钱法》、《金融机构大额交易和可疑交易报告管理办法》、《中国人民银行关于落实执行联合国安理会相关决议的通知》等反洗钱相关法律法规的规定，将严格遵守上述规定，不会违反任何前述规定；承诺用于基金投资的资金来源不属于违法犯罪所得及其收益；承诺出示真实有效的身份证件或者其他身份证明文件，积极履行反洗钱职责，不借助本业务进行洗钱等违法犯罪活动。基金投资者及基金份额持有人承诺，已认真阅读并知悉基金管理人关于可购买本基金的投资者资质的规定（以基金管理人公示的业务规则为准），并应在认购、申购本基金时及持有本基金期间内持续满足该等资质要求。

出于反洗钱、非居民金融账户涉税信息尽职调查与信息报送等相关的合规要求，本基金基金管理人有权对可购买本基金的投资者资质予以规定并不时调整，具体见《业务规则》、基金份额发售公告以及基金管理人届时发布的开放申购或赎回公告或其他相关公告。如已持有本基金基金份额，但不再满足本基金的投资者资质要求或基金合同约定的其他条件或出现基金合同约定情形的，基金管理人有权依据基金合同的约定对相应基金份额予以强制赎回或采取其他相应控制措施，提请投资者关注。

基金管理人深知个人信息对投资者的重要性，致力于投资者个人信息的保护。基金管理人承诺按照法律法规和相关监管要求的规定处理投资者的个人信息，包括通过基金管理人直销机构、其他销售机构或场内经纪机构购买路博迈基金管理（中国）有限公司旗下基金产品的所有个人投资者。基金管理人需处理的机构投资者信息中可能涉及其法定代表人、受益所有人、经办人等个人信息，也将遵守上述承诺进行处理。

由于本基金在计算 C 类基金份额的基金份额净值时，按前一日基金资产净值

的 0.40%年费率计提销售服务费，对于投资者通过直销机构认购、申购的 C 类基金份额计提的销售服务费，或者通过其他销售机构认购、申购且持续持有期限超过一年（即 365 天）的 C 类基金份额在持有超过一年（即 365 天）后继续计提的销售服务费，都将在投资者赎回、转出相应基金份额或基金合同终止时随赎回款（或清算款）一并返还给投资者，投资者实际收到的赎回款（或清算款）的金额可能与按披露的基金份额净值计算的结果存在差异。投资者的实际赎回金额（或清算资金）以登记机构确认数据为准。

详情请关注基金合同第七部分“基金合同当事人及权利义务”的相关内容及基金管理人官方网站（www.nbchina.com）不时披露的个人信息处理相关政策。

目 录

重要提示 1
目 录 5
第一部分 前言 6
第二部分 释义 7
第三部分 基金管理人 13
第四部分 基金托管人 24
第五部分 相关服务机构 27
第六部分 基金的募集 29
第七部分 基金合同的生效 35
第八部分 基金份额的申购与赎回 36
第九部分 基金的投资 51
第十部分 基金的财产 61
第十一部分 基金资产的估值 62
第十二部分 基金的收益与分配 70
第十三部分 基金的费用与税收 72
第十四部分 基金的会计与审计 75
第十五部分 基金的信息披露 76
第十六部分 侧袋机制 84
第十七部分 风险揭示 87
第十八部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算 96
第十九部分 基金合同的内容摘要 99
第二十部分 基金托管协议的内容摘要 120
第二十一部分 对基金份额持有人的服务 138
第二十二部分 招募说明书的存放及查阅方式 140
第二十三部分 备查文件 141

第一部分 前言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券法》（以下简称“《证券法》”）、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）、《公开募集证券投资基金销售费用管理规定》（以下简称“《销售费用管理规定》”）和其他有关法律法规的规定，以及《路博迈锐翼量化选股股票型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

本招募说明书阐述了路博迈锐翼量化选股股票型证券投资基金的投资目标、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、基金产品资料概要等。

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申请募集的。本招募说明书由路博迈基金管理（中国）有限公司解释。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，或对本招募说明书做出任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写，并经中国证监会注册。基金合同是约定基金合同当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人，其持有本基金基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

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：指路博迈锐翼量化选股股票型证券投资基金

2、基金管理人：指路博迈基金管理（中国）有限公司

3、基金托管人：指广发证券股份有限公司

4、基金合同、《基金合同》：指《路博迈锐翼量化选股股票型证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充

5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《路博迈锐翼量化选股股票型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充

6、招募说明书或本招募说明书：指《路博迈锐翼量化选股股票型证券投资基金招募说明书》及其更新

7、基金产品资料概要：指《路博迈锐翼量化选股股票型证券投资基金基金产品资料概要》及其更新

8、基金份额发售公告：指《路博迈锐翼量化选股股票型证券投资基金基金份额发售公告》

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

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

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

12、《信息披露办法》：指中国证监会2019年7月26日颁布、同年9月1日实施的，并经2020年3月20日中国证监会《关于修改部分证券期货规章的决定》

修正的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

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

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

15、《销售费用管理规定》：指《公开募集证券投资基金销售费用管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订

16、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

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

18、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

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

20、合格境外投资者：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

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

22、基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人

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

24、销售机构：指路博迈基金管理（中国）有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务协议，办理基金销售业务的机构

25、登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和交收业务，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、清算和交收、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等

26、登记机构：指办理登记业务的机构。基金的登记机构为路博迈基金管理（中国）有限公司或接受路博迈基金管理（中国）有限公司委托代为办理登记业务的机构

27、基金服务机构：指从事基金的销售、销售支付、份额登记、估值等基金服务业务的机构。销售机构、登记机构亦为本基金的基金服务机构。其中，国泰海通证券股份有限公司作为本基金的基金服务机构，为本基金提供份额登记、估值与核算等服务

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

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

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

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

32、份额注册日：指基金合同生效日（对认购份额），基金份额确认日（对申购份额或基金转换入份额）

33、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

34、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

35、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

36、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

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

38、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

39、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

40、《业务规则》：指《路博迈基金管理（中国）有限公司开放式基金业务规则》及基金管理人不时于其网站披露的相关规则及公示信息，是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金登记方面的业务规则，由基金管理人和投资人共同遵守

41、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

42、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

43、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

44、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

45、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

46、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申购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

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

48、元：指人民币元

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

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

51、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

52、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

53、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

54、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

55、流动性受限资产：指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券以及法律法规或中国证监会规定的其他流动性受限资产，如未来法律法规变动，基金管理人在履行适当程序后，可对前述流动性受限资产范围进行调整

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

57、不可抗力：指基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

58、基金份额分类：指本基金根据认购费、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：A 类基金份额和 C 类基金份额。两类基金份额分设不同的基金代码，并分别公布基金份额净值

59、A 类基金份额：在投资者认购、申购基金时收取认购费、申购费，而不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，投资者通过直销机构认购、申购 A 类基金份额时不收取认购费、申购费

60、C 类基金份额：在投资者认购、申购基金时不收取认购费、申购费，而是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，其中，对于投资者通过直销机构认购、申购的 C 类基金份额计提的销售服务费，或者通过其他销售机构认购、申购且持续持有期限超过一年（即 365 天）的 C 类基金份额在持有超

过一年（即 365 天）后继续计提的销售服务费，将在投资者赎回、转出相应基金份额或基金合同终止时随赎回款（或清算款）一并返还给投资者

61、销售服务费：指从相应类别基金份额的基金财产中计提的，用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务的费用

62、侧袋机制：指将基金投资组合中的特定资产从原有账户分离至一个专门账户进行处置清算，目的在于有效隔离并化解风险，确保投资者得到公平对待，属于流动性风险管理工具。侧袋机制实施期间，原有账户称为主袋账户，专门账户称为侧袋账户

63、特定资产：包括：（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

64、信用衍生品：指符合证券交易所或银行间市场相关业务规则，专门用于管理信用风险的信用衍生工具

65、信用保护买方：亦称信用保护购买方，指接受信用风险保护的一方

66、信用保护卖方：亦称信用保护提供方，指提供信用风险保护的一方

67、名义本金：亦称交易名义本金，指为一笔信用衍生品交易提供信用风险保护的金额，各项支付和结算以此金额为计算基准

第三部分 基金管理人

一、基金管理人概况

名称：路博迈基金管理（中国）有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 88 号 30 层 11 单元

办公地址：中国上海市静安区石门一路 288 号香港兴业中心 2 座 705-710 室

成立日期：2021 年 7 月 22 日

法定代表人：阎小庆

客户服务电话：400-875-5888

注册资本：人民币 80,000 万元

股权结构：

股东名称	出资比例
路博迈投资顾问有限公司（Neuberger Berman Investment Advisers LLC）	100%

二、主要人员情况

1、董事会成员

PATRICK SONG LIU 先生：董事长，英国牛津大学工商管理硕士学位。于 2017 年加入路博迈，负责监督管理并带领业务发展。现任路博迈基金管理（中国）有限公司董事长，兼任路博迈海外投资基金管理（上海）有限公司董事及董事会主席，路博迈信息咨询（上海）有限公司董事及董事会主席、总经理及法定代表人；路博迈亚洲有限公司亚太区负责人，董事，1 号、4 号、9 号牌照的负责人员（RO）。曾任路透伦敦全球战略总监和市场营销机构全球总监；路透香港亚太资产管理及研究总监；景顺投资管理有限公司首席代表；景顺长城基金管理有限公司常务副总裁；德意志投资香港有限公司大中华区董事总经理；海富通基金管理有限公司高级战略顾问及董事、总经理等多个职位。

阎小庆先生：董事，上海财经大学货币银行学硕士学位、比利时布鲁塞尔自由大学工商管理硕士。于 2019 年加入路博迈集团，负责集团在中国业务相关的管理和整体业务战略的规划和实施。现任路博迈基金管理（中国）有限公司的总

经理、法定代表人。曾任歌斐资产管理有限公司管理合伙人；海富通基金管理有限公司副总经理；比利时富通基金管理公司上海代表处首席代表；法国农业信贷银行上海分行欧洲及台湾团队主管等多个职位。

袁民强先生：董事，清华大学工商管理硕士。于 2025 年加入路博迈基金管理（中国）有限公司，现担任路博迈基金管理（中国）有限公司副总经理，负责公司业务发展工作。曾于海富通基金管理有限公司历任南方区机构业务高级业务经理、南方区机构业务副总裁、机构业务部总经理、国际业务部总经理、总经理助理等职位。

魏晓雪女士：董事，复旦大学投资学硕士。于 2022 年 10 月加入路博迈基金管理（中国）有限公司，现担任路博迈基金管理（中国）有限公司联席投资总监兼公募股票投资一部、研究部总经理。曾任西南证券高级客户经理；鹏远（北京）管理咨询上海分公司研究员；光大保德信基金管理有限公司总经理助理、研究总监及基金经理。

赵大年先生：董事，中国科学院理学硕士。于 2023 年加入路博迈，现任路博迈基金管理（中国）有限公司联席投资总监兼公募量化投资部总经理。在加入路博迈之前，曾任职于光大保德信基金管理有限公司，担任风险控制专员、风险管理部副总监、总监、量化投资部总监兼基金经理等职务，负责公司风险管理体系建设、投资与运营风险管理、量化投资与研究等业务。

Alvin Joyue Hui（许祖裕）先生：董事，英国剑桥大学硕士、律师执业资格。于 2013 年加入路博迈亚洲有限公司，现担任亚太区（日本，韩国除外）总法律顾问职务，兼任路博迈基金管理（中国）有限公司、路博迈信息咨询（上海）有限公司、路博迈海外投资基金管理(上海)有限公司、路博迈亚洲有限公司、路博迈澳洲有限公司、路博迈印度私人有限公司、路博迈新加坡有限公司、路博迈证券投资信托股份有限公司董事。曾任美盛资产管理香港有限公司副总裁、副法律顾问，道富环球投资管理亚洲（日本除外）法律主管，美盛资产管理香港有限公司亚洲（日本除外）法律主管。

于研女士：独立董事，上海财经大学世界经济系国际金融硕士、金融学博士。兼任上海财经大学商学院和金融学院教授、贵阳农商银行独立董事。曾任上海财经大学国际商学院讲师、金融学院副教授。

张少锋先生：独立董事，东北财经大学金融学硕士。兼任极融云（上海）企业发展有限公司资深顾问、海南银科融资担保公司法人代表。曾任中国建设银行股份有限公司海南省分行行长；深圳市商业银行股份有限公司（现名为平安银行股份有限公司）总行个人银行及电子银行部门总经理；上海浦东发展银行股份有限公司总行电子渠道部总经理、东亚银行（中国）有限公司总行零售银行总监及副行长。

李权先生：独立董事，英国伯明翰大学工业管理硕士、英国阿斯顿大学战略管理博士，兼任蒙特利尔银行（中国）有限公司独立董事、卢森堡国际银行独立董事。曾任国民西敏银行北亚区首席经济师；苏格兰皇家银行首席代表、行长及中国区首席执行官；澳新银行行长、中国区首席执行官及非执行董事。

2、监事

陆音女士：监事会主席，华东师范大学文学学士。于 2022 年加入路博迈基金管理（中国）有限公司，现任公司人力资源部部门总经理，负责公司人事管理事务。在加入路博迈之前，历任华泰柏瑞（原友邦华泰）基金管理有限公司人力资源部总监、纽银梅隆西部基金管理有限公司综合管理部总经理、财通证券资产管理有限公司综合管理部总经理、山金金控资本管理有限公司人力资源部总监等。

徐罄女士：职工监事，华东师范大学法学学士。于 2017 年加入路博迈集团，于路博迈投资管理（上海）有限公司担任办公室主管岗位。现任公司行政部主管。在加入路博迈之前，历任上海胜狮冷冻货柜有限公司助理、胜狮货柜企业有限公司行政主管、麦格理集团行政经理。

Andrew Steven Komaroff 先生：监事，美国纽约斯坦福法学院博士。现担任路博迈集团首席营运官，兼任路博迈基金管理（中国）有限公司监事。曾任麦肯锡管理顾问；Ripplewood Holdings 首席投资官；The Equavant Group 执行副总裁。

Heather Phyl Zuckerman 女士：监事，纽约大学博士。现担任路博迈集团首席人力官，兼任路博迈基金管理（中国）有限公司监事。曾任 Shearman&Sterling 助理；The Equavant Group 总法律顾问。

3、高级管理人员

阎小庆先生：总经理。（简历请参见上述董事会成员介绍）

袁民强先生：副总经理。（简历请参见上述董事会成员介绍）

刘铮女士：督察长，美国加利福尼亚大学戴维斯分校法学专业硕士，中国法律职业资格、美国纽约州法律职业资格、注册金融风险管理师（FRM）。于 2018 年加入路博迈集团，历任路博迈投资管理（上海）有限公司亚太区副总法律顾问，现任路博迈基金管理（中国）有限公司督察长兼法律合规部总经理。曾任上海瀚一律师事务所律师、君合律师事务所上海分所律师、平安资产管理有限责任公司法律合规部副总监。

陈溯先生：首席信息官，上海第二工业大学学士。于 2018 年加入路博迈投资管理（上海）有限公司担任信息技术总监。现任路博迈基金管理（中国）有限公司首席信息官，负责监管中国所有的 IT 基础设施和商业 IT，包括一些中国交易/市场数据系统。曾任上海惠普有限公司信息技术支持团队负责人、项目经理；GLG 格盛企业管理咨询（上海）有限公司、达帛商务咨询（上海）有限公司信息技术系统分析师；King 乐王数码科技（上海）有限公司（实际停止经营）担任信息技术经理；培腾司商务咨询（上海）有限公司信息技术服务交付经理、项目经理等多个职务。

