中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金招募说明书 （更新）

基金管理人：中邮创业基金管理股份有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

二零二六年十一月

重要提示

本基金根据 2015 年 11 月 20 日中国证券监督管理委员会《关于准予中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金募集的批复》（证监许可[2015]2683 号）的注册进行募集。

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价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资人认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书，全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资人在获得基金投资收益的同时，亦承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险，启用侧袋机制等流动性风险管理工具带来的风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险。

本基金以绝对收益策略为主要投资策略，运用股指期货对冲投资组合的系统性风险，通过同时构建多头和空头的方式实现绝对收益策略，因此除面临一般混合型基金风险外还包括本基金所特有的风险。首先，本基金的绝对收益策略是否能实现剥离多头股票系统性风险具有不确定性；其次，本基金的主要投资工具股指期货还可能引发的基差风险、杠杆风险、对手方风险、盯市结算风险等；此外，在本基金的封闭运作期间，基金份额持有人还面临不能赎回基金份额的风险。

本基金同时为发起式基金，在基金募集时，基金管理人及基金经理将运用公司固有资金及基金经理自有资金认购本基金的金额不低于 1000 万元，认购的基金份额持有期限不低于三年。基金管理人认购的基金份额持有期限满三年后，基金管理人及基金经理将根据自身情况决定是否继续持有，届时，基金管理人及基金经理有可能赎回认购的本基金份额。另外，在基金成立满三年之日，如果本基金的资产规模低于 2 亿元，基金合同将自动终止，投资者将面临基金合同可能终止的不确定性风险。

本基金的特定风险详见招募说明书“风险揭示”章节。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。投资者应当认真阅读《基金合同》、《招募说明书》等基金法律文件，

了解基金的风险收益特征，根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和自身的风险承受能力相适应，并通过基金管理人或基金管理人委托的具有基金代销业务资格的其他机构购买基金。

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。

目　　录

一、前　　言.....1
二、释　　义.....2
三、基金管理人.....7
四、基金托管人.....22
五、相关服务机构.....25
六、基金的募集.....27
七、基金备案.....30
八、基金份额的开放期、封闭期、申购与赎回.....31
九、基金的投资.....40
十、基金的财产.....52
十一、基金资产的估值.....53
十二、基金收益与分配.....58
十三、基金费用与税收.....60
十四、基金的会计与审计.....63
十五、基金的信息披露.....64
十六、侧袋机制.....70
十七、风险揭示.....72
十八、基金合同的变更、终止与基金财产的清算.....79
十九、基金合同内容摘要.....81
二十、基金托管协议内容摘要.....95
二十一、对基金份额持有人的服务.....114
二十二、其他应披露事项.....116
二十三、招募说明书存放及查阅方式.....136
二十四、备查文件.....137

一、前　　言

《中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金招募说明书》（以下简称“本招募说明书”）依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（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》”）等有关法律法规以及《中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

本招募说明书阐述了中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资者投资决策有关的全部必要事项，投资人在做出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

本基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假内容、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。本招募说明书由中邮创业基金管理股份有限公司解释。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当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

二、释　　义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

1、基金或本基金：指中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金

2、基金管理人：指中邮创业基金管理股份有限公司

3、基金托管人：指兴业银行股份有限公司

4、基金合同：指《中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充

5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充

6、招募说明书或本招募说明书：指《中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金招募说明书》及其更新

7、基金产品资料概要：指《中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金产品资料概要》及其更新

8、基金份额发售公告：指《中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金份额发售公告》

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

10、《基金法》：指2003年10月28日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，自2004年6月1日起实施，并经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2013年3月15日颁布、同年6月1日起实施的《证券投资基金销售管理办法》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《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日起实施的《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日起实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修

订

15、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

16、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会

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

18、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

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

20、合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理办法》及相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者

21、发起式基金：指符合《运作办法》和中国证监会规定的相关条件而募集、运作，由基金管理人、基金管理人股东、基金管理人高级管理人员或基金经理等人员承诺认购一定金额并持有一定期限的证券投资基金

22、发起资金：指用于认购发起式基金且来源于基金管理人的股东资金、基金管理人固有资金、基金管理人高级管理人员或基金经理等人员的资金

23、发起资金提供方：以发起资金认购本基金且承诺以发起资金认购的基金份额持有期限不少于三年的基金管理人的股东、基金管理人、基金管理人高级管理人员或基金经理等人员

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

25、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

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

27、销售机构：指中邮创业基金管理股份有限公司以及符合《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代理协议，代为办理基金销售业务的机构

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

29、登记机构：指办理登记业务的机构。基金的登记机构为中邮创业基金管理股份有限

公司或接受中邮创业基金管理股份有限公司委托代为办理登记业务的机构

30、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

31、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买卖基金的基金份额变动及结余情况的账户

32、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

33、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

34、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

35、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

36、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

37、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

38、T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日(不包含 T 日)

39、定期开放：指本基金采取的在封闭期内封闭运作、封闭期与封闭期之间定期开放的运作方式

40、封闭期：本基金的首个封闭期为自基金合同生效日起至第一个开放期的首日（不含该日）之间期间，之后的封闭期为每相邻两个开放期之间的期间。本基金在封闭期内不办理申购与赎回业务

41、开放期：本基金开放申购、赎回等业务的期间。本基金自每个封闭期结束之后进入开放期，期间可以办理申购与赎回业务。

本基金每三个月开放一次，每次开放期不超过 5 个工作日，每个开放期所在月份为基金合同生效日所在月份在后续每三个日历月中最后一个日历月，每个开放期的首日为当月沪深 300 股指期货交割日前五个工作日的第一个工作日。

开放期的具体时间以基金管理人届时公告为准，且基金管理人最迟应于开放期开始前 2 日进行公告。如在开放期内发生不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放申购与赎回业务的，开放期时间中止计算，在不可抗力或其他情形影响因素消除之日次日起，继续计算该开放期时间，直到满足开放期的时间要求

42、开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

43、开放时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

44、《业务规则》：指《中邮创业基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》，是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金登记方面的业务规则，由基金管理人和投资人共同遵守

45、认购：指在基金募集期内，投资人申请购买基金份额的行为

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

47、赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为

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

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

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

51、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 20%

52、元：指人民币元

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

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

55、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

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

57、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

58、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

59、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

60、规定媒介：指中国证监会规定的用以进行信息披露的全国性报刊及规定互联网网站（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

61、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

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

63、不可抗力：指本合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

三、基金管理人

一、基金管理人基本情况

名称：中邮创业基金管理股份有限公司

成立时间：2006 年 5 月 8 日

住所：北京市东城区北三环东路 36 号 2 号楼 C 座 20 层

办公地址：北京市东城区北三环东路 36 号环球贸易中心 C 座 20、21 层

法定代表人：张志名

注册资本：3.041 亿元人民币

股权结构：

股东名称	出资比例
首创证券股份有限公司	46.37%
中邮证券有限责任公司	28.61%
三井住友银行股份有限公司	23.68%
其他社会流通股股东	1.34%
总　　计	100%

公司客服电话：400-880-1618

公司联系电话：010-82295160

联系人：李晓蕾

二、主要人员情况

1、董事会成员

张涛先生，中共党员，管理学博士。曾任华泰证券股份有限公司总裁办公室总裁秘书、投资银行一部业务经理、福州办事处副主任、上海总部投资银行业务部副总经理（主持工作）、深圳总部副总经理（主持工作）、深圳彩田路营业部总经理、董事会秘书兼总裁助理兼董事会办公室主任、副总裁，华泰期货有限公司董事长，钟山有限公司董事、副总经理，钟山金融控股有限公司董事长，东兴证券股份有限公司财务负责人、董事、党委副书记、总经理，首创证券股份有限公司总经理等职务。现任首创证券股份有限公司党委书记、董事长，兼任中邮创业基金管理股份有限公司董事长。

程家林先生，中共党员，硕士研究生。曾任北京市通州区永乐店镇柴厂屯村党支部书记助理、北京市通州区永乐店镇半截河村党支部书记助理、中共北京市委组织部干部调配处（公

务员管理处）试用期干部、中共北京市委组织部干部调配处（公务员管理处）副主任科员、中共北京市委组织部干部调配处（公务员管理处）主任科员、北京首都创业集团有限公司人力资源部总经理助理、北京首都创业集团有限公司党群工作部（党委办公室、党委组织部）主任助理、首创环境控股有限公司党委副书记、董事、纪委书记、首创证券股份有限公司党委委员、纪委书记、党委副书记、董事。现担任首创证券股份有限公司公司党委委员、副总经理职务，兼任中邮创业基金管理股份有限公司董事。

张志名先生，中共党员，经济学硕士。曾任首创证券有限责任公司固定收益总部投资经理、首创证券有限责任公司固定收益总部总经理助理、首创证券有限责任公司固定收益总部副总经理（主持工作）、首创证券有限责任公司固定收益总部总经理、首创证券有限责任公司固定收益事业部总裁兼固定收益事业部销售交易部总经理、债券融资总部总经理（兼）、首创证券有限责任公司总经理助理、证券投资总部总经理（兼）、首创证券有限责任公司副总经理；首创证券股份有限公司党委委员、副总经理、固定收益事业部总裁、中邮创业基金管理股份有限公司董事、常务副总经理。现担任中邮创业基金管理股份有限公司党总支书记、董事、总经理、法定代表人，首创证券股份有限公司党委委员，兼任首誉光控资产管理有限公司董事长、中邮创业国际资产管理有限公司董事长。

付家伟先生，中共党员，1978 年 6 月出生，大学本科毕业于西南交通大学通信工程专业，西南财经大学高级管理人员工商管理硕士。2003.07-2006.03 任华夏证券有限公司成都马家花园营业部职员；2007 年 8 月至今，就职于首创证券股份有限公司，曾担任四川分公司总经理、公司总经理助理。现担任公司副总经理，分管财富管理中心、机构业务中心、数字发展部、信用业务部、客户服务中心、运营管理中心。

于亚卓先生，中共党员，博士研究生。曾任中国邮政集团公司邮政业务局商业信函处科员、中国邮政集团公司办公厅综合秘书、副主任科员、主任科员、中邮证券有限责任公司投资银行部董事总经理、项目负责人、中邮证券有限责任公司北京证券资产管理分公司市场总监、中邮证券有限责任公司战略客户与协同发展部副总经理、总经理、战略发展部（董事会办公室）总经理（主任）。现担任中邮证券有限责任公司四川分公司总经理。

毛利宪一郎先生，曾任三井住友银行股份有限公司国际统括部处长，亚洲、大洋洲统括部副部长、三井住友信用卡股份有限公司战略事业开发部部长，三井住友金融集团股份有限公司结算融资企划部部长，三井住友融资租赁股份有限公司亚洲战略企划部部长。现任三井住友金融集团股份有限公司资产运用战略企划部部长、以及三井住友银行股份有限公司资产运用战略企划部部长。

穆忠和先生，中共党员，国际经济博士，美国斯坦福大学经济学访问学者、执业律师。曾任天津市河西区人民政府研究室干部、天津正大律师事务所律师、国家商务部副处长、一等商务秘书（正处级）。现担任北京德恒律师事务所律师、合伙人。

聂兴凯先生，中共党员，教授、管理学博士，北京国家会计学院会计系主任、智能财务与控制研究中心主任。曾就职于中国建设银行从事资金清算与会计结算等工作、北京国家会计学院从事教学与管理工作。现兼任中交设计独立董事、开拓导控独立董事、西藏信托独立董事（非上市公司）、北京知行法律实务研究中心监事、中国中小商业企业协会特邀理事、京津冀会计硕士联盟理事、中国医院协会内部审计专业委员会常务委员。

李冰清先生，博士，博士生导师、中国精算师协会考试教育委员会委员、北美精算师协会中国委员会教育委员会委员。曾就职于南开大学保险系担任讲师、南开大学保险系担任副教授、南开大学保险系担任教授、南开大学金融学院担任教授、西南财经大学担任教授、南开大学风险管理与保险学系担任副系主任、南开大学风险管理与保险学系担任系主任。现就职于南开大学担任教授并兼任中国人民人寿保险股份有限公司独立董事。

2、公司高级管理人员

张志名先生，中共党员，经济学硕士。曾任首创证券有限责任公司固定收益总部投资经理、首创证券有限责任公司固定收益总部总经理助理、首创证券有限责任公司固定收益总部副总经理（主持工作）、首创证券有限责任公司固定收益总部总经理、首创证券有限责任公司固定收益事业部总裁兼固定收益事业部销售交易部总经理、债券融资总部总经理（兼）、首创证券有限责任公司总经理助理、证券投资总部总经理（兼）、首创证券有限责任公司副总经理；首创证券股份有限公司党委委员、副总经理、固定收益事业部总裁、中邮创业基金管理股份有限公司董事、常务副总经理。现担任中邮创业基金管理股份有限公司党总支书记、董事、总经理、法定代表人，首创证券股份有限公司党委委员，兼任首誉光控资产管理有限公司董事长、中邮创业国际资产管理有限公司董事长。

唐亚明先生，中共党员，经济学学士。曾任联合证券赛格科技园营业部研究员、深圳赛格集团财务公司金融部副经理、中信实业银行业务部经理、首创证券资金运营部总经理、计划财务部总经理、中邮创业基金管理股份有限公司资产管理事业部总经理、首誉光控资产管理有限公司副总经理。现任首誉光控资产管理有限公司董事、中邮创业国际资产管理有限公司董事、中邮创业基金管理股份有限公司副总经理兼财务负责人。

李小振先生，中共党员，工程硕士。曾任陕西省邮政储汇局技术员、陕西省邮政储汇局清算中心主任、陕西省邮政局公众服务处业务主管、中邮证券有限责任公司干部、中邮证券

有限责任公司综合办公室副主任(主持工作)、中邮证券有限责任公司综合办公室主任、中邮证券有限责任公司总经理秘书、中邮证券有限责任公司综合办公室副主任、中邮证券有限责任公司董事会秘书(其间：2011 年 12 月-2013 年 6 月兼资产管理分公司负责人；2012 年 11 月-2021 年 6 月兼战略发展部总经理；2014 年 5 月-2015 年 11 月兼山东分公司总经理；2015 年 4 月-2021 年 3 月兼北京资产管理分公司总经理)。现任中邮创业基金管理股份有限公司副总经理。

杨旭鹏先生，中共党员，工程硕士。曾任北京中启计算机公司软件开发总工程师、中邮创业基金管理股份有限公司信息技术总监、泰康资产管理有限公司互联网金融执行总监、文明互鉴文化传播(北京)有限公司总经理。现任中邮创业基金管理股份有限公司首席信息官。

高海涛先生，硕士研究生。曾就职于北京市怀柔区法院、中国证监会稽查总队、嘉实基金管理有限公司稽核部、明亚基金管理有限责任公司、日兴证券有限公司（筹），曾担任中邮创业基金管理股份有限公司合规总监。现任中邮创业基金管理股份有限公司督察长。

侯玉春先生，中共党员，法学学士。曾任北京市人民政府电子工业办公室干部、香港圣加利企业有限公司中国部行政主任、北京区域副经理、中国平安保险公司北京分公司文秘室主任、巨田证券有限责任公司投资银行部董事助理、中国辽宁国际合作（集团）股份有限公司董事、董事会秘书。现任中邮创业基金管理股份有限公司董事会秘书。

3、本基金基金经理

现任基金经理

姚艺女士，硕士研究生。曾任天弘基金管理有限公司交易员、首创证券股份有限公司固定收益事业部投资经理、中邮创业基金管理股份有限公司专户投资部投资经理。现任中邮中债-1-3 年久期央企 20 债券指数证券投资基金（2022 年 9 月 30 日—至今）、中邮纯债优选一年定期开放债券型证券投资基金（2022 年 9 月 30 日—至今）、中邮睿泽一年持有期债券型证券投资基金（2022 年 9 月 30 日—至今）、中邮优享一年定期开放混合型证券投资基金（2022 年 9 月 30 日—至今）、中邮鑫溢中短债债券型证券投资基金（2023 年 11 月 15 日—至今）、中邮鑫享 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金（2025 年 3 月 6 日—至今）、中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金（2025 年 4 月 1 日—至今）、中邮尊享混合型发起式证券投资基金（2026 年 6 月 16 日—至今）基金经理。

邢儒风先生，理学硕士。曾任中邮创业基金管理股份有限公司研究部研究员、固定收益部研究员、固定收益部基金经理助理。现任中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金（2025 年 9 月 1 日—至今）、中邮臻享混合型发起式证券投资基金（2026 年 8 月 25

日—至今）基金经理。

历任基金经理

基金经理	任职日期	离任日期
任泽松先生	2015-12-30	2018-06-25
俞科进先生	2015-12-30	2020-01-20
王喆先生	2018-12-19	2022-04-15
王高先生	2022-04-01	2025-04-01

4、投资决策委员会成员

本公司投资决策委员会分为权益投资决策委员会和固定收益投资决策委员会。

权益投资决策委员会成员包括：

主任委员：

衣瑛杰先生：经济学硕士。曾任中化化肥有限责任公司资金部资金专员、民生证券股份有限公司债券投资部投资经理助理、投资经理、首创证券固定收益部投资经理、固定收益事业部投顾业务部副总经理、固定收益事业部投顾业务部兼金融市场部总经理、深圳分公司副总经理、固定收益事业部副总裁；中邮创业基金管理股份有限公司固定收益部总经理兼固收总监、中邮纯债优选一年定期开放债券型证券投资基金、中邮悦享 6 个月持有期混合型证券投资基金、中邮睿泽一年持有期债券型证券投资基金基金经理。现任中邮创业基金管理股份有限公司投研总监、中邮稳定收益债券型证券投资基金、中邮优享一年定期开放混合型证券投资基金、中邮乐享收益灵活配置混合型证券投资基金、中邮卓享混合型证券投资基金基金经理。

执行委员：

陈梁先生：经济学硕士。曾任大连实德集团市场专员、华夏基金管理有限公司行业研究员、中信产业投资基金管理有限公司高级研究员、中邮创业基金管理股份有限公司研究部副总经理、权益投资部副总经理、中邮乐享收益灵活配置混合型证券投资基金、中邮稳健添利灵活配置混合型证券投资基金、中邮多策略灵活配置混合型证券投资基金、中邮稳健合赢债券型证券投资基金、中邮军民融合灵活配置混合型证券投资基金、中邮瑞享两年定期开放混合型证券投资基金、中邮消费升级灵活配置混合型发起式证券投资基金、中邮睿丰增强债券型证券投资基金、中邮核心优选混合型证券投资基金基金经理。现任中邮创业基金管理股份有限公司权益投资部总经理、中邮核心成长混合型证券投资基金、中邮核心主题混合型证券

