

# 国都多策略混合型 证券投资基金

## 招募说明书 (更新) 2021 年第 2 号

基金管理人：国都证券股份有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

二零二一年六月

## 重要提示

本基金于 2017 年 9 月 22 日经中国证券监督管理委员会《关于准予国都多策略混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2017]1733 号文）注册募集。

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申请的注册，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。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等做出实质性判断或者保证。

证券投资基金（以下简称“基金”）是一种长期投资工具，其主要功能是分散投资，降低投资单一证券所蕴含的个别风险。基金不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具，投资者购买基金，既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益，也可能承担基金投资所带来的损失。

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

投资有风险，投资者认购或申购基金份额时应当认真阅读本基金的《基金合同》、《招募说明书》等信息披露文件，了解本基金的风险收益特征，自主判断基金的投资价值，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断本基金是否和投资者的风险承受能力相符，自主做出投资决策，自行承担投资风险。

投资者应当通过本基金管理人或其他销售机构认购、申购和赎回基金。本基金在募集期内按 1.00 元面值发售并不改变基金的风险收益特征。投资者按 1.00 元面值认购基金份额以后，有可能面临基金份额净值跌破 1.00 元、从而遭受损失的风险。

本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。

本基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。

## 目录

绪言.....	4
释义.....	5
基金管理人.....	10
基金托管人.....	26
相关服务机构.....	29
基金的募集安排.....	31
基金合同的生效.....	35
基金份额的申购与赎回.....	36
基金的投资.....	45
基金的业绩.....	55
基金的财产.....	57
基金资产估值.....	58
基金收益与分配.....	63
基金的费用与税收.....	65
基金的会计与审计.....	67
基金的信息披露.....	68
侧袋机制.....	74
风险揭示.....	76
基金合同的变更、终止与基金财产的清算.....	83
基金合同内容摘要.....	85
基金托管协议的内容摘要.....	100
对基金份额持有人的服务.....	114
其它应披露事项.....	116
招募说明书存放及查阅方式.....	119
备查文件.....	120

## 绪言

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》）、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》（以下简称《销售办法》）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第5号<招募说明书的内容与格式>》等有关法律法规以及《国都多策略混合型证券投资基金基金合同》编写。

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

本招募说明书根据本基金的基金合同编写,并经中国证监会注册。基金合同是约定基金合同当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资者自依基金合同取得基金份额起,即成为基金份额持有人和基金合同的当事人,投资者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》、基金合同及其它有关规定享有权利、承担义务。基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的50%,但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过50%的除外。

## 释义

本《招募说明书》中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有以下含义：

- 1、基金或本基金：指国都多策略混合型证券投资基金
- 2、基金管理人：指国都证券股份有限公司
- 3、基金托管人：指兴业银行股份有限公司
- 4、基金合同：指《国都多策略混合型证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充
- 5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《国都多策略混合型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
- 6、招募说明书或本招募说明书：指《国都多策略混合型证券投资基金招募说明书》及其更新
- 7、基金份额发售公告：指《国都多策略混合型证券投资基金基金份额发售公告》
- 8、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
- 9、《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，经 2012 年 12 月 28 日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自 2013 年 6 月 1 日起实施，并经 2015 年 4 月 24 日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修改的《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
- 10、《销售办法》：指中国证监会 2020 年 8 月 28 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 11、《信息披露办法》：指中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1 日实施的，并经 2020 年 3 月 20 日中国证监会《关于修改部分证券期货规章的决定》修正的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 12、《运作办法》：指中国证监会 2014 年 7 月 7 日颁布、同年 8 月 8 日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 13、《流动性风险管理规定》：指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10 月 1 日实施的

《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订

14、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

15、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

16、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

17、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

18、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、社会团体或其它组织

19、合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者境内证券期货投资管理办法》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

20、人民币合格境外机构投资者：指按照《合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者境内证券期货投资管理办法》及相关法律法规规定，运用来自境外的人民币资金进行境内证券投资的境外法人

21、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

22、基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人

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

24、销售机构：指国都证券股份有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其它条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务协议，办理基金销售业务的机构

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

26、登记机构：指办理登记业务的机构。基金的登记机构为国都证券股份有限公司或接受国都证券股份有限公司委托代为办理登记业务的机构

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

28、基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构办理认购、申

购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户

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

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

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

32、存续期：指基金合同生效日至终止日之间的不定期期限

33、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

34、T日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日

35、T+n日：指自T日起第n个工作日(不包含T日)

36、开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

37、开放时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

38、《业务规则》：指基金管理人、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则 and 规定，由基金管理人和投资人共同遵守

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

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

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

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

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

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

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

上一开放日基金总份额的 10%

46、元：指人民币元

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

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

49、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

50、基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

51、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，但中国证监会认可的特殊情形除外

52、7 个工作日可变现资产：指可在交易所、银行间市场正常交易的股票、债券、非金融企业债务融资工具及同业存单，7 个工作日内到期或可支取的逆回购、银行存款，7 个工作日内能够确认收到的各类应收款项等

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

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

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

56、不可抗力：指基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

57、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

58、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



59、基金产品资料概要：指《国都创新驱动灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要》及其更新

## 基金管理人

### （一）基金管理人基本情况

#### 1、基本信息

名称：国都证券股份有限公司

注册地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层

办公地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层

法定代表人：翁振杰

成立日期：2001年12月28日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监机构字[2001]309号

公募基金管理业务资格批文及文号：中国证监会证监许可[2014]854号

注册资本：583000.0009万元人民币

存续期间：持续经营

联系人：李梦潇

电话：010-84183297

传真：010-84183129

经营范围：证券经纪；证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问；证券承销与保荐；证券自营；证券资产管理；证券投资基金代销；为期货公司提供中间介绍业务；融资融券业务；代销金融产品业务；公开募集证券投资基金管理业务。

股权结构：

序号	股东名称	持股比例(%)
1	中诚信托有限责任公司	13.3264
2	北京国际信托有限公司	9.5873
3	国华能源投资有限公司	7.6933
4	同方金融控股（深圳）有限公司	5.9517
5	重庆国际信托股份有限公司	5.2820

（以上为前五大股东，截至2020年12月31日。）

#### 2、部门设置情况

国都证券股份有限公司产品与业务审核委员会对包含基金在内的各类金融产品和业务（含基金管理业务、资产管理业务、创新业务、柜台业务等）的开发、销售和运作的重大事项进行审议和决策。国都证券股份有限公司设立了公募证券投资基金管理业务投资决策委员会对基金投资的重大事项进行集体决策。基金管理部负责公募证券投资基金业务。基金管理部人员分别负责投资、研究、运营和交易职能：投资人员负责公募基金的投资运作，具体包括行业和上市股票投资，固定收益市场的投资，以及其他投资品种的研究和投资业务；研究人员负责根据经济、政策、股市情况，为投资部提供投资策略，并负责对各基金产品进行绩效评价；运营人员负责根据监管机构及产品合同的要求对产品信息进行披露、传达、解读监管机构的各项政策；交易人员负责根据证监会、交易所、协会以及公司的相关法规和管理办法，负责各公募基金产品的日常交易与复核工作。

## （二）主要人员情况

### 1、董事会成员

翁振杰先生，1962年10月出生，中国国籍，无境外永久居留权，民建会员，于1986年7月毕业于解放军南京通信工程学院通信与电子系统专业，硕士研究生学历。自1986年7月至1999年9月，在解放军通信学院担任教官；自1999年9月至2001年12月，在北京中关村科技发展（控股）股份有限公司担任副总经理；自2002年2月至2005年3月，在重庆国际信托投资有限公司担任董事；自2005年3月至2014年11月，在重庆国际信托有限公司担任首席执行官、董事；自2007年12月至2010年2月，在重庆三峡银行股份有限公司担任董事长；自2010年1月至2012年8月，在西南证券股份有限公司担任董事长；自2014年11月至2015年9月，在重庆国际信托有限公司任董事长、首席执行官；自2015年9月至今，在重庆国际信托股份有限公司任董事长；自2016年2月至今，在国都证券股份有限公司任董事；自2020年4月至今，在国都证券股份有限公司任董事长。

黄磊先生，1979年1月出生，中国国籍，无境外永久居留权，中共党员，于2005年6月毕业于北京大学法律专业，硕士研究生学历。自2005年7月至2008年4月，在北京市人民检察院第二分院公诉二处任检察官；自2008年4月至2015年1月，在渣打银行（中国）有限公司法务部任高级经理；自2015年1月至2015年6月，在北京市金杜律师事务所任非诉讼、破产部主办律师；自2015年6月至今，在中诚信托有限责任公司任资产保全部总经理；自2020年3月至今，在国都证券股份有限公司任董事。

吴京林先生，1964年8月出生，中国国籍，无境外永久居留权，中共党员，于2007年5月毕业于美国德克萨斯大学阿灵顿商学院工商管理专业，硕士研究生学历，高级会计师。

自 1988 年 7 月至 1992 年 3 月，在北京市审计局任科员；自 1992 年 3 月至今，在北京国际信托有限公司历任财务部会计主管、稽核审计部经理助理、稽核审计部副经理、稽核审计部经理、计划财务部经理、副总会计师兼计划财务部经理、资产运营部经理、总会计师；自 2014 年 12 月至 2015 年 6 月，在国都证券有限责任公司任董事；自 2015 年 6 月至今，在国都证券股份有限公司任董事。

何于军先生，1969 年 9 月出生，中国国籍，无境外永久居留权，中共党员，于 1992 年 7 月毕业于成都地质学院（现成都理工大学）应用数学专业，本科学历。自 1992 年 7 月至 1997 年 12 月，任职于北京市地质调查研究院测绘部；自 1997 年 12 月至 2000 年 2 月，在华通会计师事务所审计二部任部门经理；自 2000 年 2 月至 2007 年 8 月，在利安达信隆会计师事务所证券业务三部任部门经理；自 2007 年 8 月至今，在国华能源投资有限公司风险控制部历任审计专员、副总经理、总经理，其中自 2012 年 6 月起至今兼任法律事务部总经理；自 2014 年 12 月至 2015 年 6 月，在国都证券有限责任公司任董事；自 2015 年 6 月至今，在国都证券股份有限公司任董事。

周立业先生，1963 年 8 月出生，中国国籍，无境外永久居留权，中共党员，于 1986 年 12 月毕业于清华大学核研院核物理专业，硕士研究生学历。自 1987 年 1 月至 2003 年 8 月，在清华大学核研院历任研究室副主任、主任，党支部副书记、书记，核研院党委委员、副院长；自 2003 年 7 月至 2017 年 12 月，在清华控股有限公司（原名称：清华大学企业集团）历任副总裁、董事兼总裁；自 2018 年 1 月至 2020 年 5 月，在清华控股有限公司任副董事长；自 2015 年 8 月至 2020 年 2 月，在同方股份有限公司任董事长、党委书记；自 2020 年 2 月至 2020 年 4 月，在同方股份有限公司任副董事长、总裁、党委书记；自 2020 年 4 月至今，在同方股份有限公司任党委书记；自 2020 年 3 月至今，在国都证券股份有限公司任董事。

唐喆先生，1979 年 4 月出生，中国国籍，无境外永久居留权，中共党员，于 2006 年 12 月毕业于中国科学院物理研究所凝聚态物理专业，博士研究生学历。自 2007 年 7 月至 2008 年 7 月，在新加坡国立大学理学院任博士后研究员；自 2009 年 10 月至 2011 年 11 月，在中国国际贸易促进委员会山东省委员会任行业分析员；自 2011 年 11 月至 2017 年 3 月，在山东海洋投资有限公司历任投资中心业务经理、投资经理，战略中心总经理助理，财务中心总经理助理、副总经理；自 2017 年 3 月至 2020 年 1 月，在山东海洋集团有限公司历任财务部副部长、投资部副部长、投资部副部长兼资深专家；自 2020 年 1 月至今，在山东海洋金融控股有限公司任首席投资官；自 2020 年 7 月至今，在山东蓝色经济创业投资有限公司任执行董事；自 2020 年 11 月至今，在北京海洋基石创业投资管理有限公司任董事长；自 2020

年3月至今，在国都证券股份有限公司任董事。

黄俞先生，1968年10月出生，中国国籍，无境外永久居留权，于2009年6月毕业于英国格林威治大学项目管理专业，硕士研究生学历。自1989年11月至1993年10月，在中农信公司历任经理、河北代表处副总经理；自1993年10月至1996年12月，在正大财务河北公司任副总经理；自1996年12月至2013年3月，在深圳市奥融信投资发展有限公司历任高级投资经理、董事长；自2013年3月至今，在深圳市奥融信投资发展有限公司任执行董事兼总经理；自2007年9月至今，在鹏华基金管理有限公司任监事会主席；自2009年9月至2019年12月，在深圳市华融泰资产管理有限公司任董事长；自2009年6月至2013年4月，在江西紫光医药有限公司任董事长；自2013年4月至2020年7月，在深圳华控赛格股份有限公司任董事长；自2015年11月至2020年1月，在同方股份有限公司历任副董事长、副董事长兼总裁；自2016年11月至2020年1月，在同方金融控股（深圳）有限公司任董事长兼总经理；自2020年3月至今，在国都证券股份有限公司任董事。

陈海宁先生，1963年12月出生，中国国籍，无境外永久居留权，中共党员，于1985年7月毕业于重庆建筑工程学院机电系工业设备安装工程专业，本科学历。自1985年9月至1993年2月，在中国华西企业公司任工程师；自1993年2月至1996年9月，在深圳市接待办公室任科长；自1996年9月至2004年9月，在深圳市捷宾实业发展有限公司任副总经理；自2004年9月至2011年9月，在深圳市远为实业有限公司任副总经理；自2011年9月至今，在深圳市远为投资有限公司任副总经理；自2011年9月至今，在深圳市地铁远为商业发展有限公司任总经理；自2020年3月至今，在国都证券股份有限公司任董事。

陈文博先生，1983年6月出生，中国国籍，无境外永久居留权，于2005年7月毕业于复旦大学国际金融系金融学专业，本科学历。自2005年7月至2008年12月，在上海环信投资咨询有限公司历任项目经理、副总经理；自2008年12月至2011年6月，在北京天和翊诚控股有限公司任董事长助理；自2011年6月至2015年11月，在上海会德沣投资集团有限公司任投资总监；自2015年11月至今，在天津重信资产管理有限公司任董事总经理；自2020年3月至今，在国都证券股份有限公司任董事。

