

# 广发悦享一年持有期混合型基金中基金 (FOF) 更新的招募说明书

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：中国光大银行股份有限公司

时间：二〇二二年六月

## 【重要提示】

本基金于2021年12月17日经中国证监会证监许可[2021]3978号文准予募集注册。

本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。

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

投资有风险，投资人认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书。

基金管理人管理的其他基金的业绩不构成对本基金业绩表现的保证。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本基金为混合型基金中基金，本基金的预期风险与预期收益高于债券型基金、债券型基金中基金、货币市场基金和货币型基金中基金，低于股票型基金和股票型基金中基金。投资者在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：本基金的特定风险，因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特定风险等。

本基金可投资于内地与香港股票市场交易互联互通机制试点允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”），但会根据市场环境的变化以及投资策略的需要进行调整，选择将部分基金资产投资于港股通标的股票或选择不将基金资产投资于港股通标的股票，因此本基金存在不对港股进行投资的可能。

本基金资产若投资于港股，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特定风险，包括港股市场股价波动较大的风险（港股市场实行T+0回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比A股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对基金的投资收益造成损失）、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险（在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险）等。

本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于境内市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临投资存托凭证的特殊风险，详见本基金招募说明书。

红利再投资的基金份额的持有期起始日，按原份额的持有期起始日计算。

投资者认/申购本基金份额后需至少持有一年方可赎回，即在一年持有期内基金份额持有人不能提出赎回申请。请投资者合理安排资金进行投资。

本基金《基金合同》生效后，连续五十个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元人民币的情形，基金合同将自动终止。

投资者在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》、《基金合同》、《基金产品资料概要》。

本次更新的招募说明书主要对基金管理人、基金托管人、相关服务机构、基金的募集、基金合同的生效、财务数据、净值表现、其他应披露事项等信息进行修订，更新内容截止日为2022年6月22日，有关财务数据和净值表现截止日为2022年3月31日（本报告中财务数据未经审计）。

## 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.....	7
第四部分	基金托管人.....	14
第五部分	相关服务机构.....	17
第六部分	基金的募集.....	20
第七部分	基金合同的生效.....	21
第八部分	基金份额的申购、赎回与转换 .....	22
第九部分	基金的投资.....	33
第十部分	基金的业绩.....	47
第十一部分	基金的财产.....	49
第十二部分	基金资产的估值.....	50
第十三部分	基金的收益与分配.....	57
第十四部分	基金费用与税收.....	59
第十五部分	基金的会计与审计.....	62
第十六部分	基金的信息披露.....	63
第十七部分	侧袋机制.....	70
第十八部分	风险揭示.....	72
第十九部分	基金合同的变更、终止与基金财产的清算 .....	79
第二十部分	基金合同的内容摘要 .....	81
第二十一部分	基金托管协议的内容摘要.....	97
第二十二部分	对基金份额持有人的服务.....	116

第二十三部分	其他应披露事项 .....	118
第二十四部分	招募说明书存放及查阅方式 .....	119
第二十五部分	备查文件 .....	120

## 第一部分 绪言

《广发悦享一年持有期混合型基金中基金（FOF）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》”）、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）、《公开募集证券投资基金运作指引第2号——基金中基金指引》（以下简称“《指引》”）、《基金中基金估值业务指引（试行）》以及《广发悦享一年持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

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

广发悦享一年持有期混合型基金中基金（FOF）（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，并经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）注册。基金合同是约定《基金合同》当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

## 第二部分 释义

在本招募说明书中，除非文义另有所指，下列词语具有以下含义：

- 1、招募说明书：指《广发悦享一年持有期混合型基金中基金（FOF）招募说明书》及其更新
- 2、基金或本基金：指广发悦享一年持有期混合型基金中基金（FOF）
- 3、基金管理人：指广发基金管理有限公司
- 4、基金托管人：指中国光大银行股份有限公司
- 5、基金中基金（FOF）：指将 80%以上的基金资产投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金份额的基金
- 6、股票基金：指将 80%以上的基金资产投资于股票的基金
- 7、债券基金：指将 80%以上的基金资产投资于债券的基金
- 8、货币市场基金：指仅投资于货币市场工具的基金
- 9、混合基金：指投资于股票、债券、货币市场工具或其他基金份额，并且股票投资、债券投资、基金投资的比例不符合《运作办法》第四章第三十条第（一）项、第（二）项、第（四）项规定的基金
- 10、基金合同或本基金合同：指《广发悦享一年持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充
- 11、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《广发悦享一年持有期混合型基金中基金（FOF）托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
- 12、基金产品资料概要：指《广发悦享一年持有期混合型基金中基金（FOF）基金产品资料概要》及其更新
- 13、基金份额发售公告：指《广发悦享一年持有期混合型基金中基金（FOF）基金份额发售公告》
- 14、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
- 15、《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，经 2012 年 12 月 28 日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自 2013 年 6 月 1 日起实施，并经 2015 年 4 月 24 日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十

四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修正的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订

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

17、《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，并经 2020 年 3 月 20 日中国证监会《关于修改部分证券期货规章的决定》修正的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

18、《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

19、《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

20、《互联互通指引》：指中国证监会 2016 年 10 月 11 日颁布并实施的《证券基金经营机构参与内地与香港股票市场交易互联互通指引》

21、内地与香港股票市场交易互联互通机制：指上海证券交易所、深圳证券交易所分别和香港联合交易所有限公司（以下简称香港联合交易所）建立技术连接，使内地和香港投资者可以通过当地证券公司或经纪商买卖规定范围内的对方交易所上市的股票。内地与香港股票市场互联互通机制包括沪港股票市场交易互联互通机制（以下简称沪港通）和深港股票市场交易互联互通机制（以下简称深港通）

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

23、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

24、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行保险监督管理委员会

25、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

26、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

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



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

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

30、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

31、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

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

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

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

35、登记机构：指办理登记业务的机构。基金的登记机构为广发基金管理有限公司或接受广发基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构

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

37、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、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户

38、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

39、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确认后予以公告的日期

40、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

41、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

42、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

43、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

44、年度对日：指基金合同生效日、基金份额申购确认日在后续日历年中的对应日期，若该日历年实际不存在对应日期或该对应日期为非工作日的，则顺延至下一工作日

45、T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日（不包含 T 日）

46、开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日（若该工作日为非港股通交易日，则本基金可以不开放基金份额申购、赎回或其他业务）

47、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

48、《业务规则》：指《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》，是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金登记方面的业务规则，由基金管理人和投资人共同遵守

49、认购：指在基金募集期内，投资人申请购买基金份额的行为

50、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

51、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

52、基金转换：指基金份额持有人按照本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

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

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

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

56、元：指人民币元

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

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

59、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

60、基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

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

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

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

64、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

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

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

67、不可抗力：指本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

### 第三部分 基金管理人

#### 一、概况

- 1、名称：广发基金管理有限公司
- 2、住所：广东省珠海市横琴新区环岛东路 3018 号 2608 室
- 3、办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31—33 楼
- 4、法定代表人：孙树明
- 5、设立时间：2003 年 8 月 5 日
- 6、电话：020-83936666  
全国统一客服热线：95105828
- 7、联系人：程才良
- 8、注册资本：14,097.8 万元人民币
- 9、股权结构：

股东名称	出资比例
广发证券股份有限公司	54.533%
烽火通信科技股份有限公司	14.187%
深圳市前海香江金融控股集团有限公司	14.187%
广州科技金融创新投资控股有限公司	7.093%
嘉裕元（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙）	3.87%
嘉裕祥（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙）	2.23%
嘉裕禾（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙）	1.55%
嘉裕泓（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙）	1.19%
嘉裕富（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙）	1.16%
总计	100%