投资基金、中邮能源革新混合型发起式证券投资基金基金经理。

委员：

江刘玮先生：经济学硕士。曾任中国出口信用保险公司资产管理事业部研究员、中邮创业基金管理股份有限公司研究部研究员、固定收益部研究员、中邮货币市场基金、中邮核心优选混合型证券投资基金、中邮战略新兴产业混合型证券投资基金基金经理助理、中邮睿信增强债券型证券投资基金、中邮乐享收益灵活配置混合型证券投资基金基金经理。现任中邮创业基金管理股份有限公司研究部总经理、中邮景泰灵活配置混合型证券投资基金、中邮核心竞争力灵活配置混合型证券投资基金、中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金、中邮研究精选混合型证券投资基金、中邮兴荣价值一年持有期混合型证券投资基金、中邮瑞享两年定期开放混合型证券投资基金、中邮风格轮动灵活配置混合型证券投资基金、中邮睿明债券型发起式证券投资基金基金经理。

梁雪丹女士：理学硕士。曾任宏源证券股份有限公司证券投资总部行业研究员、中信证券股份有限公司资产管理部医药行业研究员、中华联合保险资产管理中心大消费行业研究员、北京成泉资本管理有限公司研究总监兼投资经理、国开泰富基金管理有限责任公司研究总监兼基金经理、北京乐正资本管理有限公司投资经理。现任中邮医药健康混合型证券投资基金、中邮趋势精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

白鹏：工学博士。曾任中邮创业基金管理股份有限公司行业研究员、中邮新思路灵活配置混合型证券投资基金、中邮信息产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、中邮核心成长混合型证券投资基金、中邮能源革新混合型发起式证券投资基金基金经理。现任中邮低碳经济灵活配置混合型证券投资基金、中邮未来新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

王高先生：工程硕士。曾任中邮创业基金管理股份有限公司投资经理助理、量化分析师、中邮上证 380 指数增强型证券投资基金、中邮中证 500 指数增强型证券投资基金、中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金、中邮稳健添利灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、中邮乐享收益灵活配置混合型证券投资基金、中邮价值优选一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、中邮多策略灵活配置混合型证券投资基金、中邮稳健添利灵活配置混合型证券投资基金、中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理。现任中邮中证 500 指数增强型证券投资基金、中邮军民融合灵活配置混合型证券投资基金、中邮核心优选混合型证券投资基金、中邮新锐量化选股混合型发起式证券投资基金、中邮北证 50 成份指数增强型发起式证券投资基金基金经理。

固定收益投资决策委员会成员包括：

主任委员：衣瑛杰先生，见权益投资决策委员会介绍。

执行委员：

张悦女士：工程硕士。曾任渣打银行（中国）股份有限公司审核与清算岗、民生证券股份有限公司固定收益投资交易部投资经理、光大永明资产管理股份有限公司固定收益投资二部投资经理、中邮睿丰增强债券型证券投资基金、中邮淳享 66 个月定期开放债券型证券投资基金、中邮纯债聚利债券型证券投资基金基金经理。现任中邮创业基金管理股份有限公司固定收益部总经理、中邮纯债汇利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中邮纯债裕利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中邮定期开放债券型证券投资基金、中邮纯债丰利债券型证券投资基金、中邮悦享 6 个月持有期混合型证券投资基金、中邮中债 1-5 年政策性金融债指数证券投资基金、中邮鑫享 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金、中邮尊佑一年定期开放债券型证券投资基金、中邮卓享混合型证券投资基金基金经理。

委员：

闫宜乘先生：经济学硕士。曾任中国工商银行股份有限公司北京市分行营业部对公客户经理、中信建投证券股份有限公司资金运营部高级经理、中邮创业基金管理股份有限公司中邮中债-1-3 年久期央企 20 债券指数证券投资基金、中邮纯债优选一年定期开放债券型证券投资基金、中邮纯债汇利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中邮定期开放债券型证券投资基金、中邮纯债聚利债券型证券投资基金、中邮纯债恒利债券型证券投资基金、中邮货币市场基金、中邮现金驿站货币市场基金基金经理助理、中邮纯债恒利债券型证券投资基金、中邮纯债汇利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中邮景泰灵活配置混合型证券投资基金、中邮货币市场基金，中邮现金驿站货币市场基金、中邮淳悦 39 个月定期开放债券型证券投资基金、中邮尊佑一年定期开放债券型证券投资基金、中邮睿利增强债券型证券投资基金、中邮中债-1-3 年久期央企 20 债券指数证券投资基金、中邮鑫溢中短债债券型证券投资基金基金经理。现任中邮创业基金管理股份有限公司固定收益部副总经理、中邮纯债优选一年定期开放债券型证券投资基金、中邮睿信增强债券型证券投资基金、中邮稳定收益债券型证券投资基金、中邮纯债恒利债券型证券投资基金、中邮多策略灵活配置混合型证券投资基金、中邮稳健添利灵活配置混合型证券投资基金、中邮睿福债券型证券投资基金基金经理。

武志骁先生：理学硕士。曾任中国华新投资有限公司中央交易员、投资分析员、中邮创业基金管理股份有限公司投资经理、中邮沪港深精选混合型证券投资基金基金经理助理、中

邮稳健合赢债券型证券投资基金、中邮增力债券型证券投资基金、中邮纯债裕利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中邮定期开放债券型证券投资基金、中邮纯债聚利债券型证券投资基金、中邮淳享 66 个月定期开放债券型证券投资基金、中邮尊佑一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。现任中邮现金驿站货币市场基金、中邮货币市场基金、中邮纯债恒利债券型证券投资基金、中邮纯债丰利债券型证券投资基金、中邮沪港深精选混合型证券投资基金、中邮中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、中邮嘉享混合型发起式证券投资基金、中邮睿明债券型发起式证券投资基金基金经理。

郭志红女士：经济学硕士。曾任宏源期货有限公司金融研究室负责人，首创证券股份有限公司投资经理，中邮纯债恒利债券型证券投资基金基金经理。现任中邮纯债聚利债券型证券投资基金、中邮中债 1-5 年政策性金融债指数证券投资基金、中邮淳悦 39 个月定期开放债券型证券投资基金、中邮淳享 66 个月定期开放债券型证券投资基金、中邮尊佑一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。

姚艺女士：金融硕士。曾任天弘基金管理有限公司交易员、首创证券股份有限公司固定收益事业部投资经理、中邮创业基金管理股份有限公司专户投资部投资经理。现任中邮中债-1-3 年久期央企 20 债券指数证券投资基金、中邮纯债优选一年定期开放债券型证券投资基金、中邮睿泽一年持有期债券型证券投资基金、中邮优享一年定期开放混合型证券投资基金、中邮鑫溢中短债债券型证券投资基金、中邮鑫享 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金、中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金、中邮尊享混合型发起式证券投资基金基金经理。

刘建超先生：金融学硕士，曾任中粮集团有限公司创新管理部财务部运营管理会计、中诚信国际信用评级有限责任公司政府与公共融资评级部高级分析师、长盛基金管理有限公司固定收益部研究员、五矿国际信托有限公司合规风控管理总部高级信评经理，现任中邮创业基金管理股份有限公司固定收益部信用研究员。

5、上述人员之间均不存在近亲属关系。

（三） 基金管理人的职责

1、依法募集基金，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、转换和登记事宜；

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；

8、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；

9、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；

10、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；

11、保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、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，不得向他人泄露；

12、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；

13、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；

14、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，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

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

16、按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；

17、建立并保存基金份额持有人名册；

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托管人；

19、执行生效的基金份额持有人大会的决定；

20、不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

21、中国证监会规定的其他职责。

（四） 基金管理人的承诺

1、本基金管理人承诺严格遵守现行有效的相关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定。

2、本基金管理人承诺严格遵守《中华人民共和国证券法》、《基金法》及有关法律法规，

建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止下列行为发生：

（1） 将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；

（2） 不公平地对待其管理的不同基金财产；

（3） 利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人谋取利益；

（4） 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；

（5） 法律法规或中国证监会禁止的其他行为。

基金管理人承诺不从事证券法规规定禁止从事的其他行为。

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、规章及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下活动：

（1） 越权或违规经营；

（2） 违反基金合同或托管协议；

（3） 故意损害基金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，泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；

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

（9） 贬损同行，以抬高自己；

（10） 以不正当手段谋求业务发展；

（11） 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；

（12） 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；

（13） 其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

4、基金管理人关于履行诚信义务的承诺

基金管理人承诺将以取信于市场、取信于社会为宗旨，按照诚实信用、勤勉尽责的原则，

严格遵守有关法律法规和中国证监会发布的监管规定，不断更新投资理念，规范基金运作。

5、基金经理承诺

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

（2） 不利用职务之便为自己及其代理人、受雇人或任何第三人谋取利益；

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

（4） 不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

（五） 基金管理人的内部控制体系

为保证公司规范化运作，有效地防范和化解经营风险，促进公司诚信、合法、有效经营，保障基金份额持有人利益，维护公司及公司股东的合法权益，本基金管理人建立了科学、严密、高效的内部控制体系。

1、公司的内部控制目标

（1）保证公司经营运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念。

（2）防范和化解经营风险，提高经营管理效益，确保经营业务的稳健运行和受托资产的安全完整，实现公司的持续、稳定、健康发展。

（3）确保基金、公司财务和其他信息真实、准确、完整、及时。

（4）切实保障基金份额持有人的合法权益。

2、公司内部控制遵循的原则

（1） 健全性原则

风险管理必须涵盖公司各个部门和各个岗位，并渗透到各项业务过程和业务环节，包括各项业务的决策、执行、监督、反馈等环节。

（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，维护风险管理制度的有效执行。

（3） 独立性原则

公司各机构、部门和岗位确保相对独立并承担各自的风险控制职责。公司基金资产、自有资产、其他资产的运作须分离。督察长和监察稽核部对公司风险控制制度的执行情况进行检查和监督。

（4） 相互制约原则

公司在制度安排、组织机构的设计、部门和岗位设置上形成权责分明、相互制约的机制，从而建立起不同岗位之间的制衡体系，消除内部风险控制中的盲点，强化监察稽核部对业务的监督检查功能。

（5） 成本效益原则

公司将运用科学化的经营管理方法，并充分发挥各机构、部门及员工的工作积极性，尽量降低经营成本，提高经营效益，保证以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

（6） 适时性原则

风险管理应具有前瞻性，并且必须随着国家法律、法规、政策制度等外部环境的改变和公司经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化及时进行相应的修改和完善。

（7） 内控优先原则

内控制度具有高度的权威性，所有员工必须严格遵守，自觉形成风险防范意识；执行内控制度不能有任何例外，任何人不得拥有超越制度或违反规章的权力；公司业务的发展必须建立在内控制度完善并稳固的基础之上。

（8） 防火墙原则

公司在敏感岗位如：基金投资、交易执行、基金清算岗位之间，基金会计和公司会计之间、会计与出纳之间等等，在物理上和制度上设置严格的防火墙进行隔离，以控制风险。

3、内部控制的制度体系

公司制定了合理、完备、有效并易于执行的制度体系。公司制度体系由不同层面的制度构成。按照其效力大小分为四个层面：第一个层面是公司章程；第二个层面是公司内部控制大纲，它是公司制定各项规章制度的基础和依据；第三个层面是公司基本管理制度；第四个层面是公司各机构、部门根据业务需要制定的各种制度及实施细则等。它们的制订、修改、实施、废止遵循相应的程序，每一层面的内容不得与其以上层面的内容相违背。监察稽核部定期对公司制度、内部控制方式、方法和执行情况实行持续的检验，并出具专项报告。

4、内控监控防线

为体现职责明确、相互制约的原则，公司根据基金管理业务的特点，设立顺序递进、权责分明、严密有效的三道监控防线：

（1） 建立以各岗位目标责任制为基础的第一道监控防线。各岗位均制定明确的岗位职责，各业务均制定详尽的操作流程，各岗位人员上岗前必须以书面形式声明已知悉并承诺遵守，在授权范围内承担各自职责；

（2） 建立相关部门、相关岗位之间相互监督的第二道监控防线。公司在相关部门、相关岗位之间建立重要业务处理凭据传递和信息沟通制度，后续部门及岗位对前一部门及岗位负有监督的责任；

（3） 建立以督察长、监察稽核部对各岗位、各部门、各机构、各项业务全面实施监督反馈的第三道监控防线。公司督察长和内部监察稽核部门独立于其他部门，对内部控制制度的执行情况实行严格的检查和反馈。

5、关于授权、研究、投资、交易等方面的控制点

（1） 授权制度

公司的授权制度贯穿于整个公司活动。股东会、董事会、监事会和管理层必须充分履行各自的职权，健全公司逐级授权制度，确保公司各项规章制度的贯彻执行；各项经济经营业务和管理程序必须遵从管理层制定的操作规程，经办人员的每一项工作必须是在业务授权范围内进行。公司重大业务的授权必须采取书面形式，授权书应当明确授权内容和时效。公司授权要适当，对已获授权的部门和人员应建立有效的评价和反馈机制，对已不适用的授权应及时修改或取消授权。

（2） 公司研究业务

研究工作应保持独立、客观，不受任何部门及个人的不正当影响；建立严密的研究工作业务流程，形成科学、有效的研究方法；建立投资产品备选库制度，研究部门根据投资产品的特征，在充分研究的基础上建立和维护备选库。建立研究与投资的业务交流制度，保持畅通的交流渠道；建立研究报告质量评价体系，不断提高研究水平。

（3） 基金投资业务

基金投资应确立科学的投资理念，根据决策的风险防范原则和效率性原则制定合理的决

策程序；在进行投资时应有明确的投资授权制度，并应建立与所授权限相应的约束制度和考核制度。建立严格的投资禁止和投资限制制度，保证基金投资的合法合规性。建立投资风险评估与管理制度，将重点投资限制在规定的风险权限额度内；对于投资结果建立科学的投资管理业绩评价体系。

（4） 交易业务

建立集中交易室和集中交易制度，投资指令通过集中交易室完成；建立了交易监测系统、预警系统和交易反馈系统，完善了相关的安全设施；集中交易室对交易指令进行审核，建立公平的交易分配制度，确保各基金利益的公平；交易记录应完善，并及时进行反馈、核对和存档保管；同时建立了科学的投资交易绩效评价体系。

（5） 基金会计核算

公司根据法律法规及业务的要求建立会计制度，并根据风险控制重点建立严密的会计系统，对于不同基金、不同客户独立建账，独立核算；公司通过复核制度、凭证制度、合理的估值方法和估值程序等会计措施真实、完整、及时地记载每一笔业务并正确进行会计核算和业务核算。同时还建立会计档案保管制度，确保档案真实完整。

（6） 信息披露

公司建立了完善的信息披露制度，保证公开披露的信息真实、准确、完整。公司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。

（7） 监察稽核

公司设立督察长，对董事会负责，经董事会聘任，报中国证监会核准。根据公司监察稽核工作的需要和董事会授权，督察长可以列席公司相关会议，调阅公司相关档案，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。督察长定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况，董事会对督察长的报告进行审议。

公司设立监察稽核部开展监察稽核工作，并保证监察稽核部的独立性和权威性。公司明确了监察稽核部及内部各岗位的具体职责，配备了充足的人员，严格制订了专业任职条件、操作程序和组织纪律。

监察稽核部强化内部检查制度，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。

公司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。

6、基金管理人关于内部控制制度声明书

（1） 本公司承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确；

（2） 本公司承诺根据市场变化和公司业务发展不断完善内部控制制度。

四、基金托管人

一、基金托管人基本情况

1、基本情况

名称：兴业银行股份有限公司

注册地址：福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦

办公地址：上海市银城路 167 号

邮政编码：200120

法定代表人：吕家进

成立日期：1988 年 8 月 22 日

批准设立机关和批准设立文号：中国人民银行总行，银复[1988]347 号

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基金字[2005]74 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：207.74 亿元人民币

存续期间：持续经营

2、发展概况及财务状况

兴业银行成立于 1988 年 8 月，是经国务院、中国人民银行批准成立的首批股份制商业银行之一，总行设在福建省福州市，2007 年 2 月 5 日正式在上海证券交易所挂牌上市（股票代码：601166），注册资本 207.74 亿元。截至 2026 年 6 月 30 日，兴业银行资产总额达到 11.46 万亿元，较上年末增长 3.31%。开业三十多年来，兴业银行始终坚持“真诚服务，相伴成长”的经营理念，致力于为客户提供全面、优质、高效的金融服务。

二、托管业务部部门设置及员工情况

兴业银行股份有限公司总行设资产托管部，下设综合管理处、证券基金处、信托保险处、理财私募处、需求支持处、稽核监察处、投资监督处、运行管理处，共有员工 100 余人，业务岗位人员均具有基金从业资格。

三、基金托管业务经营情况

兴业银行股份有限公司于 2005 年 4 月 26 日取得基金托管资格。基金托管业务批准文号：证监基金字[2005]74 号。截至 2026 年 9 月 30 日，兴业银行共托管证券投资基金 935 只，托管基金的基金资产净值合计 33414.31 亿元，基金份额合计 28489.55 亿份。

四、基金托管人的内部控制制度

（一）内部控制目标

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

（二）内部控制组织结构

兴业银行基金托管业务内部控制组织架构由总行内部控制委员会、总行风险管理部门、总行审计部、总行资产托管部、总行运营管理部及分行托管运营机构共同组成。各级内部控制组织依照本行相关制度对本行托管业务风险管理和内部控制实施管理。

（三）内部控制原则

1、全面性原则：内部控制贯穿资产托管业务的全过程，覆盖各项业务和产品，以及从事资产托管业务的各机构和从业人员；

2、重要性原则：内部控制应当在全面控制的基础上，关注重要业务事项和高风险领域；

3、独立性原则：开展托管业务的部门和岗位的设置应权责分明、相对独立、相互制衡；

4、审慎性原则：内控与风险管理必须以防范风险，保证托管资产的安全与完整为出发点，“内控优先”，“制度优先”，审慎发展资产托管业务；

5、制衡性原则：内部控制应当在治理结构、机构设置及权责分配、业务流程等方面形成相互制约、相互监督，同时兼顾运营效率；

6、适应性原则：内部控制体系应同所处的环境相适应，以合理的成本实现内控目标，内部制度的制订应当具有前瞻性，并应当根据国家政策、法律及经营管理的需要，适时进行相应修改和完善；内部控制存在的问题应当能够得到及时反馈和纠正；

7、成本效益原则：内部控制应当权衡实施成本与预期效益，以适当的成本实现有效控制。

（四）内部控制制度及措施

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

2、建立健全的组织管理结构：前后台分离，不同部门、岗位相互牵制。

3、风险识别与评估：稽核监察处指导业务处室进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施。

4、相对独立的业务操作空间：业务操作区相对独立，实施门禁管理和音像监控。

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

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

五、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

基金托管人负有对基金管理人的投资运作行使监督权的职责。根据《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定，托管人对基金的投资对象和范围、投资组合比例、投资限制、费用的计提和支付方式、基金会计核算、基金资产估值和基金净值的计算、收益分配、申购赎回以及其他有关基金投资和运作的事项，对基金管理人进行业务监督、核查。