郭嘉令先生：财务负责人，财务会计专业本科。于 2023 年加入路博迈，现任路博迈基金管理（中国）有限公司财务负责人兼财务部总经理。在加入路博迈前，曾任职于海通证券股份有限公司担任会计经理；海富通基金管理有限公司担任总账会计、高级会计经理、财务部负责人，其拥有近 20 年国内公募行业从业经历，具备全面的财会专业理论知识和丰富的企业财务管理经验。

黄恩典先生：风控负责人，英国格拉斯哥大学理学硕士。于 2018 年加入路博迈集团历任路博迈投资管理（上海）有限公司中台分析师，现任路博迈基金管理（中国）有限公司风控负责人兼风险管理部、运营管理部总经理。在加入路博迈前，曾于兴银基金管理有限责任公司任基金会计，道富信息科技（浙江）有限公司任基金会计。

4、本基金拟任基金经理

韩羽辰先生，纽约大学金融工程专业硕士。于 2025 年 1 月加入路博迈基金管理（中国）有限公司，现任公募多资产投资部基金经理。曾任职于光大保德信基金管理有限公司，历任研究助理、量化研究员、投资经理、基金经理职务，负责量化产品的投资研究等工作。

5、投资决策委员会

本公司采取集体投资决策制度，公司投资决策委员会成员的姓名和职务如下：

阎小庆先生，总经理。

魏晓雪女士，联席投资总监兼公募股票投资一部、研究部总经理。

安昀先生，联席投资总监兼公募股票投资二部总经理。

赵大年先生，联席投资总监兼公募量化投资部总经理。

魏丽女士，公募固收投资部总经理。

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

三、基金管理人的职责

根据《基金法》、《运作办法》及其他法律、法规的规定，基金管理人应履行以下职责：

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、估值核算和登记事宜；

2、办理基金备案手续；

3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；

4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

6、编制季度报告、中期报告和年度报告；

7、计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回价格；

8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；

9、按照规定召集基金份额持有人大会；

10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

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

12、法律、行政法规、中国证监会和基金合同规定的其他职责。

四、基金管理人和基金经理的承诺

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

反现行有效的有关法律、行政法规、规章、基金合同和中国证监会有关规定的行为发生。

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

（1）将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；

（2）不公平地对待其管理的不同基金财产；

（3）利用基金财产或职务之便为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；

（4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；

（5）侵占、挪用基金财产；

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

（7）玩忽职守，不按照规定履行职责；

（8）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。

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

（1）越权或违规经营；

（2）违反基金合同或托管协议；

（3）故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法利益；

（4）在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；

（5）拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；

（6）玩忽职守、滥用职权，不按照规定履行职责；

（7）违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

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

（9）贬损同行，以抬高自己；

（10）以不正当手段谋求业务发展；

（11）有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；

（12）在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；

（13）法律、行政法规以及中国证监会规定禁止的行为。

4、基金经理承诺

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

（2）不利用职务之便为自己及其代理人、受雇人或任何第三人谋取利益；

（3）不违反现行有效的有关法律法规、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，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

（4）不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

五、基金管理人的风险管理体系

本基金管理人将经营管理中的主要风险划分为投资风险、合规风险、操作风险和声誉风险四大类。针对上述各类风险，基金管理人建立了一套完整的风险管理体系。

1、风险管理原则

基金管理人风险管理体系的构建遵循以下基本原则：

（1）健全性原则。风险控制应当包括基金管理人的各项业务、各个部门或机构和各级人员，并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个环节。

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

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

（4）相互制约原则。公司内部部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡。

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

2、风险管理组织架构

本基金管理人建立了由董事会、公司管理层、风险管理部门、业务职能部门组成的风险管理组织架构，并明确了相应的风险管理职能。

公司各部门或岗位之间的监督制约，构成风险控制的第一道监控防线；由公司总经理负责，风险管理委员会、投资决策委员会、督察长、首席风控官、法律合规部和风险管理部构成风险控制的第二道监控防线；在董事会领导下，风险控制委员会负责内部控制和风险管理的决策，构成了风险控制的第三道监控防线。

董事会对维持有效的公司风险管理框架承担最终责任。董事会对风险管理的责任包括制定业务战略和风险管理目标、审阅重大事件和决策的风险评估、审批重大风险解决方案、审批公司风险管理制度以及审阅风险管理报告。

公司管理层对有效的风险管理承担直接责任，负责风险管理政策的制定和落实，组织开展风险管理工作。管理层下设风险管理委员会，根据公司风险管理总体策略组织实施风险应对方案。

风险管理部门对公司的风险管理承担独立评估、监控、检查和报告职责，包括制定公司风险管理制度和流程、实施定量和定性的风险评估、提出风险防范和控制建议、负责公司管理层风险管理决策的落实情况以及组织推动风险管理文化建设。

业务职能部门从经营管理的各业务环节上贯彻落实风险管理措施，执行风险管理程序，定期评估风险，并对风险管理的有效性负责。

3、风险管理内容

本基金管理人的风险管理包括风险识别、风险分析、风险对应、风险报告、风险监控、风险管理体系的评价等内容。

（1）风险识别是指对外部和内部的各种风险因素进行辨别。

（2）风险分析是指对风险的重大程度进行评估，评价风险发生的可能性。

（3）风险应对是指在风险识别过程中，针对业务流程中的主要风险点，建立相应的控制措施。

（4）风险报告是指将风险事件及处置、风险评估情况以一定程序和形式进行报告的过程。

（5）风险监控是指采取适当的措施，对风险指标进行系统和有效的监控，实现以合理的成本在最大限度内防范风险和减轻损失。

（6）风险管理体系的评价是指定期对风险管理系统的安全性、合理性、适用性和成本与效益进行分析、检查、评估和修正，以提高风险管理的有效性。

六、基金管理人的内部控制制度

基金管理人建立了科学合理、控制严密、运行高效的内部控制体系，并制定了科学完善的内部控制制度。

1、内部控制基本原则

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

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

（3）独立性原则：基金管理人各机构、部门和岗位职责保持相对独立，基金资产、自有资产、其它资产的运作分离。

（4）相互制约原则：基金管理人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：基金管理人运用科学化的经营管理方法降低运作成本，提高经济效益，以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

2、内部控制主要内容

（1）投资管理业务

基金投资严格遵循基金管理人投资决策管理相关制度的规定。基金经理的投资权限必须符合基金合同对投资目标、投资范围、投资策略、投资组合和投资限制的要求，以及有关公平交易的基金管理人制度和规则。

1）研究业务控制主要内容包括：

①研究工作应保持独立、客观。

②建立严密的研究工作业务流程，形成科学、有效的研究方法。

③建立投资对象备选库制度，研究部门根据基金合同要求，在充分研究的基础上建立和维护备选库。

④建立研究与投资的业务交流制度，保持通畅的交流渠道。

⑤建立研究报告质量评价体系。

2）投资决策业务控制主要内容包括：

①投资决策应当严格遵守法律法规的有关规定，符合基金合同所规定的投资

目标、投资范围、投资策略、投资组合和投资限制等要求。

②健全投资决策授权制度，明确界定投资权限，严格遵守投资限制，防止越权决策。

③投资决策应当有充分的投资依据，重要投资要有详细的研究报告和风险分析支持，并有决策记录。

④建立投资风险评估与管理制度，在设定的风险权限额度内进行投资决策。

⑤建立科学的投资管理业绩评价体系，包括投资组合情况、是否符合基金产品特征和决策程序、基金绩效归属分析等内容。

3）基金交易业务控制主要内容包括：

①基金交易实行集中交易制度，基金经理不得直接向交易员下达投资指令或者直接进行交易。

②基金管理人建立交易监测系统、预警系统和交易反馈系统，完善相关的安全设施。

③投资指令应当进行审核，确认其合法、合规与完整后方可执行，如出现指令违法违规或者其他异常情况，应当及时报告相应部门与人员。

④基金管理人执行公平的交易分配制度，确保不同投资者的利益能够得到公平对待。

⑤建立完善的交易记录制度，每日投资组合列表等应当及时核对并存档保管。

⑥建立科学的交易绩效评价体系。

（2）信息披露

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

（3）信息技术系统

基金管理人根据国家法律法规的要求，遵循安全性、实用性、可操作性原则，严格制定信息系统的管理制度。信息技术系统的设计和开发符合法律法规的规定及国家和金融行业软件工程标准。

基金管理人制定了严格的信息系统授权制度、岗位责任制度、门禁制度、内外网分离制度等管理措施，确保系统安全运行。基金管理人建立电子信息数据的即时保存和备份制度，重要数据实行异地备份并且长期保存。信息技术部门定期进行审计、故障排除和灾难恢复，确保信息技术系统的稳定性和可靠性。

（4）会计系统控制

基金管理人依据法律法规及业务的要求建立会计制度，并针对各个风险控制点建立严密的会计系统控制。

基金管理人明确职责划分，在岗位分工的基础上明确各会计岗位职责，严禁需要相互监督的岗位由一人独自操作全过程；采取适当的会计控制措施，以确保会计核算系统的正常运转；采取合理的估值方法和科学的估值程序，公允反映投资组合所投资的有价证券在估值时点的价值；规范基金清算交割工作，在授权范围内，及时准确地完成基金清算，确保基金资产的安全；建立会计档案保管制度，确保档案真实完整。

（5）监察稽核控制

基金管理人设立督察长，对董事会负责，经董事会聘任，是公司的合规负责人。根据合规管理工作需要和董事会授权，就内部控制制度的执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能，定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况。

基金管理人设立法律合规部开展合规管理工作，对督察长负责，开展监察稽核工作，通过定期或不定期检查内部控制制度的执行情况，确保公司各项经营管理活动的有效运行。

董事会和管理层充分重视和支持监察稽核工作，对违反法律、法规和公司内部控制制度的，追究有关部门和人员的责任。

3、基金管理人关于内部控制制度的声明

（1）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）基金管理人承诺根据市场变化和基金管理人业务发展不断完善内部风险控制制度。

第四部分 基金托管人

一、基金托管人情况

（一）基本情况

名称：广发证券股份有限公司（简称：广发证券）

住所：广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街2号618室

办公地址：广东省广州市天河区马场路26号广发证券大厦34楼

法定代表人：林传辉

成立时间：1994年1月21日

基金托管资格批文及文号：证监许可【2014】510号

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币7,824,845,511元

存续期间：长期

联系人：罗琦

联系电话：020-66338888

广发证券是国内首批综合类证券公司，先后于2010年和2015年分别在深圳证券交易所及香港联合交易所有限公司主板上市（股票代码：000776.SZ，1776.HK）。截至2025年12月31日，广发证券共设立证券营业部330家。

广发证券具有完备的业务体系、均衡的业务结构，突出的核心竞争力。拥有投资银行、财富管理、交易及机构和投资管理四大业务板块，具备全业务牌照。广发证券锻造综合金融服务实力，主要经营指标连续多年稳居中国券商前列，在多项核心业务领域中形成了领先优势，研究、资产管理、财富管理等业务位居前列。截至2025年12月31日，集团总资产9,754.84亿元，归属于上市公司股东的所有者权益为1,561.11亿元，2025年营业收入为354.93亿元，营业利润为187.93亿元，归属于上市公司股东的净利润为137.02亿元。

（二）主要人员情况

刘洋先生现任广发证券资产托管部总经理。曾就职于大成基金管理有限公司、招商银行股份有限公司、浦银安盛基金管理有限公司、上海银行股份有限公司、美国道富银行。刘洋先生于2000年7月获得北京大学理学学士，并于2003年7月获

得北京大学经济学硕士学位。

广发证券资产托管部主要人员均具备多年基金、证券、银行等金融机构从业经历或会计师事务所审计经验，从业经验丰富，具备基金从业资格，熟悉基金托管工作。资产托管部员工学历均在本科以上，专业背景涵盖了金融、法律、会计、统计、计算机等领域，是一支诚实勤勉、积极进取的专业从业人员队伍。

（三）基金托管业务经营情况

广发证券于2014年5月取得中国证监会核准证券投资基金托管资格。广发证券严格履行基金托管人的各项职责，不断加强风险管理和内部控制，确保基金资产的完整性和独立性，切实维护基金份额持有人的合法权益，提供高质量的基金托管服务。截至2025年12月31日，广发证券托管的公开募集证券投资基金共117只。

二、基金托管人的风险管理原则和内部控制制度

广发证券开展基金托管业务遵循以下风险管理原则：

1、合规性原则。保持风险管理政策与监管部门要求相一致，并把监管规定作为业务开展和风险管理应遵从的最基本要求。

2、全面性原则。资产托管业务风险管理应涵盖可能出现的所有风险类型，应渗透到决策、执行、监督、反馈等各个环节，风险控制应落实到业务涉及的所有岗位、所有环节，包含事前风险控制、事中风险监控、事后风险报告和处理。

3、制衡性原则。资产托管业务各级业务部门和岗位的设置应当权责分明、相互制约，建立不同部门、不同岗位之间的制衡体系。

4、独立性原则。广发证券的风险控制相关部门，包括合规与法律事务部、风险管理部、稽核部等，均应保持高度的独立性，各自从独立的风险控制角度出发，对资产托管业务的风险进行管理。

5、持续性原则。广发证券对资产托管业务开展持续的风险管理工作，根据实际情况动态调整风控措施和风控手段，并通过顺畅的风险报告和传导机制，及时有效地处理各种风险事项，确保风险管理政策和措施的贯彻实施。

广发证券根据相关法律法规和内部制度的相关要求，制定了完善的内部控制制度，具体包括《广发证券资产托管业务管理办法》、《广发证券资产托管业务信息披露管理规定》、《广发证券资产托管业务账户管理规定》、《广发证券资产托管产品估值核算管理规定》、《广发证券资产托管业务资金清算管理规定》、《广

发证券公募基金投资监督管理规定》、《广发证券资产托管部业务信息保密与业务档案管理规定》、《广发证券资产托管业务应急管理规定》、《广发证券资产托管部工作人员管理规定》、《广发证券股份有限公司资产托管业务公开募集证券投资基金风险准备金管理规定》等，囊括了基金托管业务的账户管理、估值核算、资金清算、投资监督、内部控制、风险管理、业务系统管理、保密和档案管理、应急处理、从业人员管理等全部业务环节。

三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《基金法》等有关法律法规规定以及基金合同、基金托管协议相关约定，基金托管人对基金的投资范围和投资对象、基金投融资比例、基金投资禁止行为、基金参与银行间债券市场、基金资产净值的计算、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、信息披露等进行监督。

基金托管人发现基金管理人违反《基金法》等有关法律法规规定或基金合同、基金托管协议相关约定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对，并以书面形式对基金托管人发出回函确认。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。基金托管人发现基金管理人有重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

第五部分 相关服务机构

一、基金份额销售机构

1、直销机构：路博迈基金管理（中国）有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 88 号 30 层 11 单元

办公地址：中国上海市静安区石门一路 288 号香港兴业中心 2 座 705-710 室

法定代表人：阎小庆

成立日期：2021 年 7 月 22 日

客户服务电话：400-875-5888

公司网站：www.nbchina.com

直销中心地址:中国上海市静安区石门一路 288 号香港兴业中心 2 座 705-710 室

基金管理人暂未开通网上交易，投资者可通过基金管理人指定的其他销售机构或至基金管理人的直销中心购买本基金。除技术条件允许且经基金管理人认可外，基金管理人的直销中心交易仅接受机构投资者，个人投资者可通过基金管理人指定的其他销售机构购买本基金。

2、其他销售机构

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

二、登记机构

名称：路博迈基金管理（中国）有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 88 号 30 层 11 单元

办公地址：中国上海市静安区石门一路 288 号香港兴业中心 2 座 705-710 室

法定代表人：阎小庆

成立日期：2021 年 7 月 22 日

联系电话：400-875-5888

三、基金服务机构

名称：国泰海通证券股份有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号

办公地址：上海市静安区新闸路 669 号 19 楼

法定代表人：朱健

成立日期：1999 年 8 月 18 日

联系人：丛艳

联系电话：021-38677336

四、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

电话：（021）31358666

传真：（021）31358600

联系人：陈颖华

经办律师：吕红、陈颖华

五、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：中国北京市东城区东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 楼