邹光辉先生，1968年7月出生，中国国籍，无境外永久居留权，于1990年7月毕业于辽宁财经学院（现东北财经大学）投资经济系基建财务与信用专业，本科学历，高级会计师。自1990年8月至1992年1月，在上海长征塑料编织厂历任会计、采购员；自1992年2月至1993年5月，在长春煤炭管理干部学院历任教师、出纳、会计；自1993年6月至1997年5月，在东煤集团财务公司历任会计、信贷员、会计部主任；自1997年6月至2003年2

月，在中煤信托投资有限责任公司东北分公司任计划财务部经理；自 2003 年 3 月至今，在万盛基业投资有限责任公司历任财务部经理、财务总监、副总经理、总经理、董事长；自 2020 年 12 月至今，在国都证券股份有限公司任董事。

雷达先生，1962 年 5 月出生，中国国籍，无境外永久居留权，中共党员，于 1993 年 6 月毕业于中国人民大学国际经济系世界经济专业，博士研究生学历。自 1988 年 9 月至今，在中国人民大学经济学院从事科研与教学工作，历任国际经济系讲师、副教授、国际经济系副主任、副院长兼国际经济系主任，现任中国人民大学经济学院教授；自 2020 年 3 月至今，在国都证券股份有限公司任独立董事。

姜波女士，1955 年 12 月出生，中国国籍，无境外永久居留权，中共党员，于 2004 年 7 月毕业于中国人民大学金融学专业，博士研究生学历，高级会计师、高级经济师。自 1983 年 8 月至 1992 年 7 月，在中国农业银行历任职员、副处长；自 1992 年 7 月至 1996 年 4 月，在中国光大银行任部门总经理；自 1996 年 5 月至 2009 年 8 月，在中国光大银行任副行长；自 2009 年 8 月至 2017 年 1 月，在中国光大集团任首席财务官。自 2020 年 12 月起，在国都证券股份有限公司任独立董事。

昌孝润先生，1966 年 3 月出生，中国国籍，无境外永久居留权，中共党员，于 2009 年 7 月毕业于中国人民大学民商法专业，博士研究生学历。自 1990 年 7 月至 1994 年 5 月，在中国人民大学任教师；自 1994 年 5 月至 2001 年 5 月，在华联律师事务所任律师；自 2001 年 5 月至 2003 年 3 月，在北京市华联律师事务所任律师；自 2003 年 5 月起至今，在北京市天沐律师事务所任律师主任；自 2020 年 12 月起，在国都证券股份有限公司任独立董事。

## 2、监事会成员

江厚强先生，1970 年 9 月出生，中国国籍，无境外永久居留权，中共党员，于 1992 年 7 月毕业于天津商学院（现天津商业大学）会计学专业，本科学历。1992 年 7 月至 2000 年 3 月任职于中国五金交电化工公司，曾任期货部副总经理；2000 年 3 月至 2001 年 9 月在广州证券有限责任公司担任北京投行部经理；2001 年 9 月至 2003 年 3 月在富邦资产管理有限公司担任董事兼副总经理；2003 年 3 月至 2009 年 6 月在天风证券有限责任公司担任副总经理，期间还被借调至中国证监会风险办广东证券托管组工作；2007 年 1 月至 2009 年 6 月在北方期货经纪有限公司兼任董事长；2009 年 6 月至 2015 年 6 月在航天科技财务有限责任公司任副总经理；自 2015 年 6 月至今在国都证券股份有限公司任职员，其中自 2015 年 11 月至今，在国都证券股份有限公司任监事会主席、职工代表监事。

杜治禹先生，1974 年 1 月出生，中国国籍，无境外永久居留权，于 2013 年 7 月毕业于

北京航空航天大学工商管理专业，硕士研究生学历，高级会计师。自 1993 年 7 月至 1996 年 5 月，在吉林热力集团财务部任会计；自 1996 年 5 月至 1999 年 8 月，在吉林市财政局会计师事务所任审计师；自 1999 年 8 月至 2000 年 9 月，在海口齐盛会计师事务所任部门经理；自 2000 年 9 月至 2003 年 6 月，在北京天华会计师事务所任部门经理；自 2003 年 6 月至 2004 年 6 月，在新隆基工贸集团有限公司任财务总监；自 2004 年 7 月至 2006 年 5 月，在河北迁安化肥股份有限公司任财务总监；自 2006 年 5 月至今，在国华能源投资有限公司历任审计业务专员、高级业务经理；自 2020 年 12 月至今，在国都证券股份有限公司任监事。

Nanxing Yu 女士，1988 年 8 月出生，澳大利亚国籍，于 2011 年 11 月毕业于澳大利亚麦考瑞大学商学及法学专业，本科学历。自 2011 年 3 月至 2014 年 10 月，在 Colin Bigger & Paisley Lawyers 任律师；自 2014 年 10 月至 2015 年 9 月，在 Payce Consolidated Limited 任法律主管；自 2015 年 9 月至今，在上海丽华投资发展有限公司任执行董事；自 2015 年 9 月至今，在上海锡毅投资管理有限公司（原上海锡毅置业有限公司）任总经理；自 2016 年 5 月至今，在上海东证锡毅投资管理有限公司任总经理；自 2017 年 6 月至今，在华金证券股份有限公司任董事；自 2018 年 12 月至今，在上海南虹桥国际金融园区有限公司任总经理；自 2020 年 7 月至今，在上海东证锡毅股权投资基金合伙企业（有限合伙）任执行事务合伙人委派代表；自 2020 年 3 月至今，在国都证券股份有限公司任监事。

申晨先生，1987 年 11 月出生，中国国籍，无境外永久居留权，于 2010 年 7 月毕业于中国人民解放军陆军航空兵学院工商管理专业，本科学历。自 2010 年 7 月至 2014 年 6 月，在北京鸿福祥科技发展有限公司任投资助理；自 2014 年 6 月至 2015 年 3 月，在宁夏新日恒力钢丝绳股份有限公司任董事；自 2015 年 3 月至 7 月，在北京中民银发投资管理有限公司任投资助理；自 2015 年 7 月至今，在北京中民银发投资管理有限公司任副总经理；自 2018 年 5 月至今，在宁夏中银绒业股份有限公司任董事、副总经理；自 2020 年 3 月至今，在国都证券股份有限公司担任监事。

贺佳琳女士，1983 年 6 月出生，中国国籍，无境外永久居留权，于 2015 年 12 月毕业于上海财经大学高级管理工商管理专业，硕士学位。历任重庆国际信托股份有限公司综合管理部业务经理，西南证券股份有限公司人力资源部总经理助理、投资银行综合管理部总经理助理，国都证券股份有限公司人力资源部副总经理。2020 年 7 月至今，在国都证券股份有限公司任人力资源部副总经理，2020 年 10 月开始主持部门工作。自 2021 年 1 月起，在国都证券股份有限公司任人力资源部副总（主持工作）、职工代表监事。

陈跃武先生，1962 年 2 月出生，中国国籍，无境外永久居留权，中共党员，于 1999 年

6月毕业于辽宁大学金融学专业，硕士研究生学历，高级经济师。自1983年7月至1990年5月，在中国人民银行北京市分行职工中专学校、北京银行学校任教师；自1990年5月至1992年8月，在国家外汇管理局北京分局任科员；自1992年8月至1998年12月，在中国人民银行北京市分行任副处长；自1998年12月至2001年12月，在北京国际信托投资有限公司任总经理助理、证券总部副总经理；自2001年12月至2015年6月，在国都证券有限责任公司任研究所副所长，并自2008年10月起至2015年6月任监事；自2015年6月至今，在国都证券股份有限公司任研究所副所长、职工代表监事。

### 3、高级管理人员

韩本毅先生，1965年5月出生，中国国籍，无境外永久居留权，中共党员，于2011年12月毕业于西安交通大学应用经济学专业，博士研究生学历，高级经济师。自1984年7月至1986年9月，在安徽省宿州市物价局任干事；自1990年7月至1994年12月，在中共中央纪律检查委员会干部室、办公厅任副主任科员、主任科员；自1994年12月至1998年5月，在中共陕西省委办公厅任副处级、正处级调研员；自1998年5月至2000年4月，在陕西省长安县人民政府任副县长（挂职）；自2000年4月至2001年7月，在中国证监会西安证券监管办公室任稽查处副处长、案件调查处副处长；自2001年7月至2003年12月，在陕西省广播电视信息网络有限责任公司任常务副总经理；自2001年12月至2007年4月，在陕西广电网络传媒股份有限公司（股票简称“广电网络”，代码SH600831）任董事长；自2003年12月至2012年4月，在中国通用技术集团（控股）有限公司任集团副总经理；自2004年3月至2009年9月，在中国医药健康产业股份有限公司（股票代码：SH600056）任董事长；自2012年4月至2015年9月，在中国航空油料集团公司任集团副总经理、党委常委；自2016年6月至2020年5月，在世界华夏（北京）基金管理有限公司任董事长；自2019年5月至2020年11月，在重庆三峡银行股份有限公司任董事；自2020年6月至2020年12月，在国都证券股份有限公司任党委书记；自2020年9月至今，在中欧基金管理有限公司任董事；自2020年12月至今，在国都证券股份有限公司任党委书记、总经理。

谢荣先生，1979年6月出生，中国国籍，无境外永久居留权，于2011年1月毕业于东北财经大学经济专业，硕士研究生学历。自2002年8月至2006年4月，在中国银河证券股份有限公司任网上交易中心经理；自2006年5月至2007年5月，在普华永道咨询有限公司任企业并购部高级经理；自2007年7月至2009年7月在摩根大通银行（中国）有限公司任固定收益部副总裁；自2009年10月至2012年3月，在摩根士丹利亚洲有限公司任执行董事、董事总经理；自2012年4月至2015年1月，在摩根士丹利华鑫证券有限责任公司历



任固定收益部总经理、投资银行部总经理；自 2015 年 1 月至 2018 年 12 月在摩根士丹利华鑫证券有限责任公司任副总经理兼投资银行部联席负责人；自 2019 年 1 月起进入国都证券股份有限公司工作；自 2019 年 3 月至 2019 年 7 月，在国都证券股份有限公司任副总经理，自 2019 年 9 月起，在在国都证券股份有限公司任副总经理。

赵远峰先生，1968 年 1 月出生，中国国籍，无境外永久居留权，中共党员，1992 年 3 月毕业于吉林工业大学（现吉林大学）计算机应用专业，硕士研究生学历，2002 年 4 月毕业于北京大学高级管理人员工商管理硕士专业。自 1992 年 5 月至 1994 年 7 月，在机电部自动化研究所任助理工程师；自 1994 年 7 月至 2002 年 2 月，在华夏证券股份有限公司历任信息系统维护工程师、东四营业部信息技术主管；自 2002 年 2 月至 2015 年 6 月，在国都证券有限责任公司历任电脑中心总经理、信息技术中心总监、风控总监兼风险控制部总经理、经纪业务总监、副总经理；自 2015 年 6 月至 2018 年 12 月，在国都证券股份有限公司任副总经理，其中 2018 年 6 月至 2018 年 12 月在国都证券股份有限公司任代总经理；自 2018 年 12 月至 2019 年 1 月，在国都证券股份有限公司任总经理；自 2019 年 1 月至 2019 年 5 月，在国都证券股份有限公司任党委书记、总经理；自 2019 年 5 月至 2020 年 7 月，在国都证券股份有限公司任党委书记、总经理、首席信息官；自 2020 年 7 月至 2020 年 12 月，在国都证券股份有限公司任党委委员、总经理、首席信息官；自 2020 年 12 月至今，在国都证券股份有限公司任党委委员、副总经理、首席信息官。

刘仲哲先生，1969 年 8 月出生，中国国籍，无境外永久居留权，于 2000 年 8 月毕业于美国新泽西理工学院管理科学专业，硕士研究生学历。自 1991 年 7 月至 1993 年 10 月，在安徽财贸学院计算中心任教师；自 1993 年 10 月至 1995 年 12 月，在南方证券有限公司海南分公司海口营业部任经理；自 1995 年 12 月至 1997 年 5 月，在中煤信托投资有限公司任证券业务筹建负责人；自 1997 年 7 月至 1999 年 6 月，在美国伊利诺州帕克兰学院参加英语进修；自 1999 年 7 月至 2000 年 8 月，在美国新泽西理工学院管理学院参加硕士研究生学习；自 2000 年 7 月至 2001 年 12 月，在中煤信托投资有限责任公司任证券总部副总经理；自 2001 年 12 月至 2015 年 6 月，在国都证券有限责任公司任副总经理；自 2015 年 6 月至今，在国都证券股份有限公司任副总经理。

魏泽鸿先生，1966 年 4 月出生，中国国籍，无境外永久居留权，于 1988 年 7 月毕业于北京经济学院（现首都经济贸易大学）经济信息管理专业，本科学历。自 1988 年 8 月至 1990 年 4 月，任职于中国农业银行北京分行；自 1990 年 4 月至 1996 年 11 月，在中国证券市场研究设计中心任部门经理；自 1996 年 12 月至 2001 年 12 月，在中煤信托投资有限责任公司

上海长阳路营业部任总经理；自 2001 年 12 月至 2015 年 6 月，在国都证券有限责任公司历任经纪业务总监兼经纪业务总部总经理、风控总监兼合规与风险控制部总经理、合规总监、合规总监兼首席风险官；自 2015 年 6 月至今，在国都证券股份有限公司任副总经理、合规总监兼首席风险官。

朱玉萍女士，1962 年 10 月出生，中国国籍，无境外永久居留权，中共党员，于 2002 年 7 月毕业于北京大学法学专业，本科学历。自 1979 年 12 月至 1993 年 8 月，在空军某部队服役，并曾历任区队长、新闻干事；自 1993 年 9 月至 1997 年 4 月，在北京国际信托投资有限责任公司任证券总部办公室主任、营业部总经理；自 1997 年 5 月至 2001 年 1 月，在中工信托投资公司历任证券部副总经理、总经理；自 2001 年 2 月至 2001 年 12 月，在北京国际信托投资有限责任公司任证券总部办公室主任；自 2001 年 12 月至 2015 年 6 月，在国都证券有限责任公司历任董事会秘书、董事会秘书兼综合管理部总经理、董事会秘书兼董事会办公室主任，并自 2013 年 1 月起任党委委员；自 2015 年 6 月至 2018 年 8 月，在国都证券股份有限公司任党委委员、董事会秘书兼董事会办公室主任；自 2018 年 8 月至 2019 年 1 月，在国都证券股份有限公司任党委委员、董事会秘书兼董事会办公室主任、综合管理部总经理；自 2019 年 1 月至 2020 年 12 月，在国都证券股份有限公司任党委副书记、纪委书记、董事会秘书兼董事会办公室主任、综合管理部总经理；自 2020 年 12 月起，在国都证券股份有限公司任党委副书记、纪委书记、董事会秘书、副总经理兼董事会办公室主任、综合管理部总经理。

