

汇安裕阳三年定期开放混合型  
证券投资基金  
(2022 年第 1 号)  
招募说明书 (更新)

2022 年 4 月

二零二二年四月

基金管理人：汇安基金管理有限责任公司  
基金托管人：中国光大银行股份有限公司

## 【重要提示】

1、本基金根据2018年6月21日中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于准予汇安裕阳三年定期开放混合型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2018]1008号)进行募集。本基金合同已于2018年9月27日生效。

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

3、投资有风险,投资者认购(或申购)基金份额时应认真阅读基金合同、本招募说明书、基金产品资料概要等信息披露文件,自主判断基金的投资价值,全面认识本基金产品的风险收益特征,应充分考虑投资者自身的风险承受能力,并对认购(或申购)基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则,在投资者作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化导致的投资风险,由投资者自行承担。

4、本基金投资股指期货、国债期货等金融衍生品。金融衍生品是一种金融合约,其价值取决于一种或多种基础资产或指数,其评价主要源自于对挂钩资产的价格与价格波动的预期。投资于衍生品需承受市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险和法律风险等。由于衍生品通常具有杠杆效应,价格波动比标的工具更为剧烈,有时候比投资标的资产要承担更高的风险。并且由于衍生品定价相当复杂,不适当的估值有可能使基金资产面临损失风险。

本基金投资中小企业私募债,中小企业私募债是根据相关法律法规由非上市中小企业采用非公开方式发行的债券。由于不能公开交易,一般情况下,交易不活跃,潜在较大流动性风险。当发债主体信用质量恶化时,受市场流动性所限,本基金可能无法卖出所持有的中小企业私募债,由此可能给基金净值带来更大的负面影响和损失。

本基金投资资产支持证券,资产支持证券(ABS)是一种债券性质的金融工具,其向投资者支付的本息来自于基础资产池产生的现金流或剩余权益。与股票和一般债券不同,资产支持证券不是对某一经营实体的利益要求权,而是对基础资产池所产生的现金流和剩余权益的要求权,是一种以资产信用为支持的证券,所面临的风险主要包括交易结构风险、各种原因导致的基础资产池现金流与对应证券现金流不匹配产生的信用风险、市场交易不活跃导致的流动性风险等。

本基金可投资存托凭证,可能面临存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险,以及与存托凭证发行机制相关的风险。

5、本基金为混合型基金,属于证券投资基金中预期风险与预期收益较高的投资品种,其风险收益水平高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金。

6、本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、存托凭证、债券(包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、可转换债券、中小企业私募债等)、债券回购、同业存单、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

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

7、基金的投资组合比例为:

本基金投资于股票资产占基金资产的比例不低于50%,但因开放期流动性需要,为保护基金份额持有人利益,每个开放期开始前三个月至开放期结束后三个月内不受前述比例限制。

封闭期内,本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金;开放期内,本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债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的5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;权证、股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

8、本基金初始募集面值为人民币1.00元。在市场波动因素影响下,本基金份额净值可能低于初始面值,本基金投资者有可能出现亏损。

9、基金的过往业绩并不预示其未来表现,基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。

10、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。

11、本基金单一投资者持有基金份额数不得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超过前述50%比例的除外。

12、本招募说明书所载内容截止日为2022年3月31日，有关财务数据和净值表现截止日为2021年12月31日（财务数据未经审计）。本招募说明书已经基金托管人复核。

## 目 录

第一部分	绪言.....	1
第二部分	释义.....	2
第三部分	基金管理人.....	8
第四部分	基金托管人.....	18
第五部分	相关服务机构.....	21
第六部分	基金的募集.....	27
第七部分	基金合同的生效.....	28
第八部分	基金份额的上市交易.....	29
第九部分	基金份额的申购与赎回.....	31
第十部分	基金的投资.....	45
第十一部分	基金的业绩.....	60
第十二部分	基金的财产.....	62
第十三部分	基金资产的估值.....	63
第十四部分	基金的收益分配.....	69
第十五部分	基金费用与税收.....	70
第十六部分	基金的会计与审计.....	72
第十七部分	基金的信息披露.....	73
第十八部分	风险揭示.....	81
第十九部分	基金合同的变更、终止与基金财产的清算.....	87
第二十部分	基金合同的内容摘要.....	89
第二十一部分	基金托管协议的内容摘要.....	90
第二十三部分	其他应披露的公告.....	93
第二十四部分	招募说明书的存放及查阅方式.....	95
第二十五部分	备查文件.....	96
附件一	基金合同内容摘要.....	97
附件二	托管协议内容摘要.....	113

## 第一部分 绪言

《汇安裕阳三年定期开放混合型证券投资基金招募说明书》(以下简称“招募说明书”或“本招募说明书”)依照《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性风险管理规定》”)和其他有关法律、法规以及《汇安裕阳三年定期开放混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)编写。

本招募说明书阐述了汇安裕阳三年定期开放混合型证券投资基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资人投资决策有关的必要事项,投资人在作出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。

汇安裕阳三年定期开放混合型证券投资基金(以下简称“基金”或“本基金”)是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息,或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写,并经中国证监会注册。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。如本招募说明书内容与基金合同有冲突或不一致之处,均以基金合同为准。基金投资者自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

## 第二部分 释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有以下含义：

- 1、基金或本基金：指汇安裕阳三年定期开放混合型证券投资基金
- 2、基金管理人：指汇安基金管理有限责任公司
- 3、基金托管人：指中国光大银行股份有限公司
- 4、基金合同：指《汇安裕阳三年定期开放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《汇安裕阳三年定期开放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《汇安裕阳三年定期开放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《汇安裕阳三年定期开放混合型证券投资基金基金份额发售公告》
- 8、基金产品资料概要：指《汇安裕阳三年定期开放混合型证券投资基金基金产品资料概要》及其更新
- 9、上市交易公告书：指《汇安裕阳三年定期开放混合型证券投资基金上市交易公告书》
- 10、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等
- 11、《基金法》：指2003年10月28日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，2012年12月28日经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
- 12、《销售办法》：指中国证监会2013年3月15日颁布、同年6月1日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 13、《信息披露办法》：指中国证监会2019年7月26日颁布、同年9月1日实施的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出

的修订

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

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

16、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

17、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

18、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

19、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

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

21、合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》(包括其不时修订)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

22、人民币合格境外机构投资者：指按照《人民币合格境外机构投资者境内证券投资试点办法》(包括其不时修订)及相关法律法规规定运用来自境外的人民币资金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

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

24、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

25、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管等业务

26、销售机构：指汇安基金管理有限责任公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售



服务协议, 办理基金销售业务的机构, 以及经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的具有基金销售业务资格的深圳证券交易所会员单位

27、场外: 指通过深圳证券交易所交易系统外的销售机构利用其自身柜台或者其他交易系统进行基金份额认购、申购和赎回等业务的场所。通过该等场所办理基金份额的认购、申购、赎回也称为场外认购、场外申购、场外赎回

28、场内: 指通过深圳证券交易所内具有基金销售业务资格的会员单位利用深圳证券交易所交易系统办理本基金相关基金份额的认购、申购、赎回和上市交易的场所。通过该等场所办理基金份额的认购、申购、赎回也称为场内认购、场内申购、场内赎回

29、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开放式基金账户和/或深圳证券账户的建立和管理、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

30、登记机构: 指办理登记业务的机构。本基金的登记机构为中国证券登记结算有限责任公司

31、登记结算系统: 指中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统, 通过场外销售机构认购、申购的基金份额登记在登记结算系统

32、证券登记系统: 指中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记系统, 通过场内会员单位认购、申购或买入的基金份额登记在证券登记系统

33、场外份额: 指登记在登记结算系统下的基金份额

34、场内份额: 指登记在证券登记系统下的基金份额

35、上市交易: 指投资者通过深圳证券交易所会员单位以集中竞价的方式买卖基金份额的行为

36、开放式基金账户: 指投资者通过场外销售机构在中国证券登记结算有限责任公司注册的开放式基金账户。投资者办理场外认购、场外申购和场外赎回等业务时需具有开放式基金账户

37、深圳证券账户: 指投资人在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开立的深圳证券交易所人民币普通股票账户(即 A 股账户)或证券投资基金账户。投资者办理基金交易、场内认购、场内申购和场内赎回等业务时需持有深圳证券账户

38、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、转托管等业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户

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

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

41、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

42、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

43、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所及相关金融期货交易所的正常交易日

44、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

45、T+n日：指自T日起第n个工作日（不包含T日）

46、封闭期：本基金以三年为一个封闭期。本基金的第一个封闭期的起始之日为基金合同生效日，结束之日为基金合同生效日所对应的第三年年度对日前的倒数第一日。第二个封闭期的起始之日为第一个开放期结束之日次日，结束之日为第二个封闭期起始之日所对应的第三年年度对日前的倒数第一日，依此类推。本基金在封闭期内不办理申购与赎回业务，但投资人可在本基金上市交易后通过深圳证券交易所交易场内基金份额

47、开放期：本基金前后两个封闭期之间，办理基金份额申购、赎回或其他业务的期间。本基金每个开放期不少于5个工作日且最长不超过20个工作日，开放期的具体时间由基金管理人在上一个封闭期结束前公告说明。如在开放期内发生不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放或需依据《基金合同》暂停申购或赎回业务的，基金管理人有权合理调整申购或赎回业务的办理期间并予以公告

48、开放日：指本基金在开放期，为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

49、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

50、《业务规则》：指深圳证券交易所发布实施的《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》、《深圳证券交易所证券投资基金交易和申购赎回实施细则》及不时作出的修订；中国证券登记结算有限责任公司发布实施的《中国证券登记结算有限责任公司上市开放式基金登记结算业务实施细则》、《深圳证券交易所上市开放式基金登记结算业务指引》及不时作出的修订；深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的其他相关业务规则

51、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

52、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

53、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

54、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

55、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行为，包括系统内转托管和跨系统转托管

56、系统内转托管：指投资者将持有的基金份额在登记结算系统内不同销售机构之间或证券登记系统内不同会员单位之间进行转托管的行为

57、跨系统转托管：指投资者将持有的基金份额在登记结算系统和证券登记系统之间进行转托管的行为

58、巨额赎回：指本基金单个开放日，基金净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一工作日基金总份额的 20%的情形

59、元：指人民币元

60、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

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

62、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

63、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的数值

64、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

65、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

66、摆动定价机制：指当本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

67、指定媒介：指中国证监会指定的用以进行信息披露的全国性报刊及指定互联网网站（包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介

68、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

69、中国：指中华人民共和国（仅为基金合同之目的，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区及台湾地区）

## 第三部分 基金管理人

### 一、基金管理人概况

名称：汇安基金管理有限责任公司（简称“汇安基金”）

住所：上海市虹口区欧阳路218弄1号2楼215室

办公地址：北京市东城区东直门南大街5号中青旅大厦13层

法定代表人：刘强

成立时间：2016年4月25日

注册资本：1亿元人民币

存续期间：持续经营

联系人：赵庆玲

联系电话：(010) 56711600

汇安基金管理有限责任公司（以下简称“公司”）经中国证监会证监许可[2016]860号文批准设立。

### 二、主要成员情况

#### 1、基金管理人董事会成员

何斌先生，董事长。24年证券、基金行业从业经验。东北财经大学国民经济计划学学士，先后就职于北京市财政局、北京京都会计师事务所、中国证券监督管理委员会基金监管部，曾任国泰基金管理公司副总经理、建信基金管理有限责任公司督察长、副总经理。2016年4月加入汇安基金管理有限责任公司，现任汇安基金管理有限责任公司董事长。

刘强先生，董事，总经理。6年证券、基金行业从业经验，美国注册管理会计师（CMA），东北财经大学审计学学士。历任阿尔卡特深圳公司财务总监，霍尼韦尔深圳公司财务总监，阿特维斯（中国）财务及信息技术总监，北京刚正国际投资有限公司副总经理。2016年4月加入汇安基金管理有限责任公司，现任汇安基金管理有限责任公司总经理。

戴樱女士，董事，副总经理。6年证券、基金行业从业经验，2004年毕业于上海对外贸易学院，国际贸易专业学士学位。曾就职于上海贝尔阿尔卡特股份有限公司，任采购部经理助理；上海樱琦干燥剂有限公司，任公司董事；上海上贝资产管理有限公司合伙人。2016年4月加入汇安基金管理有限责任公司，现任

汇安基金管理有限责任公司副总经理、金融机构部总经理。

李海涛先生, 独立董事。美国耶鲁大学管理学院金融学博士。曾任密西根大学 Ross 商学院金融学教授、长江商学院金融学访问学者, 现任长江商学院副院长及杰出院长讲习教授。

余剑峰先生, 独立董事。2008年毕业于美国宾夕法尼亚大学沃顿商学院, 金融学博士。曾于2014秋任清华大学五道口金融学院访问教授; 2015年至2016年任香港中文大学(深圳)经管学院金融学教授、执行副院长; 2008年至2017年明尼苏达大学卡尔森管理学院金融学助理教授、副教授(终身教授)、正教授、Piper Jaffray 讲席教授; 2016年至今任清华大学五道口金融学院建树讲席教授; 2017年至今任清华大学国家金融研究院资产管理研究中心主任; 2019年至今任清华大学金融科技研究院副院长。

黄磊先生, 独立董事。中国人民大学经济学博士。曾任山东财经大学金融学院院长; 曾任山东省政协、山东省政协常委、山东省政协经济组召集人、山东省人大常委、山东省人大财经委员会委员; 曾任教育部金融类专业教学指导委员会委员。现任山东财经大学教授委员会主任委员、山东财经大学学术委员会副主任委员、区域金融优化与管理协同创新中心(山东)主任。

## 2、基金管理人监事

王丽英女士, 监事。5年证券、基金从业经验。毕业于中央财经大学会计学学士, 2011年6月至2017年6月在北京居然之家投资控股集团有限公司集团总部以及其名下子公司担任财务经理。2017年7月加入汇安基金管理有限责任公司, 现任汇安基金管理有限责任公司综合管理部财务总监。

## 3、高级管理人员

何斌先生, 董事长。(简历请参见董事会成员)

刘强先生, 总经理。(简历请参见董事会成员)

戴樱女士, 副总经理。(简历请参见董事会成员)

郭冬青先生, 督察长。22年证券、基金从业经验。南开大学经济学硕士。历任中石化集团财务部经济师、广发证券投行部高级经理、华安证券投行部副总经理、大商集团副总经理、中航证券董事总经理、北京国金鼎兴投资有限公司副总经理。2017年11月加入汇安基金管理有限责任公司, 现任汇安基金管理有限责任公司督察长。

钟敬棣先生，固定收益首席投资官，副总经理。26年银行、基金行业从业经验，加拿大卑诗大学工商管理硕士。2005年4月加入嘉实基金，先后任固定收益研究员、投资经理。2008年5月加入建信基金，先后任基金经理、投资部副总监、固定收益首席投资官、公司投资决策委员会委员，曾管理建信稳定增利、双息红利、安心保本等债券型基金，多次获得金牛基金。2018年5月加入汇安基金管理有限责任公司，现任汇安基金管理有限责任公司副总经理，固定收益首席投资官。

邹唯先生，权益首席投资官，副总经理。21年证券、基金行业从业经验。中国科学院遗传研究所遗传学硕士。历任长城证券有限公司研究部行业分析师，嘉实基金管理有限公司行业分析师、基金经理、主题策略组组长，中信产业基金金融投资部董事总经理，嘉实基金管理有限公司基金经理、主题策略组组长、董事总经理。2017年12月1日加入汇安基金管理有限责任公司，现任汇安基金管理有限责任公司副总经理，权益首席投资官。

窦星华先生，常务副总经理。16年证券、基金行业从业经验，CFA。英国杜伦大学金融学硕士。历任标准普尔信息服务(北京)有限公司指数分析师，交银施罗德基金管理有限公司产品经理，华安基金管理有限公司产品部总经理助理，盛世景资产管理股份有限公司产品总监。2016年7月加入汇安基金管理有限责任公司任产品及创新业务部总经理，现任汇安基金管理有限责任公司常务副总经理。

郭兆强先生，副总经理。24年证券、基金行业从业经验，保荐代表人。北京大学光华管理学院工商管理硕士。曾任山西证券投行部综合经理，中德证券高级副总裁，东北证券北京分公司深圳市场部副总经理，从事投资银行业务。2016年4月加入汇安基金管理有限责任公司，现任汇安基金管理有限责任公司副总经理。