#### 二、主要人员情况

- 1、董事会成员

孙树明先生：董事长，博士，高级经济师。曾任中国财政部条法司副处长、处长，河北涿州市人民政府副市长（挂职），中国经济开发信托投资公司总经理办公室主任、总经理助理，中共中央金融工作委员会监事会工作部副部长，中国银河证券有限公司监事会监事，中国证监会会计部副主任、主任，广发证券股份有限公司执行董事、董事长、总经理。

孙晓燕女士：董事，硕士，现任广发证券股份有限公司执行董事、副总经理、财务总监，兼任证通股份有限公司监事。曾任广东广发证券公司投资银行部经理、广发证券有限责任公司财务部经理、财务部副总经理、广发证券股份有限公司投资自营部副总经理，广发基金管理有限公司财务总监、副总经理，广发证券股份有限公司财务部总经理，证通股份有限公司监事会主席。

王凡先生：董事，博士，现任广发基金管理有限公司总经理，兼任广发国际资产管理有限公司董事会主席。曾在财政部、全国社会保障基金理事会、易方达基金管理有限公司工作，曾任广发基金管理有限公司副总经理。

曾军先生：董事，硕士，正高级工程师，现任烽火通信科技股份有限公司总裁，兼任武汉烽火网络有限责任公司董事长。曾任武汉邮电科学研究院研究员，烽火通信科技股份有限公司经理、哈尔滨办事处主任、国内市场总部副总经理、客户服务中心总经理，武汉烽火技术服务有限责任公司总经理，烽火通信科技股份有限公司副总裁。

刘根森先生：董事，学士，现任深圳市前海香江金融控股集团有限公司董事，兼任香江集团有限公司副总裁，深圳香江控股股份有限公司董事，深圳市大本创业投资有限公司董事。曾任德意志银行香港分行分析员，深圳市前海香江金融控股集团有限公司董事长，深圳市龙岗中银富登村镇银行董事。

匡丽军女士：董事，硕士，现任广州科技金融创新投资控股有限公司董事、总经理，兼任广州南沙资讯科技园有限公司副董事长，广东植物龙生物技术股份有限公司副董事长，广州云客数字技术有限公司董事，广东微量元素生物科技有限公司董事，蓝鸽集团有限公司董事、广州万孚生物技术股份有限公司监事、广州瑞立科密汽车电子股份有限公司监事。曾任广州科技开发总公司总经理办公室科员，广州科技房地产开发公司人事部（办公室）部长，广州市科达实业发展公司办公室主任、副总经理、总经理，广州科技风险投资有限公司办公室主任、董事会秘书、副总经理。

罗海平先生：独立董事，博士，教授、高级经济师，现任中华联合保险集团股份有限公司常务副总经理、首席风险官，兼任中国人民大学兼职教授。曾任中国人民保险公司荆襄支公司经理，长江保险经纪公司总经理，中国人民保险公司湖北省分公司国际保险部党组书记、总经

理，中国人民保险公司汉口分公司党委书记、总经理，太平保险有限公司市场部总经理，中国太平保险有限公司湖北分公司党委书记、总经理，中国太平保险有限公司助理总经理、副总经理兼董事会秘书，阳光财产保险股份有限公司总裁、阳光保险集团执行委员会委员，中华联合财产保险股份有限公司总经理、董事长、党委书记。

董茂云先生：独立董事，博士，教授，现任宁波大学法学院教授，兼任复旦大学兼职教授，浙江合创律师事务所兼职律师，无锡鑫宏业线缆科技股份有限公司独立董事，江苏恒顺醋业股份有限公司董事（外部董事）。曾任复旦大学法学院副教授、法律系副主任、法学院副院长，法学院教授。

姚海鑫先生：独立董事，博士，教授，现任辽宁大学新华国际商学院教授、辽宁大学学术委员会委员，兼任中兴-沈阳商业大厦（集团）股份有限公司独立董事、东软医疗股份有限公司独立董事。曾任辽宁大学工商管理学院副院长、工商管理硕士（MBA）教育中心副主任、辽宁大学发展规划处处长、财务处处长等。

## 2、监事会成员

符兵先生：监事会主席，硕士，中级经济师。曾任广东物资集团公司计划处副科长，广东发展银行广州分行世贸支行行长、总行资金部处长，广发基金管理有限公司市场拓展部副总经理、广州分公司总经理、市场拓展部总经理、营销服务部总经理、营销总监、市场总监。

吴晓辉先生：职工监事，硕士，工程师，现任广发基金管理有限公司信息技术部总经理。曾任广发证券股份有限公司信息技术部副经理、经理，广发基金管理有限公司运营保障部副总经理。

孔伟英女士：职工监事，学士，经济师。现任广发基金管理有限公司人力资源部总经理。曾任职于广发证券股份有限公司。

张成柱先生：职工监事，学士，现任广发基金管理有限公司中央交易部交易员。曾任广州新太科技股份有限公司工程师，广发证券股份有限公司工程师，广发基金管理有限公司信息技术部工程师。

刘敏女士：职工监事，硕士，现任广发基金管理有限公司营销管理部副总经理。曾任广发基金管理有限公司市场拓展部总经理助理，营销服务部总经理助理，产品营销管理部总经理助理。

### 3、总经理及其他高级管理人员

王凡先生：总经理，博士，兼任广发国际资产管理有限公司董事会主席。曾在财政部、全国社会保障基金理事会、易方达基金管理有限公司工作，曾任广发基金管理有限公司副总经理。

朱平先生：副总经理，硕士，经济师，兼任广发基金管理有限公司量化投资部总经理。曾任上海荣臣集团市场部经理，广发证券有限责任公司投资银行部华南业务部副总经理，基金科汇基金经理，易方达基金管理有限公司投资部研究负责人，广发基金管理有限公司总经理助理。

魏恒江先生：副总经理，硕士，高级工程师。曾在水利部、广发证券股份有限公司工作，历任广发基金管理有限公司上海分公司总经理、综合管理部总经理、总经理助理。

张敬晗女士：副总经理，硕士，兼任广发国际资产管理有限公司董事。曾任中国农业科学院助理研究员，中国证监会培训中心、监察局科员，基金监管部副处长及处长，私募基金监管部处长。

张芊女士：副总经理，硕士，兼任广发基金管理有限公司固定收益投资总监、固定收益管理总部总经理、基金经理。曾在施耐德电气公司、中国银河证券、中国人保资产管理公司、工银瑞信基金管理有限公司和长盛基金管理有限公司工作，历任广发基金管理有限公司固定收益部总经理。

程才良先生：督察长，博士，副教授。曾在辽河石油勘探局研究院、重庆商学院、广东民族学院、广东证监局、厦门证监局、珠海金融投资控股集团有限公司工作。

傅友兴先生：副总经理，硕士，兼任广发基金管理有限公司联席投资总监、价值投资部总经理、基金经理。曾在原天同基金管理有限公司工作，历任广发基金管理有限公司研究员、机构理财部副总经理、规划发展部总经理、研究发展部总经理、权益投资一部副总经理。

刘格菘先生：副总经理，博士，兼任广发基金管理有限公司联席投资总监、成长投资部总经理、基金经理。曾在中国人民银行、中邮创业基金管理有限公司、融通基金管理有限公司工作，历任广发基金管理有限公司权益投资一部副总经理、北京权益投资部总经理。

窦刚先生：首席信息官，硕士，工程师。曾在广发证券股份有限公司工作，历任广发基金管理有限公司中央交易部总经理、运营总监、公司总经理助理。

### 4、基金经理

杨喆女士，经济学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任国泰君安证券股份有限公司研究所分析师；先后任交银施罗德基金管理有限公司量化投资部投资经理、多元资产管理