张志军先生，1975 年 11 月出生，中国国籍，无境外永久居留权，中共党员，于 2004 年 12 月毕业于上海财经大学高级管理工商管理硕士专业，本科学历。自 1996 年 8 月至 2000 年 3 月，在陕西省国际信托股份有限公司西安东大街证券营业部任员工；自 2000 年 3 月至 2003 年 3 月，在陕西省国际信托股份有限公司上海漕东支路证券营业部任业务经理；自 2003 年 3 月至 2004 年 8 月，在健桥证券股份有限公司丹阳丹凤北路证券营业部任总经理助理；自 2004 年 8 月至 2005 年 6 月，在健桥证券股份有限公司上海漕东支路证券营业部任副总经理；自 2005 年 6 月至 2007 年 3 月，在健桥证券股份有限公司风险控制部任副总经理；自 2007 年 5 月至 2008 年 4 月，在信达证券股份有限公司金谷托管组任副组长；自 2008 年 4 月至 2014 年 8 月，在信达证券股份有限公司上海铁岭路证券营业部任总经理；自 2014 年 8 月至 2014 年 10 月，在华金证券股份有限公司（原航天证券有限责任公司）经纪业务总部任总经理；自 2014 年 10 月至 2017 年 5 月，在华金证券股份有限公司任公司副总裁；自 2017 年 5 月至 2019 年 7 月，在信达证券股份有限公司任公司业务总监兼证券经纪事业部总经理；

自 2019 年 7 月起进入国都证券股份有限公司工作；自 2019 年 8 月至今，在国都证券股份有限公司任副总经理。

杨江权先生，1973 年 4 月出生，中国国籍，无境外永久居留权，于 2013 年 12 月毕业于吉林大学人口、资源与环境经济学专业，博士研究生学历。自 1995 年 8 月至 1996 年 6 月，在北京吉泰安合金材料有限公司任财务会计；自 1996 年 7 月至 1998 年 9 月，在电力部北京动力经济研究中心任研究员；自 1998 年 10 月至 2000 年 7 月，在西南证券股份有限公司任投资银行部高级经理；自 2000 年 8 月至 2004 年 9 月，在北京睿汇德科技投资有限公司任执行总裁；自 2004 年 10 月至 2007 年 12 月，在国投中鲁果汁股份有限公司任财务总监；自 2007 年 12 月至 2010 年 8 月，在西南证券股份有限公司任投资银行部执行董事；自 2010 年 8 月至 2016 年 8 月，在西证股权投资投资有限公司任总经理；自 2016 年 9 月至 2019 年 11 月，在北京易添富股权投资管理有限公司任执行董事、总经理；自 2019 年 11 月至 2020 年 5 月，在西证股权投资投资有限公司任总经理；自 2020 年 5 月至今，在国都创业投资有限责任公司任董事长、总经理；自 2020 年 8 月至 2020 年 12 月，在国都证券股份有限公司任副总经理；自 2020 年 12 月起，在国都证券股份有限公司任副总经理、财务负责人。

储钢汉先生，1974 年 8 月出生，中国国籍，无境外永久居留权，于 1996 年 7 月毕业于中国政法大学经济法系经济法专业，本科学历。自 1996 年 7 月至 1996 年 8 月，在安徽省司法厅任干部；自 1996 年 8 月至 1996 年 12 月，在安徽安泰律师事务所任律师；自 1996 年 12 月至 1998 年 4 月，在安徽省证券管理办公室借调；自 1998 年 4 月至 1998 年 9 月，在安徽省证券管理办公室任科员；自 1998 年 9 月至 1999 年 6 月，在中国证监会合肥特派办信息法律处任科员；自 1999 年 6 月至 2001 年 4 月，在中国证监会合肥特派办稽查处任科员；自 2001 年 4 月至 2004 年 3 月，在中国证监会合肥特派办稽查处任副主任科员；自 2004 年 3 月至 2004 年 7 月，在中国证监会安徽监管局稽查处任副主任科员；自 2004 年 7 月至 2007 年 2 月，在中国证监会安徽监管局稽查处任主任科员；自 2007 年 2 月至 2010 年 12 月，在中国证监会安徽监管局稽查处任副处长（主持工作）；自 2010 年 12 月至 2015 年 11 月，在中国证监会安徽监管局上市公司监管一处任处长；自 2015 年 11 月至 2016 年 5 月，在中国证监会安徽监管局公司监管处任处长；自 2016 年 5 月至 2017 年 11 月，在中国证监会安徽监管局任正处级干部；其间：2012 年 5 月至 2017 年 9 月，在中国证监会第十四、十五、十六届主板发审委任委员；自 2017 年 12 月至 2017 年 12 月，在四川省泸州老窖集团组织部（商调）任管理干部；自 2017 年 12 月至 2020 年 8 月，在华西证券股份有限公司任总裁助理；自 2020 年 11 月起进入国都证券股份有限公司工作；自 2020 年 12 月起，在国都证券股份有

限公司任副总经理。

#### 4、本基金基金经理

尹德才先生，北京工商大学应用化学硕士。2011年加入天相投资顾问有限公司证券部研究员，2013年加入国都证券，历任研究所化工行业研究员、基金管理部高级行业研究员、基金管理部基金经理助理，现任基金管理部基金经理。

王义先生，北京大学生药学博士。曾任国都证券研究所医药行业研究员，现任国都证券基金管理部基金经理。

本基金历任基金如下：

程广飞先生（任职期自2018-5-25至2019-7-26）。

杨志刚先生（任职期自2018-5-25至2020-7-30）。

张崴女士（任职期自2020-2-21至2021-3-17）。

尹德才先生（任职期自2020-6-29至今）。

王义先生（任职期自2021-6-16至今）。

#### 5、公募证券投资基金管理业务投资决策委员会成员

国都证券股份有限公司公募证券投资基金管理业务投资决策委员会成员构成如下：廖晓东先生，尹德才先生，张晓磊先生，张宇女士，王义先生，张婷婷女士，李昭先生。

上述人员无近亲属关系。

### （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资产分别管理、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、半年度和年度基金报告；

7、计算并公告基金资产净值和基金份额累计净值，确定基金份额申购、赎回价格；

8、办理与基金资产管理业务活动有关的信息披露事项；

9、召集基金份额持有人大会；

10、保存基金资产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

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

12、有关法律法规和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相关法律法规、基金合同和中国证监会的有关规定，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反有关法律法规、基金合同和中国证监会有关规定的行为发生。

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

- （1）将其固有财产或者他人财产混同于基金资产从事证券投资；
- （2）不公平地对待其管理的不同基金资产；
- （3）利用基金资产或者职位之便为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；
- （4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- （5）侵占、挪用基金资产；
- （6）泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
- （7）玩忽职守，不按照规定履行职责；
- （8）法律法规或中国证监会规定禁止的其它行为。

3、本基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不得将基金资产用于以下投资或活动：

- （1）承销证券；
- （2）违反规定向他人贷款或者提供担保；
- （3）从事承担无限责任的投资；
- （4）向基金管理人、基金托管人出资；
- （5）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其它不正当的证券交易活动；
- （6）正在实施的有效法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其它行为。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

#### **4、基金经理承诺**

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

- （2）不利用职务之便为自己及其代理人、受雇人或任何第三人谋取利益；

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

(4) 不从事损害基金资产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

## （五）基金管理人内部控制制度

### 1、内部控制制度概述

为加强内部控制，防范和化解风险，促进公司诚信、合法、有效经营，保障基金份额持有人利益，公司已建立健全内部控制体系和内部控制制度。

公司内部控制制度由基本管理制度和部门业务规章等部分组成。基本管理制度包括投资管理、信息披露、信息技术管理、公司财务管理、基金会计、人力资源管理、资料档案管理、业绩评估考核、监察稽核、风险控制、紧急应变等制度。部门业务规章是对各部门的主要职责、岗位设置、岗位职责、操作守则等具体说明。

### 2、内部控制的原则

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

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

(3) 独立性原则：公司各机构、部门和岗位在职能上必须保持相对独立；

(4) 相互制约原则：组织结构体现职责明确、相互制约的原则，各部门有明确的授权分工，操作相互独立。

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

### 3、内部控制组织体系

(1) 公司董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任。董事会下设审计委员会、风险控制委员会，负责检查公司内部管理制度及内控制度的执行情况，充分发挥独立董事监督职能，保护投资者利益和公司合法权益。

(2) 公募证券投资基金管理业务投资决策委员会为基金投资管理的最高决策机构，由基金管理部总经理、部门负责人（投资总监）、基金经理、投资研究人员、及其他相关人员组成，负责指导基金资产的运作、确定基本的投资策略和投资组合的原则。

(3) 合规负责人积极对公司各项制度、业务的合法合规性及公司内部控制制度的执行

情况进行监察、稽核，定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况。

(4) 内控部门：公司管理层重视和支持监察稽核工作，并保证内控部门的独立性和权威性，配备了充足合格的监察稽核人员，明确合规法律部、风险管理部、稽核审计部及其各岗位的职责和 workflows、组织纪律。合规法律部、风险管理部、稽核审计部具体负责公司各项制度、业务的合法合规性及公司内部控制制度的执行情况的监察稽核工作。

(5) 业务部门：部门负责人为所在部门的风险控制第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控及时报告义务。

(6) 岗位员工：公司努力树立内控优先和风险管理理念，培养全体员工的风险防范意识，营造一个浓厚的内控文化氛围，保证全体员工及时了解国家法律法规和公司规章制度，使风险意识贯穿到基金管理业务各个部门、各个岗位和各个环节。员工在其岗位职责范围内承担相应的内控责任，并负有对岗位工作中发现的风险隐患或风险问题及时报告、反馈的义务。

#### 4、内部控制措施

(1) 公司确立积极吸收或采用先进的风险控制技术和手段，进行内部控制和风险管理。公司逐步健全法人治理结构，充分发挥独立董事和监事会的监督职能，严禁不正当关联交易、利益输送和内部人控制现象的发生，保护投资者利益和公司合法权益。

(2) 公司设置的组织结构，充分体现职责明确、相互制约的原则，各部门均有明确的授权分工，操作相互独立。公司逐步建立决策科学、运营规范、管理高效的运行机制，包括民主、透明的决策程序和管理议事规则，高效、严谨的业务执行系统，以及健全、有效的内部监督和反馈系统。

(3) 公司设立了顺序递进、权责统一、严密有效的内控防线：

①各岗位职责明确，有详细的岗位说明书和业务流程，各岗位人员在上岗前均应知悉并以书面方式承诺遵守，在授权范围内承担责任；

②建立重要业务处理凭据传递和信息沟通制度，相关部门和岗位之间相互监督制衡。

(4) 公司建立有效的人力资源管理制度，健全激励约束机制，确保公司人员具备与岗位要求相适应的职业操守和专业胜任能力。

(5) 公司建立科学严密的风险评估体系，对公司内外部风险进行识别、评估和分析，及时防范和化解风险。

(6) 授权控制应当贯穿于公司经营活动的始终，授权控制的主要内容包括：

①股东会、董事会、监事会和管理层充分了解和履行各自的职权，建立健全公司授权标准和程序，确保授权制度的贯彻执行；

②公司各部门、分公司及员工在规定授权范围内行使相应的职责；

③重大业务授权采取书面形式，授权书应当明确授权内容和时效；

④对已获授权的部门和人员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。

(7) 建立完善的基金财务核算与基金资产估值系统和资产分离制度，基金资产与公司自有资产、其他委托资产以及不同基金的资产之间实行独立运作，分别核算，及时、准确和完整地反映基金资产的状况。

(8) 建立科学、严格的岗位分离制度，明确划分各岗位职责，投资和交易、交易和清算、基金会计和公司会计等重要岗位不得有人员重叠。投资、研究、交易、IT 等重要业务部门和岗位进行物理隔离。

(9) 建立和维护信息管理系统，严格信息管理，保证客户资料等信息安全、真实和完整。积极维护信息沟通渠道的畅通，建立清晰的报告系统，各级领导、部门及员工均有明确的报告途径。

(10) 建立和完善客户服务标准，加强基金销售管理，规范基金宣传推介，不得有不正当销售行为和不正当竞争行为。

(11) 制订切实有效的应急应变措施，建立危机处理机制和程序，对发生严重影响基金份额持有人利益、可能引起系统性风险、严重影响社会稳定的突发事件，按照预案妥善处理。

(12) 公司建立健全内部监控制度，合规负责人、内控部门对公司内部控制制度的执行情况进行持续的监督，保证内部控制制度落实；定期评价内部控制的有效性并适时改进。

①对公司各项制度、业务的合法合规性核查。由内控部门设计各部门监察稽核点明细，按照查核项目和查核程序进行部门自查、监察部核查，确保公司各项制度、业务符合有关法律、行政法规、部门规章及行业监管规则。

②对内部风险控制制度的持续监督。由内控部门与风险管理部组织相关业务部门、岗位共同识别风险点，界定风险责任人，设计内部风险点自我评估表，对风险点进行评估和分析，并由内控部门与风险管理部监督风险控制措施的执行，及时防范和化解风险。

③合规负责人发现公司存在重大风险或者有违法违规行为，在告知总经理和其他有关高级管理人员的同时，向董事会、中国证监会和公司所在地中国证监会派出机构报告。

#### 5、基金管理人关于内部控制制度的声明

本基金管理人确知建立、维持、完善、实施和有效执行风险管理和内部控制制度是本基金管理人董事会及管理层的责任，董事会承担最终责任。本基金管理人特别声明以上关于内



部控制的披露真实、准确、完备，并承诺将根据市场环境的变化和业务的发展不断完善内部控制制度。

## 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：福建省福州市湖东路 154 号

办公地址：上海市银城路 167 号

邮政编码：200120

法定代表人：陶以平（代为履行法定代表人职权）

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。

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。截至 2020 年 12 月 31 日，兴业银行资产总额达 7.89 万亿元，实现营业收入 2031.37 亿元，同比增长 12.04%，全年实现归属于母公司股东的净利润 666.26 亿元。

### （二）托管业务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、市场处、委托资产管理处、产品管理处、稽核监察处、运行管理处、养老金管理中心等处室，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 2021 年 3 月 31 日，兴业银行共托管证券投资基金 405 只，托管基金的基金资产净值合计 17384.91 亿元，基金份额合计 16606.12 亿份。