王俊波先生，副总经理。17年证券、基金行业从业经验。中国人民大学金融学硕士。历任中国平安产险营销策划经理，嘉实基金券商业务部主管，兴业证券资产管理有限公司市场部执行总监。2016年7月加入汇安基金管理有限责任公司，现任汇安基金管理有限责任公司副总经理。

冯家诚先生，首席信息官。16年证券、基金行业从业经验，北京理工大学软件工程硕士研究生。历任华商基金管理有限公司信息技术部信息技术经理；天

和思创投资管理有限公司副总经理。2016年5月加入汇安基金管理有限责任公司，现任汇安基金管理有限责任公司首席信息官。

#### 4、本基金的基金经理

邹唯先生，中国科学院遗传研究所遗传学硕士，21年证券、基金行业从业经历，曾任长城证券有限公司研究部行业分析师，嘉实基金管理有限公司行业分析师、基金经理、主题策略组组长，中信产业基金金融投资部董事总经理，嘉实基金管理有限公司基金经理、主题策略组组长、董事总经理。2017年12月1日加入汇安基金管理有限责任公司，担任权益首席投资官，董事总经理。2018年4月26日至2020年6月3日，任汇安趋势动力股票型证券投资基金基金经理；2019年1月25日至2020年8月3日，任汇安核心成长混合型证券投资基金基金经理；2018年9月27日至今，任汇安裕阳三年定期开放混合型证券投资基金基金经理；2019年8月28日至今，任汇安行业龙头混合型证券投资基金基金经理；2020年12月16日至今，任汇安泓阳三年持有期混合型证券投资基金基金经理；2021年2月9日至今，任汇安均衡优选混合型证券投资基金基金经理。

#### 5、投资决策委员会成员

钟敬棣先生，固定收益首席投资官。(简历请参见高级管理人成员)。

邹唯先生，权益首席投资官。(简历请参见高级管理人成员)。

仇秉则先生，固定收益研究部总监。CFA，CPA，中山大学经济学学士，15年证券、基金行业从业经历，曾任普华永道中天会计师事务所审计经理，嘉实基金管理有限公司固定收益部高级信用分析师。2016年6月加入汇安基金管理有限责任公司，现任固定收益研究部总监一职，从事信用债投资研究工作。

窦星华先生，常务副总经理。(简历请参见高级管理人成员)。

蔡晓钰先生，董事总经理。上海交通大学管理学博士，16年银行、证券、基金行业从业经历。曾任兴业银行上海分行同业业务部理财经理、高级客户经理；兴业银行总行私人银行部副处长、主持工作副处长，部门投资决策委员会委员和内部控制及风险管理委员会委员；浦发银行上海分行金融市场部副总经理；上海好嘉资产管理有限公司联席总经理；云南省资产管理公司总经理；上海好嘉资产管理有限公司联席总经理。2020年11月加入汇安基金管理有限责任公司，现任董事总经理。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。



### 三、基金管理人的职责

- 1、依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
- 2、办理基金备案手续；
- 3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；
- 4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；
- 5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- 6、编制基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告；
- 7、计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回价格；
- 8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；
- 9、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；
- 10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- 11、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- 12、法律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、基金管理人承诺不从事违反《中华人民共和国证券法》的行为，并承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反《中华人民共和国证券法》行为的发生；

2、基金管理人承诺不从事违反《中华人民共和国基金法》的行为，并承诺建立健全内部风险控制制度，采取有效措施，防止下列行为的发生：

- (1) 将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
- (2) 不公平地对待管理的不同基金财产；
- (3) 利用基金财产或职务之便为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；
- (4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- (5) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。

3、基金管理人承诺严格遵守基金合同，并承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反基金合同行为的发生；

4、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;

5、基金管理人承诺不从事其他法规规定禁止从事的行为。

#### 五、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、受雇人或任何第三者牟取利益;

3、不泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密,尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息,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、不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

#### 六、基金管理人的内部控制制度

##### 1、风险管理的原则

(1)健全性原则:风险管理应当覆盖公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员,并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个经营环节;

(2)有效性原则:通过科学的风险管理手段和方法,建立合理的风险管理程序,维护风险管理制度的有效执行;

(3)独立性原则:公司必须在精简的基础上设立能充分满足公司风险管理需要的机构、部门和岗位,并保持其相对独立性;基金财产、公司固有财产和其他资产的管理和运作应当严格分离;基金投资研究、决策、执行、清算和评估等部门和岗位,应当在物理上和制度上适当隔离;

(4)相互制约原则:内部部门和岗位的设置必须权责分明、相互牵制,并通过切实可行的相互制衡措施来消除风险管理中的盲点;

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

##### 2、风险管理和内部风险控制体系结构

公司建立董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险管理体系,包括董事会下设的风险控制委员会、督察长、风险管理委员会、合规风控部以及各个业务部门。具体而言,包括如下组成部分:

###### (1) 董事会

董事会负责公司整体风险的预防和控制,审核、监督公司风险管理制度的有效执行。

(2) 风险控制委员会

1) 向董事会建议风险定义和风险评估标准,审阅管理层提交的风险管理报告、督察长提交的监察稽核报告;

2) 对公司存在的风险隐患和可能出现的风险问题进行研究、提出指导性建议;

3) 对重大突发性风险事件的处理提出指导性建议;

4) 提议聘请、更换外部审计机构,并就外部审计机构的资质和工作情况进行评议;

5) 协助董事会审查公司内控制度、重大项目和审计重大交易;

6) 董事会授权的其他事宜。

(3) 督察长

1) 出席或列席公司相关会议并行使相应表决权;

2) 对公司的基金运作、专户运作、内部管理、系统实施和合法合规情况进行内部监察稽核,并定期出具独立的监察稽核报告,并将报告上报董事会和中国证监会;

3) 如发现公司及基金运作中违反任何法律法规规定,立即告知公司总经理和相关业务人员,提出处理意见和整改意见,并监督整改措施的制定和落实;公司总经理对存在问题不整改或者整改未达到要求的,督察长应当向公司董事会、中国证监会及相关派出机构报告;

4) 享有充分的知情权和独立的调查权。督察长根据履行职责的需要,有权参加或者列席公司董事会以及公司业务、投资决策、风险管理等相关会议,有权调阅公司相关档案;

5) 定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况,并在董事会及董事会下设的相关专门委员会定期会议上报告基金及公司运作的合法合规情况及公司内部风险控制情况,以及需要立即报告的重大事项;

6) 对公司推出新产品、开展新业务的合法合规性问题提出意见;

7) 指导、督促公司妥善处理投资人的重大投诉,保护投资人的合法权益;

8) 严格遵守保密制度,对在履行职责中掌握的非公开信息负有保密义务,不得违反法律法规及公司规定向其他机构、人员泄露非公开信息,或者利用非公开信息为自己或者他人进行证券投资活动。

(4) 合规风控部

1) 执行风险控制委员会制订的合规管理政策及管控措施、风险管理政策和管控措施;

2) 倡导、培育公司合规文化;

3) 监督、检查法律法规、公司制度和流程的执行情况;

4) 参与公司新产品的开发设计,对潜在合规及法律风险进行分析,并提出控制建议;

5) 对公司信息披露程序及披露文档的合法合规性进行审查;

6) 对基金运作和公司内部管理进行日常监察与稽核;

7) 监控投资合规运作,对基金及特定客户资产管理计划投资活动进行独立动态监控;

8) 监控投资风险,对基金及特定客户资产管理计划投资活动进行事前、事中、事后风险控制;

9) 对基金资产、组合资产进行风险定量分析;

10) 对公司管理的各投资组合的公平交易情况进行监控和定期分析;

11) 制订投资管理业绩的评价体系,定期评估投资组合的绩效,抄送投资决策委员会、专户投资决策委员会,作为评价基金经理、投资经理业绩的重要参考依据;

12) 检查公司内部控制制度的执行情况,并就内控的合规性、合理性、完备性和有效性等方面存在的问题提出意见和建议;

13) 调查公司内部的违规案件,协助督察长处理相关事宜;

14) 有权提议聘请独立第三方专业机构对公司财务状况和基金运作状况进行审计;

15) 协助配合监管部门的监督和检查;

16) 监督和检查员工遵纪守法情况和职业操守情况,负责员工的离任审计;

17) 负责公司的有关法律事务;

18) 完成督察长要求的其他工作。

### (5) 业务部门

公司各业务部门应根据具体情况制定本部门的作业流程及风险管理制度,对风险来源和产生原因进行有效识别和分析,并对风险的严重性、发生的可能性及其影响进行测定和管理,将风险控制在最小范围内。

### 3、风险管理和内部风险控制的措施

(1) 为保障风险管理制度的持续性和有效性,公司内部必须形成良好的控制环境,建立持续的风险管理检验制度和独立的风险管理报告制度。

(2) 控制环境是与风险管理制度相关的各种因素相互作用的综合效果及其对业务、员工的影响。良好的控制环境可为其他风险管理制度要素提供规则和架构,主要包括各项风险管理制度对各项业务的牵制力,公司管理层、员工对风险管理制度的重视程度。公司致力于从公司文化、组织结构、管理制度等方面营造良好的控制环境。

(3) 公司致力于营造一个浓厚的风险文化氛围,使得风险管理意识能在公司内部广泛分享,并能扩展到公司所有员工,确保内控机制的建立、完善和各项管理制度的执行。

(4) 风险管理检验制度是公司根据市场环境、金融工具、技术应用、法律法规的变化和发展情况,不断测试和调整风险管理制度,以确保风险管理制度持续运作并充分有效的制度。

(5) 风险管理报告制度是指合规风控部及时将公司整体风险状况向公司总经理和董事会报告的制度。公司应具备完善的信息系统确保报告程序的有效性,以保证总经理、督察长和董事会及时可靠地取得准确详细的信息。

(6) 合规风控部应定时检查和指导各部门的风险管理工作,形成风险管理报告书与建议书,上报公司决策层,并坚持重点管理的原则,对相关投资部门、运营部等重要的业务部门和人员进行重点监督与防范。

(7) 公司各级人员均应认真履行工作职责,准确、及时地反映情况,对风险管理工作不力或隐瞒不报、上报虚假情况,给公司造成巨大风险和损失的,依公司规定追究其责任。

(8) 对因风险管理工作出色,防止了某些重大风险的发生,为公司挽回了重大损失,业绩特别突出的人员,公司应予以表彰和奖励。

(9) 对于各项规章制度完善、风险防范工作积极主动并卓有成效的部门，公司应给予适当表彰与奖励。

(10) 对于部门制度不完备、工作程序不合理或管理混乱而造成较大风险并给公司带来损失的，应追究直接责任人及部门负责人的责任。

## 第四部分 基金托管人

### 一、基本情况

名称：中国光大银行股份有限公司

住所及办公地址：北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心

成立日期：1992年6月18日

批准设立机关和批准设立文号：国务院、国函[1992]7号

组织形式：股份有限公司

注册资本：466.79095亿元人民币

法定代表人：李晓鹏

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【2002】75号

资产托管部总经理：李守靖

电话：(010) 63636363

传真：(010) 63639132

网址：www.cebbank.com

### 二、资产托管部部门及主要人员情况

法定代表人李晓鹏先生，自2018年3月起任本行董事长、2017年12月起任本行党委书记。现任中国光大集团股份公司党委书记、董事长，兼任中共中国光大集团党校、光大大学名誉校长，中国光大集团有限公司董事长，中国国际商会副会长，香港中国企业协会名誉会长。曾任中国工商银行河南省分行党组成员、副行长，中国工商银行总行营业部总经理，中国工商银行四川省分行党委书记、行长，中国华融资产管理公司党委委员、副总裁，中国工商银行党委委员、行长助理兼北京市分行党委书记、行长，中国工商银行党委委员、执行董事、副行长，中国投资有限责任公司党委副书记、监事长，招商局集团有限公司党委副书记、副董事长、总经理。曾兼任工银国际控股有限公司董事长、工银金融租赁有限公司董事长、工银瑞信基金管理公司董事长，招商银行股份有限公司副董事长、招商局能源运输股份有限公司董事长、招商局港口控股有限公司董事会主席、招商局华建公路投资有限公司董事长、招商局资本投资有限责任公司董事长、招商局联合发展有限公司董事长、招商局投资发展有限公司董事长等职务。获经济学博

士学位，高级经济师。第十三届全国政协经济委员会委员。

行长付万军先生，自2021年6月起任本行行长，2021年4月起任本行党委副书记，2021年2月起任本行董事。现任中国光大集团股份公司党委委员、执行董事。曾任交通银行乌鲁木齐分行信贷二部副经理、市场营销二部副经理、经理、行长助理、副行长、党委委员，银川分行党委书记、行长，新疆区(乌鲁木齐)分行党委书记、行长，重庆市分行党委书记、行长，总行公司机构业务部总经理(省分行正职级)、业务总监(公司与机构业务板块)；中国光大集团股份公司副总经理。获工商管理硕士学位，高级经济师。

李守靖先生，曾任中国光大银行海口分行部门总经理，行长助理，副行长；中国光大银行南宁分行副行长(主持工作)、行长。现任中国光大银行资产托管部总经理。

### 三、证券投资基金托管情况

截至2021年12月31日，中国光大银行股份有限公司托管公开募集证券投资基金共259只，托管基金资产规模5984.07亿元。同时，开展了证券公司资产管理计划、专户理财、职业年金、企业年金、QDII、银行理财、保险债权投资计划等资产的托管及信托公司资金信托计划、产业投资基金、股权基金等产品的保管业务。

### 四、托管业务的内部控制制度

#### 1、内部控制目标

确保有关法律法规在基金托管业务中得到全面严格的贯彻执行；确保基金托管人有关基金托管的各项管理制度和业务操作规程在基金托管业务中得到全面严格的贯彻执行；确保基金财产安全；保证基金托管业务稳健运行；保护基金份额持有人、基金管理公司及基金托管人的合法权益。

#### 2、内部控制的原则

(1) 全面性原则。内部控制必须渗透到基金托管业务的各个操作环节，覆盖所有的岗位，不留任何死角。

(2) 预防性原则。树立“预防为主”的管理理念，从风险发生的源头加强内部控制，防患于未然，尽量避免业务操作中各种问题的产生。

(3) 及时性原则。建立健全各项规章制度，采取有效措施加强内部控制。发现问题，及时处理，堵塞漏洞。



(4) 独立性原则。基金托管业务内部控制机构独立于基金托管业务执行机构，业务操作人员和内控人员分开，以保证内控机构的工作不受干扰。

### 3、内部控制组织结构

中国光大银行股份有限公司董事会下设风险管理委员会、审计委员会，委员会委员由相关部门的负责人担任，工作重点是对总行各部门、各类业务的风险和内控进行监督、管理和协调，建立横向的内控管理制约体制。各部门负责分管系统内的内部控制的组织实施，建立纵向的内控管理制约体制。资产托管部建立了严密的内控督察体系，设立了投资监督与内控管理处，负责证券投资基金托管业务的内控管理。

### 4、内部控制制度

中国光大银行股份有限公司资产托管部自成立以来严格遵照《基金法》、《中华人民共和国商业银行法》、《信息披露管理办法》、《运作办法》、《销售办法》等法律、法规的要求，并根据相关法律法规制订、完善了《中国光大银行证券投资基金托管业务内部控制规定》、《中国光大银行资产托管部保密规定》等十余项规章制度和实施细则，将风险控制落实到每一个工作环节。中国光大银行资产托管部以控制和防范基金托管业务风险为主线，在重要岗位（基金清算、基金核算、投资监督）还建立了安全保密区，安装了录像监视系统和录音监听系统，以保障基金信息的安全。

### 五、托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据法律、法规和基金合同等的要求，基金托管人主要通过定性和定量相结合、事前监督和事后控制相结合、技术与人工监督相结合等方式方法，对基金投资品种、投资组合比例每日进行监督；同时，对基金管理人就基金资产净值的计算、基金管理人和基金托管人报酬的计提和支付、基金收益分配、基金费用支付等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

基金托管人发现基金管理人的违反法律、法规和基金合同等规定的行为，及时以邮件、电话或书面等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确认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。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。