办公地址：中国上海市静安区南京西路 1266 号恒隆广场二期写字楼 25 楼

合伙事务执行人：邹俊

经办注册会计师：王国蓓、欧梦溦

电话：021-2212 2888

联系人：欧梦溦

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》等有关法律法规以及基金合同的规定，经中国证监会 2026 年 7 月 3 日证监许可【2026】1768 号文件准予注册募集。

一、基金的类型、运作方式及存续期间

1、基金类型：股票型证券投资基金

2、基金运作方式：契约型开放式

3、存续期间：不定期

二、基金份额的募集期限、募集方式、募集对象、募集场所

1、发售时间

自基金份额发售之日起最长不得超过 3 个月，具体发售时间见基金份额发售公告。

2、发售方式

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披露的基金销售机构名录。

3、发售对象

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。

基金管理人有权对可购买本基金的投资者资质予以规定并不时调整，具体见《业务规则》，以及基金管理人届时发布的相关公告。

4、募集场所

本基金将通过基金管理人的直销机构及其他基金销售机构的销售网点公开发售。

募集期间，基金管理人可根据情况变更或增减基金销售机构。具体销售城市（或网点）名单和联系方式，请参见本基金的基金份额发售公告以及当地基金销售机构以各种形式发布的公告。

5、基金的最低募集份额总额和募集规模

本基金的最低募集份额总额为 2 亿份。

基金管理人可以对募集期间的本基金募集规模设置上限。募集期内超过募集规模上限时，基金管理人可以采用比例确认或其他方式进行确认，具体限制和处理方法参见基金份额发售公告或其他相关公告。

三、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。

在投资者认购、申购基金时收取认购费、申购费，而不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，投资者通过直销机构认购、申购 A 类基金份额时不收取认购费、申购费；在投资者认购、申购基金时不收取认购费、申购费，而是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，其中，对于投资者通过直销机构认购、申购的 C 类基金份额计提的销售服务费，或者通过其他销售机构认购、申购且持续持有期限超过一年（即 365 天）的 C 类基金份额在持有超过一年（即 365 天）后继续计提的销售服务费，将在投资者赎回、转出相应基金份额或基金合同终止时随赎回款（或清算款）一并返还给投资者。

本基金 A 类基金份额和 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基金份额净值和基金份额累计净值。基金份额净值计算公式为计算日该类别基金资产净值除以计算日该类别基金份额总数。

投资者可自行选择认购、申购的基金份额类别。

在不违反法律法规、基金合同的约定以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，根据基金实际运作情况，在履行适当程序后，基金管理人可决定增加新的基金份额类别、取消某基金份额类别或对基金份额分类办法及规则进行调整等事宜，此项调整无需召开基金份额持有人大会，但调整实施前基金管理人需及时公告。

四、基金份额的认购

除法律法规或中国证监会有关规定另有规定外，任何与基金份额发售有关的当事人不得预留和提前发售基金份额。

1、基金份额的发售面值

本基金基金份额发售面值为人民币 1.00 元。

2、认购费用

本基金对通过直销机构认购本基金 A 类基金份额的不收取认购费，通过其他销售机构认购 A 类基金份额在认购时收取基金认购费用；认购本基金 C 类基金份额不收取认购费用，而是从该类别基金资产中计提销售服务费（详见本招募说明书“第十三部分 基金的费用与税收”）。募集期内投资人可多次认购本基金，通过其他销售机构认购本基金 A 类基金份额的认购费用按每笔认购申请单独计算。通过其他销售机构认购本基金 A 类基金份额的认购费率具体如下：

认购金额（M）	认购费率
M＜500 万元	0.80%
M≥500 万元	1,000 元/笔

A 类基金份额的认购费用由通过其他销售机构认购 A 类基金份额的投资者承担，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。

基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，开展基金促销活动。在基金促销活动期间，基金管理人可以适当调低基金认购费率。

3、认购份额的计算

基金认购采用金额认购的方式。

（1）A 类基金份额

1）若投资者通过直销机构认购 A 类基金份额：

认购份额＝（认购金额＋认购利息）/基金份额发售面值

2）若投资者通过其他销售机构认购 A 类基金份额的，认购金额包括认购费用和净认购金额。计算公式为：

认购费用适用比例费率：

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＋认购利息）/基金份额发售面值

认购费用适用固定金额：

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＋认购利息）/基金份额发售面值

（2）C 类基金份额

认购份额＝（认购金额＋认购利息）/基金份额发售面值

（3)认购份额的计算保留到小数点后 2 位，小数点 2 位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

例 1：某投资者投资 100,000.00 元通过其他销售机构认购本基金 A 类基金份额，则对应的认购费率为 0.80%，假定募集期产生的利息为 50.00 元，则可认购 A 类基金份额为：

净认购金额＝100,000.00/（1＋0.80%）＝99,206.35 元

认购费用＝100,000.00-99,206.35＝793.65 元

认购份额＝（99,206.35＋50.00）/1.00＝99,256.35 份

即：该投资者投资 100,000.00 元通过其他销售机构认购本基金 A 类基金份额，假定募集期产生的利息为 50.00 元，可得到 99,256.35 份 A 类基金份额。

例 2:某投资者投资 2,000,000.00 元通过直销机构认购本基金 A 类基金份额，则无认购费用，假定募集期产生的利息为 1,000.00 元，则可认购 A 类基金份额为：

认购份额＝（2,000,000.00＋1,000.00）/1.00＝2,001,000.00 份

即：该投资者投资 2,000,000.00 元通过直销机构认购本基金 A 类基金份额，假定募集期产生的利息为 1,000.00 元，可得到 2,001,000.00 份 A 类基金份额。

例 3：某投资者投资 100,000.00 元认购本基金 C 类基金份额，假定募集期产生的利息为 50.00 元，则可认购 C 类基金份额为：

认购份额＝（100,000.00＋50.00）/1.00=100,050.00 份

即：该投资者投资 100,000.00 元认购本基金 C 类基金份额，假定募集期产生的利息为 50.00 元，可得到 100,050.00 份 C 类基金份额。

4、基金份额的认购程序

（1）认购时间安排

投资者认购本基金基金份额的具体业务办理时间由基金管理人和基金销售机构确定，请参见本基金的基金份额发售公告。

（2）投资者认购本基金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。

（3）基金份额的认购采用金额认购方式

投资者认购本基金采取全额缴款认购的方式。投资者在募集期内可多次认购，认购期间单个投资者的累计认购金额没有限制，但本招募说明书、基金份额发售公告、其他相关公告另有规定的除外。投资者的认购申请一经受理不得撤销。若认购不成立或无效，则认购款项将退还给投资人。

（4）认购的确认

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。认购的确认以登记机构的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利。否则，由此产生的投资人任何损失由投资人自行承担。

（5）认购金额的限制

在基金募集期内，投资者通过基金管理人指定的其他销售机构认购本基金份额时，可多次认购基金份额，单个账户首次认购的最低金额为人民币 10 元（含认购费），追加认购不设最低金额限制。投资者通过基金管理人的直销中心认购本基金份额时，单个账户首次认购的最低金额为人民币 50,000 元，追加认购的最低金额为单笔人民币 1,000 元。在符合法律法规规定的前提下，各销售机构对最低认购限额及交易级差有其他规定的，需要同时遵循该销售机构的相关规定。募集期间不设置投资者单个账户最高认购金额限制，但本招募说明书、基金份额发售公告、其他相关公告另有规定的除外。

如本基金单个投资人累计认购的基金份额数达到或者超过基金总份额的 50%，基金管理人可以采取比例确认等方式对该投资人的认购申请进行限制。基金管理人接受某笔或者某些认购申请有可能导致投资者变相规避前述 50%比例要求的，基金管理人有权拒绝该等全部或者部分认购申请。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。

5、募集期利息的处理方式

有效认购款项在募集期间产生的利息将折算为相应类别的基金份额归基金份额持有人所有，其中利息转份额的具体数额以登记机构的记录为准。

五、募集资金的管理

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。

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，在基金募集份额总额不少于 2 亿份，基金募集金额不少于 2 亿元人民币且基金认购人数不少于 200 人的条件下，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、基金份额发售公告等相关公告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，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 日内返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

基金合同生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 50 个工作日出现前述情形的，本基金将根据基金合同第十九部分的约定进行基金财产清算并终止，而无须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。销售机构的具体信息将由基金管理人在本招募说明书“第五部分 相关服务机构”或其他相关公告中列明或在其网站公示。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

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

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

2、申购、赎回开始日及业务办理时间

基金管理人可以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。触发基金合同约定的强制赎回情形的，基金管理人可相应启动强制赎回，不受前述赎回办理开始时间的限制。

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、赎回或者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别基金份额申购、赎回的价格。

三、申购与赎回的原则

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

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；

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

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

6、基金管理人有权对可购买本基金的投资者资质予以规定并不时调整，具体见《业务规则》以及基金管理人届时发布的相关公告。本基金仅接受符合相关资质条件的基金投资者持有本基金基金份额。

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、本基金销售对象

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。

基金管理人有权对可购买本基金的投资者资质予以规定并不时调整，具体见《业务规则》，以及基金管理人届时发布的相关公告。

若基金份额持有人出现不符合或不遵守《基金合同》第七部分关于基金份额持有人义务的第(6)条的要求或基金份额持有人不符合基金管理人规定的投资本基金的基金投资者资质条件时，基金管理人或销售机构或其授权的第三方将可能采取相关措施，包括但不限于：(a)不接受该基金份额持有人对基金份额进一步的申购申请；(b)对基金份额持有人持有的基金份额进行强制赎回。

若基金份额持有人出现不再满足相关法律法规或基金管理人规定的基金

份额持有人条件，包括但不限于基金投资者可能为非中国税收居民或受限于《非居民金融账户涉税信息尽职调查管理办法》或相关法律法规及其他有关规定的任何报告或扣缴义务、不再符合或遵守《非居民金融账户涉税信息尽职调查管理办法》或相关法律法规或其他有关规定、违反反洗钱、反贪污贿赂及其他金融犯罪等法律法规要求，基金管理人有权不接受该基金份额持有人对基金份额进一步的申购申请并对该基金份额持有人持有的基金份额进行强制赎回（基金管理人不会向基金投资者披露违反反洗钱要求等事项的具体细节）。

对于未向基金管理人或其委托的基金销售机构提供反洗钱及《非居民金融账户涉税信息尽职调查管理办法》等相关尽职调查所需信息的基金投资者，基金管理人或销售机构将不接受该基金投资者对基金份额的认购或申购申请；对于未向基金管理人或销售机构提供上述尽职调查所需信息的基金份额持有人，基金管理人或销售机构将采取措施包括但不限于：(a) 不接受该基金份额持有人对基金份额进一步的申购申请；(b) 对该基金份额持有人持有的基金份额进行强制赎回（基金管理人不会向基金投资者披露违反反洗钱要求等事项的具体细节）。基金管理人或销售机构有权根据反洗钱规则的要求，根据基金投资者的具体情况采取相应的控制措施。

基金投资者不符合基金管理人规定的投资本基金的基金投资者资质条件，基金管理人或销售机构将不接受该基金投资者对基金份额的认购或申购申请。

如基金投资者或基金份额持有人不符合基金管理人规定的投资本基金的基金投资者资质条件或违反《基金合同》第一部分“前言”第十二条下承诺的情形或未能提供《非居民金融账户涉税信息尽职调查管理办法》或相关法律法规或其他有关规定所需信息及/或文件或因基金份额持有人可能为非中国税收居民或受限于《非居民金融账户涉税信息尽职调查管理办法》或相关法律法规及其他有关规定的任何报告或扣缴义务而损害基金管理人(或其授权的第三方)、本基金或本基金的其他基金份额持有人，本基金及基金管理人(或其授权的第三方)保留采取任何措施及/或就全部损失进行追偿的权利，包括但不限于拒绝接受投资人或基金份额持有人的认购/申购申请、向基金份额持有人提起诉讼/仲裁、对基金份额持有人持有的基金份额进行强制赎回，并且基金份额持有人不可以就本基金或以本基金名义为遵守任何适用法律法规、财政

或税收要求(无论是否为法定的)而采取上述措施或进行上述追偿过程中产生的任何形式的损害或责任向本基金及基金管理人(或其授权的第三方)提出任何要求或追偿，若基金份额持有人有严重违反法律法规的行为，有关金融主管部门可依据相关法律法规进行处罚，涉嫌犯罪的，移送司法机关进行处理。

2、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。

3、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，投资人交付申购款项，申购成立；基金份额登记机构确认基金份额时，申购生效。

基金份额持有人递交赎回申请，必须持有足够的基金份额余额，否则所提交的赎回申请不成立。基金份额持有人在规定的时间内递交赎回申请，赎回成立；基金份额登记机构确认赎回时，赎回生效。投资者赎回申请生效后，基金管理人将在 T＋7 日(包括该日)内支付赎回款项。如遇交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其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，则赎回款项的支付时间可相应顺延。

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。

4、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T 日)，在正常情况下，本基金登记机构在 T+1 日内对该交易的有效性进行确认。T 日提交的有效申请，投资人应在 T+2 日后(包括该日)及时到销售机构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，则申购款项退还给投资人。

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

销售机构对申购和赎回申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销

售机构确实接收到申请。申购和赎回的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利，否则，由此产生的投资人任何损失由投资人自行承担。

五、申购和赎回的数量限制

1、基金管理人规定，本基金单笔最低申购金额为人民币 10 元，追加申购不设最低金额限制。投资者通过其他销售机构申购本基金时，除需满足基金管理人最低申购金额限制外，当其他销售机构设定的最低金额（含申购费）高于上述金额限制时，投资者还应遵循相关销售机构的业务规定。

直销中心单个账户首次申购的最低金额为人民币 50,000 元，追加申购的最低金额为单笔人民币 1,000 元；已在直销中心有该基金认购记录的投资者不受首次申购最低金额的限制。

在符合法律法规规定的前提下，各销售机构对最低申购限额及交易级差有其他规定的，需要同时遵循该销售机构的相关规定。投资者当期分配的基金收益转购相应类别的基金份额时，不受最低申购金额的限制。基金管理人可根据市场情况，调整本基金申购的最低金额。

2、基金份额持有人在销售机构赎回时，每次对本基金的赎回申请不得低于 1 份基金份额，投资人全额赎回时不受该限制。基金份额持有人赎回时或赎回后在销售机构（网点）保留的基金份额余额不足 1 份的，基金管理人发起强制赎回剩余份额，赎回所有份额。但各销售机构对交易账户最低份额余额有其他规定的，以各销售机构的业务规定为准。

3、基金管理人可以规定单个投资人累计持有的基金份额上限，具体规定请参见更新的招募说明书或相关公告。

4、基金管理人可以规定单个投资者单日或单笔申购金额上限，具体规定请参见更新的招募说明书或相关公告。

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

6、单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的 50%（在基金运作过程中因基金份额赎回等基金管理人无法予以控制的情形导致被动达到或超过 50%的除外）。法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

7、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。

8、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制，或者新增基金申购或赎回的控制措施。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

六、申购费用和赎回费用

1、申购费率

本基金对通过直销机构申购本基金 A 类基金份额的不收取申购费，通过其他销售机构申购 A 类基金份额在申购时收取基金申购费用；申购 C 类基金份额时不收取申购费用，而是从该类别基金资产中计提销售服务费。投资人可多次申购本基金，通过其他销售机构申购 A 类基金份额的申购费用按每笔申购申请单独计算。