### （四）基金托管人的内部控制制度

#### 1、内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定,守法经营、规范运作、严格监察,确保业务的稳健运行,保证基金资产的安全完整,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。

## 2、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

## 3、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。

## 4、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。基金管理人违反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重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时，通知基金管理人限期纠正，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。

## 相关服务机构

### （一）基金份额发售机构

#### 1、销售机构

名称：国都证券股份有限公司

注册地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦九层十层

办公地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦九层十层

法定代表人：翁振杰

客服电话：400-818-8118

网址：www.guodu.com

2、其他销售机构情况详见本基金的《基金份额发售公告》。基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。

### （二）登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街17号

办公地址：北京市西城区太平桥大街17号

法定代表人：于文强

电话：010-58598853

传真：010-58598907

联系人：任瑞新

### （三）出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

注册地址：上海市银城中路68号19楼

办公地址：上海市银城中路68号19楼

负责人：俞卫锋

联系电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：陆奇

经办律师：黎明、陆奇

**(四) 审计基金财产的会计师事务所**

名称：中审华会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：天津开发区广场东路 20 号滨海金融街 E7106 室

办公地址：北京市西城区百万庄大街 22 号院 2 号楼 5 层

执行事务合伙人：黄庆林

联系电话：010-62378528

传真：010-62378010

联系人：高宏伟

经办注册会计师：黄庆林

## 基金的募集安排

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同的相关规定、并经中国证券监督管理委员会 2017 年 9 月 22 日《关于准予国都多策略混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2017]1733 号文）注册募集。

### （一） 基金的运作方式

契约型开放式。

### （二） 基金类型

混合型证券投资基金。

### （三） 基金存续期

不定期。

### （四） 基金份额的募集期限、募集方式及场所、募集对象、最低募集份额总额

1、募集期限：具体发售时间由基金管理人根据相关法律法规以及基金合同的规定确定，并在基金份额发售公告中披露。

根据《运作办法》的规定，如果本基金在上述时间段内未达到基金合同生效的法定条件或基金管理人根据市场情况需要延长基金份额发售的时间，本基金可延长募集时间，但募集期限自基金份额发售之日起最长不超过 3 个月。

#### 2、募集方式及场所

本基金通过各销售机构的销售网点公开发售，具体销售城市名单、销售机构联系方式以及发售方案以基金份额发售公告和相关公告为准，请投资者就募集和认购的具体事宜仔细阅读基金份额发售公告以及基金管理人届时发布的调整销售机构的相关公告。

#### 3、募集对象

符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者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。

#### 4、最低募集份额总额

本基金的最低募集份额总额为 2 亿份。

### （五） 基金的认购

1、认购程序：投资者认购时间安排、认购时应提交的文件和办理的手续，详见本基金

的份额发售公告。

## 2、认购方式及确认：

(1) 本基金认购采取金额认购的方式。投资人认购时，需按销售机构规定的方式全额缴款。

(2) 销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购的确认以登记机构的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利。

(3) 基金投资者在募集期内可以多次认购，认购申请一经受理不得撤销。

(4) 若投资者的认购申请被确认为无效，基金管理人应当将投资者已支付的认购金额本金退还投资者。

## 3、基金认购金额的限制：

(1) 在募集期内，投资者可多次认购，对单一投资者在认购期间累计认购份额不设上限。

(2) 认购最低限额：在基金募集期内，投资者通过基金管理人和其他销售机构首次认购最低限额为人民币 10 元，追加认购单笔最低限额为人民币 10 元。

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

(4) 基金管理人有权在法律法规允许的情况下，对上述限制规则和处理方法进行调整。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。

4、本基金认购费率按照认购金额递减，即认购金额越大，所适用的认购费率越低。投资者在一天之内如果有多笔认购，适用费率按单笔分别计算。

投资者在认购基金份额时需交纳前端认购费，具体认购费率如下：

认购金额（含认购费）	认购费率
100 万元以下	1.0%
100 万元（含）以上 500 万元以下	0.5%
500 万元（含）以上	1000 元/笔

本基金的认购费用由投资者承担，不列入基金资产，认购费用用于本基金的市场推广、



销售、注册登记等募集期间发生的各项费用。

#### 5、募集资金利息的处理方式

有效认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有，其中利息转份额以登记机构的记录为准。

#### 6、认购份额的计算

本基金基金份额发售面值为 1.00 元。

当投资者选择认购基金份额时，认购份额的计算方法如下：

##### ① 认购费用适用比例费率时：

$$\text{净认购金额} = \text{认购金额} / (1 + \text{认购费率})$$

$$\text{认购费用} = \text{认购金额} - \text{净认购金额}$$

$$\text{认购份额} = (\text{净认购金额} + \text{认购资金利息}) / 1.00 \text{ 元}$$

##### ② 认购费用为固定金额时：

$$\text{认购费用} = \text{固定金额}$$

$$\text{净认购金额} = \text{认购金额} - \text{认购费用}$$

$$\text{认购份额} = (\text{净认购金额} + \text{认购资金利息}) / 1.00 \text{ 元}$$

认购份额的计算结果保留小数点后两位，小数点后两位以后的部分舍去，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

**例一：**某投资者投资 10,000 元认购本基金基金份额，如果其认购资金的利息为 10 元，则其可得到的基金份额数计算如下：

$$\text{净认购金额} = 10,000 / (1 + 1.0\%) = 9,900.99 \text{ 元}$$

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

$$\text{认购份额} = (9,900.99 + 10) / 1.00 = 9,910.99 \text{ 份}$$

即投资者投资 10,000 元认购本基金基金份额，可得到 9,910.99 份基金份额。

**例二：**某投资者投资 10,000,000 元认购本基金基金份额，如果其认购资金的利息为 10 元，则其可得到的基金份额数计算如下：

$$\text{认购费用} = 1,000 \text{ 元}$$

$$\text{净认购金额} = 10,000,000 - 1,000 = 9,999,000 \text{ 元}$$

$$\text{认购份额} = (9,999,000 + 10) / 1.00 \text{ 元} = 9,999,010.00 \text{ 份}$$

即投资者投资 10,000,000 元认购本基金基金份额，可得到 9,999,010.00 份。

#### 7、募集资金

基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。

## 基金合同的生效

### （一）基金备案的条件

本基金自基金份额发售之日起 3 个月内，在基金募集份额总额不少于 2 亿份，基金募集金额不少于 2 亿元人民币且基金认购人数不少于 200 人的条件下，基金募集期届满或基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售，并在 10 日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告之日起 10 日内，向中国证监会办理基金备案手续。

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

### （二）基金合同不能生效时募集资金的处理方式

如果募集期限届满，未满足基金备案条件，基金管理人应当承担下列责任：

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

### （三）基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

基金合同生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当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。

法律法规另有规定时，从其规定。

## 基金份额的申购与赎回

### （一） 申购和赎回场所

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。具体的销售机构将由基金管理人在相关公告中列明。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。

### （二） 申购和赎回的开放日及时间

#### 1、 开放日及开放时间

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

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

#### 2、 申购、赎回开始日及业务办理时间

基金管理人自基金合同生效之日起不超过三个月开始办理申购，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。

基金管理人自基金合同生效之日起不超过三个月开始办理赎回，具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。

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

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

### （三） 申购、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。

#### **（四） 申购、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，投资人交付申购款项，申购成立；登  
记机构确认基金份额时，申购生效。

基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；登记机构确认赎回时，赎回生效。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、 申购与赎回申请的确认**

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

销售机构对申购和赎回申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收  
到申请。申购和赎回的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资人应及  
时查询并妥善行使合法权利。

基金管理人可在法律法规允许的情况下，对上述规则进行调整。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并报中国证监会备案。

#### **（五） 申购、赎回的数额限制**

##### **1、 申请申购基金的金额**

投资者通过基金管理人和其他销售机构首次申购最低限额为人民币 10 元、最高限额为  
人民币 1 亿元，追加申购单笔最低限额为 10 元、最高限额为人民币 1 亿元。

投资者将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。

投资者可多次申购，对单个投资者累计持有份额不设上限。

## 2、申请赎回基金的份额

投资者单笔赎回不得少于 1 份；若某笔赎回将导致投资者在销售机构的基金交易账户余额不足 1 份时，基金管理人有权将投资者在该销售机构的剩余基金份额一次性全部作赎回处理。

3、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数的比例达到或者超过基金份额总数的 50%，或者有可能导致投资者变相规避前述 50%比例要求的情形，基金管理人有权拒绝该等全部或者部分申购申请。投资人申购的基金份额数以登记机构的确认为准。

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，具体规定请参见相关公告。

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

## （六）申购、赎回的费率

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。具体申购费率如下：

申购金额（含申购费）	申购费率
100 万元以下	1.2%
100 万元（含）以上 500 万元以下	0.8%
500 万元（含）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，不列入基金资产。

2、本基金在投资者赎回基金份额时收取赎回费。基金份额的赎回费率按照持有时间递减，即相关基金份额持有时间越长，所适用的赎回费率越低。

本基金的赎回费用由基金份额持有人承担，对持续持有期少于 30 日的投资人收取的赎回费全额计入基金财产；对持续持有期大于等于 30 日但少于 93 日的投资人收取的赎回费的

75%计入基金财产；对持续持有期大于等于 93 日但少于 186 日的投资人收取的赎回费的 50% 计入基金财产；对持续持有期大于等于 186 日但少于 730 日的投资人收取的赎回费的 25% 计入基金财产；赎回费未计入基金财产的部分用于支付注册登记费和其他必要的手续费。本基金的赎回费率具体如下：

持有基金份额期限（T）	赎回费率
T<7 日	1.5%
7 日≤T<30 日	0.75%
30 日≤T<365 日	0.50%
365 日≤T<730 日	0.25%
T≥730 日	0%

3、基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整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，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、基金赎回费率。

### （七） 申购份额、赎回金额的计算方式

#### 1、 申购份额的计算

（1）当投资者选择申购基金份额时，申购份额的计算方法如下：

##### ① 申购费用适用比例费率时：

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

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

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

##### ② 申购费用为固定金额时：

$$\text{申购费用} = \text{固定金额}$$

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

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

（2）上述计算结果均按舍去尾数方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

例：某投资者投资 5 万元申购本基金基金份额，假设申购当日基金份额净值为 1.0500

元，则可得到的申购份额为：

$$\text{净申购金额} = 50,000 / (1 + 1.2\%) = 49,407.11 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 50,000 - 49,407.11 = 592.89 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 49,407.11 / 1.0500 = 47054.39 \text{ 份}$$

即：投资者投资 5 万元申购本基金基金份额，假设申购当日基金份额净值为 1.05 元，则其可得到 47054.39 份基金份额。

## 2、赎回金额的计算

本基金的赎回采用“份额赎回”方式，赎回价格以 T 日的基金份额净值为基准进行计算，本基金的赎回金额为赎回总额扣减赎回费用。

(1) 当投资者赎回基金份额时，赎回金额的计算方法如下：

$$\text{赎回金额} = \text{赎回份额} \times \text{T 日基金份额净值}$$

$$\text{赎回费用} = \text{赎回金额} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{净赎回金额} = \text{赎回金额} - \text{赎回费用}$$

(2) 上述计算结果均按舍去尾数方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

例：假定申请赎回的基金份额均为 10,000 份，但持有时间长短不同，其中基金份额净值假设为 1.2000 元，那么各笔赎回负担的赎回费用和获得的净赎回金额计算如下：

持有期限 (T)	适用费率	赎回总金额	赎回费用	净赎回金额
T < 7 日	1.50%	10000*1.200=12000	12000*1.50%=180	12000-180=11820.00
7 日 ≤ T < 30 日	0.75%	10000*1.200=12000	12000*0.75%=90	12000-90=11910.00
30 日 ≤ T < 365 日	0.5%	10000*1.200=12000	12000*0.5%=60	12000-60=11940.00
365 日 ≤ T < 730 日	0.25%	10000*1.200=12000	12000*0.25%=30	12000-30=11970.00
T ≥ 730 日	0.0%	10000*1.200=12000	12000*0.0%=0	12000-0=12000.00

## 3、基金份额净值计算

T 日基金份额净值 = T 日基金资产净值 / T 日发行在外的基金份额总数。

基金份额净值为计算日基金资产净值除以计算日发行在外的基金份额总数，基金份额净值单位为元，计算结果保留在小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金资产享有或承担。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

## 4、摆动定价机制

本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遵循相关法律法规、监管部门和自律规则的相关规定。

#### （八）巨额赎回的情形及处理方式

##### 1、巨额赎回的认定

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

##### 2、巨额赎回的处理方式

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

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

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

如本基金发生巨额赎回时,在单个基金份额持有人超过基金总份额 10%以上的赎回申请的情形下,基金管理人可实施延期办理赎回申请,具体延期赎回申请处理方式同上述安排一致。

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

##### 3、巨额赎回的公告

当发生上述巨额赎回并延期办理时,基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个工作日内通知基金份额持有人,说明有关处理方法,同时并在 2 日内在

规定媒介上刊登公告。

### （九）拒绝或暂停申购、赎回的情形及处理方式

1、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转。
- （2）发生基金合同约定的暂停基金资产估值情况时，或当前一估值日基金资产净值 50% 以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受投资人的申购申请。
- （3）证券、期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
- （4）接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。
- （5）基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或发生其他损害现有基金份额持有人利益的情形。
- （6）基金管理人、基金托管人、基金销售机构或登记机构的异常情况导致基金销售系统、基金登记系统或基金会计系统无法正常运行。
- （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数的比例达到或者超过基金份额总数的 50%，或者有可能导致投资者变相规避前述 50% 比例要求的情形。
- （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）、（6）、（7）项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时，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全部或部分被拒绝的，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

2、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）发生基金合同约定的暂停基金资产估值情况时，或当前一估值日基金资产净值 50% 以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。
- （3）证券、期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

(4) 连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

(5) 继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时，可暂停接受投资人的赎回申请。

(6) 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

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

#### (十) 暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

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

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

3、若暂停时间超过1日，基金管理人可以根据暂停申购或赎回的时间，依照《信息披露办法》的有关规定，最迟于重新开放申购或赎回日在规定媒介上刊登重新开放申购或赎回的公告，并公布最近1个工作日的基金份额净值；也可以根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间，届时不再另行发布重新开放的公告。

#### (十一) 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。

#### (十二) 基金的非交易过户

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

继承是指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；捐赠指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体；司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法