基金托管人发现基金管理人有违反《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法律法规规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对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，立即报告中国证监会，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。

基金托管人发现基金管理人的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。

基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、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，并及时向中国证监会报告。

五、相关服务机构

一、基金份额发售机构

（一）直销机构

（1）中邮创业基金管理股份有限公司直销中心

北京市东城区北三环东路 36 号环球贸易中心 C 座 20、21 层

联系人：李俊霞

电话：010-82290840

传真：010-82294138

网址：www.postfund.com.cn

（2）中邮基金官方微信平台——中邮基金服务号

（3）中邮创业基金网上直销平台：https://i.postfund.com.cn

（二）代销机构

其它销售机构情况详见基金份额发售公告及基金管理人网站披露的基金销售机构名录。基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择符合要求的机构销售本基金，并在基金管理人网站公示。

二、注册登记机构

名称：中邮创业基金管理股份有限公司

住所：北京市东城区北三环东路 36 号 2 号楼 C 座 20 层

办公地址：北京市东城区北三环东路 36 号环球贸易中心 C 座 20、21 层

法定代表人：张志名

联系人：叶明

电话：010-82295160

传真：010-82292422

三、出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市海华永泰律师事务所

注册地址：上海市华阳路 112 号 2 号楼东虹桥法律服务园区 302 室

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1366 号富士康大厦 12 层

负责人：陈峰

联系人：张兰

电话：021-58773177

传真：021-58773268

经办律师：梁丽金、张兰

四、审计基金财产的会计师事务所

名称：中审亚太会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：北京市海淀区复兴路 47 号天行建商务大厦 20 层 2206

首席合伙人：王增明

六、基金的募集

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定募集，募集申请经中国证监会 2015 年 11 月 20 日证监许可[2015]2683 号文注册。

（一）基金基本情况

1、基金类型

混合型发起式证券投资基金

2、基金的运作方式

契约型开放式，本基金以定期开放方式运作，即采取在封闭期内封闭运作、封闭期与封闭期之间定期开放的运作方式。

3、基金存续期

不定期

4、募集规模上限

本基金不设募集规模上限。

（二）基金份额的发售时间、发售方式、发售对象

1、发售时间

自基金份额发售之日起最长不得超过三个月，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届时发布的增加销售机构的相关公告。

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、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。

（三）基金份额的面值和认购价格

本基金基金份额初始面值为 1.00 元，本基金认购价格为 1.00 元/份。

（四）认购安排

1、认购时间：具体发售时间由基金管理人根据相关法律法规及本基金基金合同，在基金份额发售公告中确定并披露。

2、认购申请的确认

基金销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收

到认购申请。认购的确认以注册登记机构或基金管理人的确认结果为准。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。

3、认购数量限制

（1）投资人认购前，需按销售机构规定的方式全额缴款。

（2）投资人在募集期内可以多次认购基金份额，但已受理的认购申请不允许撤销。

（3）通过代销机构认购本基金时，各代销网点接受认购申请的最低金额为单笔 1,000 元；直销网点接受首次认购申请的最低金额为单笔 50,000 元，追加认购的最低金额为单笔 1,000 元（通过本基金管理人基金网上交易系统等特定交易方式认购本基金暂不受此限制）。本基金直销网点单笔最低认购金额可由基金管理人酌情调整。

（4）基金募集期间单个投资人的累计认购金额没有限制。

4、基金份额的认购费用及认购份额的计算公式

（1）认购费用

本基金的认购费率如下：

认购金额（元，含认购费）	认购费率
50 万元以下	1.0%
50 万元（含）—200 万元	0.6%
200 万元（含）—500 万元	0.2%
500 万元（含）以上	1000 元/笔

基金认购费用不列入基金财产，主要用于基金的市场推广、销售、注册登记等募集期间发生的各项费用。

（2）认购份额的计算

本基金认购采用金额认购的方式。基金的认购金额包括认购费和净认购金额。计算公式如下：

净认购金额 ＝ 认购金额/(1＋认购费率)

认购费用 ＝ 认购金额－净认购金额

认购份额 ＝(净认购金额＋认购利息)/基金份额面值

对于 500 万元(含)以上的认购适用绝对数额的认购费金额。

认购费用以人民币元为单位，计算结果按照四舍五入方法，保留到小数点后两位；认购

份额计算结果按照四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。多笔认购时，按上述公式进行逐笔计算。

例：某投资人投资 10000 元认购本基金，对应费率为 1.0%，如果募集期内认购资金获得的利息为 2 元，则其可得到的基金份额计算如下：

净认购金额＝10000/(1＋1.0%)＝9900.99 元

认购费用＝10000－9900.99＝99.01 元

认购份额＝(9900.99＋2)/1.00＝9902.99 份

即投资人投资 10000 元认购本基金，加上认购资金在募集期内获得的利息，可得到 9902.99 份基金份额。

七、基金备案

（一）基金备案的条件

1、本基金自基金份额发售之日起 3 个月内，如满足发起资金提供方认购本基金的总金额不少于 1000 万元，发起资金的提供方承诺持有期限不少于三年，基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售，并在 10 日内聘请法定验资机构验资，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。

2、基金管理人应当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。

3、基金合同生效前，投资人的认购款项只能存入专用账户，任何人不得动用。有效认购款项在募集期形成的利息在基金合同生效后将折算成基金份额，归基金份额持有人所有。利息转份额的具体数额以注册登记机构的记录为准。

（二）基金募集失败

1、基金募集期届满，未达到基金备案条件，则基金募集失败。

2、如基金募集失败，基金管理人应以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用，在基金募集期届满后 30 日内返还投资人已缴纳的认购款项，并加计银行同期活期存款利息（税后）。

3、如基金募集失败，基金管理人、基金托管人及代销机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和代销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 3 年后，若连续二十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五千万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续六十个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。

基金合同生效 3 年届满之日（指自然日），若基金资产净值低于 2 亿元的，基金合同自动终止，同时不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。

法律法规另有规定时，从其规定。

八、基金份额的开放期、封闭期、申购与赎回

（一）基金份额的开放期和封闭期

本基金每三个月开放一次，每次开放期不超过 5 个工作日，每个开放期所在月份为基金合同生效日所在月份在后续每三个日历月中最后一个日历月，每个开放期的首日为当月沪深 300 股指期货交割日前五个工作日的第一个工作日。.

本基金的首个封闭期为自基金合同生效日起至第一个开放期的首日（不含该日）之间的期间，之后的封闭期为每相邻两个开放期之间的期间。本基金在封闭期内不办理申购与赎回业务。

举例：假设本基金成立日为 2015 年 3 月 1 日，则第一个开放期所在月份为 6 月，当月沪深 300 股指期货交割日为 6 月 19 日，该日（不含）的前五个工作日的第一个工作日为 6 月 12 日，因此本基金第一个开放期的首日为 2015 年 6 月 12 日，以此类推。

开放期的具体时间以基金管理人届时公告为准，且基金管理人最迟应于开放期开始前 2 日进行公告。如在开放期内发生不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放申购与赎回业务的，开放期时间中止计算，在不可抗力或其他情形影响因素消除之日次日起，继续计算该开放期时间，直到满足开放期的时间要求。

（二）申购和赎回场所

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

（三）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，开放日为开放期内的每个工作日。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，若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

2、申购、赎回开始日及业务办理时间

在确定申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应在开放期前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告开放期的开始与结束时间。

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或者赎回或者转换。开放期以及开放期办理申购与赎回业务的具体事宜见基金管理人届时发布的相关公告。

（四）申购与赎回的原则

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

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；

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

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。

（五）申购与赎回的程序

1、申购和赎回的申请方式

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

2、申购和赎回的款项支付

投资人申购基金份额时，必须全额交付申购款项，投资人交付款项，申购申请即为有效。

投资人赎回申请成功后，基金管理人将在 T＋7 日（包括该日）内支付赎回款项。在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。

3、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日（T 日），在正常情况下，本基金登记机构在 T+1 日内对该交易的有效性进行确认。T 日提交的有效申请，投资人可在 T+2 日后（包括该日）到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。基金销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购、赎回申请的确认以注册登记机构或基金管理人的确认结果为准。若申购不成功，则申购款项退还给投资人。如因申请未得到基金管理人或基金注册登记机构的确认而造成的损失，由投资者自行承担。

（六）申购和赎回的金额

1、申购金额的限制

代销网点每个账户单笔申购的最低金额为单笔 1,000 元。

直销网点每个账户首次申购的最低金额为 50,000 元，追加申购的最低金额为单笔 1,000 元（通过本基金管理人基金网上交易系统等特定交易方式认购本基金暂不受此限制）；代销网点的投资者欲转入直销网点进行交易要受直销网点追加申购最低金额的限制。投资者当期分配的基金收益转购基金份额时，不受最低申购金额的限制。基金管理人可根据市场情况，调整本基金首次申购的最低金额。

投资者可多次申购，对单个投资人的累计持有份额不设上限限制，但对于可能导致单一投资者持有基金份额的比例超过 50%，或者变相规避 50%集中度的情形，基金管理人有权采取控制措施。当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益，具体请参见相关公告。法律法规、中国证监会另有规定的除外。

2、单笔赎回不得少于 10 份(如该账户在该销售机构保留的基金余额不足 10 份，则必须一次性赎回基金全部份额)；若某笔赎回将导致投资者在销售机构保留的基金余额不足 10 份时，基金管理人有权将投资者在该销售机构保留的剩余基金份额一次性全部赎回。

3、基金管理人可以在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告并报中国证监会备案。

4、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。

（七）基金的申购费和赎回费

1、本基金申购费率按照申购金额递减，即申购金额越大，所适用的申购费率越低。投资者在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。

本基金申购费率最高额不超过申购金额的 5%，具体如下：

申购金额（元，含申购费）	申购费率
50 万元以下	1.5%

50 万元（含）—200 万元	1.0%
200 万元（含）—500 万元	0.5%
500 万元及以上	1000 元/笔

本基金的申购费用由申购人承担，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用，不列入基金财产。

2. 本基金赎回费率按照持有时间递减，即基金份额持有时间越长，所适用的赎回费率越低。

本基金赎回费率最高不超过赎回金额的 5%，随持有期限的增加而递减。具体如下：

持有时间	赎回费率
7 日以下	1.5%
7 日（含 7 日）—30 日	0.75%
30 日（含 30 日）—365 日	0.5%
365 日(含 365 日)—730 日	0.25%
730 日以上(含 730 日)	0.0%

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，对持续持有期小于 30 日（不含 30 日）的，赎回费全额计入基金财产；对持续持有期长于 30 日（含 30 日）但少于 93 日的，将不低于赎回费总额的 75%计入基金财产；对持续持有期长于 93 日（含 93 日）但少于 186 日的，将不低于赎回费总额的 50%计入基金财产；对持续持有期长于 186 日（含 186 日）的，将不低于赎回费总额的 25%归基金财产。

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

4、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对以特定交易方式（如网上交易、电话交易等）等进行基金交易的投资人定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率。

5、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性，摆动定价机制的处理原则与操作规范参见法律法规和自律组织的自律规则，具体见基金管理人届时的相关公告。

（八）申购和赎回的数额和价格

1、申购和赎回数额、余额的处理方式

（1）申购份额余额的处理方式：申购份额计算结果按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

（2）赎回金额的处理方式：赎回金额计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

2、申购份额的计算

基金申购份额的计算

基金的申购金额包括申购费用和净申购金额，其中：

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/T 日基金份额净值

举例说明：假定 T 日的基金份额净值为 1.200 元，申购金额 10000 元，计算如下：

适用申购费率为 1.5%

净申购金额= 10000 /(1＋1.5%) = 9852.22 元

申购费用= 10000-9852.22 = 147.78 元

申购份额= 9852.22/ 1.200= 8210.18 份

3、赎回金额的计算基金的赎回金额为赎回总额扣减赎回费用，其中：

赎回总金额 ＝ 赎回份额×T 日基金份额净值

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

举例说明：假定 T 日的基金份额净值为 1.200 元，赎回份额为 10000 份，各时期净赎回金额如下：

持有期限	适用费率	赎回总金额	赎回费用	净赎回金额
7 日以下	1.50%	10000*1.200=12000	12000*1.50%=180	12000-180=11820
7 日（含 7 日）—30 日	0.75%	10000*1.200=12000	12000*0.75%=90	12000-90=11910
30 日（含 30 日）—365 日	0.5%	10000*1.200=12000	12000*0.5%=60	12000-60=11940
365 日(含 365 日)—730 日	0.25%	10000*1.200=12000	12000*0.25%=30	12000-30=11970
730 日以上(含 730 日)	0.0%	10000*1.200=12000	12000*0.0%=0	12000-0=12000

4、本基金基金份额净值的计算

本基金份额净值的计算结果，保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。在基金封闭期内，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应在开放期前最后一个工作日的次日，披露开放期前

最后一个工作日的基金份额净值和基金份额累计净值。在基金开放期每个开放日的次日，基金管理人将通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

（九）拒绝或暂停申购的情形及处理方式

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

1、因不可抗力导致基金无法正常运作。

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接收投资人的申购申请。

3、证券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、基金管理人认为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，从而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基金估值，并采取暂停接受基金申购申请的措施。

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%集中度的情形时。

8、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第（1）、（2）、（3）、（5）、（8）项暂停申购情形之一时，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拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

开放期内因发生不可抗力等原因而发生暂停申购情形的，开放期将按因不可抗力而暂停申购的时间相应延长。

（十）暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接收投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。

3、证券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、基金管理人认为接受某笔或某些赎回申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。

5、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

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基金估值并采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施。

7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。若出现上述第 5 项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并予以公告。

开放期内因发生不可抗力等原因而发生暂停赎回情形的，开放期将按因不可抗力而暂停赎回的时间相应延长。

（十一）巨额赎回的情形及处理方式

（1）巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过前一开放日的基金总份额的 20%，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、延缓支付或终止基金合同。

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）延缓支付：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，基金管理人应对当日全部赎回申请进行确认，但可以延缓支付赎回款项，当日按比例办理的赎回份额不得低于前一日基金总份额的 20%，其余赎回申请可以延缓支付，但延缓支付的期限不得超过 20 个工作日，并在规定报刊及其他相关媒介上予以公告。

3）当基金出现巨额赎回时，在单个基金份额持有人赎回申请超过前一开放日基金总份

额 20%的情形下，可以对其赎回申请延期办理。基金管理人认为支付该基金份额持有人的全部赎回申请有困难或者因支付该基金份额持有人的全部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，基金管理人可以先行对该单个基金份额持有人超出前一开放日基金总份额 20%的赎回申请实施延期办理。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。而对该单个基金份额持有人前一开放日基金总份额 20%以内（含 20%）的赎回申请与其他投资者的赎回申请按上述（1）、（2）方式处理，具体见招募说明书或相关公告。

(3)巨额赎回的公告

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

（十二）暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

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

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

（3）如发生暂停的时间超过 1 日，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 2 个工作日在规定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近 1 个开放日的基金份额净值。

（十三）基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及基金合同的规定决定开办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。

（十四）基金的非交易过户

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

继承是指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；捐赠指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体；司法强制执行是

指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供基金登记机构要求提供的相关资料，对于符合条件的非交易过户申请按基金登记机构的规定办理，并按基金登记机构规定的标准收费。

（十五）基金的转托管

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

（十六）定期定额投资计划

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

（十七）基金的冻结和解冻

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

（十八）实施侧袋机制期间本基金的申购与赎回

本基金实施侧袋机制的，本基金的申购和赎回安排详见本招募说明书的有关规定或相关公告。

九、基金的投资

一、投资目标

本基金将灵活应用各种金融工具和风险对冲策略降低投资组合风险，实现基金资产的长期稳健增值。

二、投资范围

本基金的投资范围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（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、股指期货、权证、资产支持证券、银行存款、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)。

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：本基金权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的价值的比例范围在 80％—120％之间。其中：权益类空头头寸的价值是指融券卖出的股票市值、卖出股指期货的合约价值及卖出其他权益类衍生工具的合约价值的合计值；权益类多头头寸的价值是指买入持有的股票市值、买入股指期货的合约价值及买入其他权益类衍生工具的合约价值的合计值。

开放期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%，封闭期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%。

开放期内，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制。

本基金不受证监会《证券投资基金参与股指期货交易指引》第五条第（一）项、第（三）项、第（五）项及第（七）项的限制。

基金管理人可以在不改变本基金既有投资策略和风险收益特征并在控制风险的前提下，经与基金托管人协商一致后，参与融资融券业务以及通过证券金融公司办理转融通业务，以提高投资效率及进行风险管理。届时基金参与融资融券、转融通等业务的风险控制原则、具体参与比例限制、费用收支、信息披露、估值方法及其他相关事项按照中国证监会的规定及

其他相关法律法规的要求执行，无需召开基金份额持有人大会决定。

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

三、投资策略

本基金通过多种绝对收益策略、多种交易品种的操作，有效地规避市场的系统性风险。同时在严格控制风险敞口的前提下，捕捉套利机会和趋势性交易机会，力求为基金份额持有人赢取稳定的绝对收益。

（一）股票绝对收益投资策略

本策略积极依托基金管理人投研平台的研究能力进行积极主动的个股选择策略，通过定量与定性相结合的分析方法考量上市公司的盈利状况、估值水平、市场情绪、股价催化剂等因素，辅以量化投资模型从基金管理人的股票库中精选股票，努力获取超额收益，同时在金融衍生品市场上对冲，剥离系统性风险，力争实现较为稳定的绝对收益。在构建投资组合的过程中，本基金将遵循以下投资策略：