通过其他销售机构申购本基金 A 类基金份额的申购费率具体如下：

申购金额（M）	申购费率
M＜500 万元	0.80%
M≥500 万元	1000 元/笔

通过其他销售机构申购本基金 A 类基金份额的，申购费用由申购 A 类基金份额的投资人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、登记结算等各项费用。

2、赎回费率

本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额的赎回费率相同。赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。基金份额持有人赎回基金份额产生的赎回费，全额计入基金财产。

赎回费率按基金份额持有人持有该部分基金份额的时间分段设定如下：

持有期限（N）	赎回费率
N＜7 日	1.50%

7 日≤N＜30 日	1.00%
30 日≤N<180 日	0.50%
180 日≤N	0

（注：赎回份额持续持有期的计算，以该份额在登记机构的份额注册日开始计算。）

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

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

5、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对基金投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金的申购费率、销售服务费率。

七、申购份额与赎回金额的计算

1、本基金申购份额的计算

（1）A 类基金份额

1）若投资者通过直销机构申购 A 类基金份额：

申购份额＝申购金额/申购当日 A 类基金份额净值

2）若投资者通过其他销售机构申购 A 类基金份额的，申购金额包括申购费用和净申购金额，其中：

申购费用适用比例费率时：

净申购金额=申购金额/（1＋申购费率）

申购费用=申购金额-净申购金额

申购份额=净申购金额/申购当日 A 类基金份额净值

申购费用适用固定金额时：

申购费用=固定金额

净申购金额=申购金额-申购费用

申购份额=净申购金额/申购当日 A 类基金份额净值

（2）C 类基金份额

申购份额=申购金额/申购当日 C 类基金份额净值

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

例 4：某投资者投资 40,000.00 元通过其他销售机构申购本基金 A 类基金份额，则对应的申购费率为 0.80%，假设申购当日 A 类基金份额净值为 1.0400 元，则其可得到的申购份额为：

净申购金额=40,000.00/（1+0.80%）=39,682.54 元

申购费用=40,000.00-39,682.54=317.46 元

申购份额=39,682.54/1.0400=38,156.29 份

即：该投资者投资 40,000.00 元通过其他销售机构申购本基金 A 类基金份额，假设申购当日 A 类基金份额净值为 1.0400 元，可得到 38,156.29 份 A 类基金份额。

例 5：某投资者投资 2,000,000.00 元通过直销机构申购本基金 A 类基金份额，假设申购当日 A 类基金份额净值为 1.0400 元，则其可得到的申购份额为：

申购份额=2,000,000.00/1.0400=1,923,076.92 份

即：该投资者投资 2,000,000.00 元通过直销机构申购本基金 A 类基金份额，假设申购当日 A 类基金份额净值为 1.0400 元，可得到 1,923,076.92 份 A 类基金份额。

例 6：某投资者投资 40,000.00 元申购本基金 C 类基金份额，假设申购当日 C 类基金份额为 1.0400 元，则其可得到的 C 类基金份额为：

申购份额=40,000.00/1.0400=38,461.54 份

即：该投资者投资 40,000.00 元申购本基金 C 类基金份额，假设申购当日 C 类基金份额净值为 1.0400 元，可得到 38,461.54 份 C 类基金份额。

2、本基金赎回金额的计算

赎回金额的计算方法如下：

赎回总金额＝赎回份额×赎回当日该类别基金份额净值

赎回费用=赎回总金额×赎回费率

净赎回金额=赎回总金额-赎回费用+该笔赎回确认应归属投资者的销售服务费（如有）

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

其中，对于投资者通过直销机构认购、申购的 C 类基金份额计提的销售服务费，或者通过其他销售机构认购、申购且持续持有期限超过一年（即 365 天）的 C 类基金份额在持有期限超过一年（即 365 天）后继续计提的销售服务费，都将在投资者赎回、转出相应基金份额时随赎回款一并返还给投资者。

例 7：某投资者赎回 10,000.00 份 A 类基金份额，持有期限为 6 日，对应的赎回费率为 1.50%，假设赎回当日 A 类基金份额净值为 1.2500 元，其获得的净赎回金额计算如下：

赎回总金额＝10,000.00×1.2500=12,500.00 元

赎回费用=12,500.00×1.50%＝187.50 元

净赎回金额=12,500.00-187.50＝12,312.50 元

即：该投资者赎回 10,000.00 份 A 类基金份额，持有期限为 6 日，假设赎回当日 A 类基金份额净值为 1.2500 元，则其获得的净赎回金额为 12,312.50 元。

例 8：某投资者赎回 10,000.00 份通过其他销售机构认购/申购的 C 类基金份额，持有期限为 2 年，对应的赎回费率为 0.00%，假设赎回当日 C 类基金份额净值为 1.2500 元，且假设按照基金合同约定计算出的持有期限超过一年（即 365 天）继续计提的销售服务费为 50.00 元(即该笔赎回的 C 类基金份额在持续持有期限超过一年（即 365 天）后继续计提的销售服务费，将在赎回相应基金份额时随赎回款一并返还。),其获得的净赎回金额计算如下：

赎回总金额＝10,000.00×1.2500=12,500.00 元

赎回费用=12,500.00×0.00%＝0.00 元

净赎回金额=12,500.00-0.00+50.00＝12,550.00 元

即：该投资者赎回 10,000.00 份通过其他销售机构认购/申购的 C 类基金份额，持有期限为 2 年，假设赎回当日 C 类基金份额净值为 1.2500 元，且假设按照基金合同约定计算出的持有期限超过一年（即 365 天）后继续计提的销售服务费为 50.00 元，则其获得的净赎回金额为 12,550.00 元。

3、本基金基金份额净值的计算

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。T 日的各类基金份额净值在当天收市后计算，并按基金合同的约定公告。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。

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

4、接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。

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

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

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

8、申请超过基金管理人设定的基金总规模、单日申购金额限制、单日净申购比例上限、单个投资者单日或单笔申购金额上限的。

9、基金管理人、基金托管人、基金服务机构的异常情况导致基金销售系统、基金登记系统或基金会计系统无法正常运行。

10、基金投资者未向基金管理人提供法律法规要求的反洗钱等尽职调查等事项所需的基金投资者信息。

11、基金投资者未向基金管理人提供《非居民金融账户涉税信息尽职调查管理办法》及相关法律法规要求的尽职调查等事项所需的基金投资者信息、有效税收居民身份声明文件及证明文件。

12、基金投资者可能为非中国税收居民或受限于《非居民金融账户涉税信息尽职调查管理办法》或相关法律法规及其他有关规定的任何报告或扣缴义务。

13、基金投资者不符合或不遵守《非居民金融账户涉税信息尽职调查管理办法》或相关法律法规及其他有关规定。

14、基金投资者不符合基金管理人规定的投资本基金的基金投资者资质条件。

15、法律法规规定、基金合同约定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第 1、2、3、5、6、9、15 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，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

九、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时。

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

4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

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

6、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场

价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请。

7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一（第 4 项除外）且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时，基金管理人应按规定报中国证监会备案，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。受限于销售机构的规则，基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

十、巨额赎回的情形及处理方式

1、巨额赎回的认定

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

2、巨额赎回的处理方式

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

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

（2）部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的 10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开

放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的该类别基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

（3）若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额的 10%，基金管理人有权先行对该单个基金份额持有人超出10%的赎回申请实施延期办理，即自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；而对该单个基金份额持有人 10%以内（含 10%）的赎回申请与其他投资者的赎回申请按前述条款处理，即基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的 10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。

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

（4）暂停赎回：连续 2 个开放日以上(含本数)发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经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，并依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

十一、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

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

2、上述暂停情况消除的，基金管理人应于重新开放日公布最近 1 个估值日的各类基金份额净值。

3、基金管理人可以根据暂停申购或赎回的时间，依照《信息披露办法》的有关规定，在规定媒介上刊登重新开放申购或赎回的公告；也可以根据实际

情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间，届时可不再另行发布重新开放的公告。

十二、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，或按法律法规或有权机关规定的方式处理。

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

十四、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。

如果出现基金管理人、登记机构、办理转托管的销售机构因技术系统性能限制或其它合理原因，可以暂停该业务或者拒绝基金份额持有人的转托管申请。

十五、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。

十六、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，且对基金份额持有人利益无实质性不利影响并履行适当程序的条件下，基金管理人可制定相应的业务规则并开展相关业务。

十七、基金份额的转让

在法律法规允许且条件具备的情况下，本基金的基金份额可以依照法律法规规定和基金合同约定在中国证监会认可的交易场所或者通过其他方式进行转让，具体规则由基金管理人另行规定，并在业务实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

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，本基金的申购与赎回安排详见本招募说明书“侧袋机制”部分的规定或相关公告。

十九、依据基金合同的约定，基金管理人对基金份额持有人持有的基金份额进行强制赎回的，依据本章节关于份额赎回的规定执行。在不违反相关法律法规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 基金的投资

一、投资目标

在严格风险控制的基础上，通过量化选股的方法筛选具备超额收益的个股构建投资组合，力争获取基金资产的长期稳定增值。

二、投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板、科创板及其他经中国证监会允许上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、政府支持债券、政府支持机构债、次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、信用衍生品、国债期货、股指期货、股票期权、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可根据法律法规和基金合同的约定，参与融资融券业务中的融资业务。

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

本基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为 80%-95%；每个交易日日终，在扣除国债期货合约、股指期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或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、应收申购款等。

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

三、投资策略

1、资产配置策略

基金管理人将以“自上而下”角度、以资产配置思路来构建组合。在资产配置层面将重点关注各类资产的未来收益变化情况，根据不同资产的收益做第一层面的配置，关注较为长期的影响资产收益波动的关键力量。

2、股票量化投资策略

本基金采用全市场选股的主动量化策略，以数量化投资模型作为股票投资的核心驱动力。在控制风险并保持流动性的前提下，通过系统化、纪律化的量化投资模型，对全市场股票开展多维度、深层次的评估与分析，筛选具备持续超额收益潜力的投资标的，动态构建投资组合，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。

本基金的股票投资策略以量化多因子模型为核心，立足于对中国资本市场运行特征的长期研究与深刻理解，经严谨的实证检验，构建了一套全面、多层次且动态调整的因子评估体系。该体系从不同维度系统评估股票的投资价值，深入挖掘驱动股价表现的共性因素，持续跟踪市场运行状态及模型表现，并根据市场环境变化动态调整因子的构成与权重，以提升模型的适应性与稳健性。

在此基础上，本基金进一步结合风险控制模型与组合优化技术，在控制主动风险和交易成本的前提下动态调整个股权重，追求预期收益、风险水平与交易成本之间的有效平衡。本基金坚持模型驱动的纪律化投资流程，注重投资逻辑的严谨性与可执行性，致力于为基金份额持有人创造长期、稳定且可持续的超额收益。

3、债券投资策略

本基金管理人通过对宏观经济运行情况、国家货币及财政政策、资本市场资金环境等重要因素的研究和预测，优化基金资产在利率债、信用债、可转换债券以及货币市场工具等各类固定收益类金融工具之间的配置比例，本基金关注债券组合整体流动性情况，严格控制组合资产信用风险水平。此外，本基金还可通过正回购将所获得的资金投资于债券，利用杠杆以期放大债券投资的收益。

本基金在对可转换公司债券及可交换公司债条款和发行债券公司基本面进行深入分析研究的基础上，综合考虑可转换债券及可交换债券的债性和股性，利用定价模型对债券价值及目标公司股票价值进行估值分析，选择具有较高投资价值的个券进行投资。本基金也可参与可转债新券的申购。

4、流动性管理策略

本基金在严谨深入的研究分析基础上，综合考量宏观经济形势、市场资金面走向、协议存款交易对手的信用资质以及各类资产的收益率水平等，确定各类货币市场工具的配置比例并进行积极的流动性管理。

根据对市场资金面的预期以及基金申购赎回的情况、季节性资金流动情况和日历效应等因素，基金管理人动态调整并有效分配本基金的现金流，在充分保证

本基金流动性的前提下力争获取较高收益。

5、衍生产品投资策略

（1）国债期货投资策略

为有效控制债券投资的系统性风险，本基金将结合对宏观经济形势和证券趋势的判断，通过对债券市场进行定性和定量的分析，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，适度运用国债期货来提高投资组合的运作效率。在国债期货投资过程中，本基金将对国债期货和现货基差、国债期货的流动性水平等指标进行跟踪监控。

（2）股指期货投资策略

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，充分考虑选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，并考虑股指期货的风险收益特征，通过多头或空头的套期保值策略，以改善投资组合的投资效果，降低投资组合的整体风险。

（3）股票期权投资策略

本基金投资股票期权将按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的，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，确定参与股票期权交易的投资时机和投资比例。

（4）信用衍生品投资策略

本基金投资信用衍生品，按照风险管理原则，以风险对冲为目的，对所投资的资产组合进行风险管理。本基金将根据所持标的债券等固定收益品种的投资策略，审慎开展信用衍生品投资，合理确定信用衍生品的投资金额、期限等。同时，本基金将加强基金投资信用衍生品的交易对手方、创设机构的风险管理，合理分散交易对手方、创设机构的集中度，对交易对手方、创设机构的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理。

（5）本基金将关注其他金融衍生产品的推出情况，如法律法规或监管机构允许本基金投资其他金融衍生产品，本基金在履行适当程序后，将按届时有效的法律法规和监管机构的规定，制定与本基金投资目标相适应的投资策略和估值政策，在充分评估金融衍生产品的风险和收益的基础上，谨慎地进行投资。

6、参与融资业务的投资策略

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，本基金将遵从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。

四、投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金股票投资占基金资产的比例为 80%-95%；

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

（3）本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；

（4）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金品种可以不受此条款规定的比例限制；

（5）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；

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

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

（8）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；

（9）本基金资产总值不超过基金资产净值的 140%；

（10）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%；

（11)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%；

（12）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%；

（13）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%；

（14）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；

（15）基金参与国债期货和股指期货交易，应当遵守下列要求：

1）本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的 15%；在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；

2）本基金在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%；在任何交易日日终，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%；

3）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；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；

4）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%；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%；

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

购）等；

（16）本基金参与股票期权交易，须遵守下列投资比例限制：

1）基金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；开仓卖出认沽股票期权的，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股票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；

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

（18）本基金不持有具有信用保护卖方属性的信用衍生品；本基金持有的信用衍生品名义本金不得超过本基金中所对应受保护债券面值的 100%；

（19）本基金投资于同一信用保护卖方的各类信用衍生品名义本金合计不得超过基金资产净值的 10%；

因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合（18）、（19）规定比例限制的，基金管理人应在 3 个月之内进行调整；

（20）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述第（2）、（7）、（8）、（14）、（18）、（19）项情形之外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

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

如果法律法规或监管部门对上述投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在

履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

（1）承销证券；

（2）违反规定向他人贷款或者提供担保；

（3）从事承担无限责任的投资；

（4）买卖其他基金份额，但法律法规或中国证监会另有规定的除外；

（5）向其基金管理人、基金托管人出资；

（6）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

（7）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

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

法律、行政法规或监管部门取消或变更上述限制性规定，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以变更后的规定为准。

五、业绩比较基准

本基金业绩比较基准：中证 500 等权重指数收益率×90%+活期存款基准利率×10%

1、业绩比较基准设定的原因

（1）基于基金投资范围以及预期投资的主要资产类别，本基金主要投资于境内上市公司的股票，并可持有一定比例的流动性管理资产，相应选取与之匹配的 A 股指数、活期存款基准利率作为基准要素。同时基于基金投资股票资产占基金资产的比例为 80%-95%等投资比例限制，以及预期的资产配置比例中枢，本基金将股票资产、流动性管理资产所对应的基准要素权重分别设置为 90%与 10%。