## 第五部分 相关服务机构

### 一、基金份额发售机构

#### (一) 场外销售机构

##### 1、直销机构

汇安基金管理有限责任公司直销中心

传真：021-80219047

邮箱：DS@huianfund.cn

地址：上海市虹口区东大名路501号上海白玉兰广场36层02单元

联系人：杨晴

电话：021-80219022

##### 2、其他销售机构

#### (1) 北京雪球基金销售有限公司

法定代表人：李楠

注册地址：北京市朝阳区创远路34号院6号楼15层1501室

客服电话：400-159-9288

网址：danjuanapp.com

#### (2) 北京中植基金销售有限公司

法定代表人：武建华

注册地址：北京市北京经济技术开发区宏达北路10号五层5122室

客服电话：400-8980-618

网址：www.chtfund.com

#### (3) 第一创业证券股份有限公司

法定代表人：刘学民

注册地址：深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼

客服电话：95358

网址：www.firstcapital.com.cn

#### (4) 广发银行股份有限公司

法定代表人：王凯

注册地址：广州市越秀区东风东路713号

客服电话: 400-830-8003

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

(5) 济安财富(北京)基金销售有限公司

法定代表人: 杨健

注册地址: 北京市朝阳区太阳宫中路16号院1号楼3层307

客服电话: 400-673-7010

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

(6) 京东肯特瑞基金销售有限公司

法定代表人: 邹保威

注册地址: 北京市海淀区知春路76号(写字楼)1号楼4层1-7-2

客服电话: 400 098 8511 (个人业务); 400 088 8816 (企业业务)

网址: [kenterui.jd.com](http://kenterui.jd.com)

(7) 蚂蚁(杭州)基金销售有限公司

法定代表人: 王珺

注册地址: 浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路969号3幢5层599室

客服电话: 95188-8

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

(8) 南京苏宁基金销售有限公司

法定代表人: 钱燕飞

注册地址: 南京市玄武区苏宁大道1-5号

客服电话: 95177

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

(9) 上海好买基金销售有限公司

法定代表人: 杨文斌

注册地址: 上海市虹口区东大名路501号6211单元

客服电话: 400-700-9665

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

(10) 上海天天基金销售有限公司

法定代表人: 其实

注册地址: 上海市徐汇区龙田路190号2号楼二层

客服电话: 95021/400-1818-188

网址: [www.1234567.com.cn](http://www.1234567.com.cn)

(11) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

法定代表人: CHEN ZHENG JAMES

注册地址: 深圳市福田区福田街道民田路178号华融大厦27层2704

客服电话: 4001661188

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

(12) 万家财富基金销售(天津)有限公司

法定代表人: 戴晓云

注册地址: 天津自贸区(中心商务区)迎宾大道1988号滨海浙商大厦公寓  
2-2413室

客服电话: 010-59013895

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

(13) 兴业银行股份有限公司

法定代表人: 吕家进

注册地址: 福州市湖东路154号

客服电话: 95561/4008895561

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

(14) 宜信普泽(北京)基金销售有限公司

法定代表人: 才殿阳

注册地址: 北京市朝阳区光华路7号楼20层20A1、20A2单元

客服电话: 400-6099-200

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

(15) 中国光大银行股份有限公司

法定代表人: 李晓鹏

注册地址: 中国北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心

客服电话: 95595

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

(16) 中国银行股份有限公司

法定代表人: 刘连舸

注册地址:北京市西城区复兴门内大街1号

客服电话:95566

网址:www.boc.cn

(17) 中信建投证券股份有限公司

法定代表人:王常青

注册地址:北京市朝阳区安立路66号4号楼

客服电话:95587/4008-888-108

网址:www.csc108.com

(18) 华西证券股份有限公司

法定代表人:杨炯洋

注册地址:四川省成都市高新区天府二街198号

客服电话:95584、4008-888-818

网址:www.hx168.com.cn

(19) 中国民生银行股份有限公司

法定代表人:高迎欣

注册地址:北京市西城区复兴门内大街2号

客服电话:95568

网址:www.cmbc.com.cn

(20) 上海万得基金销售有限公司

法定代表人:宋晓言

注册地址:中国(上海)自由贸易试验区福山路33号11楼B座

客服电话:400-799-1888

网址:www.520fund.com.cn

(21) 上海基煜基金销售有限公司

法定代表人:王翔

注册地址:上海市黄浦区广东路500号30层3001单元

客服电话:400-820-5369

网址:www.jiyufund.com.cn

(22) 上海利得基金销售有限公司

法定代表人:李兴春

注册地址：上海市宝山区月浦镇塘南街57号6幢221室

客服电话：400-032-5885

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

(23) 阳光人寿保险股份有限公司

法定代表人：李科

注册地址：海南省三亚市迎宾路360-1号三亚阳光金融广场16层

客服电话：95510

网址：[life.sinosig.com](http://life.sinosig.com)

(24) 北京唐鼎耀华基金销售有限公司

法定代表人：赵雪

注册地址：北京市延庆区延庆经济开发区百泉街10号2栋236室

客服电话：400-819-1958

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

(25) 北京植信基金销售有限公司

法定代表人：王军辉

注册地址：北京市密云区兴盛南路8号院2号楼106室-67

客服电话：4006-802-123

网址：[www.zhixin-inv.com](http://www.zhixin-inv.com)

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

(二) 场内销售机构：本基金办理场内认购、申购和赎回的销售机构为具有基金销售业务资格并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的深圳证券交易所会员单位。(具体名单见基金份额发售公告)

## 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：周明

联系人：赵亦清

电话：010-50938782

传真：010-50938991

### 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号时代金融中心19楼

办公地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

负责人：俞卫锋

电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：丁媛

经办律师：黎明、丁媛

### 四、审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路1318号星展银行大厦507单元01室

办公地址：上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场二座楼普华永道中心11楼

执行事务合伙人：李丹

联系电话：021-23238888

传真电话：021-23238800

联系人：沈兆杰

经办注册会计师：张振波、沈兆杰

## 第六部分 基金的募集

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《流动性风险管理规定》、基金合同及其他法律法规的有关规定募集。本基金募集申请已经中国证监会2018年6月21日证监许可[2018]1008号文准予注册募集。

本基金为混合型证券投资基金,运作方式为定期开放方式,即采用封闭运作和开放运作交替循环的方式,存续期间为不定期。

本基金的募集对象为符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。

本基金自2018年8月8日起向全社会公开募集,截至2018年9月19日募集工作结束。经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)验资,本次募集的有效净认购金额为214,110,461.82元人民币,认购资金在募集期间产生的银行利息共计216,782.49元人民币。本次募集所有资金已于2018年9月26日全额划入基金托管专户。

本次募集有效认购户数为3664户。按照每份基金份额初始发售面值1.00元人民币计算,设立募集期间募集的有效份额共计214,110,461.82份基金份额,利息结转的基金份额为216,782.49份基金份额。两项合计共214,327,244.31份基金份额,已全部计入各基金份额持有人的基金账户,归各基金份额持有人所有。其中,汇安基金管理有限责任公司基金从业人员认购持有的基金份额总额为29,981.59份,占本基金总份额的比例为0.014%。按照有关法律规定,本基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用由本基金管理人承担,不从基金资产中列支。



## 第七部分 基金合同的生效

### 一、基金合同生效

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规以及本基金基金合同、招募说明书的有关规定,本基金本次募集符合有关条件,本基金管理人已向中国证监会办理完毕基金备案手续,并于2018年9月27日获得中国证监会的书面确认,基金合同自该日起生效。自基金合同生效之日起,本基金管理人正式开始管理本基金。

### 二、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

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

法律法规或监管部门另有规定时,从其规定。

## 第八部分 基金份额的上市交易

### 一、基金份额的上市

基金合同生效后,在本基金符合法律法规和深圳证券交易所规定的上市条件的情况下,基金管理人将依据有关规定,申请本基金的基金份额上市交易。

### 二、上市交易的地点

深圳证券交易所

### 三、上市交易的时间

基金合同生效后,在本基金符合法律法规和深圳证券交易所规定的上市条件的情况下,基金管理人将在基金合同生效后的第一个封闭期内申请在深圳证券交易所上市交易。

在确定上市交易的时间后,基金管理人应依据法律法规规定在指定媒介上刊登上市交易公告书。

### 四、上市交易的规则

- 1、本基金上市首日的开盘参考价为前一交易日的基金份额净值;
- 2、本基金实行价格涨跌幅限制,涨跌幅比例为10%,自上市首日起实行;
- 3、本基金买入申报数量为100份或其整数倍;
- 4、本基金申报价格最小变动单位为0.001元人民币;
- 5、本基金在深圳证券交易所的上市交易遵循《深圳证券交易所交易规则》及《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》等其他有关规定。

### 五、上市交易的费用

基金份额上市交易的费用按照深圳证券交易所的有关规定办理。

### 六、上市交易的行情揭示

基金份额在深圳证券交易所挂牌交易,交易行情通过行情发布系统揭示。行情发布系统同时揭示基金前一交易日的基金份额净值。

### 七、上市交易的登记

投资者T日买入成功后,登记机构在T日自动为投资者登记权益并办理登记手续,投资者自T+1日(含该日)后有权卖出该部分基金;

投资者T日卖出成功后,登记机构在T日自动为投资者办理扣除权益的登记

手续。

#### 八、上市交易的停复牌、暂停上市和恢复上市

基金份额的停复牌、暂停上市和恢复上市按照相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所的相关规定执行。

#### 九、上市交易的终止上市

当基金发生《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》规定的因不再具备上市条件而应当终止上市的情形时，本基金将变更为非上市的定期开放式基金并相应修订基金合同，无需召开基金份额持有人大会。基金转型并终止上市后，对于本基金场内份额的处理规则由基金管理人提前制定并公告。

十、相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所对基金上市交易的规则等相关规定内容进行调整的，基金合同相应予以修改，并按照新规定执行，且此项修改无须召开基金份额持有人大会。

十一、若深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司增加了基金上市交易的新功能，基金管理人可以在履行适当的程序后增加相应功能。

## 第九部分 基金份额的申购与赎回

本基金以定期开放方式运作,即采用封闭运作和开放运作交替循环的方式。

### 一、基金的封闭期

本基金的第一个封闭期的起始之日为基金合同生效日,结束之日为基金合同生效日所对应的第三年年度对日前的倒数第一日。第二个封闭期的起始之日为第一个开放期结束之日次日,结束之日为第二个封闭期起始之日所对应的第三年年度对日前的倒数第一日,依此类推。年度对日指某一特定日期在后续日历年份中的对应日期,如该对应日期为非工作日,则顺延至下一个工作日,若该日历年份中不存在对应日期的,则顺延至该月最后一日的下一工作日。本基金在封闭期内不办理申购与赎回业务,但投资人可在本基金上市交易后通过深圳证券交易所交易场内基金份额。

### 二、基金的开放期

本基金自封闭期结束之日的下一个工作日起(即每个开放期首日为每个封闭期起始之日的第三年年度对日,包括该工作日)进入开放期,期间可以办理申购、赎回或其他业务。本基金每个开放期不少于5个工作日且最长不超过20个工作日,开放期的具体时间由基金管理人在上一个封闭期结束前公告说明。如在开放期内发生不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放或需依据《基金合同》暂停申购或赎回业务的,基金管理人有权合理调整申购或赎回业务的办理期间并予以公告。

### 三、申购和赎回场所

投资者办理基金份额场内申购和赎回业务的场所为具有基金销售业务资格且经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的深圳证券交易所会员单位。投资者需使用深圳证券账户,通过深圳证券交易所交易系统办理基金份额场内申购、赎回业务。

投资者办理基金份额场外申购和赎回业务的场所为基金管理人直销机构和基金管理人委托的其他销售机构。投资者需使用中国证券登记结算有限责任公司开放式基金账户办理基金份额场外申购、赎回业务。

投资者应当在基金管理人和场内、场外销售机构办理基金份额申购、赎回业

务的营业场所或按基金管理人和场内、场外销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购和赎回。本基金场内、场外销售机构名单将由基金管理人在招募说明书、基金份额发售公告或其他公告中列明。

基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并在管理人网站公示。

若基金管理人或其委托的销售机构开通电话、传真或网上等交易方式，投资者可以通过上述方式进行申购与赎回。

#### 四、申购和赎回的开放日及时间

##### 1、开放日及开放时间

本基金开放期内，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、深圳证券交易所及相关金融期货交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

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

##### 2、申购、赎回开始日及业务办理时间

除法律法规或《基金合同》另有约定外，本基金自每个封闭期结束日的下一个工作日起（含该日）进入开放期，投资人在开放期可办理本基金份额的申购、赎回或其他业务。本基金每个开放期不少于5个工作日且不超过20个工作日，开放期的具体时间以基金管理人届时公告为准。

如在开放期内发生不可抗力或其他情形致使本基金无法按时开放申购与赎回业务，或依据基金合同需暂停申购或赎回业务的，开放期时间顺延，具体时间以基金管理人届时公告为准。

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。开放期内，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、赎回或转换价格为下一开放日基金份额申购、赎回或转换的价格，但若投资人在开放期最后一日业务办理时间结束之后提出申购、赎回或转换申请的，其申购、赎回或转换申请将被拒绝。

#### 五、申购与赎回的原则

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

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；

4、基金份额的场内申购、赎回等业务，按照深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则执行。若相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对申购、赎回业务等规则有新的规定，按新规定执行，基金合同相应予以修改，且此项修改无须召开基金份额持有人大会；

5、场外赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资者认购、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》的有关规定在指定媒介上公告。

## 六、申购与赎回的程序

### 1、申购和赎回的申请方式

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

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

### 2、申购和赎回的款项支付

投资者申购基金份额时，必须全额交付申购款项，投资者交付申购款项，申购成立；登记机构确认基金份额时，申购生效。投资者在提交赎回申请时，必须有足够的基金份额余额，否则所提交的赎回申请不成立，登记机构确认赎回时，赎回生效。

投资者T日的赎回申请经本基金的登记机构确认生效后，基金管理人将在T+7日（包括该日）内支付赎回款项。在发生巨额赎回或基金合同载明的其他暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。

遇交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障

或其他非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程,则赎回款项划付时间相应顺延。

### 3、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T日),在正常情况下,本基金登记机构在T+1日内(包括该日)对该交易的有效性进行确认,投资者应在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。若申购不成立或无效,则申购款项退还给投资者。

销售机构对申请的受理并不代表该申请一定成功,而仅代表销售机构确实接收到申请。申请的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况,投资者应及时查询并妥善行使合法权利。

4、基金管理人可以在法律法规允许的范围内,对上述业务办理时间进行调整,并按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上提前公告。

### 七、申购和赎回的数量限制

1、投资人通过场外申购本基金时,首次单笔最低申购金额为人民币10.00元,追加申购单笔最低金额为人民币10.00元。

2、投资人通过深圳证券交易所场内申购本基金时,单笔最低申购金额为人民币1,000.00元(含申购费),同时每笔申购必须是人民币1.00元的整数倍。

3、基金份额持有人通过场外赎回时,在各销售机构的最低赎回、转换转出及最低持有份额为1份基金份额,基金份额持有人当日持有份额减少导致在销售机构同一交易账户保留的基金份额不足1份基金份额时,登记机构有权将全部剩余份额自动赎回。投资人通过本公司直销柜台赎回本基金遵循上述规则,各基金销售机构有不同规定的,投资者在该销售机构办理上述业务时,需同时遵循销售机构的相关业务规定。

4、对于场内申购、赎回及持有场内份额的数量限制,深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则有规定的,从其最新规定办理。

5、本基金目前对单个投资人累计持有的基金份额不设上限限制,但如单一投资者持有的基金份额数的比例超过基金份额总数的50%,或者有可能变相规避前述50%比例,则基金管理人可拒绝或暂停接受该投资人的申购申请。

6、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时,

基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施,切实保护存量基金份额持有人的合法权益。具体请参见相关公告。

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

#### 八、申购费率、赎回费率

##### 1、申购费用

本基金在申购时收取申购费用。若投资者有多笔申购,申购费率按每笔申购申请单独计算。申购费用由投资者承担,在申购基金份额时收取,不列入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用。

##### (1) 场外申购

本基金场外申购费率具体如下表所示:

申购金额(M), 元	申购费率
M<100 万	1.50%
100 万≤M<200 万	1.20%
200 万≤M<500 万	0.80%
M≥500 万	每笔 1000 元

##### (2) 场内申购

本基金的场内申购费率参照场外申购费率执行。

##### 2、赎回费用

本基金的赎回费率按基金份额持有期限递减。

##### (1) 场外赎回

本基金的场外赎回费率如下表所示:

持有年限(天)	赎回费率
Y<7 天	1.50%
7 天≤Y<30 天	0.75%
30 天≤Y<6 个月	0.50%
Y≥6 个月	0%

本基金的赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担,在基金份额持有



人赎回基金份额时收取。对持有期限不满 30 天的，收取的赎回费全额计入基金财产；持有期满 30 天（含）不满 90 天的，将不低于赎回费总额的 75%计入基金财产；持有期满 90 天（含）不满 6 个月的，将不低于赎回费总额的 50%计入基金财产。未计入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。

## (2) 场内赎回

本基金的场内赎回费率参照场外赎回费率执行。

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

## 九、申购份额与赎回金额的计算方式

本基金场外申购和场内申购均申购采用金额申购的方式。申购的有效份额为净申购金额除以当日的基金份额净值，有效份额单位为份。

### 1、申购份额的计算方式：

对于申购本基金的投资人，申购份额的计算公式为：

#### (1) 申购费用适用比例费率的情形下：

净申购金额=申购金额/（1+申购费率）

申购费用=申购金额-净申购金额

申购份额=净申购金额/申购当日基金份额净值

#### (2) 申购费用适用固定金额的情形下：

申购费用=固定金额

净申购金额=申购金额-申购费用

申购份额=净申购金额/申购当日基金份额净值

场内申购份额计算结果先按四舍五入的原则保留到小数点后两位，再采用截位方式，保留至整数位，小数部分对应的申购资金返还至投资者资金账户；场外申购份额计算结果按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。申购费用、净申购金额的计算按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此误差产生的收益或损失由基金资产承担。

例：假定某投资者通过场外申购本基金，申购当日基金份额净值为 1.2000 元，两笔申购金额分别为 1 万元和 200 万元，则各笔申购负担的申购费用和获得的该基金份额计算如下：

	申购 1	申购 2
申购金额(元, A)	10,000	2,000,000
适用申购费率(B)	1.50%	0.80%
申购费(C=A-D)	147.78	15,873.02
净申购金额(D=A/(1+B))	9,852.22	1,984,126.98
申购份额(=D/1.2000)	8,210.18	1,653,439.15

例: 假定某投资者通过场内申购本基金, 申购当日基金份额净值为 1.0150 元, 申购金额为 10 万元, 对应申购费率为 1.50%, 则其可得到的申购份额为:

$$\text{净申购金额} = 100,000 / (1 + 1.50\%) = 98,522.17 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 100,000 - 98,522.17 = 1,477.83 \text{ 元}$$

申购份额 =  $98,522.17 / 1.0150 = 97,066.18$  份 (四舍五入保留至小数点后 2 位) = 97,066 份 (保留至整数位)

$$\text{返还金额} = 0.18 \times 1.0150 = 0.18 \text{ 元}$$

即: 投资者投资 100,000 元通过场内申购本基金, 假设申购当日的基金份额净值为 1.0150 元, 则可得到 97,066 份基金份额。

## 2、赎回金额的计算方式:

本基金采用“份额赎回”方式, 赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用来计算。

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

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

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

赎回金额的计算结果按四舍五入方法, 保留到小数点后 2 位, 由此产生的收益或损失由基金财产承担。

例: 某投资者赎回本基金 10,000 份基金份额, 持有时间为 5 日, 适用的赎回费率为 1.5%, 假设赎回当日份额净值是 1.0500 元, 则其可得到的赎回金额为:

$$\text{赎回总金额} = 10,000 \times 1.0500 = 10,500.00 \text{ 元}$$

$$\text{赎回费用} = 10,500.00 \times 1.50\% = 157.50 \text{ 元}$$

$$\text{赎回金额} = 10,500.00 - 157.50 = 10,342.50 \text{ 元}$$

即: 投资者赎回本基金 10,000 份基金份额, 持有时间为 5 日, 假设赎回当

日基金份额净值是 1.0500 元，则其可得到的赎回金额为 10,342.50 元。

3、本基金基金份额净值的计算，保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并按基金合同的约定公告。遇特殊情况，基金合同另有约定或经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

4、基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情况下根据市场情况制定基金促销计划，针对投资人定期和不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，对存量基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可以按中国证监会要求履行必要手续后，对投资人适当调低基金销售费用。

5、办理基金份额的场内申购、赎回业务应遵守深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关业务规则。若相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对场内申购、赎回业务规则有新的规定，基金合同相应予以修改，并按照新规定执行，且此项修改无须召开基金份额持有人大会。

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

#### 十、申购与赎回的登记

1、经基金销售机构同意，基金投资者提出的申购和赎回申请，在基金管理人规定的时间之前可以撤销。

2、投资者申购基金成功后，登记机构在 T+1 日为投资者登记权益并办理登记手续，投资人自 T+2 日（含该日）后有权赎回该部分基金份额。

3、投资人赎回基金成功后，登记机构在 T+1 日为投资者办理扣除权益的登记手续。

4、基金管理人可以在法律法规允许的范围内，对上述登记办理时间进行调整，但不得实质影响投资者的合法权益，并最迟于开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定进行公告。

#### 十一、拒绝或暂停申购的情形

在开放期内，发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

- 1、因不可抗力导致基金无法正常运作。
- 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况。
- 3、证券、期货交易所交易时间临时停市，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，或出现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、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、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申购申请。
- 9、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、8、9 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人的申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项本金将退还给投资人。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，且开放期间按暂停申购的期间相应延长。

## 十二、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

在开放期内，发生下列情形时，基金管理人可暂停接受基金份额持有人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

- 1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。
- 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况。
- 3、证券、期货交易所交易时间临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
- 4、接受某笔或某些赎回申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。
- 5、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价

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

#### 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接受投资人的赎回申请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;对于场外份额,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。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。当出现暂停赎回或延缓支付赎回款项时,场内赎回申请按照深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关业务规则办理。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,且开放期按暂停赎回的期间相应延长。

### 十三、巨额赎回的情形及处理方式

#### 1、巨额赎回的认定

若本基金开放期内单个开放日内的基金份额净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过前一工作日的基金总份额的20%,即认为是发生了巨额赎回。

#### 2、巨额赎回的处理方式

对于场外份额,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延缓支付赎回款项。

(1) 全额赎回:当基金管理人认为有能力支付基金份额持有人的全部赎回申请时,按正常赎回程序执行。

(2) 延缓支付赎回款项:当基金管理人认为支付基金份额持有人的赎回申请有困难或认为因支付基金份额持有人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时,基金管理人应对当日全部赎回申请进行确认,当日按比例办理支付的赎回份额不得低于前一工作日基金总份额的20%,其余可以延缓支付赎回款项,但最长不超过20个工作日。延缓支付的赎回申请以赎回申请确认当日的基金份额净值为基础计算赎回金额。

(3) 本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放

日基金总份额 40%的情形下,基金管理人可以先行对该单个基金份额持有人超出 40%的赎回申请实施延期办理,延期的赎回申请与下一开放日的赎回申请一并处理,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。对该单个基金份额持有人 40%以内(含 40%)的赎回申请与其他投资者的赎回申请按上述第(1)或(2)项措施处理,具体见招募说明书或相关公告。

根据上述办理原则,如延期办理期限超过开放期的,开放期相应延长,延长的开放期内不办理申购,亦不接受新的赎回申请,即基金管理人仅为原开放期内因提交赎回申请超过基金总份额 40%以上而被延期办理赎回的单个基金份额持有人办理赎回业务。

3、当出现巨额赎回时,场内赎回申请按照深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相应规则进行处理,基金转换中转出份额的申请的处理方式遵照相关的业务规则及届时开展转换业务的公告。

#### 4、巨额赎回的公告

当发生上述巨额赎回并延期办理或延缓支付赎回款项时,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,并在 2 日内在指定媒介上刊登公告。

#### 十四、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,基金管理人当日应在规定期限内指定媒介上刊登暂停公告。

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

3、以上暂停及恢复基金申购与赎回的公告规定,不适用于基金合同约定的封闭期与开放期运作方式转换引起的暂停或恢复申购与赎回的情形。

#### 十五、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。

## 十六、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、符合法律法规的其他非交易过户。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。

## 十七、基金的登记和转托管

### 1、基金份额的登记

(1) 本基金的基金份额采用分系统登记的原则。场外认购、申购或通过跨系统转托管从场内转入的基金份额登记在登记结算系统中基金份额持有人开放式基金账户下,场内认购、申购、上市交易买入或通过跨系统转托管从场外转入的基金份额登记在证券登记系统中基金份额持有人的深圳证券账户下。

(2) 登记在证券登记系统中的基金份额可以在开放期内直接申请场内赎回或在深圳证券交易所上市。

(3) 登记在登记结算系统中的基金份额,既可以在开放期内直接申请场外赎回,也可以在办理跨系统转托管后,转至证券登记系统,在深圳证券交易所上市。

### 2、基金份额的交易

(1) 在封闭期内,登记在登记结算系统中的基金份额不得赎回,但可以通过跨系统转托管转至证券登记系统在深圳证券交易所上市交易;

(2) 在封闭期,登记在证券登记系统中的基金份额不得赎回,但可以在深圳证券交易所上市交易;

(3) 在开放期,登记在登记结算系统中的基金份额可申请场外赎回,也可以通过跨系统转托管转至证券登记系统在深圳证券交易所上市交易;

(4) 在开放期, 登记在证券登记系统中的基金份额既可以直接申请场内赎回, 也可以在深圳证券交易所上市交易。

### 3、系统内转托管

(1) 系统内转托管是指基金份额持有人将持有的基金份额在登记结算系统内不同销售机构之间或证券登记系统内不同会员单位之间进行转登记的行为。

(2) 基金份额登记在登记结算系统的基金份额持有人在变更办理基金份额赎回业务的销售机构(网点)时, 需办理已持有基金份额的系统内转托管。

(3) 基金份额登记在证券登记系统的基金份额持有人在变更办理基金份额场内赎回的会员单位(交易单元)时, 需办理已持有基金份额的系统内转托管。

(4) 募集期内不得办理系统内转托管。

### 4、跨系统转托管

(1) 跨系统转托管是指基金份额持有人将持有的基金份额在登记结算系统和证券登记系统之间进行转托管的行为。

(2) 基金份额跨系统转托管的具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司及深圳证券交易所的相关规定办理。

(3) 处于质押、冻结状态及深圳证券交易所、登记机构规定的其他情形时, 基金份额不能办理跨系统转托管。

(4) 处于募集期内的基金份额不能办理跨系统转托管。

5、基金销售机构可以按照相关规定向基金份额持有人收取转托管费。

6、基金管理人、基金登记机构或深圳证券交易所可视情况对上述规定作出调整, 并在正式实施前在指定媒介公告。

### 十八、定期定额投资计划

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

### 十九、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。

## 二十、基金份额的冻结和解冻

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

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

## 第十部分 基金的投资

### 一、投资目标

本基金在严格控制基金资产净值下行风险的基础上,追求基金资产净值的长期稳健增长。

### 二、投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、存托凭证、债券(包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、可转换债券、中小企业私募债等)、债券回购、同业存单、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

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

基金的投资组合比例为:本基金投资于股票资产占基金资产的比例不低于50%,但因开放期流动性需要,为保护基金份额持有人利益,每个开放期开始前三个月至开放期结束后三个月内不受前述比例限制。封闭期内,本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金;开放期内,本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债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的5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;权证、股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

### 三、投资策略

#### (一) 封闭期投资策略

本基金将结合宏观经济环境、政策形势、证券市场走势的综合分析,主动判断市场时机,进行积极的资产配置,合理确定基金在股票、债券等各类资产类别上的投资比例,以最大限度地降低投资组合的风险、提高稳健投资收益。

## 1、资产配置策略

本基金管理人在大类资产配置过程中,结合定量和定性分析,从宏观、中观、微观等多个角度考虑宏观经济面、政策面、市场面等多种因素,综合分析评判证券市场的特点及其演化趋势,重点分析股票、债券等资产的预期收益风险的匹配关系,在此基础上,在投资比例限制范围内,确定或调整投资组合中股票和债券的比例,以争取降低单一行业投资的系统性风险冲击。

本基金考虑的宏观经济指标包括 GDP 增长率,居民消费价格指数(CPI),生产者价格指数(PPI),货币供应量(M0, M1, M2)的增长率等指标。

本基金考虑的政策面因素包括但不限于货币政策、财政政策、产业政策的变化趋势等。

本基金考虑的市场因素包括但不限于市场的资金供求变化、上市公司的盈利增长情况、市场总体 P/E、P/B 等指标相对于长期均值水平的偏离度等。

## 2、股票投资策略

本基金以价值投资理念为导向,灵活运用多种股票投资策略,深度挖掘经济结构转型过程中具有核心竞争力和发展潜力的行业和公司,实现基金资产的长期稳定增值。

### (1) 行业配置策略

本基金管理人在进行行业配置时,将采用自上而下与自下而上相结合的方式确定行业权重。在投资组合管理过程中,基金管理人也将根据宏观经济形势以及各个行业的基本面特征对行业配置进行持续动态地调整。自上而下的行业配置策略是指通过深入分析宏观经济指标和不同行业自身的周期变化特征以及在国民经济中所处的位置,确定在当前宏观背景下适宜投资的重点行业,主要包括:

1) 宏观政策影响分析:根据政府产业政策、财政税收政策、货币政策等变化,分析各项政策对各行业及其子行业的影响,前瞻性的布局受益于国家政策较大的行业及子行业。

2) 市场需求变化:不同行业及子行业在技术优势、定价策略、销售渠道等方面的差异,影响到其盈利水平。本基金将前瞻性的配置市场需求预期比较稳定或预期保持较高增长的行业或子行业。

3) 本基金将综合研究社会发展趋势、经济发展趋势、科学技术发展趋势、消费者需求变化趋势等因素,采取“自上而下”的研究方法,对各个子行业的基

本面进行深入分析,通过行业评级及行业估值与轮动等因素确定各行业的配置比例。

自下而上的行业配置策略是指从行业的成长能力、盈利趋势、价格动量、市场估值等因素来确定基金重点投资的行业。对行业的具体分析主要包括以下方面:

#### 1) 景气分析

行业的景气程度可通过观测销量、价格、产能利用率、库存、毛利率等关键指标进行跟踪。行业的景气程度与宏观经济、产业政策、竞争格局、科技发展与技术进步等因素密切相关。

#### 2) 财务分析

行业财务分析的主要目的是评价行业的成长性、成长的可持续性以及盈利质量,同时也是对行业景气分析结论的进一步确认。财务分析考量的关键指标主要包括净资产收益率、主营业务收入增长率、毛利率、净利率、存货周转率、应收账款周转率、经营性现金流状况、债务结构等等。

#### 3) 估值分析

结合上述分析,本基金管理人将根据各行业的不同特点确定适合该行业的估值方法,同时参考可比国家类似行业的估值水平,来确定该行业的合理估值水平,并将合理估值水平与市场估值水平相比较,从而得出该行业高估、低估或中性的判断。估值分析中还将运用行业估值历史比较、行业间估值比较等相对估值方法进行辅助判断。

#### 4) 行业量化分析

本基金还将运用数量化方法分析行业的盈利能力、分析师的盈利预期、市场认同度以及行业景气周期等因素,建立行业预期收益和风险的矩阵,捕捉具有投资吸引力的行业。根据各行业的投资吸引力,决定各行业相对于业绩比较基准中股票指数的相对偏离度。提高投资吸引力高的行业配置,降低投资吸引力低的行业配置。

### (2) 精选个股策略

本基金采用定性与定量相结合的方式,对上市公司的投资价值进行综合评估,精选具有较强竞争优势的上市公司作为投资标的。在实际运行过程中将定期或不定期地进行修正,优化股票投资组合。具体来说,本基金股票投资策略主要

是以量化择股系统和基本面研究相结合的方式,根据市场的变化,灵活运用多种量化模型策略(如多因子模型、技术分析策略、个股统计分析策略、统计套利策略、定向增发策略、事件驱动策略等),从而提高组合收益,以期达到投资策略的多元化,降低组合的波动。

根据量化择股系统筛选出的个股,再从基本面分析入手,主要考虑的方面包括上市公司治理结构、核心竞争优势、议价能力、市场占有率、成长性、盈利能力、运营效率、财务结构、现金流情况等公司基本面因素,对上市公司的投资价值进行综合评价,精选具有较高投资价值的上市公司构建多头组合。

### (3) 主题轮动策略

主题轮动策略是基于自上而下的投资主题分析框架,综合运用定量和定性的分析方法,针对经济发展趋势及成长动因进行前瞻性的分析,挖掘市场的长期性和阶段性主题投资机会,并从中发现与投资主题相符的行业和具有核心竞争力的上市公司,力争获取市场超额收益。