1、定性与定量相结合构建股票组合

本基金选取具有良好投资价值的股票作为投资对象，以深入的基本面研究为基础，采取自下而上的方法，通过定量和定性相结合的方法精选个股。

1)数量化分析策略

a.多因素选股模型

根据对中国证券市场运行特征的长期研究以及大量历史数据的实证检验，选取成长性、估值、盈利能力、市场情绪及分析师情绪等五大类对股票超额收益具有较强解释度的指标，建立多因素模型，并根据该模型进行股票选择。成长性主要考虑每股收益增长率、营业收入的增长趋势以及现金流的变动情况等；估值主要考虑市盈率、市净率、市现率、股息率等指标；盈利能力主要考虑净资产报酬率、总资产报酬率、毛利率及净利率等指标；市场情绪主要考虑股价趋势及换手率等指标；分析师情绪主要考虑股票评级的变动情况以及盈利预测的变动情况等指标。多因素选股模型利用个股历史数据分析考察上述五类因素的有效性，对各只股票进行分步筛选，确定股票投资组合。当股票投资组合构建完成后，本基金会进一步根据组合内股价格波动、风险收益变化的实际情况，定期或不定期优化个股权重，以确保整个股票组合的风险处于可控范围内。多因素模型所纳入考察的选股因子以上述五类为主，会根据日常跟踪观察的因子有效性适时将可能对未来市场变化更为敏感有效的因子纳入选股框架。

b. 事件驱动策略

主要考虑重大政策事件的发布、上市公司定向增发及破发、产业资本的变化、公司股东和高管的增减持、公司股票的高送转、指数样本股调整、研报超预测、高送转、盈余公告后漂移异象等事件因素，利用量化研究方法分析这些因素对未来股价变化和时间周期的影响，以获得由事件引发带来的个股超额收益。

c.量化行业配置

在 Black-Litterman 资产配置模型的基础上结合行业多因子模型进行行业配置。充分考虑市场均衡的行业配置比例后加入通过基本面分析结合资金参与度变化、增量信息等市场交易面特征得到的基金管理人对于各行业风险收益的预期，从而测算出满足条件的最优化行业配置比例。对于每个行业分别建立各自的模型，使用宏观经济数据、行业基本面信息数据、上下游行业数据、净利润增长一致预期数据加总行业盈利增长数据、资金参与度变化、预期变化等全方位立体信息建模估计行业未来月度走势并选择相对占优行业作为重点配置行业。

本基金量化优选投资策略通过多个 Alpha 策略避免单一策略的超额收益率波动风险，构造低波动率、低下行风险的投资组合。

2）基本面分析策略

寻找内在价值被低估的股票、被市场错估的股票、未来收益很有潜力的公司，以此预期获取未来较好的超额收益，选取公司治理结构完善、管理层优秀，并在生产、技术、市场、政策环境等经营层面上具有一方面或多方面难以被竞争对手在短时间所模仿或超越的竞争优势的企业。

a.公司治理结构

企业具有良好的公司治理结构,信息透明,注重公众股东利益和投资者关系,历史上没有发生过由公司治理结构带来的风险事件。

b.管理层优秀

企业具有优秀的管理层,且企业的经营实绩证明管理层是精明能干、正直诚实、富有理性的。不以上市套现为目的，踏实做事。

c.竞争优势突出

企业在生产、技术、市场、政策环境等经营层面上具有一方面或几方面竞争优势,而且,这种优势难以在短时间被竞争对手所模仿或超越；通过上述竞争优势能不断提升经营能力,强化其技术壁垒、市场占有率、品牌影响力等。

d.行业地位领先

企业在行业中具有很高的知名度和影响力，对行业的发展起着主导性的作用，处于同行业中的领先地位。

3)定性与定量结合投资策略

在定量和定性研究的基础上，发挥公司投研团队优势，将基本面分析中的关键要素及研究方法通过定量的方法刻画出来并形成量化模型，选择行业发展空间大、行业内具有明显优势的上市公司标的作为投资目标。

2、市场中性策略

现阶段本基金将利用股指期货对冲多头股票部分的系统性风险。基金经理根据市场的变化、现货市场与期货市场的相关性等因素，计算需要用到的期货合约数量，对这个数量进行动态跟踪与测算，并进行适时灵活调整。同时，综合考虑各个月份期货合约之间的定价关系、套利机会、流动性以及保证金要求等因素，在不同月份期货合约之间进行动态配置，通过优化股指期货合约的持仓来创造额外收益。另外当本基金出现大量净申购或净赎回的情况时，本基金将使用股指期货来进行流动性风险管理，根据基金净申购或净赎回的规模，分别买入数量匹配的多头或者空头股指期货合约，并选择适当的时机平仓。随着监管的放开及其他工具流动性增强，我们会优选空头工具，采用最优的多头系统性风险剥离方式，在数量模型的约束下，严格控制运作风险，并根据市场变化趋势，定期对模型进行调整，以改进模型的有效性，最大化超额收益。

（二）其他绝对收益策略

1、固定收益品种投资策略

本基金投资债券首先综合考量股票组合及股指期货套期保值对资金的需求，对闲置资金投资债券做出规划，包括债券组合的规模、投资期限、期间的流动性安排等。然后在这些约束条件下，综合运用估值策略、久期管理策略、利率预期策略等多种方法，结合债券的流动性、信用风险分析等多种因素，对个券进行积极的管理。

2、衍生品投资策略

本基金的衍生品投资将严格遵守证监会及相关法律法规的约束，合理利用股指期货、权证等衍生工具，利用数量方法发掘可能的套利机会。投资原则为有利于基金资产增值，控制下跌风险，实现保值和锁定收益。目前衍生品投资策略主要是股指期货套利，即采用股指期货套利的对冲策略积极发现市场上如期货与现货之间、期货不同合约之间等的价差关系，进行套利，以获取绝对收益。股指期货套利包括以下两种方式：

1）期现套利

期现套利过程中，由于股指期货合约价格与标的指数价格之间的价差不断变动，套利交易可以通过捕捉该价差进而获利。

2）跨期套利

跨期套利过程中，不同期货合约之间的价差不断变动，套利交易通过捕捉合约间价差进而获利。

基金经理会实时关注市场的发展，前瞻性地运用其他绝对收益策略。

四、投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的价值的比例范围在 80%—120%之间。其中：权益类空头头寸的价值是指融券卖出的股票市值、卖出股指期货的合约价值及卖出其他权益类衍生工具的合约价值的合计值；权益类多头头寸的价值是指买入持有的股票市值、买入股指期货的合约价值及买入其他权益类衍生工具的合约价值的合计值；

（2）开放期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%，封闭期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%；

（3）开放期内，在扣除股指期货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、应收申购款等。在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制；

（4）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%；

（5）本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；

（6）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%；

（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前款所规定的流动性受限资产比例限制的，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%；

（9）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

（10）本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

（11）本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的0.5％；

（12）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％；

（13）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％；

（14）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％；

（15）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％；

（16）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；

（17）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；

（18）本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%，在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不展期；

（19）开放期内，本基金总资产不得超过基金净资产的 140%；封闭期内本基金总资产不得超过基金净资产的 200%；

（20）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；

（21）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（3）、（7）、（16）、（20）项另有约定外，因证券、期货市场波动、上市公司合并、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。

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。

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。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

（1）承销证券；

（2）违反规定向他人贷款或者提供担保；

（3）从事承担无限责任的投资；

（4）买卖其他基金份额，但是国务院证券监督管理机构另有规定的除外；

（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、行政法规和国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

上述组合限制、禁止行为的设定依据为基金合同生效时法律法规及监管机关的要求，如果法律法规或监管机关对上述组合限制、禁止行为进行调整的，基金管理人将按照调整后的规定执行。

五、业绩比较基准

本基金整体业绩比较基准构成为：金融机构人民币一年期定期存款基准利率（税后）+2%

随着市场环境的变化，如果上述业绩比较基准不适用本基金或市场推出代表性更强、投资者认同度更高且更能够表征本基金风险收益特征的业绩比较基准时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。调整业绩比较基准应经基金托管人同意，报中国证监会备案，基金管理人应在调整前 3 个工作日在中国证监会规定的信息披露媒介上刊登公告。

六、风险收益特征

本基金为特殊的混合型基金，通过采用多种绝对收益策略剥离市场系统性风险，与股票市场表现的相关性较低。相对股票型基金和一般的混合型基金，其预期风险较小。本基金实际的收益和风险主要取决于基金投资策略的有效性，因此收益不一定能超越业绩比较基准。

七、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。

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的有关规定。

八、基金的投资组合报告

本投资组合报告期为 2026 年 7 月 1 日起至 2026 年 9 月 30 日止。

1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	15,476,693.00	35.86
	其中：股票	15,476,693.00	35.86
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,663,834.99	6.17
	其中：债券	2,663,834.99	6.17
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	18,245,755.35	42.28
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	4,286,927.96	9.93
8	其他资产	2,480,602.56	5.75
9	合计	43,153,813.86	100.00

注：由于四舍五入的原因报告期末基金资产组合各项目公允价值占基金资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	5,159,773.00	12.27
C	制造业	2,222,584.00	5.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,344,234.00	3.20
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	3,212,388.00	7.64

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,345,176.00	3.20
J	金融业	2,192,538.00	5.21
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	15,476,693.00	36.80

注：由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600026	中远海能	79,800	1,640,688.00	3.90
2	600583	海油工程	244,800	1,620,576.00	3.85
3	601872	招商轮船	78,000	1,571,700.00	3.74
4	600887	伊利股份	50,400	1,375,920.00	3.27
5	601398	工商银行	163,600	1,354,608.00	3.22
6	601088	中国神华	28,300	1,352,740.00	3.22
7	601225	陕西煤业	51,900	1,350,957.00	3.21
8	601728	中国电信	214,200	1,345,176.00	3.20
9	600900	长江电力	47,100	1,344,234.00	3.20
10	601689	拓普集团	18,200	846,664.00	2.01

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	2,663,834.99	6.33
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,663,834.99	6.33

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	127025	冀东转债	9,800	1,037,296.44	2.47
2	123107	温氏转债	4,000	445,981.37	1.06
3	113648	巨星转债	3,750	424,815.41	1.01
4	113059	福莱转债	3,300	383,554.57	0.91
5	110085	通 22 转债	3,300	372,187.20	0.89

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

本报告期末本基金未持有资产支持证券。

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本报告期末本基金未持有资产权证。

8、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动（元）	风险说明
IC2610	IC2610	-1	-1,485,840.00	51,300.00	-
IF2610	IF2610	-9	-11,752,560.00	296,136.00	-
公允价值变动总额合计（元）					347,436.00
股指期货投资本期收益（元）					1,582,982.39
股指期货投资本期公允价值变动（元）					667,776.00

9、投资组合报告附注

（1）本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国工商银行在报告编制日前一年内受到中国人民银行、国家金融监督管理总局的处罚。

除此，基金投资的前十名其他证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

（2）基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内股票。

（3） 基金的其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,645,751.53
2	应收证券清算款	834,851.03
3	应收股利	-
4	应收利息	-

5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	2,480,602.56

（4） 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	127025	冀东转债	1,037,296.44	2.47
2	123107	温氏转债	445,981.37	1.06
3	113648	巨星转债	424,815.41	1.01
4	113059	福莱转债	383,554.57	0.91
5	110085	通 22 转债	372,187.20	0.89

（5） 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末本基金前十名不存在流通受限的情况。

10、开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	41,322,383.60
报告期期间基金总申购份额	4,814.38
减：报告期期间基金总赎回份额	338,680.36
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	40,988,517.62

11、基金的业绩

基金管理人承诺以恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不向投资者保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。基金合同生效以来的投资业绩及同期基准的比较如下表所示：

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-13.71%	1.04%	0.64%	0.01%	-14.35%	1.03%
过去六个月	3.43%	1.07%	1.29%	0.01%	2.14%	1.06%
过去一年	-3.39%	0.84%	2.61%	0.01%	-6.00%	0.83%
过去三年	8.57%	0.61%	8.27%	0.01%	0.30%	0.60%
过去五年	-3.75%	0.50%	14.57%	0.01%	-18.32%	0.49%

过去七年	13.87%	0.46%	21.67%	0.01%	-7.80%	0.45%
过去十年	7.77%	0.41%	34.12%	0.01%	-26.35%	0.40%
自基金合同生效起至今	2.60%	0.40%	37.67%	0.01%	-35.07%	0.39%

十、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证券及票据价值、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和。

（二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

（三）基金财产的账户

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

（四）基金财产的保管和处分

本基金财产独立于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人、基金登记机构和基金销售机构以其自有的财产承担其自身的法律责任，其债权人不得对基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。除依据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。

十一、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、权证、债券和银行存款本息、应收款项、股指期货、其它投资等资产及负债。

三、估值方法

1、证券交易所上市的有价证券的估值

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

（2）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），选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。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），选取第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。

（3）对在交易所市场上市交易的可转换债券，按照每日收盘价作为估值全价。

（4）对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募债券，估值日不存在活跃市场时采用估值技术确定其公允价值进行估值。在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。持续评估上述做法的适当性，并可在情况发生改变时做出适当调整。

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

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

（3）首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规

定确定公允价值。

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

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

4、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

5、股指期货合约估值方法

本基金投资股指期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值日无结算价的，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。

6、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。

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

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

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

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

四、估值程序

1、基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数

量计算，精确到 0.001 元，小数点后第 4 位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人于每个工作日计算基金资产净值及、基金份额净值及基金累计份额净值，并按规定公告。2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将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，由基金管理人对外公布。

五、估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后 3 位以内(含第 3 位)发生估值错误时，视为基金份额净值错误。

本基金合同的当事人应按照以下约定处理：

1、估值错误类型

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

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

2、估值错误处理原则

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

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

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

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

（4）估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

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

4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

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

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

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

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

②若基金管理人计算的基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告，由此给基金份额持有人造成损失的，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。

③如基金管理人和基金托管人对基金份额净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对或对基金管理人采用的估值方法，尚不能达成一致时，为避免不能按时公布基金份额净值的情形，以基金管理人的计算结果对外公布，由此给基金份额持有人和基金造成的损失，由基金管理人负责赔付。

④由于基金管理人提供的信息错误（包括但不限于基金申购或赎回金额等），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，由基金管理人负责赔付。

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

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

六、暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券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、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

七、基金净值的确认

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

八、特殊情况的处理

1、基金管理人或基金托管人按基金合同规定的估值方法第 8 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

2、由于不可抗力原因，或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

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。

十二、基金收益与分配

（一）基金利润的构成

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

（二）基金可供分配利润

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

（三）基金收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 50%，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基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

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

4、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。

（四）收益分配方案

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

（五）收益分配方案的确定、公告与实施

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

基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过 15 个工作日。

（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，不足于支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持

有人的现金红利自动转为基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。

（七）实施侧袋机制期间的收益分配

本基金实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配。

十三、基金费用与税收

（一）基金费用的种类

1、基金管理人的管理费；

2、基金托管人的托管费；

3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；

4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼或仲裁费；

5、基金份额持有人大会费用；

6、基金的证券交易费用；

7、基金的银行汇划费用；

8、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

基金管理人的管理费为基金管理人的基本管理费和基金管理人的附加管理费之和。其中，基金管理人的基本管理费和基金管理人的附加管理费计提方法、计提标准和支付方式如下：

（1）基金管理人的基本管理费

本基金的基本管理费按前一日基金资产净值的 1%年费率计提。基本管理费的计算方法如下：

H＝E×1%÷当年天数

H 为每日应计提的基金基本管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金基本管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金管理人向基金托管人发送基本管理费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

（2）基金管理人的附加管理费

1）基金管理人可在同时满足以下条件的前提下，提取附加管理费：

①符合基金收益分配条件

②附加管理费是在每一封闭期的最后一个工作日计算并计提。按照“新高法原则”提取超额收益的 10%作为附加管理费：即每次提取评价日提取附加管理费前的基金份额累计净

值必须超过以往提取评价日的最高基金份额累计净值、以往开放期期间最高基金份额累计净值和 1 的孰高者，管理人才能收取附加管理费，附加管理费按照下述公式计算并收取。

提取评价日：每次基金封闭期的最后一个工作日

2）附加管理费的计算方法和提取

在同时满足以上附加管理费提取条件的情况下，附加管理费的计算方法为

附加管理费=$(P_A - P_H) \times 10\% \times S_A$

其中：

P_A 为提取评价日提取附加管理费前的基金份额累计净值

P_A = 提取评价日基金份额净值 × 提取评价日的折算因子 + $\sum_{i=1}^{n}$ 第 i 次基金份额分红 × 第 i 次分红日的折算因子

P_H 为以往提取评价日的最高基金份额累计净值、以往开放期期间最高基金份额累计净值和 1 的孰高者，其中首次封闭期的 P_H 为 1

S_A 为提取评价日的基金份额=提取评价日基金总份额÷ 提取评价日的折算因子

某日的折算因子为相应日期（包括当日）之前所有折算系数的乘积

折算系数=基金折算日除权前基金份额净值÷ 基金折算日除权后基金份额净值

附加管理费在每一封闭期的最后一个工作日计算并计提。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金管理人向基金托管人发送附加管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

2、基金托管人的托管费

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

H＝E×0.2%÷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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延至法定节假日、休息日结束之日

起 3 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 3 个工作日内支付。

上述“一、基金费用的种类中第 3－7 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）基金管理费、基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可根据基金规模等因素协商一致，酌情调低基金管理费率、基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会。提高上述费率需经基金份额持有人大会决议通过。基金管理人须最迟于新费率实施日 2 日前在规定媒介刊登公告。

（五）实施侧袋机制期间的基金费用

本基金实施侧袋机制的，与侧袋账户有关的费用可以从侧袋账户中列支，但应待侧袋账户资产变现后方可列支，有关费用可酌情收取或减免，但不得收取管理费。

（六）基金税收

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。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。

十四、基金的会计与审计

（一）基金会计政策

1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；

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

3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；

4、会计制度执行国家有关会计制度；

5、本基金独立建账、独立核算；

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

7、基金托管人与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以约定方式确认。

（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具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师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。

十五、基金的信息披露

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

二、信息披露义务人

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人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应当以保护基金份额持有人利益为根本出发点，按照法律、行政法规和中国证监会的规定披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性、完整性、及时性、简明性和易得性。

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会规定的全国性报刊（以下简称“规定报刊”）及规定互联网网站（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。规定网站包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站。

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、法人或者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）《基金合同》、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要

1、《基金合同》是界定《基金合同》当事人的各项权利、义务关系，明确基金份额持有

人大会召开的规则及具体程序，说明基金产品的特性等涉及基金投资者重大利益的事项的法律文件。

2、基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。《基金合同》生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内更新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招募说明书。

3、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。

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

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

（二）基金份额发售公告

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

（三）《基金合同》生效公告

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

（四）基金净值信息

《基金合同》生效后，在基金封闭期内，基金管理人应当至少每周公告一次基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应在开放期前最后一个工作日的次日，披露开放期前最后一个工作日的基金份额净值和基金份额累计净值。

在基金开放期每个开放日的次日，基金管理人将通过规定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

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

（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，并将年度报告登载在规定网站上，将年度报告提示性公告登载在规定报刊上。基金年度报告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，并将中期报告登载在规定网站上，将中期报告提示性公告登载在规定报刊上。

基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在规定网站上，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在 2 日内编制临时报告书，并登载在规定报刊和规定网站上。

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

1、基金份额持有人大会的召开及决定的事项；

2、终止《基金合同》、基金清算；

3、转换基金运作方式、基金合并；

4、更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；

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

6、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；

7、基金管理公司变更持有百分之五以上股权的股东、变更公司的实际控制人；

8、基金募集期延长或提前结束募集；

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

10、基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十，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，中国证监会另有规定的情形除外；