（2）基于基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金通过量化选股的方法筛选全市场具备超额收益的个股构建投资组合，力争获取基金资产的长期稳定增值，预期本基金整体兼具稳定性与成长弹性。综合考虑基准指数与产品定位和投资风格的匹配度，同时兼顾考虑基准指数的表征性、认可度，以及指数盘别/市值覆盖广度、风格特征、行业与个股分布等，本基金选取中证 500 等权重指数作为股票部分的基准要素。

中证 500 等权重指数与中证 500 指数样本相同，采用等权重加权，反映中证 500 指数样本在等权重加权方式下的市场表现，适合作为本基金股票投资的业绩比较基准要素。

（3）基于基金的投资目标、投资范围和投资策略，本基金的部分资产需保持较高的流动性以应对潜在申赎或投资运作需求。综合考虑基准指数与产品定位和投资风格的匹配度，同时兼顾其表征性与公允性，选取活期存款基准利率作为本基金流动性管理部分的业绩比较基准要素。

活期存款基准利率由中国人民银行发布，具有较强的权威性和市场影响力，适合作为本基金流动性管理部分的业绩比较基准要素。

综上，本基金选取的业绩比较基准与基金投资目标、投资范围、投资策略、投资比例限制相匹配。

2、业绩比较基准要素的基本信息

中证 500 等权重指数由中证指数有限公司编制发布，指数代码为 000982，指数具体信息详见指数发布机构网站，网址：www.csindex.com.cn。

活期存款基准利率由中国人民银行发布，具体信息详见中国人民银行网站，网址：www.pbc.gov.cn。

3、业绩比较基准的计算方法

本基金业绩比较基准的计算方法为：以每日收益率为基础，以时间加权为计算原则。本基金先分别计算中证 500 等权重指数、活期存款的每日收益率，再按照预设权重比例计算当日组合要素基准的日收益率，并连乘每日收益率。

4、管理投资偏离业绩比较基准的定性或定量方法

本基金为主动管理型基金，其业绩比较基准是表征产品风格、衡量产品业绩、约束投资行为的参考标准，并非本基金的跟踪标的。基金管理人在基金合同约定

的投资范围、投资限制内享有充分的投资决策自主权，可根据投资策略、市场研判等综合因素，自主构建投资组合，包括酌情投资于业绩比较基准要素成份证券外的证券。本基金投资组合相对业绩比较基准要素成份证券和权重可能存在偏离。基金管理人在监测业绩比较基准偏离过程中，针对不同基金产品审慎设置差异化的投资偏离业绩比较基准的监测指标，基金业绩表现类指标包括但不限于，信息比率、跟踪误差、超额收益、卡玛比率等；对于权益资产，主要采用股票配置偏离限额（仓位、行业或风格结构偏离等）、基准成份券覆盖率、主动比率等指标；对于债券资产，主要采用久期中枢、信用风险暴露集中度、含权资产（如有）仓位与结构、最大回撤等指标。

基金管理人根据本基金类型、投资目标、投资风格、投资策略、风险收益特征等因素，审慎设置投资偏离业绩比较基准的监测指标和相关阈值。触发指标阈值的，基金经理原则上应当在基金管理人制度规定时间内调整完毕，或者书面提请投资决策委员会审议。投资决策委员会从保护基金份额持有人利益角度出发，对是否允许突破指标阈值作出决策，明确新的指标阈值及时间范围。

5、未来可能变更业绩比较基准的情况和程序

业绩比较基准变更符合下列条件之一且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的，基金管理人应当与基金托管人协商，在新业绩比较基准生效前三十日公告并充分说明变更原因、差异及影响，无需召开基金份额持有人大会：

（1）原有业绩比较基准的要素无法持续运作、编制方案发生重大修订等客观因素导致业绩比较基准无法再表征基金产品投资风格，或不再符合基金合同关于投资目标、投资范围、投资策略、投资比例限制等的约定，或与主要的资产类别、国别或地区、市场板块、货币类型等不再匹配；或业绩比较基准的要素不再具备市场代表性；

（2）调整业绩比较基准的要素权重、更换相同或相近特征的要素等，使新业绩比较基准代表性更强，且符合相关法律法规规定的；

（3）中国证监会认可的其他情形。

业绩比较基准变更涉及以下情形的，基金管理人应当按照规定履行变更注册、召开基金份额持有人大会等程序，法律法规、中国证监会另有规定的除外：

（1）基金投资目标、投资范围、投资策略、投资比例等拟进行重大调整，并

变更业绩比较基准的；

（2）其他对基金份额持有人利益产生重大实质性影响的情形。

六、风险收益特征

本基金为股票型基金，其预期风险及预期收益水平理论上高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

七、基金管理人代表基金行使相关权利的处理原则及方法

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

2、不谋求对上市公司的控股；

3、有利于基金财产的安全与增值；

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

八、侧袋机制的实施和投资运作安排

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

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

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

第十部分 基金的财产

一、基金资产总值

基金资产总值是指购买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开立资金账户、证券账户、期货结算账户以及投资所需的其他专用账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

四、基金财产的保管和处分

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

第十一部分 基金资产的估值

一、估值日

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

二、估值对象

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

三、估值原则

基金管理人在与其委托的基金服务机构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

本基金所持有的投资品种，按如下原则进行估值：

1、证券交易所上市的有价证券的估值

（1）交易所上市的有价证券（包括股票等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化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）在交易所市场上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种（另有规定的除外），选取估值日第三方估值机构提供的相应品种对应的估值全价估值，具体估值机构由基金管理人与基金托管人另行协商约定；

（3）在交易所市场上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种（另有规定的除外），选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值全价或推荐估值全价估值。对于含投资者回售权的固定收益品种，行使回售权的，在回售登记日至实际收款日期间选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种的唯一估值全价或推荐估值全价，同时应充分考虑发行人的信用风险变化对公允价值的影响；回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。具体估值机构由基金管理人与基金托管人另行协商约定；

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

（5）交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种对应的估值全价估值，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、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

（2）首次公开发行未上市的股票，采用估值技术确定公允价值；

（3）对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为计量日的公允价值进行估值；对于活跃市场报价未能代表计量日公允价值的情况下，采用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；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，则采用估值技术确定公允价值；

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

3、对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值全价或推荐估值全价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种，回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，采用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。

4、存款的估值方法

持有的银行定期存款或通知存款以本金列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入。

5、回购的估值方法

本基金持有的回购以成本列示，按合同利率在回购期间内逐日计提应收或应付利息。

6、同业存单的估值方法

本基金投资同业存单，采用估值日第三方估值机构提供的估值价格数据进行估值。

7、期货合约（包括股指期货合约和国债期货合约）以估值日的结算价估值。估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

8、股票期权合约按照法律法规、监管机构、行业协会等规定的估值方法进行

估值。

9、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。

10、信用衍生品按第三方估值机构提供的当日的估值价格进行估值，但基金管理人依法应当承担的估值责任不因委托而免除；选定的第三方估值机构未提供估值价格的，依照有关法律法规及《企业会计准则》要求采用合理估值技术确定公允价值。

11、本基金参与融资等业务的，按照相关法律法规和监管部门的规定估值。

12、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。

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

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

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

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

五、估值程序

1、各类基金份额净值是按照每个工作日闭市后，各类基金资产净值除以当日该类基金份额的余额数量计算，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。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人或其委托的基金服务机构于每个工作日计算基金资产净值及各类基金份额净值，并按规定公告。

2、基金管理人或其委托的基金服务机构应每个工作日对基金资产估值，但基金管理人根据法律法规或基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人或其委托

的基金服务机构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，由基金管理人按规定对外公布。

六、估值错误的处理

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

基金合同的当事人应按照以下约定处理：

1、估值错误类型

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

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

2、估值错误处理原则

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

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

（3）因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务，但估值错误责任方仍应对估值错误负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失(“受损方”)，则估值错误责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当

得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给估值错误责任方。

（4）估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

（5）按法律法规规定的其他原则处理估值错误。

3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

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

4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

（1）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，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，因基金管理人原因给基金份额持有人和基金财产造成损失的，应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金，就实际向投资者或基金支付的赔偿金额，基金管理人与基金托管人按照过错程度各自承担相应的责任。

②如基金管理人和基金托管人对基金份额净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对，尚不能达成一致时，相关方应本着勤勉尽责的态度重新计算核对，如

果最后仍无法达成一致，以基金管理人的计算结果对外公布，因基金管理人原因给基金份额持有人和基金财产造成的损失，非基金托管人原因造成的，基金托管人不承担相应责任。

③由于一方提供的信息错误（包括但不限于基金申购或赎回金额等），另一方在采取必要合理措施并履行正常程序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和基金财产的损失，由提供错误信息的一方负责赔偿。

（4）前述内容如法律法规或者监管部门另有规定的，从其规定。如果行业另有通行做法，在不违反法律法规且不损害投资者利益的前提下，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重新协商确定处理原则。

七、暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

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

4、法律法规规定、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

八、基金净值的确认

基金资产净值和各类基金份额净值由基金管理人或其委托的基金服务机构负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人或其委托的基金服务机构应于每个工作日交易结束后计算当日的基金资产净值和各类基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金净值按规定予以公布。

九、实施侧袋机制期间的基金资产估值

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

十、特殊情况的处理

1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 12 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、期货交易所、登记结算公司、存款银行

及第三方估值机构等第三方机构发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等非基金管理人与基金托管人原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误或即使发现错误但因前述原因无法及时更正的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

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

二、基金可供分配利润

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

三、基金收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。基金份额持有人可对其持有的本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别选择不同的分红方式，同一投资者持有的同一类别的基金份额只能选择一种分红方式。如投资者在不同销售机构选择的分红方式不同，基金登记机构将以投资者最后一次选择的分红方式为准；

3、基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的任一类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

本基金每次收益分配比例详见届时基金管理人发布的公告。

在不违反法律法规及基金合同的规定且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人经与基金托管人协商一致，可调整基金收益的分配原则。

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，依照《信息披露办法》的有关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，详见本招募说明书“侧袋机制”部分的规定。

第十三部分 基金的费用与税收

一、基金费用的种类

1、基金管理人的管理费；

2、基金托管人的托管费；

3、C 类基金份额的基金销售服务费；

4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用（但法律法规、中国证监会另有规定除外）；

5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、产品审计询证费、律师费、公证费、仲裁费和诉讼费；

6、基金份额持有人大会费用；

7、基金的证券、期货及期权等交易结算费用；

8、基金的银行汇划费用；

9、基金的账户开户费用、账户维护费用；

10、与基金投资运作相关的增值税及其他税费；

11、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

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

H＝E×1.20%÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，以协商一致的方式自动按照双方约定的时间、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

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

H＝E×0.20%÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，以协商一致的方式自动按照双方约定的时间、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。

3、C 类基金份额的销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.40%年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

H＝E×0.40%÷当年天数

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

C 类基金份额销售服务费每日计提，具体收取/返还方式如下：

（1）直销机构：

对于 C 类基金份额计提的销售服务费，在投资人赎回、转出基金份额或基金合同终止时随赎回款（或清算款）一并返还给投资人。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。

（2）其他销售机构：

对于投资人持续持有期限未超过一年（即 365 天）的 C 类基金份额计提的销售服务费，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的应付费用金额，以协商一致的方式自动按照双方约定的时间、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。

对于持续持有期限超过一年（即 365 天）的 C 类基金份额继续计提的销售服务费，在投资人赎回、转出基金份额或基金合同终止时，随赎回款（或清算款）一并返还给投资人。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。

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

三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

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

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、《基金合同》生效前的相关费用；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

四、实施侧袋机制期间的基金费用

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

五、基金税收

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

第十四部分 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，基金托管人承担复核责任；

2、基金的会计年度为公历年度的 1 月 1 日至 12 月 31 日；基金首次募集的会计年度按如下原则：如果《基金合同》生效少于 2 个月，可以并入下一个会计年度披露；

3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；

4、会计制度执行国家有关会计制度；

5、本基金独立建账、独立核算；

6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；

7、基金托管人每月与基金管理人或其委托的基金服务机构就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

二、基金的年度审计

1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的符合《证券法》规定的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。

2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意。

3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所需按照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

第十五部分 基金的信息披露

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

二、信息披露义务人

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人及其日常机构（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，并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

三、本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；

2、对证券投资业绩进行预测；

3、违规承诺收益或者承担损失；

4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构；

5、登载任何自然人、法人和非法人组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；

6、中国证监会禁止的其他行为。

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

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

五、公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

（一）基金招募说明书、《基金合同》、托管协议、基金产品资料概要

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

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

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

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

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

（二）基金份额发售公告

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

（三）《基金合同》生效公告

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

（四）基金净值信息

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

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

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

（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《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依照《信息披露办法》的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、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；

5、基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；

6、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；

7、基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人的实际控制人变更；

8、基金募集期延长或提前结束募集；

9、基金管理人的高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；

10、基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十，基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十；

11、涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁；

12、基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；

13、基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，

或者从事其他重大关联交易事项，但中国证监会另有规定的除外；

14、基金收益分配事项；

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

16、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、本基金调整份额类别设置；

22、基金推出新业务或新服务；

23、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；

24、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；

25、《基金合同》生效后，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和基金合同约定的其他事项。

（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

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

（十一）投资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。

（十二）投资股指期货的信息披露

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交易情况，包括交易政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示股指期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的交易政策和交易目标等。

（十三）投资股票期权的信息披露

基金管理人应在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。

（十四）投资资产支持证券的信息披露

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

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

（十五）投资信用衍生品的信息披露

基金应当在定期报告及招募说明书（更新）等文件中详细披露信用衍生品的投资情况，包括投资策略、持仓情况等，并充分揭示投资信用衍生品对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资目标及策略。

（十六）参与融资业务的信息披露

若本基金参与融资业务，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业务情况，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。

（十七）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“侧袋机制”部分的规定。

（十八）中国证监会规定的其他信息

当相关法律法规关于上述信息披露的规定发生变化时，基金管理人将按最新规定进行信息披露。

六、信息披露事务管理

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

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

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、更新的基金产品资料概要、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。

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

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

七、信息披露文件的存放与查阅

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

八、暂停或延迟披露基金信息的情形

1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、不可抗力；

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。

九、法律法规或中国证监会对信息披露另有规定的，从其规定。

第十六部分 侧袋机制

一、侧袋机制的实施条件

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

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

二、实施侧袋机制期间基金份额的申购与赎回

1、启用侧袋机制当日，基金登记机构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。

2、实施侧袋机制期间，基金管理人不办理侧袋账户份额的申购、赎回和转换；同时，基金管理人按照基金合同和招募说明书的约定办理主袋账户份额的赎回，并根据主袋账户运作情况确定是否暂停申购。

3、除基金管理人应按照主袋账户的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开放日主袋账户总份额的 10%认定。

三、实施侧袋机制期间的基金投资

侧袋机制实施期间，招募说明书“基金的投资”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。基金管理人计算各项投资运作指标和基金业绩指标时仅需考虑主袋账户资产。

基金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，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。

四、实施侧袋机制期间的基金估值

本基金实施侧袋机制的，基金管理人和基金托管人应对主袋账户资产进行估

值并披露主袋账户的基金净值信息，暂停披露侧袋账户基金净值信息。侧袋账户的会计核算应符合《企业会计准则》的相关要求。

五、实施侧袋账户期间的基金费用

1、本基金实施侧袋机制的，基金管理费和基金托管费等费用按主袋账户基金资产净值作为基数计提。

2、与侧袋账户有关的费用可从侧袋账户中列支，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，但不得收取基金管理费。

六、侧袋账户中特定资产的处置变现和支付

特定资产以可出售、可转让、恢复交易等方式恢复流动性后，基金管理人应当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变现款项。

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

七、侧袋机制的信息披露

1、临时公告

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基金管理人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。

2、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。实施侧袋机制期间本基金暂停披露侧袋账户的基金份额净值和累计净值。