人或其他组织。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。

### **(十三) 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标准收取转托管费。

### **(十四) 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。

### **(十五) 基金份额的冻结和解冻**

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

### **(十六) 基金份额的转让**

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

### **(十七) 实施侧袋机制期间本基金的申购与赎回**

本基金实施侧袋机制的，本基金的申购与赎回安排详见招募说明书“侧袋机制”部分的规定。

## 基金的投资

### （一）投资目标

本基金将灵活运用多种投资策略，在严格控制风险并保证流动性的前提下，充分挖掘市场中潜在的投资机会，力争为基金份额持有人创造中长期稳健的投资回报。

### （二）投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、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、央行票据、中期票据、短期融资券、次级债、可转换债券（包括可分离交易可转债）、可交换债券等）、同业存单、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、权证、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

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

基金的投资组合比例为：本基金对股票的投资比例为基金资产的 30%-75%；权证投资比例不得超过基金资产净值的 3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

### （三）投资策略

本基金采用多种投资策略和交易手段进行大类资产配置和股票的行业配置，在预防出现单一策略可能失效的情况下，保证整体投资业绩的稳健持续性。

#### 1、大类资产配置

本基金将综合运用定性和定量的分析方法，在对宏观经济进行深入研究的基础上，依据宏观经济周期所处阶段及变化趋势，结合估值水平、政策取向等因素，综合评估各大类资产的预期收益率和风险，合理确定本基金在股票、债券、权证、现金等大类资产之间的配置比例，以最大限度降低投资组合的风险、提高投资组合的收益。

#### 2、股票投资策略

本基金在深入分析企业基本面的基础上，建立成长策略、价值策略、再融资策略、动量策略、主题策略、事件驱动策略等多策略投资体系，并根据市场环境的变化进行灵活运用。

其中，成长策略采用自下而上的分析方法，从多维度进行企业成长性分析，精选具有较高成长性的股票；价值策略通过定性和定量分析结合估值分析，精选出价值被低估的股票进行投资；再融资投资策略主要关注上市公司再融资过程中事件关联的投资机会；动量策略重在捕捉市场动量效应驱动的投资机会；主题策略通过经济发展和资本市场趋势变化的研究把握不同主题的投资机会；事件驱动策略通过捕捉特定事件对上市公司价值有显著影响的投资机会。本基金通过以上多种策略的综合运用，精选具有估值优势的个股建立投资组合，并根据阶段性的市场变化因素进行动态调整。

#### 1) 成长策略

本基金对成长型公司的投资以新兴产业、处于周期性景气上升阶段的拐点行业以及持续增长的传统产业为重点，并精选其中行业代表性高、潜在成长性好、估值具有吸引力的个股进行投资。本基金通过定量和定性相结合的方法定期分析和评估上市公司的成长空间和竞争壁垒，从而确定本基金重点投资的成长型行业，并根据定期分析和评估结果动态调整。

#### 2) 价值策略

本基金的价值策略是通过寻找价值被低估的股票进行投资，以谋求估值反转带来的收益。通过运用多项指标如 PE、PB、EV/EBITDA 等进行相对估值，通过与国内同行业其它公司估值水平以及国外同行业公司相对估值水平等进行估值比较，找出价值被相对低估的公司。

#### 3) 再融资投资策略

本基金的再融资投资策略是通过研究上市公司再融资用途、再融资对象、再融资进程等多种因素，主要投资于再融资发行的证券，以及处于再融资进程中、再融资完成但增发或获配股份还处于限售期内、二级市场股价跌破定增预案价或实际增发价一定幅度的股票，以及有投资价值的可转债品种。本基金将根据对证券内在投资价值和成长性的判断，结合股票市场环境的分析，选择适当的时机调整投资组合。

#### 4) 动量策略

动量策略是指市场在一定时期内可呈现“强者恒强”的特征，通过买入过去一段时期的强势股可以获得超越市场平均水平的收益。本基金将综合分析各股票的市场价格动量特征，分析指标包括各股票的阶段累计收益率、换手率、市场交易活跃度、波动率，选择动量特征明显和价格趋势强劲的个股纳入投资组合，作为本基金的辅助投资策略。

#### 5) 主题策略

本基金通过深入研究经济发展和资本市场趋势变化，分析影响经济发展或企业盈利的关键性驱动因素及成长动因，挖掘中长期主题投资机会，并精选出符合投资主题的行业以及具

有核心竞争力的上市公司。首先，从经济体制变革、产业结构调整、技术发展创新等多个角度出发，分析经济结构、产业结构或企业商业运作模式变化的根本性趋势以及导致上述根本性变化的关键性驱动因素，从而前瞻性地发掘经济发展过程中的投资主题；其次，通过对投资主题的全面分析和评估，明确投资主题所对应的主题行业或主题板块，从而确定受惠于相关主题的公司，依据企业对投资主题的敏感程度、反应速度以及获益水平等指标，精选个股；再次，通过紧密跟踪经济发展趋势及其内在驱动因素的变化，不断地挖掘和研究新的投资主题，并对主题投资方向做出适时调整，从而准确把握新旧投资主题的转换时机，充分分享不同投资主题兴起所带来的投资机遇。

#### 6) 事件驱动策略

事件驱动策略是通过研究市场中的某一类规律性事件，如研究员一致预期变动、上市公司业绩超预期、股东增持、大股东减持、指数成份股调整等，发现上述事件蕴含阶段性投资机会的投资策略。本基金将在适当的时机选用合适的事件策略，用于捕捉阶段性的超额收益或绝对收益。

### 3、债券投资策略

债券投资主要用于提高非股票资产的收益率，基金管理人将坚持价值投资的理念，严格控制风险，追求合理的回报。

本基金将通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势以及不同类属的收益率水平、流动性和信用风险等因素，以久期控制和结构分布策略为主，以收益率曲线策略、利差策略等为辅，构造能够提供稳定收益的债券和货币市场工具组合。

本基金管理人密切关注通胀、利率、期限、流动性、税收等因素，实时确定各债券品种的公允价值。通过配置不同类别和期限的债券品种，达到债券组合的收益率目标。

### 4、股指期货投资策略

本基金投资股指期货以对冲系统性风险为目的，达到套期保值目的。基金管理人动态调整股指期货合约持仓品种、持仓数量，与现货相匹配，控制风险，并驻留相对收益。

### 5、资产支持证券投资策略

本基金通过对资产支持证券资产池结构和质量的跟踪考察、分析资产支持证券的发行条款、预估提前偿还率变化对资产支持证券未来现金流的影响，谨慎投资资产支持证券。

### 6、权证投资策略

本基金的权证投资以控制风险、平滑收益、锁定利润为主要目的。本基金通过对权证标的的基本面研究和未来走势预判，估算权证合理价值，同时还充分考虑其的流动性，谨慎投资。

## 7、可转债投资策略

可转债不同于一般的企业债券，其投资人具有在一定条件下转股、回售的权利，因此其理论价值等于作为普通债券的基础价值加上可转债内含选择权的价值。本基金投资于可转债，主要目标是降低基金净值的下行风险，基金投资的可转债可以转股，以保留参与股票升值的收益潜力。

### （四）投资限制

#### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

- 1) 本基金股票资产占基金资产的比例为 30%-75%；
- 2) 每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；
- 3) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值不得超过基金资产净值的 10%；
- 4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；
- 5) 本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；
- 6) 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%；
- 7) 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%；
- 8) 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%；
- 9) 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%；
- 10) 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 15%；
- 11) 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%；
- 12) 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%；
- 13) 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；

14) 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；

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

16) 本基金基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

17) 本基金参与股指期货交易，需遵守下列投资比例限制：本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值不得超过基金资产净值的 10%；在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；在任何交易日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例应当符合《基金合同》关于股票投资比例的有关规定；在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；

18) 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；

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

20) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除 2)、13)、18)、19) 之外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

2、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。上述期间，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或调整上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按照调整后的规定执行。

### 3、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) 向基金管理人、基金托管人出资；
- (5) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (6) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

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

如法律、行政法规或监管部门取消上述禁止性规定，本基金可不受上述规定的限制。

#### (五) 业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为： $\text{沪深 300 指数收益率} \times 60\% + \text{中国债券总指数收益率} \times 40\%$ 。

沪深 300 指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权，由中证指数有限公司开发的中国 A 股市场指数，它的样本选自沪深两个证券市场，覆盖了大部分流通市值，其成份股票为中国 A 股市场中代表性强、流动性高的股票，能够反映 A 股市场总体发展趋势。

中国债券总指数是由中央国债登记结算有限责任公司于 2001 年 12 月 31 日推出的债券指数。它是中国债券市场趋势的表征，也是债券组合投资管理业绩评估的有效工具。中国债券总指数为掌握我国债券市场价格总水平、波动幅度和变动趋势，测算债券投资回报率水平，判断债券供求动向提供了很好的依据。

基金管理人认为，该业绩比较基准目前能够忠实地反映本基金的风险收益特征。如果今后法律法规发生变化，或证券市场中有其他代表性更强或者更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，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，并报中国证监会备案，而无需召开基金份额持有人大会。基金管理人应在调整实施前 2 个工作日在规定媒介上予以

公告。

#### （六） 风险收益特征

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

#### （七） 基金管理人代表基金行使股东或债权人权利的处理原则及方法

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

2、不谋求对上市公司的控股；

3、有利于基金财产的安全与增值；

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

#### （八） 侧袋机制的实施和投资运作安排

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

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

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

#### （九） 基金投资组合报告

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

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年1月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

**1. 报告期末基金资产组合情况**

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	8,310,245.00	72.94
	其中：股票	8,310,245.00	72.94
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	305,680.00	2.68
	其中：债券	305,680.00	2.68
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,434,535.35	21.37
8	其他资产	342,278.20	3.00
9	合计	11,392,738.55	100.00

**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	-	-
C	制造业	6,279,874.00	56.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,256,115.00	11.33
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	774,256.00	6.98
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-

	合计	8,310,245.00	74.97
--	----	--------------	-------

注：以上行业分类以 2020 年 12 月 31 日的证监会行业分类标准为依据。

### 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	600809	山西汾酒	2,100	788,109.00	7.11
2	600276	恒瑞医药	7,000	780,220.00	7.04
3	600763	通策医疗	2,800	774,256.00	6.98
4	601888	中国中免	2,700	762,615.00	6.88
5	000333	美的集团	7,600	748,144.00	6.75
6	601012	隆基股份	7,500	691,500.00	6.24
7	002568	百润股份	6,600	688,314.00	6.21
8	000858	五粮液	2,300	671,255.00	6.06
9	002027	分众传媒	50,000	493,500.00	4.45
10	300760	迈瑞医疗	1,000	426,000.00	3.84

### 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）	305,680.00	2.76
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	305,680.00	2.76

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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	128017	金禾转债	2,000	305,680.00	2.76

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

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序的前五名贵金属投资明细

报告期末，本基金未持有贵金属投资。

#### 8. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

报告期末，本基金未持有权证。

#### 9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与股指期货交易。

#### 10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

#### 11. 投资组合报告附注

(1) 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未被监管部门立案调查，且在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

(2) 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

#### (3) 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	5,649.02
2	应收证券清算款	28,293.16
3	应收股利	-
4	应收利息	643.72
5	应收申购款	307,692.30
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	342,278.20

#### (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	128017	金禾转债	305,680.00	2.76

#### (5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

## 基金的业绩

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

1、自基金合同生效以来至 2020 年 12 月 31 日，本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表：

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
2018 年 5 月 25 日至 2018 年 12 月 31 日	-2.5%	0.32%	-11.65%	0.87%	9.15%	-0.55%
2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	39.71%	1.06%	21.41%	0.74%	18.30%	0.32%
2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	70.78%	1.42%	16.22%	0.84%	54.56%	0.58%

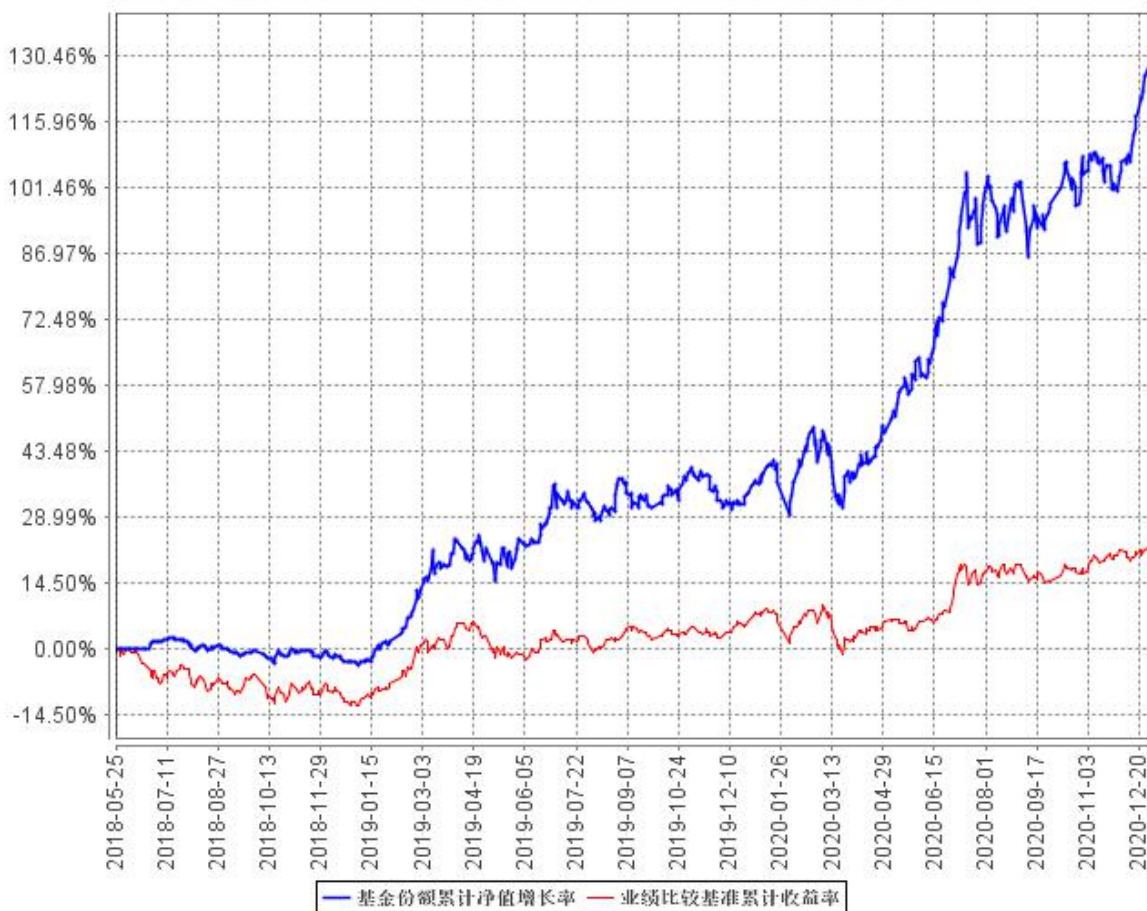
2、自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