本基金将从产业结构、分配结构、交换结构、消费结构、技术结构和区域经济结构六个方向,把握经济结构转型的脉搏,细分出具有实际投资意义的细分主题。

### (4) 成长投资策略

本基金也将关注成长型上市公司,重点关注中小市值股票(包括中小企业板和创业板股票)中具有潜在高成长性和稳健盈利模式的上市公司,在充分的行业研究和审慎的公司研究基础上,本基金将适度提高成长精选股票的风险水平,对优质成长型公司可给予适当估值溢价。在具体操作上,在以政策分析、行业分析和公司特质分析等基本面定性分析的基础上,采用时间序列分析和截面数据分析评价上市公司的盈利能力及其变化路径和公司盈利能力在行业内乃至整个市场所处的相对位置,评估风险,精选投资标的。

### (5) 事件驱动策略

本基金将重点关注影响行业和公司投资价值的事件性因素,以事件驱动作为投资策略,通过对上市公司各类事件的深入分析来精选个股。主要的事件驱动包括并购重组事件、股权激励事件、业绩超预期事件、重要股东投资行为事件、定向增发事件等。

## 3、债券投资策略

在进行债券投资时,本基金将会考量利率预期策略、信用债券投资策略、套利交易策略、可转换债券投资策略和资产支持证券投资策略,选择合适时机投资于低估的债券品种,通过积极主动管理,获得超额收益。

#### (1) 利率预期策略

本基金通过全面研究 GDP、物价、就业以及国际收支等主要经济变量,分析宏观经济运行的可能情景,并预测财政政策、货币政策等宏观经济政策取向,分析金融市场资金供求状况变化趋势及结构。在此基础上,预测金融市场利率水平变动趋势,以及金融市场收益率曲线斜度变化趋势。

组合久期是反映利率风险最重要的指标。本基金将根据对市场利率变化趋势的预期,制定出组合的目标久期:预期市场利率水平将上升时,降低组合的久期;预期市场利率将下降时,提高组合的久期。

#### (2) 信用债券投资策略

根据国民经济运行周期阶段,分析企业债券、公司债券等发行人所处行业发展前景、业务发展状况、市场竞争地位、财务状况、管理水平和债务水平等因素,评价债券发行人的信用风险,并根据特定债券的发行契约,评价债券的信用级别,确定企业债券、公司债券的信用风险利差。

债券信用风险评定需要重点分析企业财务结构、偿债能力、经营效益等财务信息,同时需要考虑企业的经营环境等外部因素,着重分析企业未来的偿债能力,评估其违约风险水平。

#### (3) 套利交易策略

在预测和分析同一市场不同板块之间(比如国债与金融债)、不同市场的同一品种、不同市场的不同板块之间的收益率利差基础上,基金管理人采取积极策略选择合适品种进行交易来获取投资收益。在正常条件下它们之间的收益率利差是稳定的。但是在某种情况下,比如若某个行业在经济周期的某一时期面临信用风险改变或者市场供求发生变化时这种稳定关系便被打破,若能提前预测并进行交易,就可进行套利或减少损失。

#### (4) 可转换债券投资策略

本基金着重对可转换债券对应的基础股票的分析与研究,同时兼顾其债券价值和转换期权价值,对那些有着较强的盈利能力或成长潜力的上市公司的可转换债券进行重点投资。

本基金管理人将对可转换债券对应的基础股票的基本面进行分析,包括所处行业的景气度、成长性、核心竞争力等,并参考同类公司的估值水平,研判发行公司的投资价值;基于对利率水平、票息率及派息频率、信用风险等因素的分析,判断其债券投资价值;采用期权定价模型,估算可转换债券的转换期权价值。综合以上因素,对可转换债券进行定价分析,制定可转换债券的投资策略。

#### (5) 资产支持证券投资策略

本基金将分析资产支持证券的资产特征,估计违约率和提前偿付比率,并利用收益率曲线和期权定价模型,对资产支持证券进行估值。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资,以降低流动性风险。

#### (6) 中小企业私募债投资策略

本基金将深入研究发行人资信及公司运营情况,与中小企业私募债券承销商紧密合作,合理合规合格地进行中小企业私募债券投资。本基金在投资过程中密切监控债券信用等级或发行人信用等级变化情况,力求规避可能存在的债券违约,并获取超额收益。

### 4、股指期货投资策略

本基金参与股指期货交易,以套期保值为目的。基金管理人根据对指数点位区间判断,在符合法律法规的前提下,决定套保比例。再根据基金股票投资组合的贝塔值,具体得出参与股指期货交易的买卖张数。基金管理人根据股指期货当时的成交金额、持仓量和基差等数据,选择和基金组合相关性高的股指期货合约为交易标的。

### 5、国债期货投资策略

本基金参与国债期货交易以套期保值为目的。在风险可控的前提下,通过对宏观经济和利率市场走势的分析与判断,并充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险特征,通过资产配置,谨慎进行投资,以调整债券组合的久期,降低投资组合的整体风险。具体而言,本基金的国债期货投资策略包括套期保值时机选择策略、期货合约选择和头寸选择策略、展期策略、保证金管理策略、流动性管理策略等。

本基金在运用国债期货投资控制风险的基础上,将审慎地获取相应的超额收益,通过国债期货对债券的多头替代和稳健资产仓位的增加,以及国债期货与债券的多空比例调整,获取组合的稳定收益。

## 6、权证投资策略

本基金采用数量化期权定价公式对权证价值进行计算,并结合行业研究员对权证标的证券的估值分析结果,选择具有良好流动性和较高投资价值的权证进行投资。采用的策略包括但不限于下列策略或策略组合:

本基金采取现金套利策略,兑现部分标的证券的投资收益,并通过购买该证券认购权证的方式,保留未来股票上涨所带来的获利空间。

根据权证与标的证券的内在价值联系,合理配置权证与标的证券的投资比例,构建权证与标的证券的避险组合,控制投资组合的下跌风险。同时,本基金积极发现可能存在的套利机会,构建权证与标的证券的套利组合,获取较高的投资收益。

## 7、存托凭证投资策略

本基金将在控制风险的前提下,依照基金投资目标和股票投资策略,基于对基础证券投资价值的深入研究和判断,通过定性分析和定量分析相结合的方式,精选出具有比较优势的存托凭证。

### (二) 开放期投资策略

基于本基金定期开放的运作方式,基金管理人在临近开放期和开放期内将重点关注基金资产的流动性和变现能力,分散投资,做好流动性管理以应对开放期投资者的赎回需求。

## 四、投资限制

### 1、组合限制

(1) 本基金投资于股票资产占基金资产的比例不低于 50%,但因开放期流动性需要,为保护基金份额持有人利益,每个开放期开始前三个月至开放期结束后三个月内不受前述比例限制;

(2) 在开放期内,本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债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,在封闭期内,本基金不受上述 5%的限制,每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金;其中,现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等;

(3) 本基金持有一家公司发行的证券,其市值不超过基金资产净值的 10%;

(4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券,不超过该证



券的10%;

(5) 本基金在封闭期内基金资产总值不得超过基金资产净值的200%，在开放期内，本基金基金资产总值不超过基金资产净值的140%;

(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20%;

(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) 本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债券市场进行债券回购的，封闭期内，债券正回购资金余额或逆回购资金余额不得超过其上一日基金资产净值的100%；开放期内，债券正回购资金余额或逆回购资金余额不得超过其上一日基金资产净值的40%；本基金在全国银行间债券市场中开展的质押式回购和买断式回购最长期限为365天，债券回购到期后不得展期;

(16) 本基金参与股指期货和/或国债期货交易，遵循下列比例限制:

1) 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，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的15%;

2) 在开放期内, 本基金在每个交易日日终, 持有的买入国债期货和股指期货合约价值与有价证券市值之和不得超过基金资产净值的 95%, 在封闭期内, 本基金在每个交易日日终, 持有的买入国债期货和股指期货合约价值与有价证券市值之和不得超过基金资产净值的 100%, 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;

3) 本基金在任何交易日日终, 持有的卖出股指期货合约价值不得超过本基金持有的股票总市值的 20%; 在任何交易日日终, 持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%;

4) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值, 合计(轧差计算)应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定; 所持有的债券(不含到期日在一年以内的政府债券)市值和买入、卖出国债期货合约价值, 合计(轧差计算)应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定;

5) 本基金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%; 在任何交易日内交易(不包括平仓)的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的30%;

(17) 本基金持有单只中小企业私募债券, 其市值不得超过基金资产净值的 10%;

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

(19) 在开放期内, 本基金持有的所有流通受限证券, 其公允价值不得超过基金资产净值的20%; 本基金持有的同一流通受限证券, 其公允价值不得超过基金资产净值的10%;

(20) 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%;

(21) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对

手开展逆回购交易的,可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致;

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

(23) 法律法规和中国证监会规定的其他投资比例限制。

除上述第(2)、(13)、(18)、(21)项外,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不符合基金合同约定的投资比例的,基金管理人应当在十个交易日内进行调整,但法律法规或中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。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上述限制,如适用于本基金,则本基金投资不再受相关限制。如果法律法规或监管部门对基金合同约定投资组合比例限制进行变更的,以变更后的规定为准,不需要经基金份额持有人大会审议。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或者活动:

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

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券,或者从事其他重大关联交易的,应当符合本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。

如法律法规或监管部门取消或变更上述禁止性规定,基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制或以变更后的规定为准。

## 五、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准:

沪深 300 指数收益率 $\times$ 60%+中国债券总指数收益率 $\times$ 40%。

其中,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。

本基金业绩比较基准沪深300指数收益率 $\times$ 60%+中国债券总指数收益率 $\times$ 40%目前能够忠实地反映本基金的风险收益特征。随着市场环境的变化,或因指数编制及发布等方面的原因,如果上述业绩比较基准不适用本基金,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出时,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。调整业绩比较基准无需召开基金份额持有人大会,但应经基金托管人同意,报中国证监会备案,基金管理人应在调整前在中国证监会指定的信息披露媒介上刊登公告。

## 六、风险收益特征

本基金为混合型基金,属于证券投资基金中预期风险与预期收益较高的投资品种,其风险收益水平高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金。

## 七、基金管理人代表基金行使相关权利的处理原则及方法

- 1、有利于基金资产的安全与增值;
- 2、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使相关权利,保护基金份额持有人的利益;
- 3、不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;

4、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理。

## 八、基金的投资组合报告

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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年3月31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。

本报告期自2021年10月1日起至2021年12月31日止。

## 1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	423,859,798.80	99.06
	其中：股票	423,859,798.80	99.06
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,989,930.25	0.47
8	其他资产	2,012,841.49	0.47
9	合计	427,862,570.54	100.00

## 2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	11,140,840.00	2.61
C	制造业	399,143,530.21	93.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应	-	-

汇安裕阳三年定期开放混合型证券投资基金  
(2022年第1号) 招募说明书(更新)

	业		
E	建筑业	4,713.80	0.00
F	批发和零售业	56,803.09	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	4,608.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	369,969.90	0.09
J	金融业	12,943,968.00	3.03
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	130,928.87	0.03
N	水利、环境和公共设施管理业	37,860.51	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	18,161.78	0.00
R	文化、体育和娱乐业	8,414.64	0.00
S	综合	-	-
	合计	423,859,798.80	99.37

## 2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

## 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	002241	歌尔股份	674,900	36,512,090.00	8.56
2	603806	福斯特	275,200	35,927,360.00	8.42
3	002466	天齐锂业	322,600	34,518,200.00	8.09
4	002812	恩捷股份	136,400	34,154,560.00	8.01
5	601012	隆基股份	381,700	32,902,540.00	7.71
6	300014	亿纬锂能	260,000	30,726,800.00	7.20
7	300750	宁德时代	51,400	30,223,200.00	7.09
8	300395	菲利华	358,700	23,580,938.00	5.53
9	600862	中航高科	529,200	18,924,192.00	4.44
10	603501	韦尔股份	55,000	17,092,350.00	4.01

## 4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

## 5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未使用股指期货策略。

## 10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未使用国债期货策略。

### 10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

## 11 投资组合报告附注

### 11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金投资的歌尔股份的发行主体歌尔股份有限公司于2021年12月28日收到中华人民共和国烟台海关的警告(烟关机简字[2018]0002号)。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。其余前十大持有证券的发行主体本报告期内没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

**11.2 基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。**

**11.3 其他资产构成**

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	123,450.46
2	应收证券清算款	1,888,656.51
3	应收股利	-
4	应收利息	734.52
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	2,012,841.49

**11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

**11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

**11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。



## 第十一部分 基金的业绩

基金业绩截止日为2021年12月31日。

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。

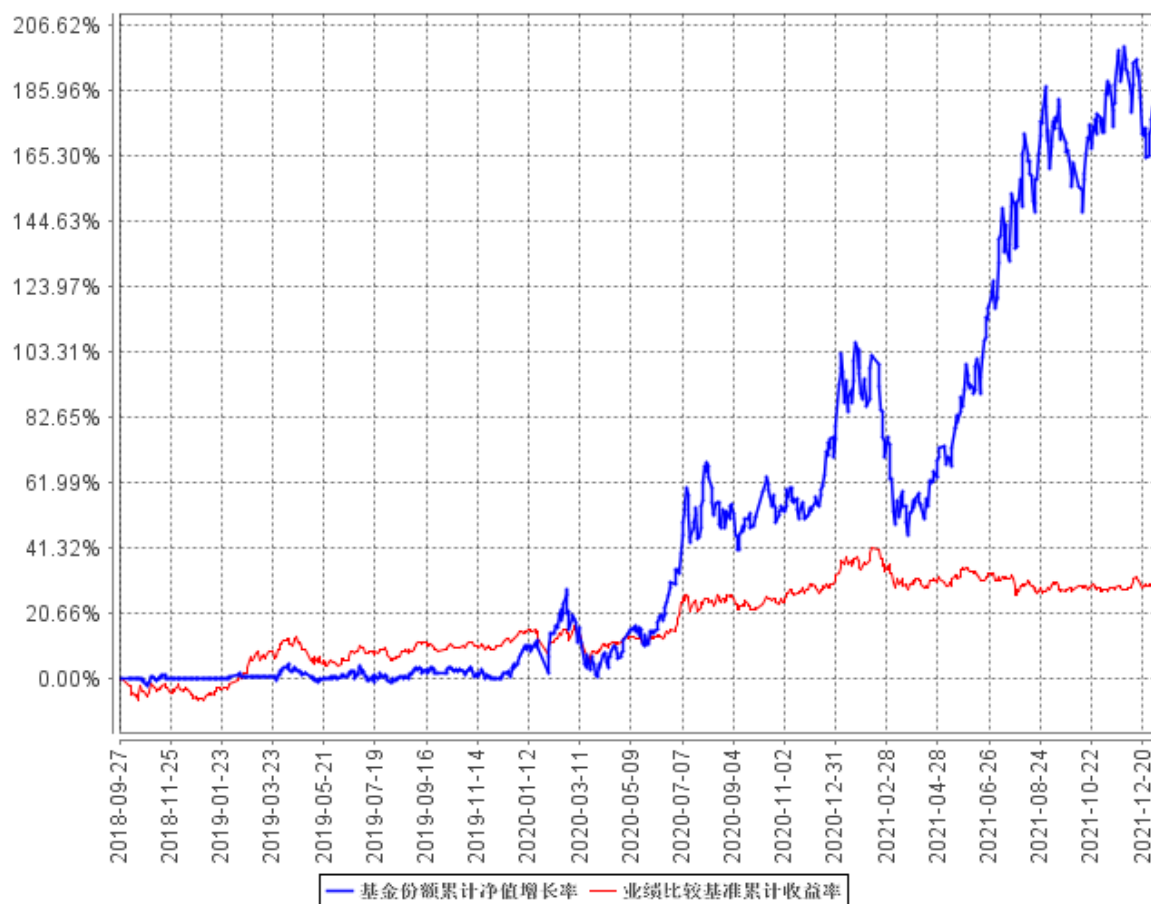
1、基金合同生效以来(截至2021年12月31日)的基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较：

### 汇安裕阳定开混合

阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
2018年9月27日(基 金合同生效日)至 2018年12月31日	0.21%	0.34%	-5.96%	0.96%	6.17%	-0.62%
2019年1月1日至 2019年12月31日	4.95%	0.62%	21.41%	0.74%	-16.46%	-0.12%
2020年1月1日至 2020年12月31日	71.29%	2.10%	16.22%	0.84%	55.07%	1.26%
2021年1月1日至 2021年12月31日	56.11%	2.39%	-1.88%	0.70%	57.99%	1.69%