3、定期报告

侧袋机制实施期间，基金管理人应当在基金定期报告中披露报告期内侧袋账户相关信息，基金定期报告中的基金会计报表仅需针对主袋账户进行编制。会计师事务所对基金年度报告进行审计时，应对报告期内基金侧袋机制运行相关的会计核算和年度报告披露等发表审计意见。

八、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。

第十七部分 风险揭示

一、市场风险

市场风险是指证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响而变化，导致收益水平存在的不确定性。市场风险主要包括：

1、政策风险

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

2、经济周期风险

随经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化。基金投资于上市公司的股票与债券，收益水平也会随之变化，从而产生风险。

3、利率风险

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

4、上市公司经营风险

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

5、信用风险

主要是指债务人的违约风险，若债务人经营不善，资不抵债，债权人可能会损失掉大部分的投资，这主要体现在企业债和公司债中。

6、购买力风险

基金的利润将主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀的影响而导致购买力下降，从而使基金的实际收益下降。

7、波动性风险

波动性风险主要存在于可转换债券的投资中，具体表现为可转换债券的价格

受到其相对应股票价格波动的影响，同时可转换债券还有信用风险与转股风险。转股风险指相对应股票价格跌破转股价，不能获得转股收益，从而无法弥补当初付出的转股期权价值。

二、管理风险

在基金管理运作过程中，基金管理人的知识、技能、经验、判断等主观因素会影响其对相关信息和经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平。

三、流动性风险

开放式基金要随时应对投资者的赎回，如果基金资产不能迅速转变成现金，或者变现为现金时对基金资产净值产生不利的影响，都会影响基金运作和收益水平。尤其是在发生巨额赎回时，如果基金资产变现能力差，可能会产生基金仓位调整的困难，导致流动性风险，可能影响基金份额净值。

1、拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

（1）投资市场的流动性风险

本基金主要投资于国内依法发行上市的股票、债券、资产支持证券、债券回购、信用衍生品、股指期货、国债期货、股票期权、银行存款、同业存单、货币市场工具等投资品种。上述资产均在规范的交易场所，运作时间长，市场透明度较高，运作方式规范，历史流动性状况良好，正常情况下能够及时满足基金变现需求，保证基金按时应对赎回要求。极端市场情况下（包括但不限于市场剧烈动荡、成交量萎缩、交易系统非正常运行、大规模停牌等），上述资产可能出现流动性不足，导致基金资产无法变现，从而影响投资者按时收到赎回款项或影响基金收益水平。根据过往经验统计，绝大部分时间上述资产流动性充裕，流动性风险可控，当遇到极端市场情况时，基金管理人会按照基金合同及相关法律法规要求，及时启动流动性风险应对措施，保护基金投资者的合法权益。

（2）投资行业的流动性风险

在股票投资层面，本基金采用全市场选股的主动量化策略，以数量化投资模型作为股票投资的核心驱动力。在控制风险并保持流动性的前提下，通过系统化、纪律化的量化投资模型，对全市场股票开展多维度、深层次的评估与分析，筛选具备持续超额收益潜力的投资标的，动态构建投资组合，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。此外，本基金在组合构建上，还将注重组合在行业和个股上的

相对分散。

在债券投资方面，本基金将通过对宏观经济运行情况、国家货币及财政政策、资本市场资金环境等重要因素的研究和预测，优化基金资产在信用债、利率债、可转换债券以及货币市场工具等各类固定收益类金融工具之间的配置比例。

因此本基金在投资运作过程中的行业配置较为灵活，在综合考虑宏观因素及行业基本面的前提下进行配置，不以投资于某单一行业为投资目标，行业分散度较高，受到单一行业流动性风险的影响通常较小。

（3）投资资产的流动性风险

本基金针对流动性较低资产的投资进行了严格的限制，以降低基金的流动性风险：本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金为开放式基金，为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，防范流动性风险。同时，结合市场流动性特点，本基金将合理安排组合流动性，统筹考虑投资者申购赎回特征和客户大额资金流向特征，以确定本基金在不同投资品种的配置比例，确保流动性充裕。

2、本基金申购、赎回安排

投资人可在本基金的开放日办理基金份额的申购和赎回业务。为切实保护存量基金份额持有人的合法权益，遵循基金份额持有人利益优先原则，本基金管理人将合理控制基金份额持有人集中度，审慎确认申购赎回业务申请，包括但不限于：

（1）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。

（2）本基金管理人对持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5%的赎回费，并全额计入基金财产。

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

（4）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、赎回申请或延缓支付赎回款项。

具体措施详见本招募说明书“第八部分 基金份额的申购与赎回”。

3、巨额赎回情形下流动性风险管理措施

当本基金出现巨额赎回情形时，本基金管理人经内部决策，并与基金托管人协商一致后，将运用多种流动性风险管理工具对赎回申请进行适度调整，以应对流动性风险，保护基金份额持有人的利益，包括但不限于：

（1）延缓办理巨额赎回申请；

（2）暂停接受赎回申请；

（3）延缓支付赎回款项；

（4）中国证监会认可的其他措施。

具体措施详见本招募说明书“第八部分 基金份额的申购与赎回”。

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

基金管理人经与基金托管人协商一致，在确保投资者得到公平对待的前提下，可依照法律法规及基金合同的约定，综合运用各类流动性风险管理工具，对赎回申请进行适度调整，作为特定情形下基金管理人流动性风险管理的辅助措施。

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，可综合运用包括延期办理巨额赎回申请、暂停接受赎回申请、延缓支付赎回款项、收取短期赎回费、暂停基金估值、摆动定价、侧袋机制等流动性风险管理工具，投资者将面临无法办理申购业务、其赎回申请被拒绝或延期办理、赎回款项延缓支付，或面临赎回成本或申购成本较高等的风险。

本基金实施备用的流动性风险管理工具包括但不限于：

（1）延期办理巨额赎回申请；

（2）暂停接受赎回申请；

（3）延缓支付赎回款项；

（4）收取短期赎回费；

（5）暂停基金估值；

（6）摆动定价；

（7）侧袋机制；

（8）中国证监会认定的其他措施。

四、特有风险

（1）量化投资模型风险

本基金通过量化模型构建的股票组合不用于高频交易。在实际运作过程中，本基金的量化模型或存在失效并导致基金亏损的风险，此外宏观经济环境、股票市场环境、交易规则等发生重大变化也可能会影响模型的有效性，无法达到预期的投资效果。

（2）国债期货投资风险

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

（3）股指期货投资风险

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

（4）股票期权投资风险

本基金的投资范围包括股票期权，股票期权的风险主要包括市场风险、管理风险、交易对手风险、流动性风险、操作风险等，这些风险可能会给基金净值带来一定的负面影响和损失。

（5）资产支持证券投资风险

本基金可投资资产支持证券，资产支持证券具有低流动性、高收益的特征，并存在一定的投资风险。资产支持证券的投资与基金资产密切相关，因此会受到特定原始权益人破产风险及现金流预测风险等的影响；当本基金投资的资产支持证券信用评级发生变化时，本基金将需要面对临时调整持仓的风险；此外当资产

支持证券相关的发行人、管理人、托管人等出现违规违约时，本基金将面临无法收取投资收益甚至损失本金的风险。

（6）信用衍生品投资风险

本基金可投资信用衍生品，信用衍生品的投资可能面临流动性风险，偿付风险，交易对手风险以及价格波动风险。流动性风险是信用衍生品交易转让过程中，因无法找到交易对手或交易对手较少，导致难以将其以合理价格变现的风险。偿付风险是在信用衍生品的存续期内，由于不可控制的市场及环境变化，创设机构可能出现经营状况不佳，或创设机构的现金流与预期发生一定的偏差，从而影响信用衍生品结算的风险。交易对手风险是由于交易对手违约导致的风险。价格波动风险是由于创设机构或所受保护债券主体经营情况或利率环境出现变化，引起信用衍生品交易价格波动的风险。

（7）投资科创板股票的风险

本基金可投资于科创板股票，会面临因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于科创板股票股价波动较大的风险、科创板股票退市的风险、科创板股票流动性较差的风险以及科创板股票股价同向波动的风险。

（8）投资北京证券交易所股票的风险

本基金可投资于北京证券交易所的股票，可能会面临北交所上市公司经营风险、股价波动较大的风险、流动性较差的风险、退市风险、投资集中风险、专板风险以及监管规则变化的风险。

（9）参与融资交易风险

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

（10）自动终止的风险

《基金合同》生效后，连续 50 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或基金资产净值低于 5000 万元情形时，本基金将根据基金合同第十九部分的约定

进行基金财产清算并终止，而无须召开基金份额持有人大会审议。因此，基金合同可能面临自动终止的风险。

（11）受到强制赎回等相应措施的风险

出于反洗钱、非居民金融账户涉税信息尽职调查与信息报送等相关的合规要求，本基金基金管理人有权对可购买本基金的投资者资质予以规定并不时调整，具体见《业务规则》以及基金管理人届时发布的相关公告。如已持有本基金基金份额，但不再满足本基金的投资者资质要求或基金合同约定的其他条件或出现基金合同约定情形的，基金管理人有权依据基金合同的约定对相应基金份额予以强制赎回或采取其他相应控制措施。因而，基金投资人或基金份额持有人面临基金份额可能按照基金合同的约定被强制赎回、追加认购/申购被拒绝、因违反法律法规承担相应法律责任等风险。

（12）证券经纪商交易结算模式的风险

本基金采用证券经纪商交易结算模式，即本基金将通过基金管理人选定的证券经营机构进行场内交易和结算，该种交易结算模式可能存在操作风险、资金使用效率降低的风险、交易结算风险、投资信息安全保密风险、无法完成当日估值等风险。

（13）委托基金服务机构提供份额登记、估值与核算等事项的外包风险

基金管理人将本基金份额登记、估值与核算等事项外包给国泰海通证券股份有限公司办理，届时因基金服务机构不符合金融监管部门规定的资质要求或因基金服务机构经营风险、技术系统故障、操作失误等，可能使得运营服务事项发生差错，给本基金运营带来风险。

（14）投资新股的风险

本基金可投资于境内新发行的股票，可能存在因股票上市后一定时间内（即锁定期）不得直接卖出，从而无法及时变现的流动性风险，同时也存在锁定期内二级市场价格低于持有成本的价格风险等风险。

（15）采用量化策略进行投资管理的风险

本基金采用数量化投资模型构建投资组合，数量化投资模型仅是选股模型，并不基于数量化投资模型进行高频交易。

在实际运作过程中，本基金通过数量化投资模型选择股票并构建投资组合，

存在失效并导致基金亏损的风险，同时宏观经济环境，股票市场环境，交易规则等发生重大变化也可能会影响模型的有效性，无法达到预期的投资效果。

量化策略投资以广泛覆盖各类信息源的数据库为基础，包括宏观经济数据、行业经济数据、证券与期货交易行情数据、上市公司财务数据等。这些数据通常来源于不同的数据提供商，并且因为不同的需要，在数据加工过程中可能遵循不同的规范。基金管理人所建立数量化投资模型将以加工后的数据作为输入，因此，源数据错误或预处理过程中出现的错误可能直接影响数量化投资模型的输出结果，形成数据风险。

此外，由于本基金采用数量化投资模型指导投资决策，因此定量方法的缺陷在一定程度上也会影响本基金的表现。一方面，面对不断变换的市场环境，量化投资策略所遵循的模型理论均处于不断发展和完善的过程中；另一方面，在定量模型的具体设定中，核心参数假定的变动均可能影响整体效果的稳定性；最后，定量模型存在对历史数据的依赖。因此，在实际运作过程中，市场环境的变化可能导致遵循数量化投资模型构建的投资组合在一定程度上无法达到预期的投资效果。

（16）销售服务费计提与返还机制的相关风险

由于本基金在计算 C 类基金份额的基金份额净值时，按前一日基金资产净值的 0.40%年费率计提销售服务费，对于投资者通过直销机构认购、申购的 C 类基金份额计提的销售服务费，或者通过其他销售机构认购、申购且持续持有期限超过一年（即 365 天）的 C 类基金份额在持有超过一年（即 365 天）后继续计提的销售服务费，都将在投资者赎回、转出相应基金份额或基金合同终止时随赎回款（或清算款）一并返还给投资者，投资者实际收到的赎回款（或清算款）的金额可能与按披露的基金份额净值计算的结果存在差异。投资者的实际赎回金额（或清算资金）以登记机构确认数据为准。

五、操作或技术风险

相关当事人在业务各环节操作过程中，因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险，例如，越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误、IT 系统故障等风险。

在开放式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基金份额持有人的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理人、基金服务机构、销售机构、证券、期货交易所、证券登记结算机构等等。

六、交易对手风险

交易对手风险是交易对手履行义务的能力的不确定性产生的风险。如果交易对手方无法全面履行它的交易承诺，本基金要承受经济损失或其它不利后果。此类交易承诺可包括支付，交易结算，履行金融合约或递交抵押品。

七、合规性风险

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

在遵守国家法律法规的前提下，基金管理人及本基金可能受制于境外法律法规及其他相关规定，对基金投资和运作等方面造成影响，而产生的相关风险。

八、本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险

本基金法律文件投资章节有关风险收益特征的表述是基于投资范围、投资比例、证券市场普遍规律等做出的概述性描述，代表了一般市场情况下本基金的长期风险收益特征。销售机构(包括基金管理人直销机构和其他销售机构)根据相关法律法规对本基金进行风险评价，不同的销售机构对同一产品所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差异；销售机构还可能根据监管要求、市场变化及基金实际运作情况等适时调整对本基金的风险评级。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，及时关注销售机构对于本基金风险评级的调整情况，谨慎做出投资决策。

九、启用侧袋机制的风险

侧袋机制是一种流动性风险管理工具，是将特定资产分离至专门的侧袋账户进行处置清算，并以处置变现后的款项向基金份额持有人进行支付，目的在于有效隔离并化解风险。当基金启用侧袋机制后，侧袋账户份额将停止披露基金份额净值，并不得办理申购、赎回和转换，仅主袋账户份额正常开放赎回，因此启用侧袋机制时持有基金份额的持有人将在启用侧袋机制后同时持有主袋账户份额和侧

袋账户份额，侧袋账户份额不能赎回，其对应特定资产的变现时间具有不确定性，最终变现价格也具有不确定性并且有可能大幅低于启用侧袋机制时的特定资产的估值，基金份额持有人可能因此面临损失。

实施侧袋机制期间，基金管理人计算各项投资运作指标和基金业绩指标时以主袋账户资产为基准，不反映侧袋账户特定资产的真实价值及变化情况。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，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。

十、其他风险

1、战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致基金管理人、基金托管人、基金服务机构等机构无法正常工作，从而导致基金资产的损失。

2、金融市场危机、行业竞争、代理商违约、基金托管人违约等超出基金管理人自身直接控制能力之外的风险，也可能导致基金或者基金份额持有人利益受损。

3、其他意外导致的风险。

第十八部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算

一、《基金合同》的变更

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

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议须报中国证监会备案，并自表决通过之日起生效，决议生效后依照《信息披露办法》的有关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《证券法》规定的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

4、基金财产清算程序：

（1）《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；

（2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；

（3）对基金财产进行估值和变现；

（4）制作清算报告；

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

（6）将清算报告报中国证监会备案并公告；

（7）对基金剩余财产进行分配。

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

四、清算费用

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

五、基金财产清算剩余资产的分配

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

其中，对于投资者通过直销机构认购、申购 C 类基金份额计提的销售服务费，或者通过其他销售机构认购、申购且持续持有期限超过一年（即 365 天）的 C 类基金份额在持有超过一年（即 365 天）后继续计提的销售服务费，都将在基金合同终止时随剩余资产分配款项一并返还给投资者。

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《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不低于法律法规规定的期限。