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、基金份额净值计价错误达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、本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；

19、基金推出新业务或服务；

20、本基金发生巨额赎回并延期办理；

21、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；

22、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；

23、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；

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

（八）澄清公告

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

（九）清算报告

《基金合同》终止的，基金管理人应当依法组织清算组对基金财产进行清算并作出清算报告。清算报告应当经过符合《证券法》规定的会计师事务所审计，并由律师事务所出具法律意见书。清算组应当将清算报告登载在规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

（十）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，应当依法报国务院证券监督管理机构备案，并予以公告。

（十一）投资资产支持证券相关公告

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

（十二）投资股指期货相关公告

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

（十三）实施侧袋机制期间的信息披露

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

（十四）中国证监会规定的其他信息。

六、信息披露事务管理

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

基金信息披露义务人公开披露基金信息，应当符合中国证监会相关基金信息披露内容与

格式准则等法规的规定。

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

基金管理人、基金托管人应当在规定报刊中选择一家报刊披露本基金信息。

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

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

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公司住所，供社会公众查阅、复制。

十六、侧袋机制

（一）侧袋机制的实施条件和程序

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

基金管理人应当在启用侧袋机制当日报中国证监会及公司所在地中国证监会派出机构备案，并于启用侧袋机制后 5 个工作日内提交相关材料。

基金管理人应当在启用侧袋机制后次日发布临时公告，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。

侧袋机制启用后，基金管理人应及时向基金销售机构提示侧袋机制启用的相关事宜。

（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，本基金登记机构以基金份额持有人的原有账户份额为基础，确认基金份额持有人的相应侧袋账户份额；当日收到的申购申请，视为投资者对侧袋机制启用后的主袋账户提交的申购申请；当日收到的赎回申请，仅办理主袋账户份额的赎回申请并支付赎回款项。 基金管理人应依法向投资者进行充分披露。

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。本招募说明书“基金份额的开放期、封闭期、申购与赎回”部分的申购、赎回规定适用于主袋账户份额。

3、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。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 20%认定。

（三）实施侧袋机制期间的基金投资

侧袋机制实施期间，本招募说明书“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应当以主袋账户资产为基准。

基金管理人原则上应当在侧袋机制启动后 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）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款项。无论侧袋账户资产是否全部完成变现，基金管理人都应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。

基金管理人不得收取侧袋账户的管理费，待侧袋账户资产变现后可将与处置侧袋账户资产相关的费用从侧袋账户中列支。因启用侧袋机制产生的咨询、审计费用等由基金管理人承担。

终止侧袋机制后，基金管理人及时聘请符合《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。

（五）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，基金管理人应按规定及时发布临时公告。

2、基金净值信息

基金管理人应按照本招募说明书“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份额净值和基金份额累计净值。实施侧袋机制期间本基金暂停披露侧袋账户份额净值。

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特定资产处置进展情况，披露报告期末特定资产可变现净值或净值区间的，需同时注明不作为特定资产最终变现价格的承诺。

十七、风险揭示

基金业绩受证券市场价格波动的影响，投资者持有本基金可能盈利，也可能亏损。本基金面临的风险有：

一、市场风险

证券市场价格因受经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响而引起的波动，将对本基金资产产生潜在风险，主要包括：

1、政策风险

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

2、经济周期风险

证券市场是国民经济的晴雨表，而经济运行具有周期性的特点。宏观经济运行状况将对证券市场的收益水平产生影响，从而产生风险。

3、利率风险

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

4、购买力风险

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

5、上市公司经营风险

上市公司的经营状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务等都会导致公司盈利发生变化，从而导致基金投资收益变化。

6、债券市场流动性风险

由于银行间债券市场深度和宽度相对较低，交易相对较不活跃，可能增大银行间债券变现难度，从而影响基金资产变现能力的风险。

7、再投资风险

再投资风险反映了利率下降对固定收益证券利息收入再投资收益的影响，这与利率上升所带来的价格风险（即利率风险）互为消长。具体为当利率下降时，基金从投资的固定收益证券所得的利息收入进行再投资时，将获得比以前较少的收益率。

二、信用风险

指基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失。

三、流动性风险

为应对投资者的赎回申请，基金管理人可采取各种有效管理措施，满足流动性需求。但如果出现较大数额的赎回申请，基金资产变现困难时，基金面临流动性风险。

1、基金申购、赎回安排

本基金的申购、赎回安排详细规则参见招募说明书第八部分基金份额的申购与赎回的相关约定。

2、拟投资市场及资产的流动性风险评估

本基金拟投资市场主要为证券交易所、全国银行间债券市场等流动性较好的规范型交易场所，主要投资对象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（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、股指期货、权证、资产支持证券、银行存款、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)，同时本基金基于分散投资的原则在行业和个券方面未有高集中度的特征，综合评估在正常市场环境下本基金的流动性风险适中。

3、巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

为应对巨额赎回情形下可能发生的流动性风险，基金管理人在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，可能采取部分延期赎回、暂停赎回或者对赎回比例过高的单一投资者延期办理部分赎回申请的流动性风险管理措施，详细规则参见招募说明书第八部分基金份额的申购与赎回的相关约定。

4、由于投资者的申购赎回行为可能导致本基金的单一投资者持有的份额占本基金总份额的比例较高，该单一投资者的申购赎回行为可能影响本基金的投资运作，从而对基金收益产生不利影响。基金管理人将控制单一投资者持有基金份额的比例低于 50%，并防止投资者以其他方式变相规避 50%集中度限制的情形发生（运作过程中，因基金份额赎回等情形导致被动超标的除外）。如基金管理人认为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%，或者基金管理人认为可能存在变相规避 50%集中度限制的情形时，基金管理人有权拒绝该单一投资者的全部或部分的认/申购申请或确认

失败。

5、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。本基金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）实施侧袋机制；

（8）中国证监会认定的其他措施。

巨额赎回情形下实施部分延期赎回、暂停赎回或者对赎回比例过高的单一投资者延期办理部分赎回申请的情形及程序详见招募说明书第八部分基金份额的申购与赎回第十条的相关约定。当实施部分延期赎回的措施时，申请赎回的基金份额持有人将无法全额确认赎回，一方面可能影响自身的流动性，另一方面将承担额外的市场波动对基金净值的影响。若实施暂停接受赎回申请，投资者一方面不能赎回基金份额，可能影响自身的流动性，另一方面将承担额外的市场波动对基金净值的影响。当实施对赎回比例过高的单一投资者延期办理部分赎回申请的措施时，该赎回比例过高的基金份额持有人将无法全额确认赎回，一方面可能影响自身的流动性，另一方面将承担额外的市场波动对基金净值的影响。

收取短期赎回费的情形和程序详见招募说明书第八部分基金份额的申购与赎回的相关约定，对持续持有期小于 7 日的投资者相比于其他持有期限的投资者将支付更高的赎回费。

暂停基金估值的情形详见招募说明书第十一部分基金资产的估值第六条的相关约定。若实施暂停基金估值，基金管理人会采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金申购赎回申请的措施，对投资者产生的风险如前所述。

当基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以对本基金的估值采用摆动定价机制，即将本基金因为大额申购或赎回而需要大幅增减仓位所带来的冲击成本通过调整基金的估值和单位净值的方式传导给大额申购和赎回持有人，以保护其他持有人的利益。在实施摆动

定价的情况下，在总体大额净申购时会导致基金的单位净值上升，对申购的投资者不利；在总体大额净赎回时会导致基金的单位净值下降，对赎回的持有人产生不利影响。

6、实施侧袋机制对投资者的影响

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，但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拥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。

四、管理风险

在基金管理运作过程中，可能因基金管理人对经济形势和证券市场等判断有误、获取的信息不全等影响基金的收益水平。基金管理人和基金托管人的管理水平、管理手段和管理技术等对基金收益水平存在影响。管理风险包括：

（1）决策风险：指基金投资的投资策略制定、投资决策执行和投资绩效监督检查过程中，由于决策失误而给基金资产造成的可能的损失；

（2）操作风险：指基金投资决策执行中，由于投资指令不明晰、交易操作失误等人为因素而可能导致的损失；

（3）技术风险：是指公司管理信息系统设置不当等因素而可能造成的损失。

五、本基金的特有风险

1、非开放日不能申购或赎回的风险

本基金每三个月开放一次，每次开放期不超过 5 个工作日，每个开放期所在月份为基金合同生效日所在月份在后续每三个日历月中最后一个日历月，每个开放期的首日为当月沪深

300 股指期货交割日（不含该日）前五个工作日的第一个工作日，因此投资人面临在非开放期内不能申购或赎回基金份额的风险。

2、巨额赎回风险

若本基金在开放期发生了巨额赎回，基金管理人有可能采取部分延期支付或暂停支付的措施以应对巨额赎回，因此在巨额赎回情形发生时，基金份额持有人存在不能及时赎回份额的风险。

3、《基金合同》生效三年后基金无法继续存续的风险

本基金的《基金合同》生效之日起三年后的对应日，若基金资产规模低于 2 亿元，基金合同自动终止，且不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限，存在着基金无法继续存续的风险。

4、本基金每三个月开放一次申购和赎回，每个开放期的起始日与当月沪深 300 股指期货交割日相关，由于每月沪深 300 股指期货交割日会发生改变，每个开放期的起始日也会发生改变，因此，请投资人关注本基金的相关公告，避免因错过开放期而无法申购或赎回基金份额。

5、绝对收益策略失败风险

本基金采用多种绝对收益策略来实现绝对收益，但是不能确保策略能完全剥离基金的系统性风险，因而有可能因绝对收益策略失败导致基金损失。

6、卖空风险

本基金现阶段主要采用股指期货来对冲多头股票部分的系统性风险，将来会优选做空个股、做空其他衍生工具的方式来实现投资目标。同时持有多头和空头头寸的方式导致本基金存在在特定市场情况下跑不赢普通偏股型基金的风险，同时有可能导致持有本基金在特殊情况下比持有普通偏股型基金蒙受更大损失。

7、股票选择风险

本基金多头股票部分主要采用基本面研究的方式进行选择，期望筛选出对比做空的股指或个股有超额收益的股票。但是通过基本面研究买入股票的区间收益率有可能低于做空的股指收益率或个股收益率，从而导致基金损失。

8、本金损失风险

本基金灵活应用各种绝对收益策略对冲基金的系统性风险，而且采用一年期定期存款基准利率(税后)+2%作为其业绩比较基准，但是投资策略的失败和投资市场的波动会导致投资本基金的投资者遭受本金损失的风险。

9、投资股指期货的风险

（1）股指期货的基差风险

在使用股指期货对冲市场风险的过程中，基金财产可能因为股指期货合约与标的指数价格波动不一致而遭受基差风险。形成基差风险的潜在原因包括：

1）需要对冲的风险资产与股指期货标的指数风险收益特征存在明显差异；

2）因未知因素导致股指期货合约到期时基差严重偏离正常水平；

3）因存在基差风险，在进行股指期货合约展期的过程中，基金财产可能会承担股指期货合约之间的价差向不利方向变动而导致的展期风险。

（2）股指期货的杠杆风险

因股指期货采用保证金交易而存在杠杆，基金财产可能因此产生更大的收益波动。

（3）股指期货的到期日风险

股指期货合约到期时，基金财产如持有未平仓合约，中金所将按照交割结算价将基金财产持有的合约进行现金交割，基金财产将无法继续持有到期合约，具有到期日风险。

（4）股指期货的对手方风险

资产管理人运用基金财产投资于股指期货时，会尽力选择资信状况优良、风险控制能力强的期货公司作为经纪商，但不能杜绝在极端情况下，所选择的期货公司在交易过程中存在违法、违规经营行为或破产清算导致基金财产遭受损失。

（5）股指期货的盯市结算风险

股指期货采取保证金交易，保证金账户实行当日无负债结算制度，对资金管理要求较高。假如市场走势对本基金财产不利，期货经纪公司会按照期货经纪合同约定的时间和方式通知资产管理人追加保证金，以使基金财产能继续持有未平仓合约。如出现极端行情，市场持续向不利方向波动导致期货保证金不足，又未能在规定时间内补足，按规定保证金账户将被强制平仓，甚至已缴付的所有保证金都不能弥补损失，从而导致超出预期的损失。

（6）股指期货的平仓风险

在某些市场情况下，基金财产可能会难以或无法将持有的未平仓合约平仓，例如，这种情况可能在市场达到涨跌停板时出现。出现这类情况，基金财产缴付的所有保证金有可能无法弥补全部损失，委托人还必须承担由此导致的全部损失。

期货经纪公司或其客户保证金不足，又未能在规定的时间内补足，或因其他原因导致中金所对期货经纪公司的经纪账户强行平仓，基金财产可能因被连带强行平仓而遭受损失。

（7）连带风险

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

10、基金资产投资特定投资对象的其他风险

如期货经纪公司违反法律法规或中金所交易、结算等规则，可能会导致基金财产受到损失。由于国家法律、法规、政策的变化、中金所交易规则的修改、紧急措施的出台等原因，基金财产持有的未平仓合约可能无法继续持有，基金财产必须承担由此导致的损失。

六、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。

七、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

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(包括基金管理人和其他销售机构)根据相关法律法规对本基金进行风险评价，不同的销售机构采用的评价方法也不同，因此销售机构的风险等级评价与法律文件中风险收益特征的表述可能存在不同，投资人在购买本基金时需按照销售机构的要求完成风险承受能力与产品风险之间的匹配检验。

八、其他风险

1、因技术因素而产生的风险，如电脑系统不可靠产生的风险；

2、因业务快速发展而在制度建设、人员配备、内控制度建立等不完善而产生的风险；

3、因人为因素而产生的风险、如内幕交易、欺诈行为等产生的风险；

4、对主要业务人员如基金经理的依赖而可能产生的风险；

5、因业务竞争压力可能产生的风险；

6、不可抗力可能导致基金资产的损失，影响基金收益水平，从而带来风险；

7、其他意外导致的风险。

九、声明

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

2、本基金通过基金管理人直销网点和指定的基金代销机构公开发售，基金管理人与基金代销机构都不能保证其收益或本金安全。

十八、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

（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。对于可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效，自决议生效之日起按照《信息披露办法》的规定在规定媒介公告。

（二）《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

1、基金份额持有人大会决定终止；

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；

3、因重大违法、违规行为，被中国证监会责令终止；

4、《基金合同》约定的其他情形；

5、基金合同生效三年届满之日（指自然日），基金资产净值低于 2 亿元的；

6、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、具有从事证券、期货相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算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。

（四）清算费用

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

（五）基金财产清算剩余资产的分配

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

（六）基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经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。

（七）基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

十九、基金合同内容摘要

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） 基金管理人的权利与义务

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

（1）依法募集基金；

（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）召集基金份额持有人大会；

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

（7）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

（8）选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；

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

（10）依据《基金合同》及有关法律规定决定基金收益的分配方案；

（11）在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；

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

（13）在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；

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

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

（16）在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换和非交易过户的业务规则；

（17）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

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

（2）办理基金备案手续；

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

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

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

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

（7）依法接受基金托管人的监督；

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

（9）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

（10）编制季度报告、中期报告和年度报告；

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

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

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

（14）按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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

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

（17）确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者

能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的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存款利息在基金募集期结束后30日内退还基金认购人；

（25）执行生效的基金份额持有人大会的决议；

（26）建立并保存基金份额持有人名册；

（27）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

（二） 基金托管人的权利与义务

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

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

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

（3）监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人有违反《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，为基金开设证券账户、为基金办理证券交易资金清算。

（5）提议召开或召集基金份额持有人大会；

（6）在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

（7）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

（1）以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

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

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

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

（5）保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

（6）按规定开设基金财产的资金账户和证券账户,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；

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

（9）办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

（10）对基金财务会计报告、季度报告、中期报告、半年度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15年以上；

（12）建立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份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

（16）按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；

（17）参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

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

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

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

（21）执行生效的基金份额持有人大会的决定；

（22）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

（三）基金份额持有人的权利和义务

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》；

（2）了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自行承担投资风险；

（3）关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；

（4）缴纳基金认购、申购、赎回款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；

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

（6）不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；

（7）执行生效的基金份额持有人大会的决定；

（8）返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；

（9）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

（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：

（1）决定修改基金合同的重要内容或提前终止《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）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；

（6）变更基金类别；

（7）本基金与其他基金的合并；

（8）变更基金投资目标、范围或策略；

（9）变更基金份额持有人大会程序；

（10）基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；

（11）单独或合计持有本基金总份额10%以上（含10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人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、以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

（1）调低基金管理费、基金托管费；

（2）法律法规要求增加的基金费用的收取；

（3）在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率；

（4）因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；

（5）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变化；

（6）在对基金份额持有人利益无实质影响的情况下调整本基金的业绩比较基准；

（7）按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

（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开的，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。

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、书面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书面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、通讯开会方式等法律法规或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50%（含50%）。

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召集人确定的非

现场方式在表决截至日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以召集人确定的非现场方式进行表决。

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50%（含50%）；

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

（5）会议通知公布前报中国证监会备案。

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、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50%以上（含50%）通过方为有效；除下列第2项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、本基金与其他基金合并、终止《基金合同》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，表决符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

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

在上述规则的前提下，具体规则以召集人发布的基金份额持有人大会通知为准。

（七）计票

1、现场开会

（1）如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

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

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

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

2、通讯开会

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

（八）生效与公告

基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

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

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

（九）参加基金份额持有人大会的持有人的基金份额低于50%的，召集人可以在原公告基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内，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基金份额的持有人参加，方可召开。重新召集基金份额持有人大会的通知、形式、议事程序、表决、生效和公告等适用本合同中有关基金份额持有人大会的规定。

（十）实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定

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

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

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

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

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

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

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

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

同一主侧袋账户内的每份基金份额具有平等的表决权。

（十一）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。对于可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自表决通过之日起方可执行，自决议生效之日起按照《信息披露办法》的规定在规定媒介公告。

（二）《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

1、基金份额持有人大会决定终止；

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；

3、因重大违法、违规行为，被中国证监会责令终止；

4、《基金合同》约定的其他情形；

5、基金合同生效满三年之日（指自然日），基金资产净值低于2亿元的；

6、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、具有从事证券、期货相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算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）对基金财产进行分配。

5、基金财产清算的期限为6个月。

（四）清算费用

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

（五）基金财产清算剩余资产的分配

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

（六）基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经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。

（七）基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。

四、争议解决方式

对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力。

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》受中国法律管辖。

五、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

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

二十、基金托管协议内容摘要

一、基金托管协议当事人

（一）基金管理人

名称：中邮创业基金管理股份有限司

注册地址：北京市东城区北三环东路 36 号 2 号楼 C 座 20 层

法定代表人：张志名

成立日期： 2006 年 5 月 8 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字【2006】23 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：3.041 亿元