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

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



注：本报告期，本基金投资比例符合基金合同要求。

## 第十二部分 基金的财产

### 一、基金资产总值

基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息和基金应收款项以及其他资产所形成的价值总和。

### 二、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### 三、基金财产的账户

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

### 四、基金财产的保管和处分

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

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

## 第十三部分 基金资产的估值

### 一、估值日

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

### 二、估值对象

基金所拥有的股票、存托凭证、权证、债券、股指期货、国债期货和银行存款本息、应收款项、其他投资等资产及负债。

### 三、估值原则

对于存在活跃市场的情况下，以活跃市场上未经调整的报价作为计量日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表计量日公允价值的情况下，对市场报价进行调整以确定计量日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，则采用估值技术确定其公允价值。

### 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固定收益品种(基金合同另有规定的除外)，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种对应的估值净价估值，具体估值机构由基金管理人与基金托管人另行协商约定；

(3) 交易所上市交易的可转换债券，按照每日收盘价作为估值全价；交易所上市实行全价交易的债券(可转债除外)，选取第三方估值机构提供的估值全价减去估值全价中所含的债券(税后)应收利息得到的净价进行估值；

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

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

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

5、存款的估值方法

持有的银行定期存款或通知存款以本金列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入。

6、投资证券衍生品的估值方法

股指期货、国债期货合约，一般以估值当日结算价进行，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。

7、中小企业私募债券采用估值技术确定公允价值估值。如使用的估值技术难以确定和计量其公允价值的，按成本估值。

8、同业存单按估值日第三方估值机构提供的估值净价估值；选定的第三方

估值机构未提供估值价格的,按成本估值。

9、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。

10、本基金投资存托凭证的估值核算,依照境内上市交易的股票执行。

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

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

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

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

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

基金管理人于每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值,并按规定公告。

2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后,将基金份额净值结果发送基金托管人,经基金托管人复核无误后,由基金管理人对外公布。

## 六、估值错误的处理

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

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”)的直接经济损失按下述“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,并报中国证监会备案。

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

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

②若基金管理人计算的基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告,由此给基金份额持有人造成损失的,应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金,就实际向投资者或基金支付的赔偿金额,基金管理人与基金托管人按照过错程度各自承担相应的责任。

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

④由于基金管理人提供的信息错误(包括但不限于基金申购或赎回金额等),



进而导致基金份额净值计算错误而引起的基金份额持有人和基金财产的损失,由基金管理人负责赔付。

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

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

3、当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应当暂停基金估值;

4、法律法规、中国证监会和《基金合同》认定的其他情形。

#### 八、基金净值的确认

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

#### 九、特殊情形的处理

1、基金管理人、基金托管人按估值方法第 11 项进行估值时,所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

2、由于证券、期货交易所及登记结算公司发送的数据错误或由于其他不可抗力原因,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,由此造成的基金财产估值错误,基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

## 第十四部分 基金的收益分配

### 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、本基金的每份基金份额享有同等分配权；
- 2、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，本基金的收益分配，每年不得少于一次，且每次基金收益分配比例不低于截至收益分配基准日可供分配利润的90%；具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满3个月则可不进行收益分配；
- 3、本基金收益分配方式仅现金分红一种方式；
- 4、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；
- 5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

### 四、收益分配方案

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

### 五、收益分配方案的确定、公告与实施

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

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

### 六、基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。

## 第十五部分 基金费用与税收

### 一、基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 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、仲裁费和诉讼费；
- 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、基金的相关账户的开户及维护费用；
- 9、基金上市初费及上市年费；
- 10、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

### 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

#### 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0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付,由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。费用自动扣划后,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。

3、上述“一、基金费用的种类”中第3—10项费用,根据有关法律法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

### 三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

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

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;

3、《基金合同》生效前的相关费用;

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

### 四、基金税收

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。

## 第十六部分 基金的会计与审计

### 一、基金会计政策

1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；

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

3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；

4、会计制度执行国家有关会计制度；

5、本基金独立建账、独立核算；

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

7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

### 二、基金的年度审计

1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的具有证券、期货相关从业资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。

2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意。

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

## 第十七部分 基金的信息披露

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

### 二、信息披露义务人

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律、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中国证监会指定的全国性报刊（以下简称“指定报刊”）及指定互联网网站（以下简称“指定网站”）等媒介披露，并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

三、本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

- 1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；
- 2、对证券投资业绩进行预测；
- 3、违规承诺收益或者承担损失；
- 4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构；
- 5、登载任何自然人、法人和非法人组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；
- 6、法律法规和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。同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证不同文本的内容一致。不同文本之间发生歧义的，以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

### 五、公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

(一) 基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议、基金产品资料概要

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

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

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

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

基金募集申请经中国证监会注册后，基金管理人在基金份额发售的3日前，将基金招募说明书、《基金合同》摘要登载在指定媒介上；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指定媒介上。

(三) 《基金合同》生效公告

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

(四) 上市交易公告书

本基金获准在深圳证券交易所上市交易的，基金管理人应当在基金份额上市交易3个工作日前，将基金份额上市交易公告书登载在指定网站上，并将上市交

易公告书提示性公告登载在指定报刊上。

#### (五) 基金净值信息

《基金合同》生效后,在基金上市交易前,基金管理人应当至少每周在指定网站披露一次基金份额净值和基金份额累计净值。

在基金上市交易后,基金管理人应当在不晚于每个交易日的次日,通过指定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露交易日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日,在指定网站披露半年度和年度最后一日的基金份额净值和基金份额累计净值。(六) 基金份额申购、赎回价格

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

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

基金管理人应当在每年结束之日起三个月内,编制完成基金年度报告,将年度报告登载在指定网站上,并将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关业务资格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,将中期报告登载在指定网站上,并将中期报告提示性公告登载在指定报刊上。

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,将季度报告登载在指定网站上,并将季度报告提示性公告登载在指定报刊上。

《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比例达到或超过基金份额总数20%的情形,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。

本基金持续运作过程中,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。



#### (八) 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,并登载在指定报刊和指定网站上。

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(不包括本基金封闭期与开放期运作方式的转换)、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、基金管理费、基金托管费、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、基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五;

17、本基金进入开放期;

18、开放期内,本基金发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时;

19、本基金开放期内发生巨额赎回并延缓支付赎回款项或延期办理;

20、本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请;

21、本基金推出新业务或新服务;

22、基金管理人采用摆动定价机制进行估值;

23、基金份额停复牌、暂停上市、恢复上市或终止上市;

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

#### (九) 澄清公告

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

#### (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指定网站上,并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

#### (十一) 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。

基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会,基金管理人、基金托管人对基金份额持有人大会决定的事项不依法履行信息披露义务的,召集人应当履行相关信息披露义务。

#### (十二) 投资股指期货、国债期货的相关公告

在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书(更新)等文件中披露股指期货、国债期货交易情况,包括投资政策、持仓情况、损益情况、风

险指标等,并充分揭示股指期货、国债期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标等。

#### (十三) 投资资产支持证券的相关公告

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

#### (十四) 投资中小企业私募债券的相关公告

基金管理人应当在基金投资中小企业私募债券后 2 个交易日内,在中国证监会指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。基金管理人应当在本基金季度报告、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等法律法规规定。

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

基金管理人、基金托管人应当在指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指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指定媒介、基金上市交易的证券交易所网站披露信息,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。

#### 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、基金上市交易的证券交易所,供社会公众查阅、复制。

#### 八、暂停或延迟披露基金相关信息的情形

当出现下述情况时,基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金信息:

- 1、基金投资所涉及的证券、期货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、法律法规规定、中国证监会或《基金合同》认定的其他情形。

九、本基金信息披露事项以法律法规规定及本章节约定的内容为准。



## 第十八部分 风险揭示

### 一、投资于本基金的主要风险

投资于本基金的主要风险有：

#### 1、市场风险

证券市场价格受到各种因素的影响，导致基金收益水平变化而产生风险，主要包括：

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

(2) 经济周期风险。随着经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化。

(3) 利率风险。金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。

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

(5) 再投资风险。再投资风险反映了利率下降对固定收益证券利息收入再投资收益的影响，这与利率上升所带来的价格风险（即利率风险）互为消长。

#### 2、信用风险

信用风险主要指债券、资产支持证券等信用证券发行主体信用状况恶化，导致信用评级下降甚至到期不能履行合约进行兑付的风险，另外，信用风险也包括证券交易对手因违约而产生的证券交割风险。

#### 3、操作风险

操作风险是指基金运作过程中，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。

#### 4、管理风险

在基金管理运作过程中，基金管理人的研究水平、投资管理水平直接影响基金收益水平，如果基金管理人经济形势和证券市场判断不准确、获取的信息不充分、投资操作出现失误等，都会影响基金的收益水平。

#### 5、合规风险

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，或者违反

《基金合同》有关规定的风险。

## 6、本基金的特有风险

### (1) 基金运作的特有风险

本基金在深圳证券交易所挂牌上市,由于上市期间可能因信息披露导致基金停牌,投资者在停牌期间不能买卖本基金上市交易份额,产生风险;同时,可能因上市后交易对手不足而产生流动性风险;另外,当基金份额持有人将份额转向场外交易后导致场内的基金份额或持有人数不满足上市条件时,本基金存在终止上市的可能。

### (2) 科创板股票投资风险

本基金可投资科创板股票,科创板股票的主要风险包括但不限于退市风险、流动性风险、投资集中度风险、市场风险等,可能导致委托财产遭受损失。投资科创板股票存在的风险包括但不限于:

#### 1) 退市风险

科创板退市制度较主板更为严格,退市时间更短,退市速度更快;退市情形更多,新增市值低于规定标准、上市公司信息披露或者规范运作存在重大缺陷导致退市的情形;执行标准更严,明显丧失持续经营能力,仅依赖与主业无关的贸易或者不具备商业实质的关联交易维持收入的上市公司可能会被退市;且不再设置暂停上市、恢复上市和重新上市环节,上市公司退市风险更大。

#### 2) 流动性风险

由于科创板投资门槛高于A股其他板块,整体板块流动性可能弱于A股,投资者可能在特定阶段对科创板个股形成一致性预期,因此存在基金持有股票无法正常交易的风险。

#### 3) 集中度风险

因科创板上市企业均为科技创新成长性企业,其商业模式、盈利风险、业绩波动等特征较为相似,基金难以通过分散投资降低投资风险,若股票价格同向波动,将引起基金净值波动。

#### 4) 市场风险

科创板个股集中来自新一代信息技术、高端装备、新材料、新能源、节能环保及生物医药等高新技术和战略新兴产业领域。大多数企业为初创型公司,企业未来盈利、现金流、估值均存在不确定性,与传统二级市场投资存在差异,整体

投资难度加大,个股市场风险加大。

科创板个股上市前五日无涨跌幅限制,第六日开始涨跌幅限制在正负20%以内,个股波动幅度较其他股票加大,市场风险随之上升。

### (3) 金融衍生品投资风险

本基金投资股指期货、国债期货等金融衍生品。金融衍生品是一种金融合约,其价值取决于一种或多种基础资产或指数,其评价主要源自于对挂钩资产的价格与价格波动的预期。投资于衍生品需承受市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险和法律风险等。由于衍生品通常具有杠杆效应,价格波动比标的工具更为剧烈,有时候比投资标的资产要承担更高的风险。并且由于衍生品定价相当复杂,不适当的估值有可能使基金资产面临损失风险。

### (4) 资产支持证券投资风险

本基金投资资产支持证券,资产支持证券(ABS)是一种债券性质的金融工具,其向投资者支付的本息来自于基础资产池产生的现金流或剩余权益。与股票和一般债券不同,资产支持证券不是对某一经营实体的利益要求权,而是对基础资产池所产生的现金流和剩余权益的要求权,是一种以资产信用为支持的证券,所面临的风险主要包括交易结构风险、各种原因导致的基础资产池现金流与对应证券现金流不匹配产生的信用风险、市场交易不活跃导致的流动性风险等。

### (5) 流通受限证券投资风险

本基金可投资流通受限证券,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。本基金可能由于持有流通受限证券而面临流动性风险以及流通受限期间内证券价格大幅下跌的影响。

### (6) 中小企业私募债投资风险

本基金投资中小企业私募债,中小企业私募债是根据相关法律法规由非上市中小企业采用非公开方式发行的债券。由于不能公开交易,一般情况下,交易不活跃,潜在较大流动性风险。当发债主体信用质量恶化时,受市场流动性所限,本基金可能无法卖出所持有的中小企业私募债,由此可能给基金净值带来更大的负面影响和损失。



### (7) 存托凭证投资风险

本基金可投资存托凭证,可能面临与存托凭证发行机制相关的风险,包括但不限于存托协议自动约束存托凭证持有人的风险;存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险;存托凭证退市的风险;因多地上市造成存托凭证价格差异以及受境外市场影响交易价格大幅波动的风险;存托凭证持有人权益被摊薄的风险;已在境外上市的基础证券发行人,在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险;境内外法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险等本基金可投资存托凭证,基金净值可能受到存托凭证的境外基础证券价格波动影响,存托凭证的境外基础证券的相关风险可能直接或间接成为本基金的风险。

### 7、流动性风险

流动性风险是指因证券市场交易量不足,导致证券不能迅速、低成本地变现的风险。流动性风险还包括基金出现巨额赎回,致使没有足够的现金应付赎回支付所引致的风险。

#### (1) 本基金的申购、赎回安排

本基金以定期开放方式运作,即采用封闭运作和开放运作交替循环的方式,以三年为一个封闭期。在本基金的开放期内,基金管理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、深圳证券交易所及相关金融期货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。除法律法规或《基金合同》另有约定外,本基金自每个封闭期结束日的下一个工作日起(含该日)进入开放期,投资人在开放期可办理本基金份额的申购、赎回或其他业务。本基金每个开放期不少于5个工作日且不超过20个工作日,开放期的具体时间以基金管理人届时公告为准。

提示投资人注意本基金的申购赎回安排和相应的流动性风险,合理安排投资计划。

#### (2) 拟投资市场及资产的流动性风险

1) 本基金投资于股票资产占基金资产的比例不低于50%,但因开放期流动性需要,为保护基金份额持有人利益,每个开放期开始前三个月至开放期结束后三个月内不受前述比例限制。在封闭期内,本基金将结合宏观经济环境、政策形

势、证券市场走势的综合分析,主动判断市场时机,进行积极的资产配置,合理确定基金在股票、债券等各类资产类别上的投资比例。基金管理人在临近开放期和开放期内将重点关注基金资产的流动性和变现能力,分散投资,做好流动性管理以应对开放期投资者的赎回需求。

2) 本基金所投资的股票市场具有发展成熟、容量较大、交易活跃、流动性充裕的特征,能够满足本基金开放期的流动性要求。同时,本基金采用分散投资,针对个股设置投资比例上限,以控制流动性风险。

3) 本基金投资债券部分可存在由于部分个券由于发行规模不大,市场成交额较小,导致基金管理人无法迅速、低成本地变现或调整基金投资组合的风险。本基金将通过控制本基金规模、设置个券投资比例上限、根据市场情况灵活调整基金现金资产和非现金资产的比例、调整个券的投资比例、审慎接受或确认赎回申请等措施持续优化组合配置,以控制流动性风险。

4) 股指期货、国债期货合约存在无法及时变现所带来的流动性风险。

5) 资产支持证券,只能通过特定的渠道进行转让交易,存在市场交易不活跃导致的流动性风险。

6) 非公开发行股票等流通受限证券由于具有明确的锁定期和解禁后减持相关规定的限制,存在不能及时变现的流动性风险。

7) 中小企业私募债由于不能公开交易,一般情况下,交易不活跃,潜在较大流动性风险。

基金管理人将密切关注各类资产及投资标的的交易活跃程度与价格的连续性情况,评估各类资产及投资标的占基金资产的比例并进行动态调整,以满足基金运作过程中的流动性要求,应对流动性风险。

### (3) 巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

若本基金开放期内单个开放日内的基金份额净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过前一工作日的基金总份额的20%,即认为是发生了巨额赎回。对于场外份额,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延缓支付赎回款项。本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额40%的情形下,基金管理人可以先行对该单个基金份额持有人超出40%的赎回申请实施延期办理。当出

现巨额赎回时,场内赎回申请按照深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相应规则进行处理。

(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  
本基金在面临大规模赎回的情况下有可能因为无法变现造成流动性风险。