第十九部分 基金合同的内容摘要

一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

（一）基金份额持有人

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。

除法律法规另有规定或基金合同另有约定外，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》、招募说明书等信息披露文件及《业务规则》；

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

（4）遵守基金管理人、基金托管人、销售机构和登记机构的相关交易及业务规则；

（5）向基金管理人或其委托的销售机构提供法律法规规定的或基金管理人根据其内部制度要求的真实、准确、完整、充分的信息资料及身份证明文件，配合基金管理人或其委托的销售机构进行的尽职调查及反洗钱工作，并同意基金管理人在遵守法律法规的前提下授权相关第三方为反洗钱、非居民金融账户涉税信息尽职调查与信息报送等相关的尽职调查之目的、识别基金投资者是否符合基金管理人规定的投资本基金的基金投资者资质条件之目的查阅该等信息资料及身份证明文件；

（6）按《非居民金融账户涉税信息尽职调查管理办法》及相关法律法规及其他有关规定的要求，向基金管理人或销售机构或其授权的第三方真实、及时、准确、完整、充分地提供有效税收居民声明文件及证明文件，并在税收居民或其他情况于前述资料发生变更的 30 天内提供有效的税收居民声明文件及证明文件，配合基金管理人或销售机构或其委托第三方完成《非居民金融账户涉税信息尽职调查管理办法》及相关法律法规及其他有关规定要求的尽职调查及信息报送工作；

（7）出现不符合或不遵守上述第(6)条的要求或基金份额持有人不符合基金管理人规定的投资本基金的基金投资者资质条件时，基金份额持有人持有的基金份额将可能被基金管理人进行强制赎回；

（8）出现不再满足相关法律法规或不符合基金管理人规定的投资本基金的基金投资者资质条件时，包括但不限于基金投资者可能为非中国税收居民或受限于《非居民金融账户涉税信息尽职调查管理办法》或相关法律法规及其他有关规定的任何报告或扣缴义务、不再符合或遵守《非居民金融账户涉税信息尽职调查管理办法》或相关法律法规或其他有关规定、违反反洗钱、反贪污贿赂及其他金融犯罪等法律法规要求或违反第一部分“前言”第十二条下承诺的情形，基金管理人将有权对该基金份额持有人持有的基金份额进行强制赎回（基金管理人不会向基金投资者披露违反反洗钱要求等事项的具体细节）等相应控制措施；

（9）知悉基金管理人将根据《非居民金融账户涉税信息尽职调查管理办法》

等法律法规的规定定期向国家税务总局等相关监管机构报送非居民金融账户涉税信息；

（10）知悉并同意基金管理人在遵守法律法规的前提下及在必要的情况下，有权向相关接收方（包括但不限于会计师事务所、律师、份额登记机构等第三方服务机构）提供本基金合同第七部分“基金合同当事人及权利义务”中“基金管理人的权利”第（24）条所述的信息；如果基金投资者拒绝提供该等信息的，基金管理人及基金管理人委托的销售机构（如有）有权拒绝该等基金投资者的认购/申购申请。基金投资者依据《基金合同》取得基金份额，即表示基金投资者自愿接受上述安排；

（11）知悉并持续关注基金管理人官方网站（www.nbchina.com）不时披露的个人信息处理相关政策；

（12）关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；

（13）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；

（14）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；

（15）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；

（16）执行生效的基金份额持有人大会的决议；

（17）返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；

（18）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

（二） 基金管理人

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）自行或委托其他符合条件的机构办理基金估值核算业务；

（11）依据《基金合同》及有关法律规定决定基金收益的分配方案；

（12）在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购、赎回或转换申请；

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

（14）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；

（15）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；

（16）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；

（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、转换和非交易过户等的业务规则；

（18）若本基金的证券交易模式采用“券商结算”的，委托证券经纪商在证券交易所进行各类证券交易、证券交收，以及相关证券交易的资金交收等证券经纪服务。证券经纪服务的相关权利、义务，由基金管理人与证券经纪商或其他相关服务机构签订《证券经纪服务协议》进行约定；

（19）若基金份额持有人出现不符合或不遵守基金份额持有人义务的第（6）条的要求或基金份额持有人不符合基金管理人规定的投资本基金的基金投资者资质条件时，基金管理人或销售机构或其授权的第三方将可能采取相关措施，包括但不限于：(a)不接受该基金份额持有人对基金份额进一步的申购申请；(b)对基金份额持有人持有的基金份额进行强制赎回；

（20）若基金份额持有人出现不再满足相关法律法规或基金管理人规定的基金份额持有人条件，包括但不限于基金投资者可能为非中国税收居民或受限于《非

居民金融账户涉税信息尽职调查管理办法》或相关法律法规及其他有关规定的任何报告或扣缴义务、不再符合或遵守《非居民金融账户涉税信息尽职调查管理办法》或相关法律法规或其他有关规定、违反反洗钱、反贪污贿赂及其他金融犯罪等法律法规要求，基金管理人有权不接受该基金份额持有人对基金份额进一步的申购申请并对该基金份额持有人持有的基金份额进行强制赎回（基金管理人不会向基金投资者披露违反反洗钱要求等事项的具体细节）；

（21）对于未向基金管理人或其委托的基金销售机构提供反洗钱及《非居民金融账户涉税信息尽职调查管理办法》等相关尽职调查所需信息的基金投资者，基金管理人或销售机构将不接受该基金投资者对基金份额的认购或申购申请；对于未向基金管理人或销售机构提供上述尽职调查所需信息的基金份额持有人，基金管理人或销售机构将采取措施包括但不限于：(a) 不接受该基金份额持有人对基金份额进一步的申购申请；(b) 对该基金份额持有人持有的基金份额进行强制赎回（基金管理人不会向基金投资者披露违反反洗钱要求等事项的具体细节）。基金管理人或销售机构有权根据反洗钱规则的要求，根据基金投资者的具体情况采取相应的控制措施；

（22）基金投资者不符合基金管理人规定的投资本基金的基金投资者资质条件，基金管理人或销售机构将不接受该基金投资者对基金份额的认购或申购申请；

（23）如基金投资者或基金份额持有人不符合基金管理人规定的投资本基金的基金投资者资质条件或违反第一部分“前言”第十二条下承诺的情形或未能提供《非居民金融账户涉税信息尽职调查管理办法》或相关法律法规或其他有关规定所需信息及/或文件或因基金份额持有人可能为非中国税收居民或受限于《非居民金融账户涉税信息尽职调查管理办法》或相关法律法规及其他有关规定的任何报告或扣缴义务而损害基金管理人(或其授权的第三方)、本基金或本基金的其他基金份额持有人，本基金及基金管理人(或其授权的第三方)保留采取任何措施及/或就全部损失进行追偿的权利，包括但不限于拒绝接受投资人或基金份额持有人的认购/申购申请、向基金份额持有人提起诉讼/仲裁、对基金份额持有人持有的基金份额进行强制赎回，并且基金份额持有人不可以就本基金或以本基金名义为遵守任何适用法律法规、财政或税收要求(无论是否为法定的)而采取上述措施或进行上述追偿过程中产生的任何形式的损害或责任向本基金及基金管理人(或其授权的第三方)提出任何要求或追偿，若基金份额持有人有严重违反法律法规的行为，有关金融主管部门可依据相关法律法规进行处罚，涉嫌犯罪的，移送司法机

关进行处理；

（24）基金管理人为履行法律、法规、监管规定等要求（包括但不限于反洗钱、投资者适当性、税收居民身份调查等方面的要求）或公司内部控制制度的要求，有权收集基金投资者及其最终控制人的相关信息；

（25）基金管理人或其委托的销售机构或其授权的第三方将遵守《非居民金融账户涉税信息尽职调查管理办法》及相关法律法规就基金份额持有人（及消极非金融机构的控制人）为非中国税收居民的金融账户资料（包括账户持有人名称、现居地址、出生地点及出生日期（适用于个人及控制人）、税务居民国（地区）、居民国（地区）纳税人识别号、账户余额、投资收入等信息）将可能每年被报送至国家税务总局，继而与相应的税收居民国（地区）的主管机构进行信息交换；

（26）基金管理人有权在遵守法律法规的前提下及在必要的情况下，向相关接收方（包括但不限于会计师事务所、律师、份额登记机构等第三方服务机构）提供第（24）条所述的信息，并将要求接收方不得将该等信息用于违法违规之目的；基金投资者（及其控制人）拒绝提供该等信息的，基金管理人及基金管理人委托的销售机构（如有）有权拒绝该等基金投资者的认购/申购申请。基金投资者依据《基金合同》取得基金份额，即表示基金投资者自愿接受上述安排；

（27）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、估值核算和登记事宜；

（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、赎回价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回的价格；

（9）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

（10）编制季度报告、中期报告和年度报告；

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

（12）保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露，但因监管机构、司法机构等有权机关的要求，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低于法律法规规定的期限；

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

（25）执行生效的基金份额持有人大会的决议；

（26）建立并保存基金份额持有人名册；

（27）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

（三） 基金托管人

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，如发现基金管理人有违反《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、证券账户和期货结算账户等投资所需账户，为基金办理证券、期货交易资金清算；

（5）提议召开或召集基金份额持有人大会；

（6）在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

（7）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

（1）以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

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

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

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

（5）保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

（6）按规定开设基金财产的资金账户、证券账户和期货结算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，但因监管机构、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；

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

（9）办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

（10）对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行；如果基金管理人有未执行《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低于法律法规规定的期限；

（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，并通知基金管理人；

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

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

（21）执行生效的基金份额持有人大会的决议；

（22）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

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

本基金基金份额持有人大会不设立日常机构。若未来本基金份额持有人大会成立日常机构，则按照届时有效的法律法规的规定执行。

（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或基金合同另有约定的除外：

（1）终止《基金合同》；

（2）更换基金管理人；

（3）更换基金托管人；

（4）转换基金运作方式；

（5）调整基金管理人、基金托管人的报酬标准，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，在履行适当程序后，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、调低销售服务费率；

（3）因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；

（4）对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生重大变化；

（5）增加、减少或调整基金份额分类办法及规则；

（6）在法律法规和中国证监会允许的前提下，调整有关基金申购、赎回、转托管、基金交易、非交易过户等业务规则；

（7）本基金推出新业务或新服务；

（8）按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

（二）会议召集人及召集方式

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

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。

3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书

面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集，并自出具书面决定之日起60日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

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

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

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

（三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

（1）会议召开的时间、地点和会议形式；

（2）会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；

（3）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；

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

（5）会务常设联系人姓名及联系电话；

（6）出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；

（7）召集人需要通知的其他事项。

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

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

（四）基金份额持有人出席会议的方式

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

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

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

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

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形

式或大会公告载明的其他方式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址或系统。通讯开会应以书面方式或大会公告载明的其他方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

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

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

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

3、在不与法律法规冲突的前提下，基金份额持有人大会可通过网络、电话、短信或其他方式召开，基金份额持有人可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式进行表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

4、在不与法律法规冲突的前提下，基金份额持有人授权他人代为出席会议并表决的，授权方式可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式，具体方式在会议通知中列明。

（五）议事内容与程序

1、议事内容及提案权

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

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

2、议事程序

（1）现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第(七)条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

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

（2）通讯开会

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

（六）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1、一般决议，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过方为有效；除下列第 2 项所规定的须以特

别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。除法律法规另有规定或《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后依照《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本部分的相关规定。

（十）本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人与基金托管人根据新颁布的法律法规或监管规则协商一致并提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

三、基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

（一）《基金合同》的变更

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

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议须报中国证监会备案，并自表决通过之日起生效，决议生效后依照《信息披露办法》的有关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《证券法》规定的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

4、基金财产清算程序：

（1）《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；

（2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；

（3）对基金财产进行估值和变现；

（4）制作清算报告；

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

（6）将清算报告报中国证监会备案并公告；

（7）对基金剩余财产进行分配。

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

（四）清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金财产清算过程中发生的所有合理

费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金剩余财产中支付。

（五）基金财产清算剩余资产的分配

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

其中，对于投资者通过直销机构认购、申购 C 类基金份额计提的销售服务费，或者通过其他销售机构认购、申购且持续持有期限超过一年（即 365 天）的 C 类基金份额在持有超过一年（即 365 天）后继续计提的销售服务费，都将在基金合同终止时随剩余资产分配款项一并返还给投资者。

（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《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不低于法律法规规定的期限。

四、争议解决方式

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交上海国际经济贸易仲裁委员会（上海国际仲裁中心），根据该会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为上海市，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力。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，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（为本基金合同之目的，在此不包括香港、澳门特别行政区和台湾地区法律）管辖并从其解释。

五、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

《基金合同》可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、销售机构的

办公场所和营业场所查阅。

第二十部分 基金托管协议的内容摘要

一、基金托管协议当事人

（一）基金管理人

名称：路博迈基金管理（中国）有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 88 号 30 层 11 单元

法定代表人：阎小庆

成立日期：2021 年 7 月 22 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监许可[2021]3094 号

组织形式：有限责任公司（外国法人独资）

注册资本：人民币 75,000 万元

存续期间：持续经营

（二）基金托管人

名称：广发证券股份有限公司

注册地址：广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街 2 号 618 室

办公地址：广东省广州市天河区马场路 26 号广发证券大厦 34 楼

法定代表人：林传辉

成立日期：1994 年 01 月 21 日

批准设立机关和批准设立文号：中国人民银行广东省分行粤银管字【1991】第 133 号

注册资本：782484.5511 万元人民币

存续期间：长期

基金托管资格批文及文号：证监许可【2014】510 号

组织形式：股份有限公司

经营范围：许可项目：证券业务；公募证券投资基金销售；证券公司为期货公司提供中间介绍业务；证券投资基金托管。（依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动，具体经营项目以相关部门批准文件或许可证件为准）

二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

（一）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金投

资范围、投资对象进行监督。基金管理人应通过基金管理人公司邮箱或双方共同认可的其他方式向基金托管人提供投资监督联系方式。基金托管人接收基金管理人投资监督联系方式以及向基金管理人发送投资监督提示邮件的邮箱地址为：compliance_zctg@gf.com.cn。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板、科创板及其他经中国证监会允许上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、政府支持债券、政府支持机构债、次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、信用衍生品、国债期货、股指期货、股票期权、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可根据法律法规和基金合同的约定，参与融资融券业务中的融资业务。

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

本基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为 80%-95%；每个交易日日终，在扣除国债期货合约、股指期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或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、应收申购款等。

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

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

1、本基金股票投资占基金资产的比例为 80%-95%；

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

3、本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；

4、本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的

10%；完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金品种可以不受此条款规定的比例限制；

5、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；

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

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

8、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；

9、本基金资产总值不超过基金资产净值的 140%；

10、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%；

11、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%；

12、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%；

13、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%；

14、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；

15、基金参与国债期货和股指期货交易，应当遵守下列要求：

（1）本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的 15%；在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；

（2）本基金在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%；在任何交易日日终，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%；

（3）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；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；

（4）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%；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%；

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

16、本基金参与股票期权交易，须遵守下列投资比例限制：

（1）基金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；开仓卖出认沽股票期权的，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股票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；

17、本基金参与融资业务后，在任何交易日日终，持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；

18、本基金不持有具有信用保护卖方属性的信用衍生品；本基金持有的信用衍生品名义本金不得超过本基金中所对应受保护债券面值的 100%；

19、本基金投资于同一信用保护卖方的各类信用衍生品名义本金合计不得超过基金资产净值的 10%；

因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合 18、19 规定比例限制的，基金管理人应在 3 个月之内进行调整；

20、法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他投资限制。

除上述第 2、7、8、14、18、19 项情形之外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

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

如果法律法规或监管部门对上述投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

（三）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对本基金投资禁止行为进行监督。为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