### 国都多策略混合型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图：

（2018 年 5 月 25 日至 2020 年 12 月 31 日）

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图





## 基金的财产

### （一）基金资产总值

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

### （二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### （三）基金财产的账户

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

### （四）基金财产的保管和处分

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

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

## 基金资产估值

### （一） 估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券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、股指期货合约、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

### （三） 估值原则

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

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

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

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

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

### （四） 估值方法

## 1、证券交易所上市的有价证券的估值

(1) 交易所上市的有价证券（包括股票、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) 交易所上市交易或挂牌转让的不含权和含权固定收益品种，选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价；

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

(4) 交易所市场挂牌转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

## 2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

(2) 首次公开发行未上市的股票、债券和权证，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。

3、全国银行间债券市场交易的固定收益品种，选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价。

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、股指期货合约以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

6、如有充足理由认为按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值。

7、当本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采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性，并需履行相关信息披露义务。摆动定价机制的处理原则与操作规范参考中国证监会颁布的相关法律法规或中国证券投资基金业协会制定的相关标准。

8、相关法律法规以及监管部门有强制规定且适用于本基金的，从其规定。

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，按照基金管理人对本基金资产净值的计算结果对外予以公布。

#### **（五） 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0.0001元，小数点后第五位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或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，由基金管理人根据基金合同的约定对外公布。

#### **（六） 估值错误的处理**

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后四位以内(含第四位)发生估值错误时，视为基金份额净值错误。

基金合同的当事人应按照以下约定处理：

##### **1、估值错误类型**

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

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

## 2、估值错误处理原则

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

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

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

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

## 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

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

## 4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

(1) 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) 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。

#### **(七) 暂停估值的情形**

- 1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；
- 3、当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上的，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停基金估值；
- 4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

#### **(八) 基金净值的确认**

用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个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根据基金合同的约定予以公布。

#### **(九) 特殊情况的处理**

- 1、基金管理人或基金托管人按基金合同约定的估值方法第 6 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。
- 2、由于不可抗力，或由于证券、期货交易所或登记结算公司发送的数据错误等原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

#### **(十) 实施侧袋机制期间的基金资产估值**

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

## 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6次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的20%，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。

在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可调整基金收益的分配原则，不需召开基金份额持有人大会审议。

### （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并报中国证监会备案。

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，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。

#### **（七） 实施侧袋机制期间的收益分配**

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



## 基金的费用与税收

### （一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、《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、诉讼费和仲裁费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券、期货交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、基金的账户开户费用、账户维护费用；
- 9、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

### （二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人授权基金托管人于次月首日起 5 个工作日内将双方复核后的管理费从基金资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 0.15%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人授权基金托管人于次月首日起 5 个工作日内将双方复核后的托管费从基金资产中一次性支取。若遇法定节假日

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。

上述“（一）基金费用的种类”中第3—9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

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

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、《基金合同》生效前的相关费用；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

### （四） 实施侧袋机制期间的基金费用

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

### （五） 基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## 基金的会计与审计

### （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、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以托管协议约定方式确认。

### （二）基金的年度审计

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

## 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》、《基金合同》及其他有关规定。

### 二、信息披露义务人

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

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

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过符合中国证监会规定条件的全国性报刊（以下简称“规定报刊”）及《信息披露办法》规定的互联网网站（以下简称“规定网站”）等媒介披露，并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

三、本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

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

四、本基金公开披露的信息应采用中文文本。如同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证两种不同文本的内容一致。两种不同文本之间发生歧义的，以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

### 五、公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

#### （一）基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议、基金产品资料概要

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

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

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

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

基金募集申请经中国证监会注册后，基金管理人在基金份额发售的3日前，将基金招募说明书、《基金合同》摘要登载在规定媒介上；基金管理人、基金托管人应当将《基金合同》、基金托管协议登载在网站上。

## （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） 基金资产净值、基金份额净值

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

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额销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。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在规定媒介上。

#### **（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份额销售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、基金半年度报告和基金季度报告**

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

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

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

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

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

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

#### **（七） 临时报告**

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 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、《基金合同》终止、基金清算；

- 3、转换基金运作方式、基金合并；
- 4、更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；
- 5、基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；
- 6、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- 7、基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人的实际控制人变更；
- 8、基金募集期延长或提前结束募集；
- 9、基金管理人的高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；
- 10、基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十，基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十；
- 11、涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁；
- 12、基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；
- 13、基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易事项，但中国证监会另有规定的除外；
- 14、基金收益分配事项；15、管理费、托管费、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、基金份额净值估值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、本基金发生巨额赎回并延期办理；
- 19、本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；
- 20、本基金暂停接受申购、赎回申请或者重新接受申购、赎回
- 21、发生涉及本基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；
- 22、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；
- 23、基金信息披露义务人认为可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的其他事项或中国证监会规定的其他事项。

#### （八）澄清公告

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

#### **（九）基金份额持有人大会决议**

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

#### **（十）清算报告**

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

#### **（十一）股指期货的投资情况**

基金管理人应当在基金季度报告、基金半年度报告、基金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。

#### **（十二）资产支持证券的投资情况**

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

#### **（十三）中小企业私募债的投资情况**

本基金投资中小企业私募债券后两个交易日内，基金管理人应在中国证监会规定媒介披露所投资中小企业私募债券的名称、数量、期限、收益率等信息，并在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露中小企业私募债券的投资情况。

#### **（十四）实施侧袋机制期间的信息披露**

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

#### **（十五）中国证监会规定的其他信息。**

### **六、信息披露事务管理**

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



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

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、基金定期报告和定期更新的招募说明书、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、基金上市交易的证券交易所网站（如适用）披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

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

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规定媒介规定媒介规定媒介。

## 七、信息披露文件的存放与查阅

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

## 八、本基金信息披露事项以法律法规规定及《基金合同》约定的内容为准

## 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后及时发布临时公告，并在法律法规规定的时间内聘请侧袋机制启用日发表意见且符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所进行审计并披露专项审计意见。

### （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，确认相应侧袋账户基金份额持有人名册和份额；当日收到的申购申请，按照启用侧袋机制后的主袋账户份额办理；当日收到的赎回申请，仅办理主袋账户份额的赎回申请并支付赎回款项。

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

3、除基金管理人应按照主袋账户的份额净值办理主袋账户份额的申购和赎回外，本招募说明书“基金份额的申购与赎回”部分的申购、赎回规定适用于主袋账户份额，巨额赎回按照单个开放日内主袋账户份额净赎回申请超过前一工作日主袋账户总份额的10%认定。

### （三）实施侧袋机制期间的基金投资

侧袋机制实施期间，招募说明书“基金的投资”部分约定的投资组合比例、投资策略、组合限制、业绩比较基准、风险收益特征等约定仅适用于主袋账户，基金管理人计算各项投资运作指标和基金业绩指标时仅需考虑主袋账户资产。

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

基金管理人不得在侧袋账户中进行除特定资产处置变现以外的其他投资操作。

### （四）实施侧袋机制期间的基金估值

本基金实施侧袋机制的，基金管理人和基金托管人应对主袋账户资产进行估值并披露主袋账户的基金资产净值和份额净值，暂停披露侧袋账户份额净值。侧袋账户的会计核算应符合《企业会计准则》的相关要求。

#### **（五）实施侧袋账户期间的基金费用**

1、 本基金实施侧袋机制的，主袋账户的管理费、托管费和销售服务费按主袋账户基金资产净值作为基数计提。

2、 与侧袋账户有关的费用可从侧袋账户列支，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）侧袋账户中特定资产的处置变现和支付**

特定资产以可出售、可转让、恢复交易等方式恢复流动性后，基金管理人应当按照基金份额持有人利益最大化原则，采取将特定资产予以处置变现等方式，及时向侧袋账户份额持有人支付对应变现款项。

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

侧袋账户资产全部完成变现并终止侧袋机制后，基金管理人及时聘请符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所进行审计并披露专项审计意见。

#### **（七）侧袋机制的信息披露**

##### **1、 临时公告**

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

##### **2、 基金净值信息**

基金管理人应按照招募说明书“基金的信息披露”部分规定的基金净值信息披露方式和频率披露主袋账户份额的基金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和累计净值。

##### **3、 定期报告**

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

## 风险揭示

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

### （一）市场风险

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

#### 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，导致证券价格波动而产生风险。

#### 2、经济周期风险

经济运行具有周期性的特点，宏观经济运行状况将对证券市场的收益水平产生影响，基金投资的收益水平也会随之变化，从而产生风险。

#### 3、利率风险

金融市场利率波动会影响货币的供需水平，并进一步影响证券价格。同时直接影响企业的融资成本和利润水平。基金投资于债券，收益水平会受到利率变化的影响。

#### 4、购买力风险

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

#### 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。

### （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

指基金资产不能迅速转变成现金，或者不能应付可能出现的投资者大额赎回的风险。在开放式基金交易过程中，可能会发生如下流动性风险，甚至影响基金份额净值。

### 1、申购、赎回的流动性风险及安排

本基金在开放式基金交易过程中，可能会发生巨额申购、赎回等情形。巨额申购、赎回可能会产生基金仓位调整的困难，导致流动性风险，甚至影响基金份额净值。

本基金积极加强申购环节的管理，合理控制基金份额持有人集中度，审慎确认大额申购申请，保持对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，积极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。

本基金积极充分评估基金组合资产变现能力、投资比例变动与基金单位份额净值波动的基础上，审慎接受、确认赎回申请，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。

### 2、本基金拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估及安排

本基金主要的投资品种为在国内上市的股票、债券、债券回购、及同业存单。

股票的流动性风险是指因存在停牌或其他交易所暂停交易的情形导致的流动性风险。本基金将个股的交易流动性列为重要影响因素，采取分散化投资，控制个股不同流动性级别的投资比例，保证本基金产品的流动性。

债券的流动性风险是指难以合理价格及时变现的风险，债券的交易活跃度整体低于股票。本基金对投资于债项评级AA以下的企业债、公司债、中期票据短期融资债券、次级债的投资比例、审批程序方面做出比较严格的限制，债券投资的流动性风险整体可控。

同业存单的流动性风险是指在规模剧烈缩减下，导致市场交投活跃度下降，从而一定程度的增加资产变现难度及资产变现价值。其中短久期同业存单流动性较好，本基金主要投资1年以内、高信用级别同业存单，同业存单投资的流动性风险整体可控。

债券回购的流动性风险是指由于其期限固定导致的流动性风险，本基金拟通过短期限安排或期限搭配等方式来降低风险。

### 3、巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

基金管理人认为本基金有能力支付全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。基金管理人认为本基金现金不足以支付赎回款项时，会当在充分评估基金组合资产变现能力、投资比例变动与基金单位份额净值波动的基础上，审慎接受、确认赎回申请。本基金在巨额赎回情形下的流动性风险管理措施包括：部分延期办理巨额赎回申请、暂停接受赎回申请、延缓支付赎回款项、收取短期赎回费、暂停基金估值、摆动定价以及中国证监会认定的其他措施。

### 4、实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响

当本基金发生下列情形时，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)、发生基金合同约定的暂停基金资产估值情况时，或当前一估值日基金资产净值 50% 以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。

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

4)、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

5)、继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时，可暂停接受投资人的赎回申请。

6)、实施侧袋机制：具体请参见招募说明书“侧袋机制”部分，详细了解本基金实施侧袋机制的情形及程序。

当基金管理人采取上述措施时，投资者将面临申购、赎回被拒绝、无法及时获得赎回款项或承担更高的投资成本等风险。

8) 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在本文中列示，其中对持续持有期少于 7 日的投资者收取 1.5% 的赎回费并全额计入基金财产。

本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遵循相关法律法规、监管部门和自律规则的相关规定。

当本基金发生下列情形时，基金管理人可暂停估值：

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

2)、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

3)、当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；

4)、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按

单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。若出现上述第 4 项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

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

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

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

如本基金发生巨额赎回时，在单个基金份额持有人超过基金总份额 10%以上的赎回申请的情形下，基金管理人可实施延期办理赎回申请，具体延期赎回申请处理方式同上述安排一致。

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

当本基金实施不同的流动性风险管理工具时，将会对基金投资者产生影响，具体的影响如下：

1) 当本基金延期办理巨额赎回申请和暂停接受赎回申请时，投资者发起的赎回申请将会根据基金的赎回情况有所影响；

2) 当本基金延期支付赎回款项时，持有不同份额的投资者发起赎回申请后，将会根据具体延期支付款项的程序公平对待投资者，投资者收到赎回款项的实际到账日期将有所延迟；

3) 基金管理人对持续持有期少于 7 日的本基金的投资人收取 1.5%的赎回费，并将上

述赎回费全额计入基金财产，强化对投资者短期投资行为的管理；

4) 当本基金采用摆动定价机制时，以确保基金估值的公平性，保证对申购或赎回的投资者和持有本基金的投资者的公平对待。

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

6、实施侧袋机制期间，因本基金不披露侧袋账户份额的净值，即便基金管理人在基金定期报告中披露报告期末特定资产可变现净值或净值区间的，也不作为特定资产最终变现价格的承诺，因此对于特定资产的公允价值和最终变现价格，基金管理人不承担任何保证和承诺的责任。

7、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。

8、启用侧袋机制后，基金管理人计算各项投资运作指标和基金业绩指标时仅需考虑主袋账户资产，基金业绩指标应当以主袋账户资产为基准，因此本基金披露的业绩指标不能反映特定资产的真实价值及变化情况。

#### **(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。

#### **(五) 操作风险**

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

在开放式基金的各种交易行为或者后台运作中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致投资者的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理公司、登记机构、其他销售机构、证券交易所、证券登记结算机构等等。



## （六） 合规风险

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） 本基金的特定风险

### 1、 混合型基金特有的风险

本基金为混合型基金，会投资于股票资产，投资者面临的特定风险主要为资产配置风险、股票投资风险以及其他证券投资风险。股票投资收益会受宏观经济、市场偏好、行业波动和公司自身经营状况等因素的影响，本基金所投资的股票可能在一定时期内表现与其他未投资的股票不同，造成本基金的收益低于其他基金；另外，由于本基金还可以投资债券等其他品种，这些品种的价格也可能因市场中的各类变化而出现一定幅度的波动，产生特定的风险，并影响到整体基金的投资收益。