如果出现流动性风险,基金管理人经与基金托管人协商,在确保投资者得到公平对待的前提下,可实施备用的流动性风险管理工具,包括但不限于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、摆动定价、暂停基金估值等,作为特定情形下基金管理人流动性风险管理的辅助措施,同时基金管理人应时刻防范可能产生的流动性风险,对流动性风险进行日常监控,保护持有人的利益。当实施备用的流动性风险管理工具时,有可能无法按合同约定的时限支付赎回款项。

#### 8、基金管理人职责终止风险

因违法经营或者出现重大风险等情况,可能发生基金管理人被依法取消基金管理资格,或依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等情况。在基金管理人职责终止情况下,投资者面临基金管理人变更或基金合同终止的风险。基金管理人职责终止,涉及基金管理人、临时基金管理人、新任基金管理人之间责任划分的,相关基金管理人对各自履职行为依法承担责任。

#### 9、其他风险

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、代理商违约、托管行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。

## 二、声明

1、投资者投资于本基金,须自行承担投资风险;

2、除基金管理人直接办理本基金的销售外,本基金还通过其他基金销售机构销售,基金管理人与其他基金销售机构都不能保证其收益或本金安全。

## 第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### 一、《基金合同》的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于法律法规规定和《基金合同》约定的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须报中国证监会备案，并自表决通过之日起生效，决议生效后两日内依照《信息披露办法》的规定在指定媒介公告。

### 二、《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，在履行相关程序后，《基金合同》应当终止：

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

### 三、基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起30个工作日内成立清算小组，基金管理人或临时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或临时基金管理人、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不超过 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剩余财产中支付。

#### 五、基金财产清算剩余资产的分配

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

#### 六、基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告; 基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

#### 七、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 第二十部分 基金合同的内容摘要

基金合同内容摘要详见附件一。

## 第二十一部分 基金托管协议的内容摘要

托管协议内容摘要详见附件二。

## 第二十二部分 对基金份额持有人的服务

对本基金份额持有人的服务主要由基金管理人、发售代理机构、申购赎回代理券商提供。基金管理人根据基金份额持有人的需要和市场的变化,有权增加和修改服务项目,主要提供的服务内容如下:

### 一、网站服务

通过基金管理人网站,投资者可获得如下服务:

1、查询服务:投资者可以通过基金管理人网站查询所持有基金的基金份额、交易确认记录等信息,同时可以查询和修改投资者联系方式等基本资料。

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各类信息,包括基金法律文件、基金管理人最新动态、热点问题等。

### 二、电话服务

1、自助电话服务:基金管理人提供24小时自动语音查询服务。基金份额持有人可进行基金账户余额、交易情况、基金净值等信息的查询。

2、人工服务:基金管理人提供每个交易日9:00-11:30,13:00-17:00人工热线咨询服务。投资者可通过客户服务电话享受业务咨询、信息查询、服务资料修改等专项服务。

### 三、资料递送服务

1、账户确认单:投资者开户申请自成功受理之日起的2个交易日后,相关基金账户的开户确认信息可通过销售机构进行查询和打印。

2、交易确认单:投资者自交易申请成功下达之日起的2个交易日后,可通过销售机构查询和打印交易确认单。

3、基金对账单:基金份额持有人如有需求,可致电销售机构和基金管理人索取季度、年度对账单。

4、其他资料:基金管理人将根据投资者的需求,不定期递送基金管理人介绍和产品宣传推介材料等。

基金管理人提供的资料递送服务原则上以电子形式为主,如基金份额持有人需纸质资料,可致电客户服务中心。对于纸质资料的递送,基金管理人不对资料的邮寄送达做出任何承诺和保证,也不对邮寄过程中所出现的遗漏、泄露而导致的直接或间接损害承担赔偿责任。

### 四、客户意见、建议或投诉处理



份额持有人可以通过本公司热线电话、电子邮箱、传真、书信等方式对基金管理人和销售机构提出意见、建议或投诉。

投资者还可以通过销售机构的服务电话对该销售机构提出意见、建议或投诉。

#### 五、基金管理人联系方式

公司网址：[www.huianfund.cn](http://www.huianfund.cn)

客服电话：010-56711690

客服邮箱：[services@huianfund.cn](mailto:services@huianfund.cn)

六、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。

## 第二十三部分 其他应披露的公告

自2021年4月23日至2022年3月31日本基金的临时公告和定期报告刊登于《证券时报》和基金管理人网站 [www.huianfund.cn](http://www.huianfund.cn)。

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	汇安裕阳三年定期开放混合型证券投资基金(2021年第1号)招募说明书(更新)	规定报刊和/或公司网站	2021/5/18
2	汇安裕阳三年定期开放混合型证券投资基金基金产品资料概要(更新)	规定报刊和/或公司网站	2021/5/18
3	汇安基金管理有限责任公司关于旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	规定报刊和/或公司网站	2021/6/23
4	汇安裕阳三年定期开放混合型证券投资基金2021年第2季度报告	规定报刊和/或公司网站	2021/7/21
5	关于汇安基金管理有限责任公司旗下基金增加销售机构的公告	规定报刊和/或公司网站	2021/8/10
6	汇安基金管理有限责任公司关于旗下深交所基金新增扩位简称的公告	规定报刊和/或公司网站	2021/8/21
7	汇安裕阳三年定期开放混合型证券投资基金2021年中期报告	规定报刊和/或公司网站	2021/8/31
8	汇安裕阳三年定期开放混合型证券投资基金开放日常申购、赎回的公告	规定报刊和/或公司网站	2021/9/6
9	汇安裕阳三年定期开放混合型证券投资基金分红公告	规定报刊和/或公司网站	2021/9/13
10	关于汇安裕阳三年定期开放混合型证券投资基金开放日常申购、赎回的提示性公告	规定报刊和/或公司网站	2021/9/24
11	关于汇安裕阳三年定期开放混合型证券投资基金开放日常申购、赎回的第二次提示性公告	规定报刊和/或公司网站	2021/10/22
12	汇安裕阳三年定期开放混合型证券投资基金2021年第3季度报告	规定报刊和/或公司网站	2021/10/27
13	汇安基金管理有限责任公司关于变更高级管理人员的公告	规定报刊和/或公司网站	2021/11/17

汇安裕阳三年定期开放混合型证券投资基金  
(2022年第1号) 招募说明书(更新)

14	汇安基金管理有限责任公司关于江苏分公司成立的公告	规定报刊和/或公司网站	2021/12/29
15	汇安基金管理有限责任公司关于海南分公司成立的公告	规定报刊和/或公司网站	2021/12/31
16	汇安裕阳三年定期开放混合型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	规定报刊和/或公司网站	2022/1/24
17	汇安裕阳三年定期开放混合型证券投资基金 2021 年年度报告	规定报刊和/或公司网站	2022/3/31

## 第二十四部分 招募说明书的存放及查阅方式

招募说明书公布后,应当分别置备于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的办公场所,投资人可在办公时间查阅;投资人在支付工本费后,可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。对投资人按此种方式所获得的文件及其复印件,基金管理人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

投资人还可以直接登录基金管理人的网站([www.huianfund.cn](http://www.huianfund.cn))查阅和下载招募说明书。

## 第二十五部分 备查文件

以下备查文件存放在基金管理人的办公场所，在办公时间可供免费查阅。

(一)中国证监会准予汇安裕阳三年定期开放混合型证券投资基金募集的文件

(二)《汇安裕阳三年定期开放混合型证券投资基金基金合同》

(三)《汇安裕阳三年定期开放混合型证券投资基金托管协议》

(四)基金管理人业务资格批件、营业执照

(五)基金托管人业务资格批件、营业执照

(六)关于申请募集汇安裕阳三年定期开放混合型证券投资基金之法律意见书

(七)中国证监会要求的其他文件

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。

汇安基金管理有限责任公司

2022年4月20日

## 附件一 基金合同内容摘要

### 一、基金合同当事人及权利义务

#### (一) 基金管理人

##### 1、基金管理人简况

名称：汇安基金管理有限责任公司

住所：上海市虹口区欧阳路218弄1号2楼215室

法定代表人：刘强

成立日期：2016年4月25日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监许可[2016]860号

组织形式：有限责任公司

注册资本：1亿元

存续期限：持续经营

联系电话：(010) 56711600

##### 2、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》及有关法律的规定决定基金收益的分配方案；

11) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购、赎回或转换申请；

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

13) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；

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

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

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

17) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

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

2) 办理基金备案手续；

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

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

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

6) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，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条件下得到有关资料的复印件；

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

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

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

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

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

23) 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他



法律行为:

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

25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议;

26) 建立并保存基金份额持有人名册;

27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(二) 基金托管人

1、基金托管人简况

名称: 中国光大银行股份有限公司

住所: 北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心

邮政编码: 100033

法定代表人: 李晓鹏

成立日期: 1992 年 6 月 18 日

批准设立机关和批准设立文号: 国务院、国函[1992]7 号

组织形式: 股份有限公司

注册资本: 466.79095 亿元人民币

存续期间: 持续经营

2、基金托管人的权利与义务

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

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

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

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

4) 根据相关市场规则,为基金开设证券账户、资金账户、期货账户等投资所需账户,为基金办理证券、期货交易资金清算;

- 5) 提议召开或召集基金份额持有人大会;
- 6) 在基金管理人更换时, 提名新的基金管理人;
- 7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

- 1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产;
- 2) 设立专门的基金托管部门, 具有符合要求的营业场所, 配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员, 负责基金财产托管事宜;
- 3) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度, 确保基金财产的安全, 保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立; 对所托管的不同的基金分别设置账户, 独立核算, 分账管理, 保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立;
- 4) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外, 不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益, 不得委托第三人托管基金财产;
- 5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证;
- 6) 按规定开设基金财产的资金账户、证券账户和期货结算等投资所需账户, 按照《基金合同》的约定, 根据基金管理人的投资指令, 及时办理清算、交割事宜;
- 7) 保守基金商业秘密, 除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外, 在基金信息公开披露前予以保密, 不得向他人泄露;
- 8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购、赎回价格;
- 9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项;
- 10) 对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告出具意见, 说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行; 如果基金管理人未执行《基金合同》规定的行为, 还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施;
- 11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上;
- 12) 从基金管理人或其委托的登记机构处接收并保存基金份额持有人名册;
- 13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对;

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

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

16) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作;

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

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

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

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

21) 执行生效的基金份额持有人大会的决议;

22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

### (三) 基金份额持有人

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

每份基金份额具有同等的合法权益。

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

(1) 分享基金财产收益;

(2) 参与分配清算后的剩余基金财产;

(3) 在开放期内, 依法转让或者申请赎回其持有的基金份额;

(4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会;

(5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会, 对基金份额持有人大会

审议事项行使表决权；

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

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

- (1) 认真阅读并遵守《基金合同》、招募说明书等信息披露文件；
- (2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；
- (3) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；
- (4) 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。

本基金未设立基金份额持有人大会的日常机构，如今后设立基金份额持有人大会的日常机构，按照相关法律法规的要求执行。

### (一) 召开事由

1、除法律法规、中国证监会另有规定或《基金合同》另有约定外，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(不包括本基金封闭期和开放期运作方式的转换);
- (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) 终止基金份额上市,但因基金不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市的除外;
- (11) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会;
- (12) 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;
- (13) 对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项;
- (14) 法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

2、在法律法规、中国证监会规定和《基金合同》的约定范围内,以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下,以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改,不需召开基金份额持有人大会:

- (1) 调低除基金管理费、基金托管费以外的应由本基金或基金份额持有人承担的费用;
- (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》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低本基金的赎回费率、或在不提高现有基金份额持有人适用费率的前提下,增加或调整基金份额类别或变更收费方式;
- (4) 因相应的法律法规、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则发生变动而应当对《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) 基金管理人、登记机构、基金销售机构,在法律法规规定或中国证监

会许可的范围内,在不对基金份额持有人权益产生实质性不利影响的情况下,调整有关认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务规则;

(7) 在法律法规规定或中国证监会许可的范围内,本基金推出新业务或服务;

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

## (二) 会议召集人及召集方式

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

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时,由基金托管人召集。

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

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

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

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

(三) 召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

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

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

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

(四) 基金份额持有人出席会议的方式

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

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

- (1) 亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人

持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托书证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；

(2) 经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）。

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式或会议通知载明的其他形式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址或系统。通讯开会应以书面方式或会议通知载明的其他形式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

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

(3) 本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的，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）；

(4) 上述第(3)项中直接出具表决意见的基金份额持有人或受托代表他人出具表决意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具表决意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托书符合法律法规、《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、在法律法规或监管机构允许的情况下，本基金亦可采用网络、电话等其他非书面方式由基金份额持有人向其授权代表进行授权。

4、在法律法规和监管机关允许的情况下，本基金亦可采用网络、电话等其他非现场方式或者以非现场方式与现场方式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。

5、若到会者在权益登记日所持有的有效基金份额低于第1条第(2)款、出



具表决意见或授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人在权益登记日所持有的有效基金份额低于第2条第(3)款规定比例的,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,到会者所持有的有效基金份额、出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所持有的有效基金份额应不小于在权益登记日基金总份额的三分之一(含三分之一)。

#### (五) 议事内容与程序

##### 1、 议事内容及提案权

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

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

##### 2、 议事程序

###### (1) 现场开会

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

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

###### (2) 通讯开会

在通讯开会的情况下,首先由召集人提前30日公布提案,在所通知的表决

截止日期后2个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决,在公证机关监督下形成决议。

#### (六) 表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议:

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

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

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

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

#### (七) 计票

##### 1、现场开会

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

(2) 监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当

场公布计票结果。

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

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

## 2、通讯开会

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

### (八) 生效与公告

基金份额持有人大会的决议,召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起2日内在指定媒介上公告。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) 本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定,凡是直接引用法律法规或监管规则的部分,如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的,基金管理人经与基金托管人协商一致并提前公告后,可直接对本部分内容进行修改和调整,无需召开基金份额持有人大会审议。

## 三、基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

### (一) 《基金合同》的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本基金合同约定应经基金份额持有人

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

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议须报中国证监会备案,并自表决通过之日起生效,决议生效后两日内依照《信息披露办法》的规定在指定媒介公告。

#### (二) 《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的,在履行相关程序后,《基金合同》应当终止:

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

#### (三) 基金财产的清算

1、基金财产清算小组:自出现《基金合同》终止事由之日起30个工作日内成立清算小组,基金管理人或临时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或临时基金管理人、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不超过 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剩余财产中支付。

(五) 基金财产清算剩余资产的分配

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

(六) 基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

(七) 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

四、争议的处理

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，根据该会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局性的，并对各方当事人均有约束力，仲裁费用、律师费用由败诉方承担。

争议处理期间，双方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责，各自继续忠实、勤勉、尽责地履行《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。

《基金合同》受中国法律管辖。

五、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

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

## 附件二 托管协议内容摘要

### 一、托管协议当事人

#### (一) 基金管理人

名称：汇安基金管理有限责任公司

住所：上海市虹口区欧阳路218弄1号2楼215室

法定代表人：刘强

成立日期：2016年4月25日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监许可[2016]860号

组织形式：有限责任公司

注册资本：1亿元

存续期限：持续经营

经营范围：公募基金管理（基金募集、基金销售、资产管理、特定客户资产管理）和中国证监会许可的其他业务）

#### (二) 基金托管人

名称：中国光大银行股份有限公司

住所：北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心

邮政编码：100033

法定代表人：李晓鹏

成立日期：1992年6月18日

批准设立机关和批准设立文号：国务院、国函[1992]7号

组织形式：股份有限公司

注册资本：466.79095亿元人民币

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；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；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；经中国人民银行和国家外汇管理局批准的其他业务。

### 二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

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

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(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、存托凭证、债券(包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、可转换债券、中小企业私募债等)、债券回购、同业存单、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

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

基金的投资组合比例为:本基金投资于股票资产占基金资产的比例不低于50%,但因开放期流动性需要,为保护基金份额持有人利益,每个开放期开始前三个月至开放期结束后三个月内不受前述比例限制。

封闭期内,本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金;开放期内,本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债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的5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;权证、股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

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

1、本基金投资于股票资产占基金资产的比例不低于50%,但因开放期流动性需要,为保护基金份额持有人利益,每个开放期开始前三个月至开放期结束后三个月内不受前述比例限制;

2、在开放期内,本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债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,在封闭期内,本基金不受上述5%的限制,每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于交易保