存续期间：持续经营

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、中国证监会许可的其他业务

（二）基金托管人

名称：兴业银行股份有限公司（简称：兴业银行）

注册地址：福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦

办公地址：上海市浦东新区银城路 167 号 4 楼

法定代表人：吕家进

成立日期：1988 年 8 月 22 日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基金字[2005]74 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：207.74 亿元人民币

存续期间：持续经营

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；代理发行股票以外的有价证券；买卖、代理买卖股票以外的有价证券；资产托管业务；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；结汇、售汇业务；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；财务顾问、资信调查、咨询、见证业务；经中国银行业监督管理机构批准的其他业务。

二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

（一）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。

基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种池和交易对手库，以便基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。

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（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、股指期货、权证、资产支持证券、银行存款、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)。

本基金的投资组合比例为:本基金权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的价值的比例范围在 80%—120%之间。其中：权益类空头头寸的价值是指融券卖出的股票市值、卖出股指期货的合约价值及卖出其他权益类衍生工具的合约价值的合计值;权益类多头头寸的价值是指买入持有的股票市值、买入股指期货的合约价值及买入其他权益类衍生工具的合约价值的合计值。

开放期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%，封闭期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%。

开放期内，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制。基金管理人最迟应于开放期开始前 2 日书面通知基金托管人，基金托管人据此进行相应的投资比例和投资限制监督事项的调整。

本基金不受证监会《证券投资基金参与股指期货交易指引》第五条第（一）项、第（三）项、第（五）项及第（七）项的限制。

基金管理人可以在不改变本基金既有投资策略和风险收益特征并在控制风险的前提下，经与基金托管人协商一致后，参与融资融券业务以及通过证券金融公司办理转融通业务，以提高投资效率及进行风险管理。基金管理人运用本基金财产参与融资融券业务以及通过证券金融公司办理转融通业务前，应与基金托管人签署补充协议，明确约定基金管理人及基金托

管人在本基金参与融资业务中的交易结算模式，包括双方在交易执行、资金划拨、资金清算、会计核算、担保品存管等业务中的权利和义务，以及基金托管人对基金参与融资业务的监督、核查和风险控制流程等。届时基金参与融资融券、转融通等业务的风险控制原则、具体参与比例限制、费用收支、信息披露、估值方法及其他相关事项按照中国证监会的规定及其他相关法律法规的要求执行，无需召开基金份额持有人大会决定。

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

（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）本基金权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的价值的比例范围在 80%—120%之间。其中：权益类空头头寸的价值是指融券卖出的股票市值、卖出股指期货的合约价值及卖出其他权益类衍生工具的合约价值的合计值；权益类多头头寸的价值是指买入持有的股票市值、买入股指期货的合约价值及买入其他权益类衍生工具的合约价值的合计值；

（2）开放期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%，封闭期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%；

（3）开放期内，在扣除股指期货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、应收申购款等。在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制；

（4）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%；

（5）本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；

（6）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%；

（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前款所规定的流动性受限资产比例限制的，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%；

（9）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

（10）本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

（11）本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%；

（12）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%；

（13）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%；

（14）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%；

（15）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%；

（16）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；

（17）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；

（18)本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%，在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年，债券回购到期后不展期；

（19）开放期内，本基金总资产不得超过基金净资产的140%；封闭期内本基金总资产不得超过基金净资产的200%；

（20)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；

（21）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（3)、(7)、(16)、(20）项另有约定外，因证券、期货市场波动、上市公司合并、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。法律法规或监管机构另有规定时，从其规定。

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。

基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消上述限制，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，对本托管协议第十五条第九款基金投资禁止行为进行监督。基金托管人通过事后监督方式对基金管理人基金投资禁止行为进行监督。

（四）基金托管人依据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定，对基金关联投资进行监督。

根据法律法规有关基金从事的关联交易的规定，基金管理人和基金托管人应事先相互提供与本机构有控股关系的股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司名单及有关关联方发行的证券名单，加盖公章并书面提交，并确保所提供的关联交易名单的真实性、完整性、全面性。基金管理人有责任保管真实、完整、全面的关联交易名单，并负责及时更新该名单。名单变更后基金管理人应及时发送基金托管人，基金托管人于 2 个工作日内进行回函确认已知名单的变更。基金管理人收到基金托管人书面确认后，新的关联交易名单开始生效。基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当遵循基金份额持有人利益优先的原则，防范利益冲突，符合国务院证券监督管理机构的规定，并履行信息披露义务。

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，相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规进行操作。

（五）基金托管人对基金投资银行存款进行监督。

本基金投资银行存款应符合如下规定：

1、基金管理人、基金托管人应当与存款银行建立定期对账机制，确保基金银行存款业务账目及核算的真实、准确。

2、基金管理人应当按照有关法规规定，与基金托管人、存款机构签订相关书面协议。基金托管人应根据有关相关法规及协议对基金银行存款业务进行监督与核查，严格审查、复核相关协议、账户资料、投资指令、存款证实书等有关文件，切实履行托管职责。

3、基金管理人与基金托管人在开展基金存款业务时，应严格遵守《基金法》、《运作办法》等有关法律法规，以及国家有关账户管理、利率管理、支付结算等的各项规定。

4、基金投资银行存款的，基金管理人应根据法律法规的规定及基金合同的约定，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，基金托管人应据以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。基金管理人对定期存款提前支取的损失由其承担。

（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，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。

基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的、经慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手名单，并约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金管理人应严格按照交易对手名单的范围在银行间债券市场选择交易对手。基金托管人监督基金管理人是否按事前提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易。基金管理人可以每半年对银行间债券市场交易对手名单及结算方式进行更新，新名单确定前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。如基金管理人根据市场情况需要临时调整银行间债券市场交易对手名单及结算方式的，应向基金托管人说明理由，并在与交易对手发生交易前 3 个工作日内与基金托管人协商解决。

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，并承担交易对手不履行合同造成的损失，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。如基金托管人事后发现基金管理人没有按照事先约定的交易对手或交易方式进行交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人，基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任。

（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《关于规范基金投资非公开发行证券行为的紧急通知》、《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。

2．流通受限证券，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。

3．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

等规章制度。基金管理人应当根据基金的投资风格和流动性的需要合理安排流通受限证券的投资比例，并在相关制度中明确具体比例，避免基金出现流动性风险。基金投资非公开发行股票，基金管理人还应提供流动性风险处置预案。上述资料应包括但不限于基金投资流通受限证券的投资额度和投资比例控制情况。

上述规章制度须经基金管理人董事会批准。

4、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)：

拟发行数量、定价依据、监管机构的批准证明文件复印件、基金管理人与承销商签订的销售协议复印件、缴款通知书、基金拟认购的数量、价格、总成本、划款账号、划款金额、划款时间文件等。基金管理人应保证上述信息的真实、完整。

5．基金管理人应在本基金投资非公开发行股票后两个交易日内，在中国证监会规定媒介披露所投资非公开发行股票的名称、数量、总成本、账面价值，以及总成本和账面价值占基金资产净值的比例、锁定期等信息。

6．基金托管人应对基金管理人是否遵守法律法规、投资决策流程、风险控制制度、流动性风险处置预案情况进行监督，并审核基金管理人提供的有关书面信息。基金托管人认为上述资料可能导致基金出现风险的，有权要求基金管理人在投资流通受限证券前就该风险的消除或防范措施进行补充书面说明，并保留查看基金管理人风险管理部门就基金投资流通受限证券出具的风险评估报告等备查资料的权利。

如基金管理人和基金托管人无法达成一致，应及时上报中国证监会请求解决。如果基金托管人切实履行监督职责，则不承担任何责任。如果基金托管人没有切实履行监督职责，导致基金出现风险，基金托管人应承担连带责任。

7．相关法律法规对基金投资流通受限证券有新规定的，从其规定。

（八）基金管理人应在基金首次投资中期票据前，与基金托管人签署相应的风险控制补充协议，并按照法律法规的规定和补充协议的约定向基金托管人提供经基金管理人董事会批准的有关基金投资中期票据的投资管理制度。

（九）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、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。

（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违反法律法规、基金合同和本托管协议的规定，应及时以电话提醒或书面提示等方式通知基金管理人限期纠

正。

基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到书面通知后应在下一工作日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。

（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律法规、基金合同和本托管协议的要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

（十二）若基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当立即通知基金管理人。

（十三）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、阻挠对方根据本托管协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的，基金托管人应报告中国证监会。

（十四）基金托管人应当依照法律法规和基金合同约定，对侧袋机制启用、特定资产处置和信息披露等方面进行复核和监督。

三、基金管理人对基金托管人的业务核查

（一）基金管理人对基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、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、本托管协议及其他有关规定时，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正。

基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式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、阻挠对方根据本托管协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经基金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、基金财产保管

（一）基金财产保管的原则

1．基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产；

2．基金托管人应安全保管基金财产；

3．基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户；

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

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

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．基金募集期间募集的资金应存于基金管理人在具有托管资格的商业银行开立的“基金募集专户”。该账户由基金管理人开立并管理。

2．基金募集期满或基金停止募集时，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银行账户，同时在规定时间内，聘请具有从事证券相关业务资格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。

（三）基金银行账户的开立和管理

1．基金托管人以基金托管人的名义开设资产托管专户，保管基金财产的银行存款。该资产托管专户同时也是基金托管人在法人集中清算模式下，代表所托管的包括本基金财产在内的所有托管资产与中国证券登记结算有限责任公司进行一级结算的专用账户。该账户的开设和管理由基金托管人承担。本基金的一切货币收支活动，均需通过基金托管人的资产托管专户进行。资产托管人可根据实际情况需要，为基金财产开立资金清算辅助账户，以办理相关的资金汇划业务。资产管理人应当在开户过程中给予必要的配合，并提供所需资料。

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

3．基金银行账户的开立和管理应符合银行业监督管理机构的有关规定。

（四）基金证券账户和结算备付金账户的开立和管理

1．基金托管人在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司为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，仅限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借或未经对方同意擅自转让基金的任何证券账户，亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

3．基金证券账户的开立和证券账户卡的保管由基金托管人负责，账户资产的管理和运用由基金管理人负责。

4．基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户，并代表所托管的基金完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级法人清算工作，基金管理人应予以积极协助。结算备付金、结算互保基金、交收价差资金等的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

5．若中国证监会或其他监管机构在本托管协议订立日之后允许基金从事其他投资品种的投资业务，涉及相关账户的开立、使用的，若无相关规定，则基金托管人比照上述关于账户开立、使用的规定执行。

（五）债券托管专户的开设和管理

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的有关规定，在中央国债登记结算有限责任公司开立债券托管账户，并代表基金进行银行间市场债券的结算。基金管理人和基金托管人共同代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议。

（六）股指期货的相关账户的开立和管理

基金管理人、基金托管人应当按照相关规定开立期货结算账户、期货资金账户，在中国金融期货交易所获取交易编码。期货结算账户名称、期货资金账户名称及交易编码对应名称应按照有关规定设立。

（七）其他账户的开立和管理

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

2．法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

（八）基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的有关实物证券等有价凭证由基金托管人存放于基金托管人的保管库，也可存入中央国债登记结算有限责任公司、中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司或票据营业中心的代保管库，保管凭证由基金托管人持有。实物证券等有价凭证的购买和转让，由基金管理人和基金托管人共同办理。基金托管人对由基金托管人以外机构实际有效控制的证券不承担保管责任。

（九）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保证基金一方持有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。重大合同的保管期限为基金合同终止后 15 年。

对于无法取得二份以上的正本的，基金管理人应向基金托管人提供加盖授权业务章的合同传真件，未经双方协商或未在合同约定范围内，合同原件不得转移。

五、基金资产净值计算和会计核算

（一）基金资产净值的计算、复核与完成的时间及程序

1．基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的金额。

基金份额净值是指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数，基金份额净值的计算，

精确到 0.001 元，小数点后第 4 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人每个工作日计算基金资产净值、基金份额净值及基金份额累计净值，经基金托管人复核，按规定公告。

2．复核程序

基金管理人每工作日对基金资产进行估值后，将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，由基金管理人按照规定对外公布。

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

（二）基金资产估值方法和特殊情形的处理

1．估值对象

基金所拥有的股票、权证、债券和银行存款本息、应收款项、股指期货、其它投资等资产及负债。

2．估值方法

（1）证券交易所上市的有价证券的估值

1）交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的市价（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），选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。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），选取第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。

3）对在交易所市场上市交易的可转换债券，按照每日收盘价作为估值全价。

4）对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募债券，估值日不存在活跃市场时采用估值技术确定其公允价值进行估值。在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。持续评估上述做法的适当性，并可在情况发生改变时做出适当调整。

（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市价（收盘价）估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

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

3）首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的市价（收盘价）估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

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

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

（4）同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

（5）股指期货合约估值方法

本基金投资股指期货合约， 一般以估值当日结算价进行估值，估值日无结算价的，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。

（6）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。

（7）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。

（8）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。

3．特殊情形的处理

（1）基金管理人、基金托管人按估值方法的第（8）项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

（2）由于不可抗力原因，或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

（三）基金份额净值错误的处理方式

1．当基金份额净值小数点后 3 位以内（含第 3 位）发生差错时，视为基金份额净值错误；基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；错误偏差达到或超过基金份额净值的 0.25%时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告；当发生净值计算错误时，由基金管理人负责处理，由此给基金份额持有人和基金造成的直接损失，应由基金管理人先行赔付，基金管理人按差错情形，有权向其他当事人追偿。

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

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

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

（3）如基金管理人和基金托管人对基金份额净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对，尚不能达成一致时，为避免不能按时公布基金份额净值的情形，以基金管理人的计算结果对外公布，由此给基金份额持有人和基金造成的直接损失，由基金管理人负责赔付。

（4）由于基金管理人提供的信息错误（包括但不限于基金申购或赎回金额等），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直接损失，由基金管理人负责赔付。

3．由于不可抗力原因，或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

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

5.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，双方当事人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商。

（四）暂停估值与公告基金份额净值的情形

1．基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2.因不可抗力或其它情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

3．占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障投资人的利益，已决定延迟估值；

4．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；

5．中国证监会和基金合同认定的其它情形。

（五）基金会计制度

按国家有关部门规定的会计制度执行。

（六）基金账册的建立

基金管理人进行基金会计核算并编制基金财务会计报告。基金管理人独立地设置、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资产净值的计算和公告的，以基金管理人的账册为准。

（七）基金财务报表与报告的编制和复核

1．财务报表的编制

基金财务报表由基金管理人编制，基金托管人复核。

2．报表复核

基金托管人在收到基金管理人编制的基金财务报表后，进行独立的复核。核对不符时，应及时通知基金管理人共同查出原因，进行调整，直至双方数据完全一致。

3．财务报表的编制与复核时间安排

（1）报表的编制

基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内完成基金季度报告的编制；在上半年结束之日起两个月内完成基金中期报告的编制;在每年结束之日起三个月内完成基金年度报告的编制。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。基金合同生效不足两个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。

（2）报表的复核

基金管理人在月度报表完成当日，将报表盖章后提供给基金托管人复核；基金托管人在收到后应在 3 日内进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在季度报告完成当日,将有关报告提供给基金托管人复核,基金托管人应在收到后 7 个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在中期报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后 30 日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在年度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人应在收到后 45 日内完成复核，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加密传真的方式或双方商定的其他方式进行。

基金管理人应留足充分的时间，便于基金托管人复核相关报表及报告。

（八）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。

六、基金份额持有人名册的登记与保管

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、基金份额持有人大会权利登记日、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必须包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。 基金份额持有人名册由基金的基金注册登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，基金管理人和基金托管人应按照目前相关规则分别保管基金份额持有人名册。保管方式可以采用电子或文档的形式。保管期限为 15 年。

基金管理人应当及时向基金托管人提交下列日期的基金份额持有人名册：《基金合同》生效日、《基金合同》终止日、基金份额持有人大会权利登记日、每年 6 月 30 日、每年 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必须包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。其中每年 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。

基金托管人以电子版形式妥善保管基金份额持有人名册，并定期刻成光盘备份，保存期限为 15 年。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

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

争议处理期间，双方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责，各自继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和本托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本托管协议受中华人民共和国法律管辖。

八、托管协议的变更、终止与基金财产的清算

（一）托管协议的变更程序

本托管协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行修改。修改后的新协议，其内容不得与基金合同的规定有任何冲突。基金托管协议的变更报中国证监会备案后生效。

（二）基金托管协议终止出现的情形

1．基金合同终止；

2．基金托管人解散、依法被撤销、破产或由其他基金托管人接管基金资产；

3．基金管理人解散、依法被撤销、破产或由其他基金管理人接管基金管理权；

4．发生法律法规、中国证监会或基金合同规定的终止事项。

（三）基金财产的清算

1．基金财产清算小组

(1) 基金合同终止事由发生之日起 30 个工作日内，成立基金清算小组，基金管理人组

织基金清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

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

(3)在基金财产清算过程中，基金管理人和基金托管人应各自履行职责，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。

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

2．基金财产清算程序

（1）《基金合同》终止情形发生后，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。

（7）公告基金清算报告；

（7）对基金剩余财产进行分配；

3．基金财产清算的期限为 6 个月。

4．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财产中支付。

5．基金财产清算剩余资产的分配

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

6．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具有证券、期货相关业务资格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。7. 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

二十一、对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务，以下是主要的服务内容，基金管理人根据基金份额持有人的需要、市场状况及自身服务能力的变化，有权增加、修改这些服务项目。

（一）对账单服务

基金管理人根据持有人账户情况定期或不定期发送对账单，但由于基金份额持有人在本公司未详实填写或更新客户资料（含姓名、手机号码、电子邮箱、邮寄地址、邮政编码等）导致基金管理人无法送出的除外。

（二）主动通知服务

基金管理人会根据业务开展情况，通过电子邮件、短信、电话等方式主动为基金份额持有人提供各项通知服务，包括公司信息、产品信息、交易信息及重要信息提示等。

（三）信息定制服务

基金份额持有人可通过基金管理人客服热线、公司网站等途径，按照服务定制规则和定制范围，定制各种资讯，基金管理人会通过 EMAIL、短信、信函等多渠道发送相关资讯与资料。

（四）客户服务热线

投资者拨打基金管理人客服热线 400-880-1618 / （010）58511618（国内免长途话费）可享有如下服务：

1、自助语音服务：提供 7×24 小时基金净值信息、账户交易情况、基金产品等自助查询服务。

2、人工服务：每个工作日的 9:00—17:00。投资者可拨打客服热线获得业务咨询、信息查询、服务投诉及建议、信息定制、资料修改等专项服务。

（五）在线服务

通过本公司网站 www.postfund.com.cn，基金份额持有人还可以获得如下服务：

1、查询服务

基金份额持有人均可通过基金管理人网站实现基金交易查询、账户信息查询和基金信息查询。

2、信息资讯服务

投资者可登录基金管理人网站获取基金和基金管理人的各类信息，包括基金的法律文件、

业绩报告及基金管理人最新动态等资料。

3、网上交易

基金管理人已开通个人投资者的网上直销交易业务。个人投资者通过基金管理人网站 www.postfund.com.cn 可以办理基金认购、申购、赎回、账户资料修改、和交易申请查询等各类业务。