### 2、 资产支持证券的投资风险

本基金可投资于资产支持证券。资产支持证券是一种债券性质的金融工具，其具有的风险包括：价格波动风险、流动性风险、及信用风险。价格波动风险指的是市场利率波动会导致资产支持证券的收益率和价格波动。流动性风险指的是受资产支持证券市场规模及交易活跃程度的影响，资产支持证券可能无法在同一价格水平上进行较大数量的买入或卖出，存在一定的流动性风险。信用风险指的基金所投资的资产支持证券之债务人出现违约，或在交易过程中发生交收违约，或由于资产支持证券信用质量降低导致证券价格下降，造成基金财产损失。

### 3、 股指期货的投资风险

本基金可投资于股指期货，股指期货作为一种金融衍生品，其所面临的风险如下：

#### （1） 杠杆风险

股指期货交易采用保证金交易方式，由于高杠杆特征，当出现不利行情时，股价指数微小的变动就可能会使本基金遭受较大损失。

#### （2） 强制平仓的风险

如果市场走势对本基金持有的期货合约不利从而导致账户保证金不足时，期货公司会按照期货经纪合同约定的时间和方式通知追加保证金，以使本基金能继续持有未平仓合约。如未于规定时间内存入所需保证金，本基金持有的未平仓合约将可能在亏损的情况下被强行平仓，本基金必须承担由此导致的一切损失。

#### （3） 无法平仓的风险

在市场剧烈变化的情况下，基金管理人可能难以或无法将持有的未平仓合约平仓。这类情况将导致保证金有可能无法弥补全部损失，本基金必须承担由此导致的全部损失。同时本基金将面临股指期货无法当天平仓而价格变动的风险。

#### （4）强行减仓的风险

在极端情况下，本基金持有的期货合约可能被期货交易所强行减仓，从而使得本基金无法继续持有期货合约，从而导致交易价格的不确定性或者策略失败。

#### （5）政策变化的风险

由于国家法律、法规、政策的变化、期货交易所交易规则的修改、紧急措施的出台等原因导致未平仓合约可能无法继续持有从而导致损失。

#### （6）连带风险

为委托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，委托财产的资产可能因被连带强行平仓而遭受损失。

#### （7）合作方风险

本基金管理人运用委托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委托财产遭受损失。

#### （八）其它风险

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

金融市场危机、行业竞争、销售机构违约、托管人违约等超出基金管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致基金或者基金持有人利益受损。

## 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生效后方可执行，并自决议生效后两日内在规定媒介公告。

### （二）基金合同的终止事由

有下列情形之一的，基金合同应当终止：

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

### （三）基金财产的清算

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

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券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符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算小组进行公告。基金财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

#### **(七) 基金财产清算账册及文件的保存**

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存不低于法律法规规定的最低期限。

## 基金合同内容摘要

### 一、基金管理人、基金托管人和基金份额持有的权利、义务

#### (一) 基金管理人的权利与义务

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

- (1) 依法募集资金；
- (2) 自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
- (3) 依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- (4) 销售基金份额；
- (5) 按照规定召集基金份额持有人大会；
- (6) 依据《基金合同》及有关法律、法规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律、法规规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- (7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- (8) 选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；
- (9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；
- (10) 依据《基金合同》及有关法律、法规规定决定基金收益的分配方案；
- (11) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；
- (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) 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；
- (14) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商、期货经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；
- (15) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换

和非交易过户等业务规则；

(16) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

(1) 依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构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内发出, 并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式, 随时查阅到与基金有关的公开资料, 并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件;

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

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

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

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

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

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

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

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议;

(26) 建立并保存基金份额持有人名册;

(27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## (二) 基金托管人的权利与义务

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

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

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

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

(4) 根据相关市场规则, 为基金开设资金账户和证券账户等投资所需账户, 为基金办

理证券、期货交易资金清算；

(5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

(6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

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

(5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

(6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户等投资所需账户，按照《基金合同》及《托管协议》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》、《托管协议》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，因审计、法律等外部专业顾问提供的情况除外；

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

(9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

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

(11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料不低于法律法规规定的最低期限；

(12) 从基金管理人或其委托的登记机构处接收并保存基金份额持有人名册；



- (13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
- (14) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；
- (15) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
- (16) 按照法律法规、基金合同及托管协议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》及《托管协议》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- (20) 按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿；
- (21) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- (22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

### (三) 基金份额持有人的权利与义务

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》、招募说明书等信息披露文件；
- (2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；
- (3) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；
- (4) 缴纳基金认购、申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；
- (5) 在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；
- (6) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；
- (7) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- (8) 返还在基金交易过程中因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

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

本基金份额持有人大会不设日常机构。

### (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) 终止《基金合同》；
- (2) 更换基金管理人；
- (3) 更换基金托管人；
- (4) 转换基金运作方式；
- (5) 调整基金管理人、基金托管人的报酬标准；
- (6) 变更基金类别；
- (7) 本基金与其他基金的合并；
- (8) 变更基金投资目标、范围或策略；
- (9) 变更基金份额持有人大会程序；
- (10) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- (11) 单独或合计持有本基金总份额10%以上（含10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；
- (12) 对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

(13) 法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

2、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) 调低除基金管理费、基金托管费以外的其他费用；
- (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》规定的范围内且在对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下调整本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式；
- (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重大变化；
- (6) 按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

## (二) 会议召集人及召集方式

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

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。

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

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

5、代表基金份额10%以上（含10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表基金份额10%以上（含

10%)的基金份额持有人有权自行召集,并至少提前30日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的,基金管理人、基金托管人应当配合,不得阻碍、干扰。

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

(三) 召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

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

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下,由会议召集人决定在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、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表决意见的计票进行监督的,不影响表决意见的计票效力。

(四) 基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式或法律法规、监管机构允许的其他方式召开,会议的召开方式由会议召集人确定。基金管理人、基金托管人须为基金份额持有人行使投票权提供便利。

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书委派代表出席,现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会,基金管理人或基金托管人不派代表列席的,不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时,可以进行

基金份额持有人大会议程：

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

(2) 经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）；若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、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到会者在权益登记日代表的有效的基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之一（含三分之一）。

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

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

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

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

(4) 上述第(3)项中直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面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书符合法律法规、《基金合同》和会议通

知的规定，并与基金登记机构记录相符。

3、在法律法规和监管机关允许的情况下，本基金的基金份额持有人亦可采用其他非书面方式授权其代理人出席基金份额持有人大会，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

4、在会议召开方式上，本基金亦可采用其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开基金份额持有人大会，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。

#### (五) 议事内容与程序

##### 1、议事内容及提案权

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

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

##### 2、议事程序

###### (1) 现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第（七）款规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

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

###### (2) 通讯开会

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

#### (六) 表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

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

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

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

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

#### (七) 计票

##### 1、现场开会

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

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

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

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

## 2、通讯开会

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

### (八) 生效与公告

基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

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

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

### (九) 实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定

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

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

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

3、通讯开会的直接出具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)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的部分,如将来法律法规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

#### (一)《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的;

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

3、《基金合同》约定的其他情形;

4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

#### (二)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。

### (三) 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。

### (四) 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。

### (五) 基金财产清算的公告

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

### (六) 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存不低于法律法规规定的最低期限。

## 四、争议解决方式

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，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，对当事人均有约束力。仲裁费用由败诉方承担，除非仲裁裁决另有决定。

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约定的义务，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。

## 基金托管协议的内容摘要

### （一） 托管协议当事人

#### 1、基金管理人

名称：国都证券股份有限公司

住所：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层

办公地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层

法定代表人：翁振杰

成立时间：2001年12月28日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监机构字[2001]309号

公募基金管理业务资格批文及文号：中国证监会证监许可[2014]854号

经营范围：证券经纪；证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问；证券承销与保荐；证券自营；证券资产管理；证券投资基金代销；为期货公司提供中间介绍业务；融资融券业务；代销金融产品业务；公开募集证券投资基金管理业务。

注册资本：583000.0009万元

组织形式：股份有限公司

存续期间：持续经营

#### 2、基金托管人

名称：兴业银行股份有限公司

住所：福建省福州市湖东路154号

法定代表人：陶以平（代为履行法定代表人职权）成立时间：1988年8月22日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[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委员会批准的其他业务。

电话：(021)62677777

传真：(021)62159217

## **(二) 基金托管人对基金管理人的业务监督和核查**

### **1、基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权**

**(1) 基金托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定，对下述基金投资范围、投资对象进行监督。**

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板、中小板以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、央行票据、中期票据、短期融资券、次级债、可转换债券等（包括可分离交易可转债）、可交换债券等）、同业存单、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、权证、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

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

**(2) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投融资比例进行监督：**

(1) 按法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金的投资资产配置比例为：

本基金对股票的投资比例为基金资产的 30%-75%；权证投资比例不得超过基金资产净值的 3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

(2) 根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金投资组合遵循以下投资限制：

1) 本基金股票资产占基金资产的比例为 30%-75%；

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

3) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值不得超过基金资产净值的 10%；

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

5) 本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放

基金) 持有一家上市公司发行的可流通股票, 不得超过该上市公司可流通股票的 15%; 本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票, 不得超过该上市公司可流通股票的 30%;

6) 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%;

7) 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%;

8) 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%;

9) 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%;

10) 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 15%;

11) 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%;

12) 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%;

13) 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;

14) 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;

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

16) 本基金基金总资产不得超过基金净资产的 140%;

17) 本基金参与股指期货交易, 需遵守下列投资比例限制: 本基金在任何交易日日终, 持有的买入股指期货合约价值不得超过基金资产净值的 10%; 在任何交易日日终, 持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和, 不得超过基金资产净值的 95%, 其中, 有价证券指股票、债券(不含到期日在一年以内的政府债券)、权证、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等; 在任何交易日日终, 持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%; 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值, 合计(轧差计算)占基金资产的比例应当符合《基金合同》关于股票投资比例的有关规定; 在任何交易日内交易(不包括平仓)的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的

20%;

18) 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;

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

20) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除 2)、13)、18)、19) 之外, 因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的, 基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整, 但中国证监会规定的特殊情形除外。

2、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。上述期间, 基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或调整上述限制, 如适用于本基金, 基金管理人在履行适当程序后, 则本基金投资不再受相关限制或按照调整后的规定执行。

**(3) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定, 对下述基金投资禁止行为进行监督:**

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

如法律、行政法规或监管部门取消上述禁止性规定, 本基金可不受上述规定的限制。

**(4) 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。**

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

议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

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。

**(5) 基金托管人依据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。**

1) 基金托管人依据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定对于基金管理人参与银行间债券市场交易时面临的交易对手资信风险进行监督。

基金管理人向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的银行间债券市场交易对手的名单，并按照审慎的风险控制原则在该名单中约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金托管人在收到名单后2个工作日内回函确认收到该名单。基金管理人应定期或不定期对银行间债券市场现券及回购交易对手的名单进行更新，名单中增加或减少银行间债券市场交易对手时须向基金托管人提出书面申请，基金托管人于2个工作日内回函确认收到后，对名单进行更新。基金管理人收到基金托管人书面确认后，被确认调整的名单开始生效，新名单生效前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。

如果基金托管人发现基金管理人与不在名单内的银行间债券市场交易对手进行交易，应及时提醒基金管理人撤销交易，经提醒后基金管理人仍执行交易并造成基金财产损失的，由基金管理人承担相应责任，基金托管人不承担责任，发生此种情形时，基金托管人有权报告中国证监会。

2) 基金托管人对于基金管理人参与银行间债券市场交易的交易方式的控制

基金管理人在银行间债券市场进行现券买卖和回购交易时，需按交易对手名单中约定的该交易对手所适用的交易结算方式进行交易。如果基金托管人发现基金管理人没有按照事先约定的有利于信用风险控制的交易方式进行交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人与交易对手重新确定交易方式，经提醒后仍未改正时造成基金财产损失的，基金托管人不承担责任，法律法规另有规定的除外。



3) 基金管理人向基金托管人提供银行间债券市场交易对手名单。基金管理人有责任控制交易对手的资信风险,在与银行间债券市场交易对手名单以外的交易对手进行交易时,由于交易对手资信风险引起的损失先由基金管理人承担,其后有权要求相关责任人进行赔偿,如果基金托管人在运作中严格遵循了上述监督流程,则对于由于交易对手资信风险引起的损失,不承担赔偿责任。在基金管理人与银行间债券市场交易对手名单中的交易对手,以约定适用的交易方式进行交易的情况下,由于交易对手资信风险引起的损失,基金管理人不承担责任,但基金管理人有权要求相关责任人进行赔偿。

**(6) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定,对基金管理人选择存款银行进行监督。**

本基金投资银行存款的信用风险主要包括存款银行的信用等级、存款银行的支付能力等涉及到存款银行选择方面的风险。基金管理人向基金托管人提供存款银行名单,本基金投资除存款银行名单以外的银行存款出现由于存款银行信用风险而造成的损失时,先由基金管理人负责赔偿,之后有权要求相关责任人进行赔偿,如果基金托管人在运作过程中遵循上述监督流程,则对于由于存款银行信用风险引起的损失,不承担赔偿责任。基金管理人与基金托管人协商一致后,可以根据当时的市场情况对于存款银行名单进行调整。

**(7) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定,对基金投资中期票据进行监督**

1) 基金管理人管理的基金在投资中期票据前,基金管理人须根据法律、法规、监管部门的规定,制定严格的关于投资中期票据的风险控制制度和流动性风险处置预案,并书面提供给基金托管人,基金托管人依据上述文件对基金管理人投资中期票据的额度和比例进行监督。

2) 如未来有关监管部门发布的法律法规对证券投资基金投资中期票据另有规定的,从其约定。

3) 基金托管人有权监督基金管理人在相关基金投资中期票据时的法律法规遵守情况,有关制度、信用风险、流动性风险处置预案的完善情况,有关额度、比例限制的执行情况。基金托管人发现基金管理人的上述事项违反法律法规和基金合同以及本协议的规定,应及时以书面形式通知基金管理人纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人应按相关托管协议要求向基金托管人及时发出回函,并及时改正。基金托管人有权随时对所通知事项进行复查,督促基金管理人改正。如果基金管理人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。如果基金托管人未能切实履行监督职责,导致基