部副总监、基金经理。现任广发基金管理有限公司资产配置部联席总经理、广发优选配置两年封闭运作混合型基金中基金（FOF-LOF）基金经理（自 2021 年 11 月 2 日起任职）、广发核心优选六个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金经理（自 2021 年 11 月 19 日起任职）、广发悦享一年持有期混合型基金中基金（FOF）基金经理（自 2022 年 1 月 25 日起任职）、广发安裕稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）基金经理（自 2022 年 3 月 15 日起任职）、广发积极优势一年封闭运作混合型基金中基金（FOF-LOF）基金经理（自 2022 年 6 月 9 日起任职）。

5、本基金投资采取集体决策制度，投资决策委员会成员的姓名及职务如下：

基金管理人权益公募投资决策委员会由副总经理傅友兴先生、副总经理刘格菘先生、总经理助理陈少平女士和策略投资部总经理李巍先生等成员组成，傅友兴先生、刘格菘先生担任权益公募投资决策委员会联席主席。

基金管理人固定收益投资决策委员会由副总经理张芊女士、固定收益投资总监温秀娟女士、混合资产投资部总经理曾刚先生、债券投资部总经理姚秋先生、债券投资部副总经理代宇女士、混合资产投资部副总经理张雪女士、宏观策略部总经理武幼辉先生、金融工程与风险管理部总经理高詹清先生等成员组成，张芊女士担任固定收益投资决策委员会主席。

基金管理人境外投资决策委员会由副总经理傅友兴先生、副总经理刘格菘先生、总经理助理陈少平女士、策略投资部总经理李巍先生和国际业务部总经理李耀柱先生成员组成，傅友兴先生、刘格菘先生担任境外投资决策委员会联席主席。

基金管理人 FOF 投资决策委员会由总经理助理 JINYA 先生、总经理助理陈少平女士、债券投资部总经理姚秋先生、宏观策略部总经理武幼辉先生、资产配置部联席总经理吴成强先生、资产配置部联席总经理杨喆女士等成员组成，JINYA 先生、杨喆女士担任 FOF 投资决策委员会联席主席。

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，办理或者委托经国务院证券监督管理机构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、编制季度报告、中期报告和年度报告；
- 7、计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回价格；
- 8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；
- 9、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、国务院证券监督管理机构规定的其他职责。

#### **四、 基金管理人承诺**

##### **1、基金管理人承诺：**

(1) 严格遵守《基金法》及其他相关法律法规的规定，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反《基金法》及其他法律法规行为的发生；

(2) 根据基金合同的规定，按照招募说明书列明的投资目标、策略及限制进行基金资产的投资。

##### **2、基金管理人严格按照法律、法规、规章的规定，基金资产不得用于下列投资或者活动：**

- (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) 不公平地对待其管理的不同基金财产；
- (3) 利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；
- (4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- (5) 法律法规以及中国证监会规定禁止的其他行为。

##### **3、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、代理人、代表人、受雇人或任何其他第三人谋取不当利益；

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

(4) 不协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

## 五、 基金管理人的内部控制制度

基金管理人的内部风险控制制度包括内部控制大纲、基本管理制度、部门业务规章等。内部控制大纲是对公司章程规定的内控原则的细化和展开，对各项基本管理制度的总揽和指导。内部控制大纲明确了内部控制目标和原则、内部控制组织体系、内部控制制度体系、内部控制环境、内部控制措施等。基本管理制度包括风险控制制度、基金投资管理制度、基金绩效评估考核制度、集中交易制度、基金会计制度、信息披露制度、信息系统管理制度、员工保密制度、危机处理制度、监察稽核制度等。部门业务规章是在基本管理制度的基础上，对各部门的主要职责、岗位设置、工作要求、业务流程等的具体说明。

根据基金管理业务的特点，公司设立顺序递进、权责统一、严密有效的四道内控防线：

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

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

3、建立以合规风控部门对各岗位、各部门、各机构、各项业务全面实施监督反馈的第三道监控防线。合规风控部门属于内核部门，直接接受总经理的领导，独立于其他部门和业务活动，对内部控制制度的执行情况实行严格的检查和监督。

4、建立以合规审核委员会及督察长为核心，对公司所有经营管理行为进行监督的第四道监控防线。

## 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

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。

资产托管部总经理李守靖先生，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 2022 年 3 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 265 只，托管基金资产规模 5809.02 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、 基金份额销售机构

#### 1、 直销机构

##### (1) 电子交易平台

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

客服电话: 95105828 或 020-83936999

客服传真: 020-34281105

投资者可以通过本公司网站或移动客户端, 办理本基金的开户、申购等业务, 具体交易细则请参阅本公司网站公告。

##### (2) 广发基金管理有限公司直销中心业务联系方式 (仅限机构客户)

直销中心电话: 020-89899073

直销中心传真: 020-89899069/89899070/89899126

直销中心邮箱: [gfzxzx@gffunds.com.cn](mailto:gfzxzx@gffunds.com.cn)

##### (3) 广州分公司

地址: 广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 10 楼

电话: 020-83936999

传真: 020-89899131

##### (4) 北京分公司

地址: 北京市西城区金融大街 9 号楼 11 层 1101 单元

(电梯楼层 12 层 1201 单元)

电话: 010-68083113

传真: 010-68083078

##### (5) 上海分公司

地址: 中国 (上海) 自由贸易试验区陆家嘴东路 166 号 905-10 室

电话: 021-68885310

传真: 021-68885200

(6) 投资人也可通过本公司客户服务电话 (95105828 或 020-83936999) 进行本基金销售相关事宜的查询和投诉等。

## 2、 其他销售机构

基金管理人可根据有关法律法规的要求，增减或变更基金销售机构，并在基金管理人网站公示基金销售机构名录。投资者在各销售机构办理本基金业务请遵循各销售机构业务规则与操作流程。

## 二、 注册登记人

名称：广发基金管理有限公司

住所：广东省珠海市横琴新区环岛东路 3018 号 2608 室

法定代表人：孙树明

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31—33 楼

电话：020-89188970

传真：020-89899175

联系人：李尔华

## 三、 出具法律意见书的律师事务所

名称：广东广信君达律师事务所

住所：广东省广州市天河区珠江新城珠江东路 6 号广州周大福金融中心（广州东塔）29 层、10 层

负责人：王晓华

电话：020-37181333

传真：020-37181388

经办律师：杨琳、刘智

联系人：王晓华

## 四、 审计基金资产的会计师事务所

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

办公地址：北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室

法人代表：毛鞍宁

联系人：赵雅

电话：020—28812888

传真：020—28812618

经办注册会计师：赵雅、马婧



## 第六部分 基金的募集

基金管理人按照《基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、基金合同及其他有关规定募集本基金，并于 2021 年 12 月 17 日经中国证监会证监许可[2021]3978 号文准予募集注册。

本基金为契约型开放式基金，基金存续期为不定期。

本基金自 2022 年 1 月 6 日至 2022 年 1 月 21 日进行发售。本基金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。

本基金的面值为每份基金份额人民币 1.00 元。

## 第七部分 基金合同的生效

### 一、 基金合同生效的说明

本基金基金合同已于 2022 年 1 月 25 日生效，自该日起，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金数额

《基金合同》生效后，连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元人民币情形的，基金管理人应在定期报告中予以披露；连续五十个工作日出现前述情形的，基金管理人应当终止基金合同，并按照基金合同的约定程序进行清算，不需要召开基金份额持有人大会进行表决。