1、承销证券；

2、违反规定向他人贷款或者提供担保；

3、从事承担无限责任的投资；

4、买卖其他基金份额，但是法律法规或中国证监会另有规定的除外；

5、向其基金管理人、基金托管人出资；

6、从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

7、法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券，或者

从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先的原则，防范利益冲突，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。基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供基金管理人关联方名单和关联交易证券名单。如基金管理人关联方名单和关联交易证券名单发生变化的，基金管理人应确保不影响基金托管人履行投资监督职责，及时将变化情况以书面形式通知基金托管人。

（四）基金托管人应当加强对基金合同的审核，对业绩比较基准的选取、变更等进行充分评估，确保基金管理人选取的业绩比较基准符合法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》约定。基金托管人应当对定期报告有关业绩比较基准的披露内容进行复核。

（五）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。本基金参与银行间债券交易前，须向基金托管人提供经慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手名单，并约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金托管人监督基金管理人是否按事前提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易。基金管理人可以每半年对银行间债券市场交易对手名单进行更新，如基金管理人根据市场情况需要临时调整银行间债券市场交易对手名单，应向基金托管人说明理由，在与交易对手发生交易前 3 个工作日内与基金托管人协商解决。基金管理人收到基金托管人书面确认后，被确认调整的名单开始生效，新名单生效前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。基金管理人负责对交易对手的资信控制，按银行间债券市场的交易规则进行交易，并负责解决因交易对手不履行合同而造成的纠纷及损失，基金托管人不承担由此造成的任何法律责任及损失。若未履约的交易对手在基金托管人与基金管理人确定的时间前仍未承担违约责任及其他相关法律责任的，基金管理人可以对相应损失先行予以承担，然后再向相关交易对手追偿。基金托管人则根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督，但不承担交易对手不履行合同造成的损失。如基金托管人事后发现基金管理人没有按照

事先约定的交易对手或交易方式进行交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人，基金托管人不承担由此造成的相应损失和责任。如基金管理人未提供名单，视为可与全市场交易对手进行交易。

（六）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金管理人投资银行存款进行监督。

基金投资银行存款的，基金管理人应确定符合条件的所有存款银行的名单，并及时提供给基金托管人，基金托管人对基金投资银行存款的交易对手是否符合有关规定进行监督。基金管理人应根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，建立投资制度、审慎选择存款银行，做好风险控制；并按照基金托管人的要求配合基金托管人完成相关业务办理。

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

如果基金管理人未经基金托管人的审核擅自将不实的业绩表现数据印制在宣传推介材料上，则基金托管人对此不承担任何责任，并将在发现后立即报告中国证监会。

（八）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金投资流通受限证券进行监督。

1、基金投资流通受限证券，应遵守《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。

2、流通受限证券与上文所述的流动性受限资产并不完全一致，包括由法律法规或中国证监会规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。

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

本基金投资的流通受限证券应保证登记存管在本基金名下，基金管理人负责

相关工作的落实和协调，并确保基金托管人能够正常查询。因基金管理人原因产生的流通受限证券登记存管问题，造成基金托管人无法安全保管本基金资产的责任与损失，及因流通受限证券存管直接影响本基金安全的责任及损失，由基金管理人承担。

3、在首次投资流通受限证券之前，基金管理人应当制定相关投资决策流程、风险控制制度、流动性风险控制预案等规章制度。基金管理人应当根据基金流动性的需要合理安排流通受限证券的投资比例，并在风险控制制度中明确具体比例，避免基金出现流动性风险。基金管理人应当将上述规章制度提交给基金托管人。

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

在投资流通受限证券之前，基金管理人应至少提前一个交易日向基金托管人提供有关流通受限证券的相关信息，具体应当包括但不限于如下文件（如有）：

拟发行证券主体的中国证监会批准文件、发行证券数量、发行价格、锁定期、基金拟认购的数量、价格、总成本、总成本占基金资产净值的比例、已持有流通受限证券市值占资产净值的比例、资金划付时间等。基金管理人应保证上述信息的真实、完整。

基金托管人在监督基金管理人投资流通受限证券的过程中，如认为因市场出现剧烈变化导致基金管理人的具体投资行为可能对基金财产造成较大风险，基金托管人有权要求基金管理人对该风险的消除或防范措施进行补充和整改，并做出书面说明。否则，基金托管人经事先书面告知基金管理人，有权拒绝执行其有关指令。因拒绝执行该指令造成基金财产损失的，基金托管人不承担任何责任，并有权报告中国证监会。

基金管理人应保证基金投资的流通受限证券登记存管在本基金名下，并确保基金托管人能够正常查询。因基金管理人原因产生的流通受限证券登记存管问题，

造成基金财产的损失或基金托管人无法安全保管基金财产的责任与损失，由基金管理人承担。

如果基金管理人未按照本协议的约定向基金托管人报送相关数据或者报送了虚假的数据，导致基金托管人不能履行托管人职责的，基金管理人应依法承担相应法律后果。除基金托管人未能依据《基金合同》及本协议履行职责外，因投资流通受限证券产生的损失，基金托管人按照本协议履行监督职责后不承担上述损失。

（九）侧袋机制的实施和投资运作安排

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

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

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

（十）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和《基金合同》的规定，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函，就基金托管人的合理疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内,基金托管人有权随时对通知事项进行复查,督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反《基金合同》约定的，应当立即通知基金管理人，并报告中国证监会。

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

（十二）基金托管人发现基金管理人有重大违规行为，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、阻挠基金托管人根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍基金托管人进行有效监督，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。

三、基金管理人对基金托管人的业务核查

（一）基金管理人对基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的托管账户、证券账户和期货结算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》、《基金合同》、本协议及其他有关规定时，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正。基金托管人收到通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金管理人发出回函，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复基金管理人并改正。

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

四、基金财产的保管

（一）基金财产保管的原则

1、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人、证券经纪机构的固有财产。

2、基金托管人应安全保管基金财产。未经基金管理人依据合法程序作出的合

法合规指令，基金托管人不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。

3、基金托管人按照规定开设基金财产的托管账户、证券账户和期货结算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，独立核算，分账管理，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的指令，按照《基金合同》和本协议的约定保管基金财产，如有特殊情况双方可另行协商解决。

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

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

（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或其委托的登记机构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或其委托的登记机构开立并管理。

2、基金募集期满或基金停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，基金管理人应将属于基金财产的全部资金划入基金托管人开立的基金托管账户，同时在规定时间内，聘请符合《证券法》规定的会计师事务所进行验资，出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的 2 名或 2 名以上中国注册会计师签字方为有效。

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

（三）基金托管账户的开立和管理

1、基金托管人应负责本基金的托管账户的开设和管理。

2、基金托管人可以本基金的名义在商业银行开设本基金的托管账户，并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。本基金的一切货币收支活动，包括但不

限于投资、支付赎回款、支付基金收益、收取申购款，均需通过本基金的托管账户进行。

3、基金托管账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立任何其他银行账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

4、基金托管账户应符合相关法律法规的有关规定。

（四）基金证券账户和证券资金账户的开立和管理

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

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

3、基金管理人以基金名义在基金管理人选择的证券经纪机构营业网点开立证券资金账户。证券经纪机构根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立相关资金账户并按照该证券经纪机构开户的流程和要求与基金管理人签订相关协议。

4、交易所证券交易资金采用第三方存管模式，即用于证券交易结算资金全额存放在基金管理人为基金开设证券资金账户中，场内的证券交易资金清算由基金管理人所选择的证券公司负责。基金托管人不负责办理场内的证券交易资金清算，也不负责保管证券资金账户内存放的资金。

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

（五）债券托管与结算账户的开设和管理

根据基金管理人的要求,《基金合同》生效后,基金托管人根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司、银行间市场清算所股份有限公司的有关规定，以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司、银行间市场清算所股份有限公司开立债券托管与结算账户，并代表基金进行银行间市场债券的结算。基金管理人代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议。回购主协议的签署与基金托管人无关。全国银行间同业拆借市场的交易资格由基金管理人以基金的名义申

请，银行间债券市场准入备案由基金管理人和基金托管人共同负责。

（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，可以根据法律法规和《基金合同》的规定，在基金管理人和基金托管人商议后开立。新账户按有关规则使用并管理。

2、法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

（七）基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的有关实物证券、银行定期存款存单等有价凭证由基金托管人负责妥善保管，保管凭证由基金托管人持有。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。属于基金托管人实际有效控制下的实物证券在基金托管人保管期间的损坏、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

由基金管理人代表基金签署的、与基金有关的重大合同的原件分别由基金管理人、基金托管人保管。除协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时应尽可能保证基金一方持有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人应在重大合同签署后及时将重大合同扫描件发送给基金托管人，并在三十个工作日内将正本送达基金托管人处。重大合同的保管期限不低于法律法规规定的最低期限。对于无法取得二份以上的正本的，基金管理人应向基金托管人提供加盖公章的合同复印件或扫描件，未经双方协商一致，合同原件不得转移。

五、基金资产净值计算和会计核算

（一）基金资产净值的计算及复核程序

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价值。

各类基金份额净值是按照每个工作日闭市后，各类基金资产净值除以当日该类基金份额的余额数量计算。本基金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。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人或其委托的基金服务机构每个工作日计算基金资产净值及各类基金份额净值，并按规定公告。

2、复核程序

基金管理人或其委托的基金服务机构每个工作日对基金资产进行估值后，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，由基金管理人依据《基金合同》和相关法律法规的规定对外公布。

（二）基金资产估值方法和特殊情形的处理

1、估值对象

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

2、估值方法

基金管理人与基金托管人应按照《基金合同》约定的估值方法进行估值。

3、特殊情形的处理

基金管理人与基金托管人应当按照《基金合同》的约定处理特殊情况。

（三）基金份额净值错误的处理方式

基金管理人与基金托管人应当按照《基金合同》的约定处理估值错误。

（四）暂停估值与公告基金份额净值的情形

1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

3、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；

4、法律法规规定、中国证监会和《基金合同》认定的其他情形。

（五）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《基金合同》的约定对主袋账户资产进行估值并披露主袋账户的基金净值信息，暂停披露侧袋账户份额净值。

（六）基金会计制度

按国家有关部门规定的会计制度执行。

（七）基金账册的建立

基金管理人进行基金会计核算并编制基金财务会计报告。基金管理人独立地设置、记录和保管本基金的全套账册。若基金管理人和基金托管人对会计处理方法存在分歧，应以基金管理人的处理方法为准。若当日核对不符，暂时无法查找到错账的原因而影响到基金净值的计算和公告的，以基金管理人的账册为准。

（八）基金财务报表与报告的编制和复核

1、财务报表的编制

基金管理人应当及时编制并对外提供真实、完整的基金财务会计报告。月度报表的编制，基金管理人应于每月终了后 5 个工作日内完成。季度报告应在每个季度结束之日起 15 个工作日内编制完毕并予以公告；中期报告在上半年结束之日起两个月内编制完毕并予以公告；年度报告在每年结束之日起三个月内编制完毕并予以公告。基金年度报告中的财务会计报告应当经过符合《证券法》规定的会计师事务所审计。《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。

2、报表复核

基金管理人在上述财务报表完成后，将报表提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人和基金托管人之间的上述文件往来均以邮件的方式或双方商定的其他方式进行。

基金托管人在复核过程中，发现双方的报表存在不符时，基金管理人和基金托管人应共同查明原因，进行调整，调整以双方认可的账务处理方式为准；若双方无法达成一致，以基金管理人的账务处理为准。核对无误后，基金托管人在基金管理人提供的报告上加盖托管业务专用章或者出具加盖托管业务专用章的复核意见书，双方各自留存一份。如果基金管理人与基金托管人不能于应当发布公告之日之前就相关报表达成一致，基金管理人有权按照其编制的报表对外发布公告，基金托管人有权就相关情况报中国证监会备案。

（九）基金管理人应每季向基金托管人提供基金业绩比较基准的基础数据和编制结果。

六、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基金份额持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册由登记机构编制，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日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，保存期限不少于法律法规规定的最低期限。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。

七、争议解决方式

因本协议产生或与之相关的争议，双方当事人应通过协商、调解解决，协商、调解不能解决的，任何一方均有权将争议提交上海国际经济贸易仲裁委员会（上海国际仲裁中心），仲裁地点为上海市，按照该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。

八、托管协议的变更与终止

（一）托管协议的变更程序

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

（二）基金托管协议终止的情形

1、基金合同终止；

2、基金托管人解散、依法被撤销、破产或由其他基金托管人接管基金资产；

3、基金管理人解散、依法被撤销、破产或由其他基金管理人接管基金管理权；

4、发生法律法规、中国证监会或基金合同规定的终止事项。

（三）基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。在基金财产清算小组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

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

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

4、基金财产清算程序

（1）《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；

（2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；

（3）对基金财产进行估值和变现；

（4）制作清算报告；

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

（6）将清算报告报中国证监会备案并公告；

（7）对基金剩余财产进行分配。

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

6、清算费用

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

7、基金财产清算剩余资产的分配

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

其中，对于投资者通过直销机构认购、申购 C 类基金份额计提的销售服务费，或者通过其他销售机构认购、申购且持续持有期限超过一年（即 365 天）的 C 类基金份额在持有超过一年（即 365 天）后继续计提的销售服务费，都将在基金合同终止时随剩余资产分配款项一并返还给投资者。

8、基金财产清算的公告

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

9、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存，保存期限不少于法律法规规定的最低期限。

第二十一部分 对基金份额持有人的服务

对于基金份额持有人，基金管理人将根据具体情况提供一系列的服务，并将根据基金份额持有人的需要和市场的变化，增加或变更服务项目。主要服务内容如下：

一、基金份额持有人交易信息查询服务

1、基金交易确认查询服务：基金投资者在交易申请被受理的 2 个工作日后，可以到销售网点查询该项交易的确认信息，或者通过基金管理人客服电话进行查询。

2、基金对账单服务：基金管理人将以电子邮件的形式向通过直销渠道购买基金的投资者发送对账单。通过代销渠道购买基金的投资者可根据与销售机构约定的方式接收对账单。

二、客户服务中心电话服务

客户服务中心人工服务负责接听投资者热线来电；帮助投资者查询账户、基金、交易等相关信息；记录投资者投诉及建议并及时的反馈给相关部门处理。人工客服时间为工作日上午 9：30 - 11：30，下午 14：00 - 17：00。

三、投资者持续信息服务

基金管理人作为直销机构，依据法律法规向通过直销渠道购买本基金的投资者提供持续信息服务，具体提供范围及方式以公司与投资者的约定为准。

四、网站服务

基金份额持有人可以通过基金管理人网站(www.nbchina.com)享受理财资讯、信息披露等服务。

五、投诉受理服务

基金份额持有人可以通过基金管理人客服电话、书信、传真、电子邮件等方式对基金管理人、销售机构所提供的服务进行投诉。基金管理人受理投诉后，将及时做出回应。

六、基金管理人客户服务联络方式

联系地址：中国上海市静安区石门一路 288 号香港兴业中心 2 座 705-710 室

联系电话：400-875-5888

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

第二十二部分 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。投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件，但应以基金备查文件正本为准。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与公告的内容完全一致。

第二十三部分 备查文件

以下备查文件存放在基金管理人、基金托管人的办公场所，在办公时间可供免费查阅。

（一）中国证监会准予路博迈锐翼量化选股股票型证券投资基金募集注册的文件

（二）《路博迈锐翼量化选股股票型证券投资基金基金合同》

（三）《路博迈锐翼量化选股股票型证券投资基金托管协议》

（四）基金管理人业务资格批件、营业执照

（五）基金托管人业务资格批件、营业执照

（六）关于申请募集注册路博迈锐翼量化选股股票型证券投资基金之法律意见书

（七）中国证监会要求的其他文件

路博迈基金管理（中国）有限公司

2026 年 11 月 10 日