金出现风险，基金托管人应承担连带责任。

#### **(8) 基金托管人对基金投资流通受限证券的监督**

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

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

3) 基金管理人应在基金首次投资流通受限证券前，向基金托管人提供经基金管理人董事会批准的有关基金投资流通受限证券的投资决策流程、风险控制制度。基金投资非公开发行股票，基金管理人还应提供基金管理人董事会批准的流动性风险处置预案。上述资料应包括但不限于基金投资流通受限证券的投资额度和投资比例控制情况。

基金管理人应至少于首次执行投资指令之前两个工作日将上述资料书面发至基金托管人，保证基金托管人有足够的时间进行审核。基金托管人应在收到上述资料后两个工作日内，以书面或其他双方认可的方式确认收到上述资料。

4) 基金投资流通受限证券前，基金管理人应向基金托管人提供符合法律法规要求的有关书面信息，包括但不限于拟发行证券主体的中国证监会批准文件、发行证券数量、发行价格、锁定期，基金拟认购的数量、价格、总成本、总成本占基金资产净值的比例、已持有流通受限证券市值占资产净值的比例、资金划付时间等。基金管理人应保证上述信息的真实、完整，并应至少于拟执行投资指令前两个工作日将上述信息书面发至基金托管人，保证基金托管人有足够的时间进行审核。

5) 基金托管人应按照《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》规定，对基金管理人是否遵守法律法规进行监督，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。否则，基金托管人有权拒绝执行有关指令。因拒绝执行该指令造成基金财产损失的，基金托管人不承担任何责任，并有权报告中国证监会。

如基金管理人和基金托管人无法达成一致，应及时上报中国证监会请求解决。如果基金托管人切实履行监督职责，则不承担任何责任。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。

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

**3、基金托管人发现基金管理人的投资运作及其他运作违反《基金法》、《基金合同》、基金托管协议及其他有关规定时，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在下一个工作日及时核对，并以书面形式向基金托管人发出回函，进行解释或举证。**

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。基金托管人有义务要求基金管理人赔偿因其违反《基金合同》而致使投资者遭受的损失。

基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律法规规定或者违反《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，并报告中国证监会。

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

基金托管人发现基金管理人重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠基金托管人根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍基金托管人进行有效监督，情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的，基金托管人应报告中国证监会。

### **（三）基金管理人**对**基金托管人**的业务**核查**

根据有关法律法规、《基金合同》及本协议规定，基金管理人应对基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括但不限于基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户等投资所需账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、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。

基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、无故未执行或延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、《基金合同》、

本托管协议及其他有关规定时，基金管理人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确认并以书面形式向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。在限期内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正，并予协助配合。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应报告中国证监会。基金管理人有权要求基金托管人赔偿基金因此所遭受的损失。

基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应立即报告中国证监会和银行业监督管理机构，同时通知基金托管人限期纠正。

基金管理人基于正当合理理由可定期和不定期地对基金托管人保管的基金财产进行核查。基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复基金管理人并改正。

基金托管人无正当理由，拒绝、阻挠基金管理人根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍基金管理人进行有效监督，情节严重或经基金管理人提出警告仍不改正的，基金管理人应报告中国证监会。

#### **（四） 基金财产保管**

##### **1、基金财产保管的原则**

- (1) 基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。
- (2) 基金托管人应安全保管基金财产。未经基金管理人的正当指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。
- (3) 基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户等投资所需账户。
- (4) 基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，与基金托管人的其他业务和其他基金的托管业务实行严格的分账管理，确保基金财产的完整与独立。
- (5) 对于因基金认（申）购、基金投资过程中产生的应收财产，如基金托管人无法从公开信息获取到账日期的，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托管人处的，基金托管人应及时通知并有义务配合基金管理人采取措施进行催收。由此给基金造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失，基金托管人对此不承担责任。
- (6) 基金托管人对因为基金管理人投资产生的存放或存管在基金托管人以外机构的基金财产，或交由期货公司或证券公司负责清算交收的基金资产及其收益，由于该等机构或该机构会员单位等基金合同当事人外第三方的欺诈、疏忽、过失或破产等原因

因给基金财产造成的损失等不承担责任。

- (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。

## 2、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。

## 3、基金的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基金托管专户，保管基金财产的银行存款。该基金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基金托管专户进行。基金托管人可根据实际情况需要，为基金开立资金清算辅助账户，以办理相关的资金汇划业务。
- (2) 基金托管专户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立其他任何银行账户；亦不得使用基金的任何银行账户进行本基金业务以外的活动。
- (3) 基金托管专户的管理应符合《人民币银行结算账户管理办法》、《现金管理暂行条例》、《人民币利率管理规定》、《利率管理暂行规定》、《支付结算办法》以及银行业监督管理机构的其他规定。

## 4、基金证券账户与证券交易资金账户的开设和管理

- (1) 基金托管人以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司开设证券账户。
- (2) 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上海分公司/深

圳分公司开立基金证券交易资金账户，用于证券清算。

- (3) 基金托管人以基金托管人名义在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司开立托管人结算备付金账户，用于基金的证券资金清算。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。
- (4) 基金证券账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借和未经对方书面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证券账户进行本基金业务以外的活动。
- (5) 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。

## 5、定期存款账户

基金财产投资定期存款的，基金管理人还需按照法规规定，与基金托管人、存款机构签订相关书面协议。

本基金投资定期存款在存款机构开立的银行账户，包括实体或虚拟账户，其预留印鉴经各方商议后预留。对于任何的定期存款投资，基金管理人都必须和存款机构签订定期存款协议，约定双方的权利和义务，该协议作为划款指令附件。在取得存款证实书后，基金托管人保管证实书正本。基金管理人应该在合理的时间内进行定期存款的投资和支取事宜，若基金管理人提前支取或部分提前支取定期存款，若产生息差（即本基金已计提的资金利息和提前支取时收到的资金利息差额），该息差的处理方法由基金管理人和基金托管人双方协商解决。

## 6、债券托管账户的开立和管理

《基金合同》生效后，基金管理人负责以基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表基金进行交易；基金托管人负责以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司和银行间债券市场清算所股份有限公司开设银行间债券市场债券托管账户，并代表基金进行债券和资金的清算。

## 7、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规定设立。

## 8、其他账户的开设和管理

在本托管协议订立日之后，本基金被允许从事符合法律法规规定和《基金合同》约定的其他投资品种的投资业务时，如果涉及相关账户的开设和使用，由基金管理人协助基金托管

人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定，开立有关账户。该账户按有关规则使用并管理。

基金管理人、基金托管人根据与期货公司三方签订的《金融期货投资操作备忘录》约定开立相关期货账户。

## 9、基金财产投资的有关实物证券的保管

基金财产投资的有关实物证券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或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。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。属于基金托管人实际有效控制下的实物证券在基金托管人保管期间的损坏、灭失，由此产生的责任应由基金托管人承担。基金托管人对基金托管人以外机构实际有效控制的实物证券不承担保管责任。

## 10、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财产有关的重大合同的原件分别应由基金托管人、基金管理人保管，相关业务程序另有限制的除外。除本协议另有规定外，基金管理人代表基金签署的与基金财产有关的重大合同应保证基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人应在重大合同签署后及时将重大合同传真给基金托管人，并在 5 个工作日内将正本送达基金托管人处。因基金管理人发送的合同传真件与事后送达的合同原件不一致所造成的后果，由基金管理人负责。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

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。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 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人应于每个工作日对基金财产估值。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。估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算业务指引》及其他法律、法规的规定。用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金份额净值并以双方认可的方式发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核后以双方认可的方式发送给基金管理人，由基金管理人根据基金合同的约定予以公布。

## （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益登记日、每年6月30日、12月31日的基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容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益登记日、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

双方当事人同意，因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议，除经友好协商可以解决的，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根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点在北京市，仲裁裁决是终局性的并对双方均有约束力，仲裁费用由败诉方承担，除非仲裁裁决另有决定。

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

本协议受中国法律管辖。

## （八） 托管协议的变更、终止与基金资产的清算

### 1、 托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议的内容进行变更。变更后的托管协议，其内



容不得与《基金合同》的规定有任何冲突。

## 2、基金托管协议终止的情形

发生以下情况，本托管协议在履行适当程序后终止：

- (1) 《基金合同》终止；
- (2) 基金托管人解散、依法被撤销、破产或有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、破产或有其他基金管理人接管基金管理权；
- (4) 发生法律法规或《基金合同》规定的终止事项。

## 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,并将根据基金份额持有人的需要和市场的变化,增加或变更服务项目。主要服务内容如下:

### (一) 资料寄送

#### 1、投资人对账单服务

基金份额持有人可通过基金管理人网站、客服电话等方式向本基金管理人定制对账单。基金管理人根据基金份额持有人的对账单定制情况,向账单期内发生交易或账单期末仍持有基金管理人旗下基金份额的持有人发送对账单,但由于基金份额持有人未详实填写或未及时更新相关信息(包括姓名、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。

对账单形式及服务方式具体如下:

1) 月度电子邮件对账单:每月结束后 10 个工作日内,基金管理人将以电子邮件方式,向当月进行基金交易或当月最后一个交易日仍持有基金份额,并成功定制电子对账单的投资者发送月度电子对账单。内容包括:截止月度末的基金份额持有概况及当月交易明细。

2) 月度短信对账单:每月结束后 10 个工作日内,基金管理人将以手机短信方式,向当月最后一个交易日仍持有基金份额,并成功定制手机短信对账单的投资者发送月度短信对账单。内容包括:截止月度末的基金份额持有概况及参考市值。

3) 基金份额持有人可登录基金管理人网站([www.guodu.com](http://www.guodu.com))账户查询系统查阅对账单。

4) 基金份额持有人也可拨打基金管理人客服热线索取电子或纸质对账单,亦可通过销售机构网点进行查询。

#### 2、其他相关的信息资料

指以不定期的方式向投资者发送的基金资讯材料,如基金新产品或新服务的相关材料、开放式基金运作情况回顾、客户服务问答等。

### (二) 手机短信服务

基金管理人向定制净值短信的基金份额持有人提供基金净值短信服务。基金份额持有人可通过拨打全国免费客户服务电话 400-818-8118 和基金管理人网站定制短信服务。

### （三） 在线服务

通过基金管理人网站 [www.guodu.com](http://www.guodu.com)，基金份额持有人还可获得如下服务：

#### 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

投资者可以利用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。

### （四） 咨询服务

1、 投资者或基金份额持有人如果了解申购与赎回的交易情况、基金账户余额、基金产品与服务等信息，可拨打基金管理人全国统一客服电话：400-818-8118（免长途电话费）。

#### 2、 网站和电子信箱

基金管理人网址：[www.guodu.com](http://www.guodu.com)

电子信箱：[gdfund@guodu.com](mailto:gdfund@guodu.com)

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

## 其它应披露事项

自 2018 年 2 月 26 日至 2021 年 6 月 30 日，本基金的临时报告刊登于《中国证券报》和公司网站。

序号	临时报告名称	披露日期	备注
1	关于国都多策略混合型证券投资基金提前结束募集的公告	2018 年 5 月 22 日	
2	国都多策略混合型证券投资基金基金合同生效公告	2018 年 5 月 29 日	
3	国都证券股份有限公司关于公募基金行业高级管理人员变更的公告	2018 年 6 月 8 日	
4	国都多策略混合型证券投资基金开放申购、赎回业务的公告	2018 年 6 月 21 日	
5	国都多策略混合型证券投资基金 2018 年第 3 季度报告	2018 年 10 月 25 日	
6	国都多策略混合型证券投资基金 2018 年第 4 季度报告	2019 年 1 月 19 日	
7	关于国都证券股份有限公司旗下公募证券投资基金对持有的股票长春高新采用“指数收益法”进行估值价格调整的公告	2019 年 3 月 2 日	
8	国都多策略混合型证券投资基金 2018 年年度报告	2019 年 3 月 30 日	
9	国都多策略混合型证券投资基金 2019 年第 1 季度报告	2019 年 4 月 22 日	
10	国都多策略混合型证券投资基金招募说明书更新 2019 年第 1 号	2019 年 7 月 10 日	
11	国都多策略混合型证券投资基金 2019 年第 2 季度报告	2019 年 7 月 18 日	
12	国都多策略混合型证券投资基金变更基金经理	2019 年 7 月 30 日	

	的公告		
13	国都多策略混合型证券投资基金 2019 年半年度报告	2019 年 8 月 28 日	
14	国都多策略混合型证券投资基金 2019 年第 3 季度报告	2019 年 10 月 23 日	
15	国都多策略混合型证券投资基金 2019 年第 4 季度报告	2020 年 1 月 17 日	
16	国都多策略混合型证券投资基金增聘基金经理公告	2020 年 2 月 26 日	
17	国都多策略混合型证券投资基金 2020 年第 1 季度报告	2020 年 4 月 21 日	
18	国都多策略混合型证券投资基金 2019 年年度报告	2020 年 4 月 30 日	
19	国都多策略混合型证券投资基金增聘基金经理的公告	2020 年 7 月 1 日	
20	国都证券股份有限公司关于国都多策略混合型证券投资基金参与申购费率优惠活动的公告	2020 年 7 月 11 日	
21	国都多策略混合型证券投资基金 2020 年第 2 季度报告	2020 年 7 月 18 日	
22	国都多策略混合型证券投资基金基金经理变更的公告	2020 年 8 月 5 日	
23	国都多策略混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	2020 年 8 月 27 日	
24	国都多策略混合型证券投资基金 2020 年中期报告	2020 年 8 月 29 日	
25	国都多策略混合型证券投资基金 2020 年第 3 季度报告	2020 年 10 月 27 日	
26	国都多策略混合型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	2021 年 1 月 22 日	

27	国都多策略混合型证券投资基金基金经理变更的公告	2021年3月19日	
28	国都多策略混合型证券投资基金2020年年度报告	2021年3月30日	
29	国都多策略混合型证券投资基金2021年第1季度报告	2021年4月21日	
30	国都多策略混合型证券投资基金基金合同(更新)	2021年4月30日	
31	国都多策略混合型证券投资基金托管协议(更新)	2021年4月30日	
32	国都多策略混合型证券投资基金招募说明书(更新)2021年第1号	2021年4月30日	
33	国都多策略混合型证券投资基金增聘基金经理的公告	2021年6月18日	

## 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，投资者可在营业时间内免费查阅，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的内容与所公告的内容完全一致。

## 备查文件

- 1、中国证监会准予国都多策略混合型证券投资基金注册的文件；
- 2、《国都多策略混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《国都多策略混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、注册登记协议；
- 8、中国证监会要求的其它文件。

存放地点：基金管理人、基金托管人处

查阅方式：投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。