法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

## 第八部分 基金份额的申购、赎回与转换

### 一、 申购与赎回的场所

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

- 1、本公司直销机构；
- 2、代销机构：经本公司委托，具有销售本基金资格的商业银行或其他机构的营业网点。

### 二、 申购与赎回的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，本基金的开放日为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日，若该工作日为非港股通交易日，则本基金可以不开放申购与赎回。基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。开放日的具体办理时间在招募说明书或相关公告中载明。

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

#### 2、申购、赎回开始日及业务办理时间

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

基金管理人自基金合同生效之日对应的次年的年度对日（含该日，如该日为非工作日，则顺延至下一工作日）开始办理赎回，具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。

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

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

### 3、一年持有期

本基金每个开放日开放申购，但投资人每笔认购/申购的基金份额需至少持有满一年，在一年持有期内不能提出赎回申请。

对于每份基金份额，一年持有期指基金合同生效日（对认购份额而言，下同）或基金份额申购确认日（对申购份额而言，下同）起至对应的次年的年度对日（不含）的持有期间，如不存在该年度对日或该年度对日为非工作日的，则延后至下一工作日。

## 三、 申购与赎回的原则

- 1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日的基金份额净值为基准进行计算；
- 2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；
- 3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；
- 4、赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人认购、申购的先后次序进行顺序赎回；
- 5、办理申购、赎回业务时，应当遵循基金份额持有人利益优先原则，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待。

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

## 四、 申购与赎回的数额限制

1、通过代销机构或基金管理人网上交易系统每个基金账户首次最低申购金额为1元(含申购费)人民币；投资人追加申购时最低申购限额及投资金额级差详见各销售机构网点公告。

2、基金份额持有人在各代销机构的最低赎回、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，注册登记机构有权将全部剩余份额自动赎回。各基金代理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。

3、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。具体见基金管理人相关公告。

4、基金管理人可以根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整上述规定的数量或比

例限制。基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

## 五、 申购与赎回的程序

### 1、 申购和赎回的申请方式

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

### 2、 申购和赎回的款项支付

投资人申购基金份额时，必须全额交付申购款项，投资人交付申购款项，申购申请成立；本基金登记机构确认基金份额时，申购生效。

基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；本基金登记机构确认赎回时，赎回生效。投资人赎回申请生效后，基金管理人将在 T+7 日(包括该日)内支付赎回款项。在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照本基金合同有关条款处理。

### 3、 申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T 日)，在正常情况下，本基金登记机构在 T+2 日内对该交易的有效性进行确认。T 日提交的有效申请，投资人可在 T+3 日后(包括该日)到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定生效，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购、赎回的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资者应及时查询。因投资者怠于履行该项查询等各项义务，致使其相关权益受损的，基金管理人、基金托管人、基金销售机构不承担由此造成的损失或不利后果。若申购不生效，则申购款项退还给投资人。

## 六、 申购费率、赎回费率

### 1. 申购费率

(1)本基金的申购费率随申购金额的增加而递减。投资者在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。

本基金对通过本公司直销中心申购基金份额的特定投资者与除此之外的其他普通投资者实施差别的申购费率。

特定投资者指全国社会保障基金、依法设立的基本养老保险基金、依法制定的企业年金

计划筹集的资金及其投资运营收益形成的企业补充养老保险基金（包括企业年金单一计划以及集合计划），以及可以投资基金的其他社会保险基金。如将来出现可以投资基金的住房公积金、享受税收优惠的个人养老账户、经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，基金管理人可将其纳入特定投资者范围。

具体费率如下：

申购金额（M）	其他普通投资者申购费率
M < 100 万元	0.80%
100 万元 ≤ M < 200 万元	0.40%
200 万元 ≤ M < 500 万元	0.20%
M ≥ 500 万元	每笔 1000 元

申购金额（M）	特定投资者申购费率
M < 100 万元	0.08%
100 万元 ≤ M < 200 万元	0.04%
200 万元 ≤ M < 500 万元	0.02%
M ≥ 500 万元	每笔 100 元

(2) 本基金的申购费用由基金申购人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。基金销售机构可以对申购费用实行一定的优惠，具体以实际收取为准。

## 2. 赎回费率

投资人需至少持有本基金基金份额满一年，在一年持有期内不能提出赎回申请，持有满一年后赎回不收取赎回费用。

3. 基金管理人可以在履行相关手续后，在基金合同约定的范围内调整申购、赎回费率或调整收费方式，基金管理人依照有关规定于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》有关规定在规定媒介上公告。

4. 对特定交易方式（如网上交易等），在不违背法律法规规定的情况下，基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

5. 对基金份额持有人无实质性不利影响的前提下，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，针对基金投资者定期和不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，基金管理人可以按中国证监会要求履行必要手续后，对基金投资者适当调低基金申购费率、赎回费率和转换费率。

6. 基金管理人运用本基金财产申购自身管理的其他基金（ETF 除外），应当通过直销渠道申购且不收取申购费、赎回费（按照相关法规、招募说明书约定应当收取并计入基金资产的赎回费用除外）、销售服务费等销售费用。

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

## 七、 申购份额与赎回金额的计算方式

### 1、 本基金申购份额的计算：

若投资者选择申购本基金，则申购份额的计算公式为：

净申购金额 = 申购金额 / (1 + 申购费率)

或，净申购金额 = 申购金额 - 固定申购费金额

申购费用 = 申购金额 - 净申购金额

或，申购费用 = 固定申购费金额

申购份额 = 净申购金额 / 申购当日基金份额净值

例：某普通投资者投资 100,000 元申购本基金，对应费率为 0.80%，假设申购当日基金份额净值为 1.0160 元，则其可得到的申购份额为：

净申购金额 =  $100,000 / (1 + 0.80\%) = 99,206.35$  元

申购费用 =  $100,000 - 99,206.35 = 793.65$  元

申购份额 =  $99,206.35 / 1.0160 = 97,644.05$  份

即：普通投资者投资 100,000 元申购本基金，对应费率为 0.80%，假设申购当日基金份额净值为 1.0160 元，则可得到 97,644.05 份基金份额。

### 2、 本基金赎回金额的计算：

采用“份额赎回”方式，赎回价格以 T 日的基金份额净值为基准进行计算，计算公式：

赎回总金额 = 赎回份额 × T 日基金份额净值

例：某投资者赎回 10 万份基金份额，份额持有期限为 400 天，假设赎回当日基金份额净值是 1.2130 元，则其可得到的赎回金额为：

赎回总金额=100,000×1.2130=121,300.00 元

即：投资者赎回本基金 10 万份基金份额，份额持有期限为 400 天，假设赎回当日基金份额净值是 1.2130 元，则其可得到的赎回金额为 121,300.00 元。

### 3、本基金基金份额净值的计算：

本基金基金份额净值的计算公式为：

$T$  日基金份额净值= $T$  日基金份额的基金资产净值/ $T$  日基金份额的余额数量。

本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  $T+1$  日内计算，并在  $T+2$  日内披露。遇特殊情况，经履行适当程序，可以适当延迟计算或披露。

### 4、申购份额、余额的处理方式：

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，上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

### 5、赎回金额的处理方式：

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，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

## 八、 申购与赎回的注册登记

1、投资者  $T$  日申购基金成功后，正常情况下，基金注册登记机构在  $T+2$  日为投资者增加权益并办理注册登记手续。

2、投资者  $T$  日赎回基金成功后，正常情况下，基金注册登记机构在  $T+2$  日为投资者扣除权益并办理相应的注册登记手续。

## 九、 拒绝或暂停申购的情形及处理

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

1、因不可抗力导致基金无法正常运作。

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



申请。

3、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

4、接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。

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

6、基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术故障等异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。

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

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

9、占基金资产相当比例的被投资基金暂停申购，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。

10、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第 1、2、3、5、6、7、9、10 项暂停申购情形之一且基金管理人决定拒绝或暂停接受投资者的申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在规定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