证金一倍的现金；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；

3、本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的10%；

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

5、本基金在封闭期内基金资产总值不得超过基金资产净值的200%，在开放期内，本基金基金资产总值不超过基金资产净值的140%；

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20%；

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、本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债券市场进行债券回购的，封闭期内，债券正回购资金余额或逆回购资金余额不得超过其上一日基金资产净值的100%；开放期内，债券正回购资金余额或逆回购资金余额不得超过其上一日基金资产净值的40%；本基金在全国银行间债券市场中开展的质押式回购和买断式回购最长期限为365天，债券回购到期后不得展期；

16、本基金参与股指期货和/或国债期货交易，遵循下列比例限制：

(1) 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，持有的买入国债期货合约价值，不得



超过基金资产净值的 15%;

(2) 在开放期内, 本基金在每个交易日日终, 持有的买入国债期货和股指期货合约价值与有价证券市值之和不得超过基金资产净值的 95%, 在封闭期内, 本基金在每个交易日日终, 持有的买入国债期货和股指期货合约价值与有价证券市值之和不得超过基金资产净值的 100%, 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;

(3) 本基金在任何交易日日终, 持有的卖出股指期货合约价值不得超过本基金持有的股票总市值的 20%; 在任何交易日日终, 持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%;

(4) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值, 合计(轧差计算)应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定; 所持有的债券(不含到期日在一年以内的政府债券)市值和买入、卖出国债期货合约价值, 合计(轧差计算)应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定;

(5) 本基金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%; 在任何交易日内交易(不包括平仓)的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 30%;

17、本基金持有单只中小企业私募债券, 其市值不得超过基金资产净值的 10%;

18、在开放期内, 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%, 在封闭期内, 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 50%; 因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合该比例限制的, 基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;

19、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%;

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

持一致;

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

22、法律法规和中国证监会规定的其他投资比例限制。

除上述第2、13、18、20项外,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不符合基金合同约定的投资比例的,基金管理人应当在十个交易日内进行调整,但法律法规或中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。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上述限制,如适用于本基金,则本基金投资不再受相关限制。如果法律法规或监管部门对基金合同约定投资组合比例限制进行变更的,以变更后的规定为准,不需要经基金份额持有人大会审议。

(三)基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对本托管协议第十五条第(十二)款基金投资禁止行为进行监督。

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,应当符合本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。

(四)基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。

基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的、经慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手名单,并约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金管理人应严格按照交易对手名单的范围在银行间债券市场选择交易对手。基金托管人事后监督基金管理人是否按事前提提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易。基金管理人可以每半年对银行间债券

市场交易对手名单及结算方式进行更新,新名单确定前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易,仍应按照协议进行结算。如基金管理人根据市场情况需要临时调整银行间债券市场交易对手名单及结算方式的,应向基金托管人说明理由,并在与交易对手发生交易前3个工作日内与基金托管人协商解决。

基金管理人负责对交易对手的资信控制,按银行间债券市场的交易规则进行交易,并承担交易对手不履行合同造成的损失,基金托管人则根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督。如基金托管人事后发现基金管理人没有按照事先约定的交易对手进行交易时,基金托管人应及时提醒基金管理人,基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任。

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

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

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

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

上述规章制度须经基金管理人董事会批准。上述规章制度经董事会通过之后,基金管理人应至少于首次投资流通受限证券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。

4. 在投资流通受限证券之前,基金管理人应按约定时间向基金托管人提供符合法律法规要求的有关流通受限证券的信息,具体应当包括但不限于如下文件(如有):拟发行证券主体的中国证监会批准文件、拟发行数量、定价依据、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基金资产净值的比例、划款账号、划款金额、划款时间文件等。基金管理人应保证上述信息的真实、完整。

5. 基金投资流通受限证券,基金管理人应根据本协议的规定与基金托管银行签订风险控制补充协议。协议应包括基金托管人对于基金管理人是否遵守相关制度、流动性风险处置预案以及相关投资额度和比例的情况进行监督等内容。

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

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

(六) 基金管理人投资银行定期存款应符合相关法律法规约定。基金管理人在投资银行定期存款的过程中,必须符合基金合同就投资品种、投资比例、存款期限等方面的限制。基金管理人应基于审慎原则评估存款银行信用风险并据此选择存款银行。因基金管理人违反上述原则给基金造成的损失,基金托管人不承担任何责任。开立定期存款账户时,定期存款账户的户名应与托管账户户名一致,本着便于委托资产的安全保管和日常监督核查的原则,存款行应尽量选择托管账户所在地的分支机构。对于跨行定期存款投资,管理人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。该协议中必须有如下明确条款:“存款证实书不得被质押或以任何方式被抵押,并不得用于转让和背书;本息到期归还或提前支取的所有款项必须划至托管专户(明确户名、开户行、账号等),不得划入其他任何账户”。并依照本协议交接原则对存单交接流程予以明确。如定期存款协议中未体现前述条款,托管人有权拒绝定期存款投资的划款指令。对于跨行存款,管理人需提前与托管人就定期存款协议及存单交接流程进行沟通。除非存款协议中规定存款证实书由存款行保管或存款协议作为存款支取的依据,存单交接原则上采用存款行上门服务、管理人负责监交的方式。

特殊情况下,采用管理人交接存单的方式。在取得存款证实书后,托管人保管证实书正本。管理人需对跨行存款的利率政策风险、存款行的选择及存款协议承担责任,并指定专人在核实存款行授权人员身份信息后,负责印鉴卡与存款证实书等凭证的监交或交接,以确保与托管人所交接凭证的真实性、准确性和完整性。托管人对投资后处于托管人实际控制之外的资产不承担保管责任。跨行定期存款账户的预留印鉴为托管人托管业务专用章与托管业务授权人名章。

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

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

(八)基金托管人发现基金管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作违反法律法规、基金合同和本托管协议的规定,应及时以电话提醒或书面提示等方式通知基金管理人限期纠正。

基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到书面通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函,就基金托管人合理的疑义进行解释或举证,说明违规原因及纠正期限,并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内,基金托管人有权随时对通知事项进行复查,督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的,基金托管人应报告中国证监会。

(九)基金管理人义务配合和协助基金托管人依照法律法规、基金合同和本托管协议对基金业务执行核查。

对基金托管人发出的书面提示,基金管理人应在规定时间内答复并改正,或就基金托管人合理的疑义进行解释或举证;对基金托管人按照法律法规、基金合同和本托管协议的要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项,基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

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

理人。

(十一)基金托管人发现基金管理人有关重大违规行为,应及时报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正,并将纠正结果报告中国证监会。

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

### 三、基金管理人有关基金托管人的业务核查

(一)基金管理人有关基金托管人履行托管职责情况进行核查,核查事项包括基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户、证券账户、期货账户以及投资所需的其他专用账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

(二)基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、基金合同、本协议及其他有关规定时,应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正。

基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式给基金管理人发出回函,说明违规原因及纠正期限,并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内,基金管理人有权随时对通知事项进行复查,督促基金托管人改正。基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为,包括但不限于:提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性,在规定时间内答复基金管理人并改正。

(三)基金管理人发现基金托管人有关重大违规行为,应及时报告中国证监会,同时通知基金托管人限期纠正,并将纠正结果报告中国证监会。

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

### 四、基金财产的保管

#### (一)基金财产保管的原则

1. 基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产;
2. 基金托管人应安全保管基金财产;

3. 基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户、证券账户、期货账户以及投资所需的其他专用账户;

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

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

6. 对于因为基金投资产生的应收资产, 应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人, 到账日基金财产没有到达基金账户的, 基金托管人应及时通知并配合基金管理人采取措施进行催收。由此给基金财产造成损失的, 基金管理人应负责向有关当事人追偿基金财产的损失, 基金托管人对基金管理人的追偿行为应予以必要的协助;

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

#### (二) 基金募集期间及募集资金的验资

1. 基金募集期间募集的资金应存于基金管理人开立的“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为本基金开立的基金托管专户, 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或基金停止募集时, 未能达到基金合同生效的条件, 由基金管理人按规定办理退款等事宜, 基金托管人应提供充分协助。

#### (三) 基金托管专户的开立和管理

1. 基金托管人以基金的名义在其营业机构开设基金托管专户, 保管基金的银行存款。本基金的一切货币收支活动, 包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益、收取申购款, 均需通过基金托管专户进行。

资金账户开户名称为: 汇安裕阳三年定期开放混合型证券投资基金

资金账户开户行为: 中国光大银行广州分行营业部

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任何其他银行账户; 亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

3. 基金托管专户的开立和管理应符合有关法律法规以及银行业监督管理机构的其他有关规定。

#### (四) 基金证券账户和结算备付金账户的开立和管理

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

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

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

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

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

#### (五) 银行间债券托管专户的开设和管理

基金合同生效后, 基金管理人负责以基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格, 并代表基金进行交易; 基金托管人负责根据中国人民银行、银行间市场登记结算机构的有关规定, 以本基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司和银行间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, 并代表基金进行银行间市场债券的结算。基金管理人和基金托管人共同代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议, 基金托管人保管协议正本, 基金管理人保存协议副本。

#### (六) 期货账户的开立和管理

基金托管人与基金管理人应依据相关期货交易所或期货公司的相关规定开



立和管理期货账户。

#### (七) 其他账户的开立和管理

在本托管协议签订日之后,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。

法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的,从其规定办理。

#### (八) 基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的有关实物证券、银行存款开户证实书等有价凭证由基金托管人存放于基金托管人的保管库,也可存入中央国债登记结算有限责任公司、中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司、银行间市场清算所股份有限公司或票据营业中心的代保管库,保管凭证由基金托管人持有。实物证券、银行存款开户证实书等有价凭证的购买和转让,由基金管理人和基金托管人共同办理。基金托管人对由基金托管人及基金托管人委托保管的机构以外机构实际有效控制的证券不承担保管责任。

#### (九) 与基金财产有关的重大合同的保管

与基金财产有关的重大合同的签署,由基金管理人负责。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由基金管理人、基金托管人保管。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包括但不限于基金年度审计合同、基金信息披露协议及基金投资业务中产生的重大合同,基金管理人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30个工作日内将正本送达基金托管人处。重大合同的保管期限为基金合同终止后15年,法律法规另有规定或有权机关另有要求的除外。

对于无法取得二份以上正本的,基金管理人应向基金托管人提供与合同原件核对一致的加盖公章的合同传真件或复印件,未经双方协商一致或未在合同约定范围内,合同原件不得转移。

### 五、基金资产净值计算和会计核算

#### (一) 基金资产净值的计算、复核与完成的时间及程序

##### 1. 基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。基金份额净值是指计算日基金份额的基金资产净值除以计算日基金份额总数后的数值。

计算公式为：计算日基金份额净值 = 计算日基金份额的基金资产净值 / 计算日基金份额的总份额。基金份额净值的计算均精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。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和基金份额净值，并按规定公告。

## 2. 复核程序

基金管理人每个工作日对基金资产进行估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人按规定对外公布。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。

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

## (二) 基金资产估值方法和特殊情形的处理

### 1. 估值对象

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

### 2. 估值方法

#### (1) 证券交易所上市的有价证券的估值

1) 交易所上市的有价证券(包括股票、权证等)，以其估值日在证券交易所挂牌的市价(收盘价)估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化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固定收益品种(基金合同另有规定的除外)，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种对应的估值净价估值，具体估值机构由基金管理人与基金托管人另行协商约定；

3) 交易所上市交易的可转换债券,按照每日收盘价作为估值全价;交易所上市实行全价交易的债券(可转债除外),选取第三方估值机构提供的估值全价减去估值全价中所含的债券(税后)应收利息得到的净价进行估值;

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

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

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

(5) 存款的估值方法

持有的银行定期存款或通知存款以本金列示,按协议或合同利率逐日确认利息收入。

(6) 投资证券衍生品的估值方法

股指期货、国债期货合约，一般以估值当日结算价进行，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。

(7) 中小企业私募债券采用估值技术确定公允价值估值。如使用的估值技术难以确定和计量其公允价值的，按成本估值。

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

(9) 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。

(10) 本基金投资存托凭证的估值核算，依照境内上市交易的股票执行。

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

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

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

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

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

3. 特殊情形的处理

(1) 基金管理人或基金托管人按估值方法第(11)项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

(2) 由于不可抗力原因，或由于证券、期货交易所、期货公司或登记结算公司发送的数据错误、遗漏等原因，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,但是未能发现该错误的,由此造成的基金资产估值错误,基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

### (三) 估值错误的处理

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

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”)的直接经济损失按下述“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,并报中国证监会备案;

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

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

②若基金管理人计算的基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告,由此给基金份额持有人造成损失的,应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金,就实际向投资者或基金支付的赔偿金额,基金管理人与基金托管人按照过错程度各自承担相应的责任。

③如基金管理人和基金托管人对基金份额净值的计算结果,虽然多次重新计

算和核对,尚不能达成一致时,为避免不能按时公布基金份额净值的情形,以基金管理人的计算结果对外公布,由此给基金份额持有人和基金造成的损失,由基金管理人负责赔付。

④由于基金管理人提供的信息错误(包括但不限于基金申购或赎回金额等),进而导致基金份额净值计算错误而引起的基金份额持有人和基金财产的损失,由基金管理人负责赔付。

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

#### (四) 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、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时;

3、当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应当暂停基金估值;

4、法律法规、中国证监会和基金合同认定的其他情形。

#### (五) 基金会计制度

按国家有关部门规定的会计制度执行。

#### (六) 基金账册的建立

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

#### (七) 基金财务报表与报告的编制和复核

##### 1. 财务报表的编制

基金财务报表由基金管理人编制,基金托管人复核。

##### 2. 报表复核

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

### 3. 财务报表的编制与复核时间安排

#### (1) 报表的编制

基金管理人应当在每月结束后5个工作日内完成月度报表的编制;在季度结束之日起15个工作日内完成基金季度报告的编制;在上半年结束之日起两个月内完成基金中期报告的编制;在每年结束之日起三个月内完成基金年度报告的编制。基金年度报告中的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计。基金合同生效不足两个月的,基金管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。

#### (2) 报表的复核

基金管理人应及时完成报表编制,将有关报表提供基金托管人复核;基金托管人在复核过程中,发现双方的报表存在不符时,基金管理人和基金托管人应共同查明原因,进行调整,调整以国家有关规定为准。

基金管理人应留足充分的时间,便于基金托管人复核相关报表及报告。

### 六、基金份额持有人名册的保管

基金份额持有人名册至少应包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。基金份额持有人名册由基金登记机构根据基金管理人的指令编制和保管。基金管理人应定期向基金托管人提供基金份额持有人名册,基金托管人得到基金管理人提供的持有人名册后与基金管理人分别进行保管。保管方式可以采用电子或文档的形式,保存期不少于15年,法律法规另有规定或有权机关另有要求的除外。如不能妥善保管,则按相关法规承担责任。

基金托管人因编制基金定期报告等合理原因要求基金管理人提供相关资料时,基金管理人应将有关资料送交基金托管人,不得无故拒绝或延误提供,并保证其真实性、准确性和完整性。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途,并应遵守保密义务,法律法规另有规定或有权机关另有要求的除外。

### 七、争议解决方式

各方当事人同意,因基金合同及本协议而产生的或与基金合同或本协议有关



的一切争议,如经友好协商未能解决的,任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会,按照该会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的,对各方当事人均有约束力,仲裁费用和律师费用由败诉方承担。

争议处理期间,基金合同当事人应恪守各自的职责,继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和本协议规定的义务,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

### (一) 托管协议的变更程序

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

### (二) 基金托管协议终止的情形

1. 基金合同终止;
2. 基金托管人解散、依法被撤销、破产或由其他基金托管人接管基金资产;
3. 基金管理人解散、依法被撤销、破产或由其他基金管理人接管基金管理权;
4. 发生法律法规或基金合同规定的终止事项。

### (三) 基金财产的清算

#### 1. 基金财产清算小组

(1) 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) 在基金财产清算过程中,基金管理人和基金托管人应各自履行职责,继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和本托管协议规定的义务,维护基金份额持有人的合法权益。

(4) 基金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。

## 2. 基金财产清算程序

基金合同终止,应当按法律法规和基金合同的有关规定对基金财产进行清算。基金财产清算程序主要包括:

- (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。

3. 基金财产清算的期限不超过 6 个月。

## 4. 清算费用

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

5. 基金财产按下列顺序清偿:

- (1) 支付清算费用;
- (2) 交纳所欠税款;
- (3) 清偿基金债务;
- (4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款(1)－(3)项规定清偿前,不分配给基金份额持有人。

## 6. 基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告;基金财产清算报告经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。

## 7. 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。