（六）投诉建议受理

投资者可以通过基金管理人提供的客服电话、信函、电子邮件等渠道对基金管理人和销售机构所提供的服务进行投诉或提出建议。投资者还可以通过代销机构的服务电话对该代销机构提供的服务进行投诉或提出建议。

（七）客户服务中心联系方式

1、客户服务电话：400-880-1618

2、客户投诉电话：（010）58511618

3、网址：www.postfund.com.cn

4、客服信箱：info@postfund.com.cn

二十二、其他应披露事项

本基金及基金管理人的有关公告（自招募说明书公布日至本次更新内容截止日）：

披 露 事 项	时 间
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金份额发售公告	2015-12-12
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同	2015-12-12
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同（摘要）	2015-12-12
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金招募说明书	2015-12-12
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金托管协议	2015-12-12
中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下基金增加代销机构的公告	2015-12-16
中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下基金增加代销机构的公告	2015-12-16
中邮创业基金管理股份有限公司关于参加深圳前海微众银行股份有限公司费率优惠的公告	2015-12-18
中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下基金增加代销机构的公告	2015-12-18
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同生效公告	2015-12-31
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金开放申购、赎回业务公告	2016-03-10
中邮创业基金管理股份有限公司参加代销机构及直销机构网上申购基金费率优惠的公告	2016-03-10
关于实施特定投资群体通过直销中心申购费率优惠的公告	2016-03-10
关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下基金参加交通银行、平安银行网上交易申购费率优惠活动的公告	2016-03-10
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 2016 年第 1 季度报告	2016-04-21
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金开放申购、赎回业务公告	2016-06-07
中邮创业基金管理股份有限公司关于参加华泰证券股份有限公司费率优惠的公告	2016-06-15
关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金参加交通银行基金申购费率优惠活动的公告	2016-06-30
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 2016 年第 2 季度报告	2016-07-19
中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加民生银行为代销机构并参加申购费率优惠活动的公告	2016-07-22
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金更新招募说明书（2016 年第 1 号）	2016-08-13
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金开放申购、赎回业务公告	2016-09-07
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金关于运用股指期货对冲的投资策略执行情况公告	2016-09-08

中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金开通民生银行基金定投业务并参加基金定投费率优惠活动的公告	2016-10-26
关于中邮创业基金管理股份有限公司开通网上直销平台基金定投业务并参加申购及定投费率优惠活动的公告	2016-11-08
中邮创业基金管理股份有限公司关于开通网上直销平台的公告	2016-11-08
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金开放申购、赎回业务公告	2016-12-07
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金关于运用股指期货对冲的投资策略执行情况公告	2016-12-08
关于中邮创业基金管理股份有限公司开通网上直销平台基金定投业务并参加申购及定投费率优惠活动的公告	2016-12-09
中邮创业基金管理股份有限公司关于增加中国国际金融股份有限公司为代销机构的公告	2016-12-24
关于中邮创业基金管理股份有限公司开通网上直销平台基金定投业务并参加申购及定投费率优惠活动的公告	2016-12-24
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 2016 年第 4 季度报告	2017-01-21
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金更新招募说明书（2017 年第 1 号）	2017-01-25
关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金参加交通银行股份有限公司基金手机银行申购及定投优惠活动的公告	2017-02-23
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金开放申购、赎回业务公告	2017-03-08
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金关于运用股指期货对冲的投资策略执行情况公告	2017-03-09
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 2016 年年度报告	2017-03-31
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 2017 年第 1 季度报告	2017-04-21
关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金参加交通银行股份有限公司基金手机银行申购及定投优惠活动的公告	2017-04-22
中邮创业基金管理股份有限公司关于参加广发证券股份有限公司申购费率优惠的公告	2017-04-26
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金开放申购、赎回业务公告	2017-06-07
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金关于运用股指期货对冲的投资策略执行情况公告	2017-06-08
关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金参加交通银行股份有限公司基金手机银行申购及定投优惠活动的公告	2017-06-30
关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金参加交通银行股份有限公司网上银行基金申购手续费费率优惠活动的公告	2017-07-01
中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金所持乐视网股票（300104）估值调整的公告	2017-07-08

中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 2017 年第 2 季度报告	2017-07-21
关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金参加华西证券股份有限公司基金申购及定投费率优惠活动的公告	2017-07-27
关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金开通华泰证券股份有限公司基金定投业务并参加基金申购及定投费率优惠活动的公告	2017-07-29
中邮创业基金管理股份有限公司关于增加上海凯石财富基金销售有限公司为代销机构的公告	2017-08-02
关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金调整上海凯石财富基金销售有限公司申购起点金额、开通基金定投业务并参加基金申购及定投费率优惠活动的公告	2017-08-02
关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金调整上海长量基金销售投资顾问有限公司申购起点金额并参加基金申购费率优惠活动的公告	2017-08-11
中邮创业基金管理股份有限公司关于增加上海长量基金销售投资顾问有限公司为代销机构的公告	2017-08-11
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金更新招募说明书（2017 年第 2 号）	2017-08-12
中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金所持尔康制药股票（300267）估值调整的公告	2017-08-12
中邮创业基金管理股份有限公司关于增加上海基煜基金销售有限公司为代销机构的公告	2017-08-16
关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金参加上海基煜基金销售有限公司基金申购费率优惠活动的公告	2017-08-16
关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金调整深圳前海凯恩斯基金销售有限公司、大泰金石基金销售有限公司申购起点金额、开通基金定投业务并参加基金申购及定投费率优惠活动的公告	2017-08-17
中邮创业基金管理股份有限公司关于增加深圳前海凯恩斯基金销售有限公司、大泰金石基金销售有限公司为代销机构的公告	2017-08-17
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 2017 年半年度报告	2017-08-29
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金开放申购、赎回业务公告	2017-09-06
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金关于运用股指期货对冲的投资策略执行情况公告	2017-09-07
中邮创业基金管理股份有限公司关于代销机构调整基金申购金额下限的公告	2017-09-20
关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金参加上海利得基金销售有限公司基金申购费率优惠活动的公告	2017-09-20
中邮创业基金管理股份有限公司关于增加上海利得基金销售有限公司为代销机构的公告	2017-09-20
关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金调整凤凰金信（银川）基金销售有限公司申购起点金额、开通基金定投业务并参加基金申购及定投费率优惠活动的公告	2017-09-25

中邮创业基金管理股份有限公司关于增加凤凰金信（银川）基金销售有限公司为代销机构的公告	2017-09-25
关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金调整上海联泰资产管理有限公司开通基金定投业务并参加基金申购及定投费率优惠活动的公告	2017-09-25
中邮创业基金管理股份有限公司关于增加上海联泰资产管理有限公司为代销机构的公告	2017-09-25
中邮创业基金管理股份有限公司关于调整北京创金启富投资管理有限公司基金申购金额下限的公告	2017-09-28
关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金开通北京创金启富投资管理有限公司基金定投业务并参加基金申购及定投费率优惠活动的公告	2017-09-28
中邮创业基金管理股份有限公司关于增加北京创金启富投资管理有限公司为代销机构的公告	2017-09-28
关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金调整北京蛋卷基金销售有限公司申购起点金额、开通基金定投业务并参加基金申购及定投费率优惠活动的公告	2017-10-12
中邮创业基金管理股份有限公司关于增加北京蛋卷基金销售有限公司为代销机构的公告	2017-10-12
中邮创业基金管理股份有限公司关于代销机构调整基金申购金额下限的公告	2017-10-26
关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金开通北京汇成基金销售有限公司基金定投业务并参加基金申购及定投费率优惠活动的公告	2017-10-26
中邮创业基金管理股份有限公司关于增加北京汇成基金销售有限公司为代销机构的公告	2017-10-26
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 2017 年第 3 季度报告	2017-10-26
中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金所持乐视网股票（300104）估值调整的公告	2017-10-28
中邮创业基金管理股份有限公司关于增加通华财富（上海）基金销售有限公司、南京苏宁基金销售有限公司为代销机构的公告	2017-11-09
中邮创业基金管理股份有限公司关于增加世纪证券有限责任公司为代销机构的公告	2017-11-09
关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金调整通华财富（上海）基金销售有限公司、南京苏宁基金销售有限公司申购起点金额并参加基金申购费率优惠活动的公告	2017-11-09
中邮创业基金管理股份有限公司关于代销机构调整基金申购金额下限的公告	2017-11-16
关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金开通宜信普泽投资顾问（北京）有限公司基金定投业务并参加基金申购及定投费率优惠活动的公告	2017-11-16
中邮创业基金管理股份有限公司关于增加宜信普泽投资顾问（北京）有限公司为代销机构的公告	2017-11-16

中邮创业基金管理股份有限公司关于代销机构调整基金申购金额下限的公告	2017-11-23
关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金开通深圳市新兰德证券投资咨询有限公司基金定投业务并参加基金申购及定投费率优惠活动的公告	2017-11-23
中邮创业基金管理股份有限公司关于增加深圳市新兰德证券投资咨询有限公司为代销机构的公告	2017-11-23
关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金开通南京证券股份有限公司基金定投业务并参加基金申购及定投费率优惠活动的公告	2017-11-30
中邮创业基金管理股份有限公司关于增加南京证券股份有限公司为代销机构的公告	2017-11-30
关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金调整上海华夏财富投资管理有限公司申购起点金额、开通基金定投业务并参加基金申购及定投费率优惠活动的公告	2017-12-07
中邮创业基金管理股份有限公司关于增加上海华夏财富投资管理有限公司为代销机构的公告	2017-12-07
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金开放申购、赎回业务公告	2017-02-07
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金关于运用股指期货对冲的投资策略执行情况公告	2017-12-08
关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金参加交通银行股份有限公司基金手机银行申购及定投优惠活动的公告	2017-12-29
关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金调整代销机构申购起点金额、开通基金定投业务并参加基金申购及定投费率优惠活动的公告	2018-01-16
中邮创业基金管理股份有限公司关于增加深圳盈信基金销售有限公司、华瑞保险销售有限公司、北京植信基金销售有限公司为代销机构的公告	2018-01-16
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 2017 年第 4 季度报告	2018-01-20
关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金调整北京展恒基金销售股份有限公司申购起点金额、开通基金定投业务并参加基申购及定投费率优惠活动的公告	2018-02-01
中邮创业基金管理股份有限公司关于增加北京展恒基金销售股份有限公司为代销机构的公告	2018-02-01
关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金调整代销机构申购起点金额、开通基金定投业务并参加基金申购及定投费率优惠活动的公告	2018-02-06
中邮创业基金管理股份有限公司关于增加深圳市前海排排网基金销售有限责任公司为代销机构的公告	2018-02-06
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金更新招募说明书（2018 年第 1 号）	2018-02-12
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金开放申购、赎回业务公告	2018-03-07

中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金关于运用股指期货对冲的投资策略执行情况公告	2018-03-08
关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金调整一路财富（北京）信息科技股份有限公司申购起点金额、开通基金定投业务并参加基金申购及定投费率优惠活动的公告	2018-03-13
中邮创业基金管理股份有限公司关于增加一路财富（北京）信息科技股份有限公司为代销机构的公告	2018-03-13
关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金调整代销机构申购起点金额、开通基金定投业务并参加基金申购及定投费率优惠活动的公告	2018-03-23
中邮创业基金管理股份有限公司关于增加厦门市鑫鼎盛控股有限公司、北京坤元基金销售有限公司为代销机构的公告	2018-03-23
关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金调整代销机构申购起点金额、开通基金定投业务并参加基金申购及定投费率优惠活动的公告	2018-03-28
中邮创业基金管理股份有限公司关于增加诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司、深圳众禄基金销售股份有限公司为代销机构的公告	2018-03-28
关于修改中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同等法律文件的公告	2018-03-29
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同（摘要）	2018-03-29
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同	2018-03-29
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金托管协议	2018-03-29
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金招募说明书（更新）	2018-03-29
关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金参加交通银行股份有限公司基金手机银行申购及定投优惠活动的公告	2018-03-30
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 2017 年年度报告	2018-03-30
中邮创业基金管理股份有限公司关于增加蚂蚁（杭州）基金销售有限公司为代销机构的公告	2018-04-21
关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金调整蚂蚁（杭州）基金销售有限公司申购起点金额并参加基金申购费率优惠活动的公告	2018-04-21
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 2018 年第 1 季度报告	2018-04-23
关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金开通银河证券基金定投业务并参加基金申购及定投费率优惠活动的公告	2018-05-18
关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金调整代销机构申购起点金额、开通基金定投业务并参加基金申购及定投费率优惠活动的公告	2018-05-24
中邮创业基金管理股份有限公司关于增加珠海盈米财富管理有限公司为代销机构的公告	2018-05-24
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金开放申购、赎	2018-06-06

回业务公告	
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金关于运用股指期货对冲的投资策略执行情况公告	2018-06-07
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理变更公告	2018-06-26
关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金参加交通银行股份有限公司基金手机银行申购及定投优惠活动的公告	2018-06-29
关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金调整代销机构申购起点金额、开通基金定投业务并参加基金申购及定投费率优惠活动的公告	2018-07-07
中邮创业基金管理股份有限公司关于增加泰诚财富基金销售（大连）有限公司、奕丰金融服务（深圳）有限公司为代销机构的公告	2018-07-07
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 2018 年第 2 季度报告	2018-07-19
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金更新招募说明书（2018 年 2 号）	2018-08-11
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 2018 年半年度报告	2018-08-28
关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金增加代销机构的公告	2018-09-06
关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金调整代销机构申购起点金额并参加基金申购费率优惠活动的公告	2018-09-06
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金开放申购、赎回业务公告	2018-09-12
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金关于运用股指期货对冲的投资策略执行情况公告	2018-09-13
关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金调整代销机构申购起点金额、开通基金定投业务并参加基金申购及定投费率优惠活动的公告	2018-09-20
中邮创业基金管理股份有限公司关于增加大连网金基金销售有限公司、上海挖财基金销售有限公司为代销机构的公告	2018-09-20
关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金调整代销机构申购起点金额、开通基金定投业务并参加基金申购及定投费率优惠活动的公告	2018-09-27
中邮创业基金管理股份有限公司关于增加喜鹊财富基金销售有限公司为代销机构的公告	2018-09-27
关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金参加交通银行股份有限公司基金手机银行申购及定投优惠活动的公告	2018-09-29
关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金调整代销机构申购起点金额、开通基金定投业务并参加基金申购及定投费率优惠活动的公告	2018-10-19
中邮创业基金管理股份有限公司关于增加武汉市伯嘉基金销售有限公司、上海有鱼基金销售有限公司为代销机构的公告	2018-10-19
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 2018 年第 3 季	2018-10-24

度报告	
关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金调整代销机构申购起点金额、开通基金定投业务并参加基金申购及定投费率优惠活动的公告	2018-10-25
中邮创业基金管理股份有限公司关于增加上海攀赢基金销售有限公司、成都华羿恒信基金销售有限公司为代销机构的公告	2018-10-25
关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金参加代销机构基金申购及定投费率优惠活动的公告	2018-11-01
关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金参加代销机构基金申购及定投申购费率优惠活动的公告	2018-11-09
中邮创业基金管理股份有限公司关于增加西藏东方财富证券股份有限公司为代销机构的公告	2018-11-21
关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金调整代销机构申购起点金额并参加基金申购费率优惠活动的公告	2018-11-21
中邮创业基金管理股份有限公司关于增加长江证券股份有限公司为代销机构的公告	2018-12-07
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金开放申购、赎回业务公告	2018-12-12
中邮创业基金管理股份有限公司关于增加沈阳麟龙投资顾问有限公司为代销机构的公告	2018-12-13
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金关于运用股指期货对冲的投资策略执行情况公告	2018-12-13
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理变更公告	2018-12-20
关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金调整代销机构申购起点金额并参加基金申购费率优惠活动的公告	2019-01-03
中邮创业基金管理股份有限公司关于增加深圳前海财厚基金销售有限公司为代销机构的公告	2019-01-03
中邮创业基金管理股份有限公司 关于网上直销平台、官方微信平台申购及定投费率优惠的公告	2019-01-04
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 2018 年第 4 季度报告	2019-01-22
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金更新招募说明书（2019 年 1 号）	2019-02-02
关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金参加代销机构基金申购及定投费率优惠活动的公告	2019-02-20
中邮创业基金管理有限公司关于增加阳光人寿保险股份有限公司为代销机构的公告	2019-03-05
关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金开通基金定投业务并参加基金申购及定投申购费率优惠活动的公告	2019-03-05
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金开放申购、赎回业务公告	2019-03-06
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金关于运用股指期货对冲的投资策略执行情况公告	2019-03-07

关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金参加基金申购费率优惠活动的公告	2019-03-07
中邮创业基金管理股份有限公司关于增加江苏天鼎证券投资咨询有限公司为代销机构的公告	2019-03-07
中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分开放式基金开展赎回费率优惠活动的公告	2019-03-08
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 2018 年年度报告	2019-03-28
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 2019 年第 1 季度报告	2019-04-19
中邮创业基金管理股份有限公司关于增加海银基金销售有限公司等机构为代销机构的公告	2019-05-22
中邮创业基金管理股份有限公司直销平台认购费率及申购费率优惠的公告	2019-05-24
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金开放申购、赎回业务公告	2019-06-12
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金关于运用股指期货对冲的投资策略执行情况公告	2016-06-13
中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金可投资于科创板股票的公告	2019-06-21
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 2019 年第 2 季度报告	2019-07-19
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金更新招募说明书（2019 年 2 号）	2019-08-02
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 2019 年半年度报告	2019-08-26
中邮创业基金管理股份有限公司关于调整旗下部分基金最低赎回份额及最低持有份额的公告	2019-09-05
关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金开通海银基金销售有限公司基金定投业务并参加基金申购及定投费率优惠活动的公告	2019-09-10
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金暂停大额申购业务公告	2019-09-10
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金开放申购、赎回业务公告	2019-09-10
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金关于运用股指期货对冲的投资策略执行情况公告	2019-09-11
关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金参加代销机构基金申购费率优惠活动的公告	2019-10-17
中邮创业基金管理股份有限公司关于增加扬州国信嘉利基金销售有限公司为代销机构的公告	2019-10-17
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 2019 年第 3 季度报告	2019-10-24
关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金 开通深圳前海微众银行股份有限公司基金定投业务 并参加基金申购及定投费率优惠	2019-11-06