## 十、 暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形及处理

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。

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

3、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

5、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。

6、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值

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

7、占基金资产相当比例的被投资基金暂停赎回，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请。

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

## 十一、巨额赎回的情形及处理方式

### 1、巨额赎回的认定

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

### 2、巨额赎回的处理方式

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

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

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

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

(3)若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额 20%的，基金管理人可以对该单个基金份额持有人超过该比例以上的赎回申请实施延期办理（基金份额持有人可在提交赎回申请时选择将当日未获办理部分予以撤销）。对该单个基金份额持有人未超过上一开放日基金总份额 20%的赎回申请与其他账户赎回申请，应当按照其申请赎回份额占当日申请赎回总份额的比例，确定该单个账户当日办理的赎回份额；投资者未能赎回部分，除投资者在提交赎回申请时选择将当日未获办理部分予以撤销外，延迟至下一个开放日办理，赎回价格为下一个开放日的价格。依照上述规定转入下一个开放日的赎回不享有赎回优先权，并以此类推，直到全部赎回为止。

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

### 3、巨额赎回的公告

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

## 十二、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

1、发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人应当在规定期限内在规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规定媒介上刊登重新开放申购或赎回的公告；也可以根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间，届时不再另行发布重新开放的公告。

## 十三、基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及本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本基金合同的规定制定并公告，并提前告知基金托管人与相关机构。

#### **十四、基金份额的转让**

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

#### **十五、基金的非交易过户**

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

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

#### **十六、基金的转托管**

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

#### **十七、定期定额投资计划**

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

#### **十八、基金的冻结、解冻与质押**

基金登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻，以及登记机构认

可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。基金份额被冻结的，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。法律法规或监管机构另有规定的除外。

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

#### **十九、实施侧袋机制期间本基金的申购与赎回**

本基金实施侧袋机制的，本基金的申购和赎回安排详见本招募说明书“侧袋机制”部分的规定或相关公告。

## 第九部分 基金的投资

### 一、 投资目标

本基金在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过定量与定性相结合的方法精选不同资产类别中的优质基金，结合基金的风险收益特征和市场环境合理配置权重，追求基金资产的长期稳健增值。

### 二、 投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括证券投资基金（包括香港互认基金及其他经中国证监会依法核准或注册的基金，不包括 QDII 基金）、国内依法发行上市的股票（包括创业板及其他依法发行上市的股票及存托凭证）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、企业债券、公司债券、可转换债券（含可分离交易可转换债券的纯债部分）、可交换债券、公开发行的次级债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券等以及经法律法规或中国证监会允许投资的其他债券类金融工具）、资产支持证券、债券回购、银行存款（含协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

本基金为混合型基金中基金，基金的投资组合比例为：本基金投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金份额的资产不低于基金资产的 80%；投资于股票型基金（包括股票指数基金）的比例占基金资产的 0%-30%；本基金持有的现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；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。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或对投资比例要求有变更的，基金管理人在履行适当程序后，可以做出相应调整。

### 三、 投资策略

#### （一）大类资产配置策略

本基金的资产配置主要是在宏观经济分析基础上，结合政策面、市场资金面，积极把握市场发展趋势，根据经济周期不同阶段各类资产市场表现变化情况，进行各类资产的比例确

定，并根据市场环境的变化进行适度调整，以追求良好的风险收益比。

本基金的长期资产配置，基于对国内外宏观经济周期、货币周期、市场状态变化情况的深入研究，采用定量方法和定性研究相结合的方式，确定并动态调整权益类资产、固定收益类资产及其他资产的配置比例。

## （二）基金投资策略

本基金管理人依托专业的研究力量，建立基金综合评价体系，力求从不同资产类别、不同风险收益特征以及不同风格的基金中精选出优质的基金品种，确定本基金的组合配置情况。

基金综合评价指标主要包含：基金业绩分析、基金绩效归因、定性调研分析等。

1、通过对基金进行业绩分析，比较各类型基金在不同市场行情环境下的业绩表现情况，评估其收益风险特质。具体如下：

收益分析：如绝对收益率、超额收益率等；

风险分析：如年化波动率、最大回撤、相对最大回撤等；

风险调整后收益分析：如夏普比率、信息比率、索提诺比率等。

2、通过对基金进行绩效归因，寻求基金的收益来源解释，分析其业绩稳定性和持续性，结合对未来市场的研判评估基金的投资价值。具体如下：

配置分析：如资产配置情况、行业配置情况等；

持仓分析：如重仓持股情况、重仓持债情况等；

交易分析：如持仓稳定性、换手情况等。

3、在定量分析的基础上，本基金将通过对基金进行定性调研分析，对基金管理人和基金经理有一个更加深刻全面的认知。具体包括：基金管理人基本情况、投研团队稳定性、投资方法及投资理念等。

结合上述定量与定性分析，筛选出各类型基金中优质的基金品种进行配置。本基金将持续跟踪投资组合业绩，并基于基金综合评价指标，对投资组合进行动态调整和优化，力争实现基金资产的长期稳健资产增值。

## （三）股票投（含存托凭证）资策略

本基金的股票投资通过定量与定性相结合的分析方法，筛选出估值合理、基本面良好且具有良好成长性的股票进行投资。

定量分析通过财务和运营数据进行企业价值评估。本基金主要从盈利能力、成长能力以及估值水平等方面进行考量。定性分析从持续成长性、市场前景以及公司治理结构等方面对

上市公司进行进一步的精选。

本基金投资存托凭证的策略依照上述境内上市交易的股票投资策略执行。

#### （四）债券投资策略

基于基金流动性管理和有效利用基金资产的需要，本基金将投资于流动性较好的国债、央行票据等债券，保证基金资产流动性，提高基金资产的投资收益。本基金将根据宏观经济形势、货币政策、证券市场变化等分析判断未来利率变化，结合债券定价技术，进行个券选择。

#### （五）资产支持证券投资策略

本基金将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析，并辅助采用数量化定价模型，评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。

若未来法律法规或监管部门有新规定的，本基金将按最新规定执行。

## 四、 投资限制

### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金份额的资产不低于基金资产的 80%；

（2）本基金投资于股票型基金（包括股票指数基金）的比例占基金资产的 0%-30%；

（3）本基金每个交易日日终应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

（4）本基金持有一家公司发行的证券（同一家公司在内地和香港同时上市的 A+H 股合并计算），其市值不超过基金资产净值的 10%；

（5）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券（同一家公司在内地和香港同时上市的 A+H 股合并计算），不超过该证券的 10%；

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

（7）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%；



(8) 本基金持有单只基金的市值，不得超过基金资产净值的 20%，且不得持有其他基金中基金；

(9) 除 ETF 联接基金外，本基金管理人管理的全部基金持有单只基金不得超过被投资基金净资产的 20%，被投资基金净资产规模以最近定期报告披露的规模为准；

(10) 本基金投资商品基金的比例不得超过基金资产的 10%；

(11) 本基金投资货币市场基金的比例不得超过基金资产的 15%；

(12) 本基金投资其他基金，被投资基金的运作期限应当不少于 1 年、最近定期报告披露的季末基金净资产应不低于 1 亿元；

(13) 在本基金开放日，本基金投资于流通受限基金的市值不得超过基金资产净值的 10%；流通受限基金是指封闭运作基金、定期开放基金等由基金合同规定明确在一定期限锁定期内不可赎回的基金，但不包括 ETF、LOF 等可上市交易的基金；

(14) 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%；

(15) 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%；

(16) 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%；

(17) 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%；

(18) 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；

(19) 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；

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

(21) 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；

(22) 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；

(23) 基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

(24) 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；

(25) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

因证券市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述第(8)、(9)项时，基金管理人应当在 20 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。除上述第(3)、(8)、(9)、(18)、(21)、(22)条外，因证券市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

## 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、行政法规和国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

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

3、法律法规或监管部门取消上述组合限制、禁止行为规定或从事关联交易的条件和要求，本基金可不受相关限制。法律法规或监管部门对上述组合限制、禁止行为规定或从事关联交

易的条件和要求进行变更的，本基金可以变更后的规定为准；经与基金托管人协商一致，基金管理人可依据法律法规或监管部门规定直接对基金合同进行变更，该变更无须召开基金份额持有人大会审议。

## 五、 业绩比较基准

本基金的业绩比较基准：中债综合(全价)指数收益率×85%+沪深 300 指数收益率×15%。

采用该比较基准主要基于如下考虑：

选择沪深 300 指数作为权益类资产的业绩比较基准和中债综合(全价)指数作为固定收益类资产的业绩比较基准，主要因为沪深 300 指数具有很强的代表性，能全面的反映国内权益市场的表现情况，而中债综合(全价)指数能够较好反映国内债券市场的整体表现，目前债券型基金多采用该指数作为业绩比较基准，具有较好的普适性和公认度。

如果指数编制单位停止计算编制这些指数或更改指数名称，本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

如果今后法律法规发生变化，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，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时，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，经与基金托管人协商一致，在履行适当程序后变更业绩比较基准并及时公告。

## 六、 风险收益特征

本基金为混合型基金中基金，本基金的预期风险与预期收益高于债券型基金、债券型基金中基金、货币市场基金和货币型基金中基金，低于股票型基金和股票型基金中基金。

本基金可投资于港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险（港股市场实行T+0 回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对基金的投资收益造成损失）、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险（在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险）等。

## 七、 基金管理人代表基金行使股东或债权人权利的处理原则及方法

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

2、不谋求对上市公司的控股；

3、有利于基金财产的安全与增值；

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

## 八、 侧袋机制的实施和投资运作安排

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

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

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

## 九、 投资组合报告

广发基金管理有限公司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，并对本报告内容的真实性、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6月24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。

本投资组合报告所载数据截至2022年3月31日，本报告中所列财务数据未经审计。

### 1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	64,175,687.64	4.35
	其中：普通股	64,175,687.64	4.35
	存托凭证	-	-

2	基金投资	1,310,668,221.84	88.81
3	固定收益投资	70,236,641.11	4.76
	其中：债券	70,236,641.11	4.76
	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	30,687,395.76	2.08
8	其他资产	114,447.44	0.01
9	合计	1,475,882,393.79	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	4,114,964.00	0.28
C	制造业	31,413,765.64	2.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,933,360.00	0.67
E	建筑业	341,048.00	0.02
F	批发和零售业	899,486.00	0.06
G	交通运输、仓储和邮政业	1,553,994.00	0.11
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,994,865.00	0.34
J	金融业	4,541,000.00	0.31
K	房地产业	6,137,778.00	0.42
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	245,427.00	0.02
S	综合	-	-
	合计	64,175,687.64	4.35

## 2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

## 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	占基金资产 净值比例 (%)
1	600900	长江电力	365,200	8,034,400.00	0.54
2	600519	贵州茅台	4,600	7,907,400.00	0.54
3	600887	伊利股份	164,400	6,064,716.00	0.41
4	600048	保利发展	230,700	4,083,390.00	0.28
5	600585	海螺水泥	77,000	3,040,730.00	0.21
6	600406	国电南瑞	89,000	2,802,610.00	0.19
7	601398	工商银行	500,000	2,385,000.00	0.16
8	600703	三安光电	95,100	2,261,478.00	0.15

9	601288	农业银行	700,000	2,156,000.00	0.15
10	600028	中国石化	485,600	2,097,792.00	0.14

#### 4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	70,235,641.10	4.76
	其中：政策性金融债	70,235,641.10	4.76
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,000.01	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	70,236,641.11	4.76

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
1	220201	22 国开 01	700,000	70,235,641.10	4.76
2	113057	中银转债	10	1,000.01	0.00

#### 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

- (1) 本基金本报告期末未持有股指期货。
- (2) 本基金本报告期内未进行股指期货交易。

## 10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

- (1) 本基金本报告期末未持有国债期货。
- (2) 本基金本报告期内未进行国债期货交易。

## 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中，国家开发银行在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会或其派出机构的处罚。

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。除上述主体外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期没有出现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 本报告期内，基金投资的前十名股票未出现超出基金合同规定的备选股票库的情形。

### 11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	13,323.34
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	101,124.10



6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	114,447.44

#### 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不存在流通受限情况。

## 12 基金中基金

### 12.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	006998	广发景兴中短债债券 A	契约型 开放式	47,250,047.25	50,165,375.17	3.40	是
2	006591	广发景明中短债 A	契约型 开放式	48,647,596.81	50,136,213.27	3.40	是
3	005709	华安鼎益债券 A	契约型 开放式	47,334,090.69	50,036,867.27	3.39	否
4	005577	交银丰晟收益债券 A	契约型 开放式	44,435,655.88	50,012,330.69	3.39	否

5	100066	富国纯 债债券 发起 A	契约型 开放式	45,790,823.34	49,921,155.61	3.39	否
6	004705	南方祥 元债券 A	契约型 开放式	45,215,228.79	49,867,875.83	3.38	否
7	003031	安信新 目标混 合 C	契约型 开放式	35,383,209.63	49,847,865.73	3.38	否
8	003280	鹏华丰 恒债券	契约型 开放式	44,906,592.42	49,644,237.92	3.37	否
9	010916	交银臻 选回报 混合	契约型 开放式	46,606,077.55	49,313,890.66	3.34	否
10	002792	景顺长 城顺益 回报混 合 A	契约型 开放式	34,269,235.57	49,121,522.27	3.33	否

## 12.2 当期交易及持有基金产生的费用

项目	本期费用 2022 年 1 月 1 日-2022 年 3 月 31 日	其中：交易及持有基金管 理人以及管理人关联方所 管理基金产生的费用
当期交易基金产生的申购 费（元）	19,540.00	-
当期交易基金产生的赎回 费（元）	81,932.20	-
当期持有基金产生的应支 付销售服务费（元）	95,535.97	-

当期持有基金产生的应支付管理费（元）	1,156,666.15	167,789.19
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	278,381.46	35,956.52

注：当期持有基金产生的应支付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，上表列示金额为按照本基金对被投资基金的持仓根据被投资基金基金合同约定的相应费率计算得出。

根据相关法律法规及本基金合同的约定，基金管理人不得对基金中基金财产中持有的自身管理的基金部分收取基金中基金的管理费，基金托管人不得对基金中基金财产中持有的自身托管的基金部分收取基金中基金的托管费。基金管理人运用本基金财产申购自身管理的其他基金的（ETF 除外），应当通过直销渠道申购且不收取申购费、赎回费（按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取，并计入基金资产的赎回费用除外）、销售服务等销售费用，其中申购费、赎回费在实际申购、赎回时按上述规定执行，销售服务费由本基金管理人从被投资基金收取后返还至本基金基金资产。

### 12.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本报告期内，本基金所投资的子基金未发生包括转换运作方式、与其他基金合并、终止基金合同、召开基金份额持有人大会及大会表决意见等重大影响事件。