活动的公告	
中邮创业基金管理股份有限公司 关于调整代销机构基金申购金额下限的公告	2019-11-06
中邮创业基金管理股份有限公司 关于代销机构调整基金申购、定投金额下限的公告	2019-11-07
中邮创业基金管理股份有限公司关于增加江苏汇林保大基金销售有限公司为代销机构的公告	2019-11-07
关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金 参加代销机构基金申购费率优惠活动的公告	2019-11-07
中邮绝对收益策略定期开放混合型证券投资基金托管协议	2019-12-10
中邮创业基金管理股份有限公司关于修改旗下中邮绝对收益策略定基金合同等法律文件的公告	2019-12-10
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同(更新)	2019-12-10
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金招募说明书摘要（更新 ）	2019-12-10
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金招募说明书（更新 ）	2019-12-10
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金开放申购、赎回业务公告	2019-12-11
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金关于运用股指期货对冲的投资策略执行情况公告	2019-12-12
关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金参加交通银行股份有限公司手机银行基金申购及定投申购费率优惠活动的公告	2020-01-02
关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金开通北京植信基金销售有限公司基金定投业务并参加定投费率优惠活动的公告	2020-01-06
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 2019 年第 4 季度报告	2020-01-18
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式 证券投资基金基金经理变更公告	2020-01-21
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式 证券投资基金招募说明书（更新）	2020-01-22
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式 证券投资基金招募说明书摘要（更新）	2020-01-21
关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金 参加深圳前海微众银行股份有限公司基金申购及定投优惠活动的公告	2020-02-25
关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金开通万家财富基金销售（天津）有限公司基金定投业务并参加基金申购及定投费率优惠活动的公告	2020-02-28
关于中邮创业基金管理股份有限公司增加中信期货有限公司为代销机构 并开通中信期货有限公司基金定投业务的公告	2020-03-03
中邮创业基金管理股份有限公司关于增加中国邮政储蓄银行股份有限公司为代销机构的公告	2020-03-03

中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金开放申购、赎回业务公告	2020-03-07
中邮创业基金管理股份有限公司关于中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金增加代销机构的公告	2020-03-10
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金关于运用股指期货对冲的投资策略执行情况公告	2020-03-11
关于中邮创业基金管理股份有限公司参加代销机构基金申购费率优惠活动的公告	2020-03-13
关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金开通基金定投业务并参加基金申购及定投申购费率优惠活动的公告	2020-03-18
关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金参加 中国民生银行股份有限公司基金申购费率优惠活动的公告	2020-03-27
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 2019 年年度报告	2020-04-20
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 2020 年第 1 季度报告	2020-04-22
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金开放申购、赎回业务公告	2020-06-09
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金关于运用股指期货对冲的投资策略执行情况公告	2020-06-10
中邮创业基金管理股份有限公司关于代销机构调整基金申购及定投起点金额下限的公告	2020-06-18
关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下基金参加交通银行股份有限公司基金申购及定投费率优惠活动的公告	2020-07-01
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 2020 年第 2 季度报告	2020-07-21
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金产品资料概要（更新）	2020-08-28
中邮绝对收益策略定期开放混合型 发起式证券投资基金 2020 年中期报告	2020-08-29
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金开放申购、赎回业务公告	2020-09-09
中邮创业基金管理股份有限公司关于增加代销机构并参加基金费率优惠活动的公告	2020-09-16
中邮创业基金管理股份有限公司关于增加汇成基金为代销机构并参加基金费率优惠活动的公告	2020-09-16
中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金 开通定投业务并参加费率优惠活动的公告	2020-09-22
中邮创业基金管理股份有限公司关于增加中国人寿为代销机构的公告	2020-09-22
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金招募说明书（更新）	2020-09-29
中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金开通定投业务并参加费率优惠活动的公告	2020-10-21

中邮创业基金管理股份有限公司关于增加玄元保险为代销机构的公告	2020-10-21
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 2020 年第 3 季度报告	2020-10-28
旗下部分基金开通定投业务并参加费率优惠活动的公告	2020-11-13
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金开放申购、赎回业务公告	2020-12-09
中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金赎回费率优惠活动的公告	2020-12-09
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金关于运用股指期货对冲的投资策略执行情况公告	2020-12-10
中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加平安银行股份有限公司费率优惠活动的公告	2020-12-28
中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加中国邮政储蓄银行股份有限公司费率优惠活动的公告	2020-12-31
中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加交通银行股份有限公司费率优惠活动的公告	2020-12-31
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	2021-01-22
中邮创业基金管理股份有限公司关于中邮绝对收益赎回费率优惠活动的公告	2021-03-01
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金开放申购、赎回业务公告	2021-03-10
中邮绝对收益策略定期开放混合型 发起式证券投资基金 2020 年年度报告	2021-03-11
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金关于运用股指期货对冲的投资策略执行情况公告	2021-03-11
中邮创业基金管理股份有限公司关于珠海盈米调整基金申购及定投起点金额下限的公告	2021-03-26
中邮创业基金管理股份有限公司关于增加北京度小满基金销售有限公司为代销机构并参加费率优惠的公告	2021-04-19
中邮创业基金管理股份有限公司关于调整特定投资群体通过直销柜台申购旗下部分基金费率优惠方案的公告	2021-04-22
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	2021-04-22
中邮创业基金管理股份有限公司关于玄元保险调整基金申购起点金额下限的公告	2021-05-27
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金开放申购、赎回业务公告	2021-06-09
中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加交通银行股份有限公司费率优惠活动的公告	2021-06-10
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金关于运用股指期货对冲的投资策略执行情况公告	2021-06-11
中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加中国邮政储蓄	2021-06-17

银行股份有限公司费率优惠活动的公告	
中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加费率优惠活动的公告	2021-06-30
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 2021 年第 2 季度报告	2021-07-21
关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金 参加招商证券股份有限公司费率优惠活动的公告	2021-07-29
中邮创业基金管理股份有限公司关于增加腾安基金 为代销机构并参加基金费率优惠活动的公告	2021-07-30
中邮绝对收益策略定期开放混合型 发起式证券投资基金托管协议	2021-07-30
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起 式证券投资基金基金合同	2021-07-30
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式 证券投资基金招募说明书（更新）	2021-07-30
中邮创业基金管理股份有限公司 关于根据《侧袋机制指引》修改旗下基金基金合同的公告	2021-07-30
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 基金产品资料概要（更新）	2021-07-30
中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金 参加兴业银行费率优惠活动的公告	2021-08-03
关于调整中邮旗下部分基金申购及定投起点金额 并参加其费率优惠活动的公告	2021-08-17
关于调整中邮旗下部分基金申购及定投起点金额 并参加其费率优惠活动的公告	2021-08-23
关于调整中邮旗下部分基金申购及定投起点金额 并参加其费率优惠活动的公告	2021-08-24
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 2021 年中期报告	2021-08-31
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 开放申购、赎回业务公告	2021-09-08
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 关于运用股指期货对冲的投资策略执行情况公告	2021-09-09
中邮创业基金管理股份有限公司关于调整旗下部分基金在 上海天天基金销售有限公司申购及定投起点金额的公告	2021-09-23
中邮创业基金管理股份有限公司关于增加泰信财富基金销售有限公司为代销机构并参加其费率优惠的公告	2021-09-28
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 2021 年第 3 季度报告	2021-10-27
中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加华安证券股份有限公司费率优惠活动的公告	2021-11-16
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金招募说明书（更新）	2021-11-24
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金产品资料概要（更新）	2021-11-24

中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金关于运用股指期货对冲的投资策略执行情况公告	2021-12-08
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金开放申购、赎回业务公告	2021-12-08
中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在部分销售机构暂停定期定额投资业务的公告	2021-12-08
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	2022-01-24
中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加宁波银行股份有限公司为代销机构及开通相关业务的公告	2022-02-18
中邮创业基金管理股份有限公司关于调整旗下部分基金在浙江同花顺基金销售有限公司申购及定投起点金额的公告	2022-03-08
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 开放申购、赎回业务公告	2022-03-09
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金关于运用股指期货对冲的投资策略执行情况公告	2022-03-10
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 2021 年年度报告	2022-03-11
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理变更公告	2022-04-02
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金产品资料概要（更新）	2022-04-07
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金招募说明书（更新）	2022-04-07
中邮创业基金管理股份有限公司关于调整旗下部分基金在北京雪球基金销售有限公司申购及定投起点金额的公告	2022-04-15
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理变更公告	2022-04-19
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金产品资料概要（更新）	2022-04-20
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金招募说明书（更新）	2022-04-20
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	2022-04-22
中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在广发证券股份有限公司开通定投业务并参加其费率优惠活动的公告	2022-04-26
中邮创业基金管理股份有限公司关于调整旗下部分基金在北京微动利基金销售有限公司申购及定投起点金额的公告	2022-05-25
中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在申万宏源证券有限公司开通定投业务并参加其费率优惠活动的公告	2022-05-26
中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在申万宏源西部证券有限公司开通定投业务并参加其费率优惠活动的公告	2022-05-27
中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在万家财富基金销售有限公司开通定投业务并调整其申购及定投起点金额的公告	2022-05-31

中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金开放申购、赎回业务公告	2022-06-08
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金关于运用股指期货对冲的投资策略执行情况公告	2022-06-09
中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在和讯信息科技有限公司开通定投业务并参加其费率优惠活动的公告	2022-06-20
中邮创业基金管理股份有限公司关于调整旗下部分基金在首创证券股份有限公司申购及定投起点金额的公告	2022-06-22
中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分公开募集证券投资基金可投资北交所上市股票的风险提示性公告	2022-07-01
中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在上海陆金所基金销售有限公司开通定投业务并调整其起点金额的公告	2022-07-12
中邮创业基金管理股份有限公司关于调整旗下部分基金在北京雪球基金销售有限公司申购及定投起点金额的公告	2022-07-14
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式 证券投资基金招募说明书（更新）	2022-07-20
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金产品资料概要（更新）	2022-07-20
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 2022 年第 2 季度报告	2022-07-21
中邮创业基金管理股份有限公司关于调整旗下部分基金在中国人寿保险股份有限公司申购及定投起点金额的公告	2022-08-08
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 2022 年中期报告	2022-08-31
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金开放申购、赎回业务公告	2022-09-06
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金关于运用股指期货对冲的投资策略执行情况公告	2022-09-07
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金关于运用股指期货对冲的投资策略执行情况公告	2022-09-07
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 2022 年第 3 季度报告	2022-10-26
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 2022 年第 3 季度报告	2022-10-26
中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在直销平台开展费率优惠活动的公告	2022-11-14
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金开放申购、赎回业务公告	2022-12-07
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金关于运用股指期货对冲的投资策略执行情况公告	2022-12-07
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	2023-01-20
中邮创业基金管理股份有限公司关于调整旗下部分基金在南京证券股份有限公司申购及定投起点金额的公告	2023-02-01

中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加泛华普益基金销售有限公司为代销机构及开通相关业务的公告	2023-02-06
中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加博时财富基金销售有限公司为代销机构及开通相关业务的公告	2023-02-06
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金关于运用股指期货对冲的投资策略执行情况公告	2023-03-08
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金开放申购、赎回业务公告	2023-03-08
中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加上海中欧财富基金销售有限公司为代销机构及开通相关业务的公告	2023-03-23
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 2022 年年度报告	2023-03-30
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	2023-04-22
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金关于运用股指期货对冲的投资策略执行情况公告	2023-06-07
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金开放申购、赎回业务公告	2023-06-07
中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加上海陆享基金销售有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	2023-06-30
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 2023 年第 2 季度报告	2023-07-21
中邮创业基金管理股份有限公司中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金的关联交易公告	2023-08-23
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起 式证券投资基金基金合同	2023-08-25
中邮绝对收益策略定期开放混合型 发起式证券投资基金托管协议	2023-08-25
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金招募说明书（更新）	2023-08-25
中邮创业基金管理股份有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告	2023-08-25
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 基金产品资料概要（更新）	2023-08-25
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 2023 年中期报告	2023-08-31
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金关于运用股指期货对冲的投资策略执行情况公告	2023-09-06
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金开放申购、赎回业务公告	2023-09-06
中邮创业基金管理股份有限公司关于调整旗下部分基金在京东肯特瑞基金销售有限公司申购及定投起点金额的公告	2023-09-19
中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加麦高证券有限责任公司为代销机构及开通相关业务的公告	2023-10-10
中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加贵州省贵文文	2023-10-25

化基金销售有限公司为代销机构及开通相关业务的公告	
中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加和信证券投资咨询股份有限公司为代销机构及开通相关业务的公告	2023-10-25
中邮绝对收益策略定期开放混合型 发起式证券投资基金 2023 年第 3 季度报告	2023-10-25
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金关于运用股指期货对冲的投资策略执行情况公告	2023-12-06
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金开放申购、赎回业务公告	2023-12-06
中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加上海华夏财富投资管理有限公司为代销机构及开通相关业务的公告	2023-12-22
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	2024-01-22
中邮创业基金管理股份有限公司基金改聘会计师事务所公告	2024-01-30
中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在华泰证券股份有限公司开通定投业务并参加其费率优惠活动的公告	2024-01-30
中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加国金证券股份有限公司为代销机构及开通相关业务的公告	2024-02-26
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回业务公告	2024-03-26
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金关于运用股指期货对冲的投资策略执行情况公告	2024-03-26
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 2023 年年度报告	2024-03-28
中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加万联证券股份有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	2024-04-15
中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在中国中金财富证券有限公司开通定投业务并参加其费率优惠活动的公告	2024-04-16
中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加光大证券股份有限公司费率优惠活动的公告	2024-04-17
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	2024-04-22
中邮创业基金管理股份有限公司关于在中国邮政储蓄银行股份有限公司开通基金转换业务及参加 转换补差费率优惠活动的公告	2024-04-25
中邮创业基金管理股份有限公司关于在兴业银行股份有限公司开通基金转换业务的公告	2024-05-17
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回业务公告	2024-06-12
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金关于运用股指期货对冲的投资策略执行情况公告	2024-06-13
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新	2024-06-19
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 2024 年第 2	2024-07-19

季度报告	
中邮创业基金管理股份有限公司关于在中国民生银行股份有限公司开通基金转换业务的公告	2024-07-23
中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在东北证券股份有限公司开通定投业务并参加其费率优惠活动的公告	2024-07-26
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 2024 年中期报告	2024-08-30
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回业务公告	2024-09-09
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金关于运用股指期货对冲的投资策略执行情况公告	2024-09-11
中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加上海中正达广基金销售有限公司为代销机构及开通相关业务的公告	2024-09-13
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 2024 年第 3 季度报告	2024-10-25
中邮创业基金管理股份有限公司关于调整旗下部分基金在奕丰基金销售有限公司申购及定投起点金额的公告	2024-11-08
中邮创业基金管理股份有限公司 关于旗下部分基金增加东吴证券股份有限公司为代销机构 及开通相关业务的公告	2024-11-18
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 基金产品资料概要更新	2024-11-26
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式 证券投资基金招募说明书（更新）	2024-11-26
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 开放日常申购、赎回业务公告	2024-12-11
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 关于运用股指期货对冲的投资策略执行情况公告	2024-12-12
中邮创业基金管理股份有限公司 关于旗下部分基金增加中邮证券有限责任公司为代销机构 及开通相关业务的公告	2024-12-13
中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在通华财富（上海）基 金销售有限公司开通定投业务并调整起点金额的公告	2024-12-19
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 2024 年第 4 季度报告	2025-01-22
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 开放日常申购、赎回业务公告	2025-03-12
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 关于运用股指期货对冲的投资策略执行情况公告	2025-03-13
中邮创业基金管理股份有限公司 关于旗下部分基金增加海通证券股份有限公司为代销机构 及开通相关业务的公告	2025-03-17
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 2024 年年度报告	2025-03-28
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 基金经理变更公告	2025-04-02

中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 基金经理变更公告	2025-04-03
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式 证券投资基金招募说明书（更新）	2025-04-03
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 基金产品资料概要更新	2025-04-03
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	2025-04-22
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 开放日常申购、赎回业务公告	2025-06-11
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 关于运用股指期货对冲的投资策略执行情况公告	2025-06-12
中邮创业基金管理股份有限公司 关于旗下部分基金增加华宝证券股份有限公司为代销机构 及开通相关业务的公告	2025-07-10
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 2025 年第 2 季度报告	2025-07-21
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 2025 年中期报告	2025-08-29
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式 证券投资基金招募说明书（更新）	2025-09-02
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 基金产品资料概要更新	2025-09-02
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 基金经理变更公告	2025-09-02
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 开放日常申购、赎回业务公告	2025-09-10
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 关于运用股指期货对冲的投资策略执行情况公告	2025-09-11
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 2025 年第 3 季度报告	2025-10-28
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金招募说明书（更新）	2025-11-26
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新	2025-11-26
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回业务公告	2025-12-10
中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加世纪证券有限责任公司申购和定投费率优惠活动的公告	2025-12-10
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金关于运用股指期货对冲的投资策略执行情况公告	2025-12-11
中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加易方达财富管理基金销售（广州）有限公司为代销机构及开通相关业务的公告	2025-12-16
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	2026-01-22

中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回业务公告	2026-03-11
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金关于运用股指期货对冲的投资策略执行情况公告	2026-03-12
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金2025年年度报告	2026-03-20
中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加国泰海通证券股份有限公司申购和定投费率优惠活动的公告	2026-03-27
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金2026年第1季度报告	2026-04-22
中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金在中国银河证券股份有限公司开通基金转换业务的公告	2026-04-28
中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金在中国银河证券股份有限公司开通基金转换业务的公告	2026-04-29
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回业务公告	2026-06-10
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金关于运用股指期货对冲的投资策略执行情况公告	2026-06-11
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金2026年第2季度报告	2026-07-21
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金2026年中期报告	2026-08-31
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回业务公告	2026-09-09
中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金关于运用股指期货对冲的投资策略执行情况公告	2026-09-10

二十三、招募说明书存放及查阅方式

本招募说明书存放在基金管理人、基金托管人及基金销售机构住所，供投资者查阅，也可按工本费购买复印件。基金管理人和基金托管人保证其所提供的文本内容与所公告的内容完全一致。

投资者还可以直接登录基金管理人的网站(www.postfund.com.cn)查阅和下载招募说明书。

二十四、备查文件

（一） 中国证监会准予中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金募集注册的文件；

（二） 《中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》；

（三） 《中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金托管协议》；

（四） 《法律意见书》；

（五） 基金管理人业务资格批件和营业执照；

（六） 基金托管人业务资格批件和营业执照；

（七）中国证监会要求的其他文件。

存放地点：基金管理人、基金托管人处；

查阅方式：基金份额持有人可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

中邮创业基金管理股份有限公司

2026 年 11 月 20 日