## 第十部分 基金的业绩

本基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。

投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。基金业绩数据截至 2022 年 3 月 31 日。

### 1、 本基金本报告期单位基金资产净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

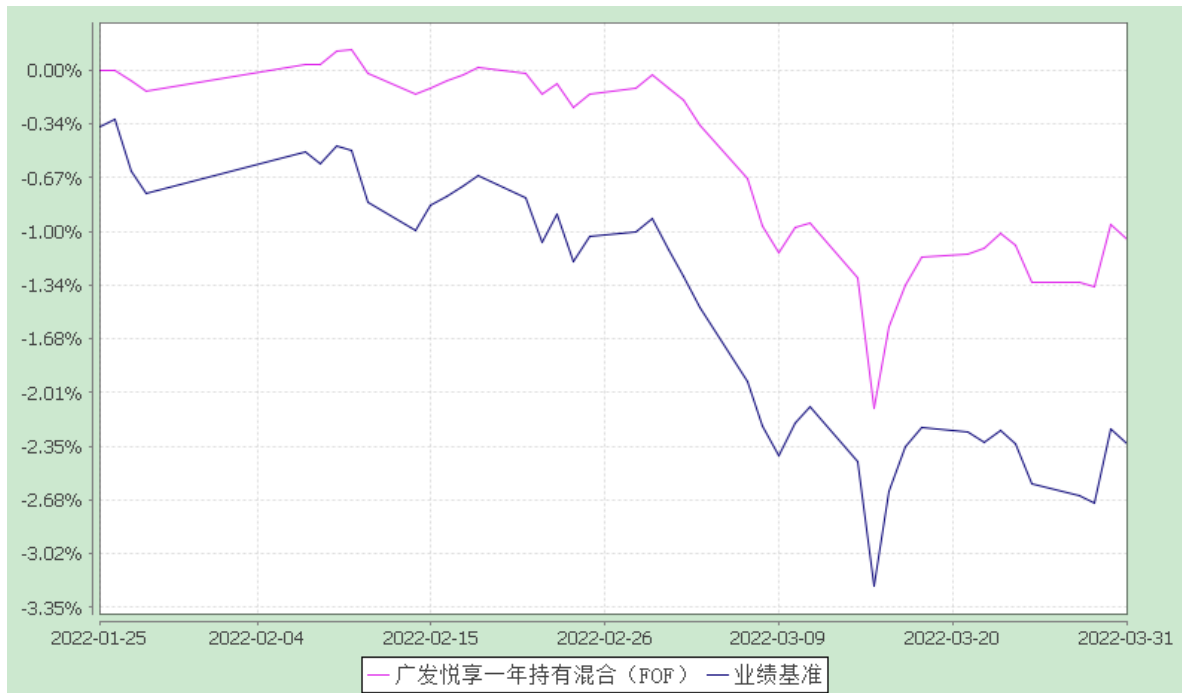
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
自基金合同生效起至今	-1.06%	0.21%	-2.33%	0.25%	1.27%	-0.04%

### 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

广发悦享一年持有期混合型基金中基金（FOF）

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2022 年 1 月 25 日至 2022 年 3 月 31 日)



注：（1）本基金合同生效日期为 2022 年 1 月 25 日，至披露时点未满一年。

（2）本基金建仓期为基金合同生效后 6 个月，至披露时点本基金仍处于建仓期。

## 第十一部分 基金的财产

### 一、基金资产总值

基金资产总值是指购买各类证券投资基金、证券及票据价值、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和。

### 二、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### 三、基金财产的账户

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

### 四、基金财产的保管和处分

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

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

## 第十二部分 基金资产的估值

### 一、 估值日

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

### 二、 估值对象

基金所拥有的证券投资基金、股票、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

### 三、 估值原则

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

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

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

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

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

价值。

#### 四、 估值方法

本基金所持有的投资品种，按如下原则进行估值：

##### 1、基金估值方法

###### (1) 非上市基金估值

1) 本基金投资的境内非货币市场基金，按所投资基金估值日的基金份额净值估值。

2) 本基金投资的境内货币市场基金，按所投资基金前一估值日后至估值日期间（含节假日）的万份收益计提估值日基金收益。

###### (2) 上市基金估值

1) 本基金投资的 ETF 基金、境内上市定期开放式基金、封闭式基金，按所投资基金估值日的收盘价估值。

2) 本基金投资的境内上市开放式基金(LOF)，按所投资基金估值日的基金份额净值估值。

3) 本基金投资的境内上市交易型货币市场基金，如所投资基金披露份额净值，则按所投资基金估值日的份额净值估值；如所投资基金披露万份（百份）收益，则按所投资基金前一估值日后至估值日期间（含节假日）的万份（百份）收益计提估值日基金收益。

(3)如遇所投资基金不公布基金份额净值、进行折算或拆分、估值日无交易等特殊情况，基金管理人根据以下原则进行估值：

1) 以所投资基金的基金份额净值估值的，若所投资基金与本基金估值频率一致但未公布估值日基金份额净值，按其最近公布的基金份额净值为基础估值。

2) 以所投资基金的收盘价估值的，若估值日无交易，且最近交易后市场环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后市场环境发生了重大变化的，可使用最新的基金份额净值为基础或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，确定公允价值。

3) 如果所投资基金前一估值日至估值日期间发生分红除权、折算或拆分，基金管理人应根据基金份额净值或收盘价、单位及份额分红金额、折算拆分比例、持仓份额等因素合理确定公允价值。

##### 2、证券交易所上市的有价证券的估值

(1) 交易所上市的有价证券（包括股票等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收



盘价)估值;估值日无交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化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)对在交易所市场上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种,选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值,具体估值机构由基金管理人与基金托管人另行协商约定;

(3)对在交易所市场上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种,选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价进行估值;

(4)对在交易所市场上市交易的可转换债券,以每日收盘价作为估值全价;

(5)交易所上市不存在活跃市场的有价证券,采用估值技术确定公允价值。交易所市场挂牌转让的资产支持证券,采用估值技术确定公允价值;

(6)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估值日的公允价值;对于活跃市场报价未能代表估值日公允价值的情况下,应对市场报价进行调整以确认估值日的公允价值;对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下,应采用估值技术确定其公允价值。

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

4、全国银行间市场交易的固定收益品种的估值

(1)银行间市场交易不含权的固定收益品种,选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值。对银行间市场上含权的固定收益品种,选取第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价;

(2) 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、同一证券同时在两个或两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。

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

7、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。

8、估值中的汇率选取原则：港股通投资持有外币证券资产估值涉及到的主要货币对人民币汇率，以估值日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价为准。

9、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。

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

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

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

## 五、 估值程序

1、基金份额净值是按照每个估值日闭市后，基金份额的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。基金管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的，从其规定。

每个估值日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定披露。

2、基金管理人应每个估值日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或本基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个估值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。

本基金合同的当事人应按照以下约定处理：

### 1、估值错误类型

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

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

### 2、估值错误处理原则

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

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

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

（4）估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

### 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

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

4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

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

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

(3) 前述内容如法律法规或监管部门机关另有规定的，从其规定。

## 七、 暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

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

4、占本基金资产净值相当比例的被投资基金暂停估值时，本基金可以暂停估值；

5、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

## 八、 基金净值的确认

用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算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，由基金管理人在 T+2 日内对基金净值予以公布。

## 九、 特殊情形的处理

1、基金管理人按估值方法的第 9 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、由于证券交易所及其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、基金托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

## 十、 实施侧袋机制期间的基金资产估值

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

## 第十三部分 基金的收益与分配

### 一、 基金利润的构成

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

### 二、 基金可供分配利润

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

### 三、 收益分配原则

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

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；红利再投资的基金份额的持有期起始日，按原份额的持有期起始日开始计算；

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

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在符合法律法规及基金合同约定，并对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，经与基金托管人协商一致，基金管理人可对基金收益分配原则和支付方式进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

### 四、 收益分配方案

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

### 五、 收益分配方案的确定、公告与实施

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

法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

## **六、 基金收益分配中发生的费用**

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。

## **七、 实施侧袋机制期间的收益分配**

本基金实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配，上述收益分配原则仅适用于主袋账户资产和主袋账户份额持有人。

## 第十四部分 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、律师费和诉讼费；
  - 5、基金份额持有人大会费用；
  - 6、基金的证券交易费用；
  - 7、基金的银行汇划费用；
  - 8、账户开户费用和账户维护费；
  - 9、因投资港股通标的股票而产生的各项合理费用；
  - 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。
- 本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

### 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扣除本基金持有的基金管理人自身管理的其他基金份额所对应资产净值的剩余部分的 0.80% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

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扣除本基金持有的基金管理人自身管理的其他基金份额所对应资产净值的剩余部分，若为负数，则 E 取 0。

基金管理费每日计提，按月支付，经管理人授权后，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扣除本基金持有的基金托管人自身托管的其他基



金份额所对应资产净值的剩余部分的 0.20%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值扣除本基金持有的基金托管人自身托管的其他基金份额所对应资产净值的剩余部分，若为负数，则 E 取 0。

基金托管费每日计提，按月支付，经管理人授权后，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。

基金管理人运用本基金财产申购自身管理的基金的（ETF 除外），应当通过直销渠道申购且不得收取申购费、赎回费（按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取，并计入基金财产的赎回费用除外）、销售服务费等销售费用。

上述“一、基金费用的种类中第 3—9 项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

### 三、 不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

### 四、 实施侧袋机制期间的基金费用

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

### 五、 基金税收

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

## 第十五部分 基金的会计与审计

### 一、 基金的会计政策

- 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；
- 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符合《证券法》规定的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意。
- 3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所按照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

## 第十六部分 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。相关法律对信息披露的方式、登载媒介、报备方式等规定发生变化时，本基金从其最新规定。

### 二、信息披露义务人

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

本基金信息披露义务人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。

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

规定网站包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站。规定网站应当无偿向投资者提供基金信息披露服务。

### 三、本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

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

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

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

## 五、公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

### （一）基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议、基金产品资料概要

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

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

更新的招募说明书应设立专门章节披露投资于其他基金的以下情况并揭示相关风险：一是投资政策、持仓情况、损益情况、净值披露时间等；二是交易及持有基金产生的费用，包括申购费、赎回费、销售服务费、管理费、托管费等，招募说明书中应当列明计算方法并举例说明；三是持有的基金发生重大影响事件，如转换运作方式、与其他基金合并、终止基金合同以及召开基金份额持有人大会等；四是本基金投资于基金管理人以及基金管理人关联方所管理基金的情况。

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

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

基金募集申请经中国证监会注册后，基金管理人应当在基金份额发售的三日前，将基金份额发售公告、基金招募说明书提示性公告和基金合同提示性公告登载在规定报刊上，将基金份额发售公告、基金招募说明书、基金产品资料概要、《基金合同》和基金托管协议登载在

规定网站上，并将基金产品资料概要登载在基金销售机构网站或营业网点；基金托管人应当同时将基金合同、基金托管协议登载在网站上。

## （二）基金份额发售公告

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

## （三）《基金合同》生效公告

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

## （四）基金净值信息

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

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在不晚于每个开放日后的 2 个工作日内，通过其规定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当不晚于半年度和年度最后一日后的 2 个工作日内，在规定网站披露半年度和年度最后一日的基金份额净值和基金份额累计净值。

## （五）基金份额申购、赎回价格

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

## （六）基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告

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

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

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

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

报告。

如报告期内出现单一投资人持有基金份额达到或超过基金总份额 20%的情形，为保障其他投资人的权益，基金管理人至少应当在定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资人的类别、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定风险，中国证监会认定的特殊情况除外。基金管理人应当在基金年度报告和中期报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。

基金定期报告应设立专门章节披露投资于其他基金的相关情况并揭示相关风险：一是投资政策、持仓情况、损益情况、净值披露时间等；二是交易及持有基金产生的费用，包括申购费、赎回费、销售服务费、管理费、托管费等；三是持有的基金发生重大影响事件，如转换运作方式、与其他基金合并、终止基金合同以及召开基金份额持有人大会等；四是本基金投资于管理人以及管理人关联方所管理基金的情况。

本基金在基金年报及中期报告中披露其持有的流通受限证券总额、流通受限证券市值占基金净资产的比例和报告期内所有的流通受限证券明细。

#### （七）临时报告

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应在 2 日内编制临时报告书，并登载在规定的报刊和规定网站上。

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

- 1、基金份额持有人大会的召开及决定的事项；
- 2、基金合同终止、基金清算；
- 3、转换基金运作方式、基金合并；
- 4、更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；
- 5、基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；
- 6、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- 7、基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人的实际控制人变更；
- 8、基金募集期延长或提前结束募集；
- 9、基金管理人的高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；

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

11、涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁；

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

13、基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易事项，中国证监会另有规定的情形除外；

14、基金收益分配事项；

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

16、基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；

17、本基金开始办理申购、赎回；

18、本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；

19、本基金发生巨额赎回并延期支付；

20、本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；

21、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；

22、调整基金份额类别的设置；

23、基金推出新业务或服务；

24、本基金连续三十个工作日、四十个工作日、四十五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 5,000 万元人民币的情形；

25、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、本基金合同规定的其他事项。

#### （八）澄清公告

在基金合同期限内，任何公共媒体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。

#### （九）基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。



#### （十）投资资产支持证券的信息披露

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。

#### （十一）清算报告

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

#### （十二）侧袋机制相关的信息披露

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

#### （十三）中国证监会规定的其他信息。

### 六、信息披露事务管理

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

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

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

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

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

信息的内容应当一致。

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

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

## 七、信息披露文件的存放与查阅

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

## 第十七部分 侧袋机制

为加强对本基金流动性风险的管控，保护投资者的合法权益，根据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》、《公开募集证券投资基金侧袋机制指引（试行）》及其他有关法律法规，本基金引入侧袋机制作为流动性风险管理工具之一。

### 一、 侧袋机制的实施条件和程序

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

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

### 二、 实施侧袋机制期间基金份额的申购与赎回

1、启用侧袋机制当日，本基金登记机构以基金份额持有人的原有账户份额为基础，确认基金份额持有人的相应侧袋账户份额；当日收到的申购申请，按照启用侧袋机制后的主袋账户份额办理；当日收到的赎回申请，仅办理主袋账户份额的赎回申请并支付赎回款项。

2、实施侧袋机制期间，基金管理人不得办理侧袋账户份额的申购、赎回和转换；同时，基金管理人按照基金合同和招募说明书约定的政策办理主袋账户份额的赎回，并根据主袋账户运作情况确定是否暂停申购。本招募说明书“基金份额的申购、赎回与转换”部分的申购、赎回规定适用于主袋账户份额。

3、基金管理人应按照主袋账户的份额净值办理主袋账户份额的申购和赎回。巨额赎回按照单个开放日内主袋账户份额净赎回申请超过前一开放日主袋账户总份额的 10% 认定。

### 三、 实施侧袋机制期间的基金投资

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

基金管理人原则上应当在侧袋机制启动后 20 个交易日内完成对主袋账户投资组合的调

整，因资产流动性受限等中国证监会规定的情形除外。

基金管理人不得在侧袋账户中进行除特定资产处置变现以外的其他投资操作。

#### **四、 侧袋账户中特定资产的处置变现和支付**

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

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

#### **五、 侧袋机制的信息披露**

##### **1、临时公告**

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

##### **2、基金净值信息**

基金管理人应按照招募说明书“基金的信息披露”部分规定的基金净值信息披露方式和频率披露主袋账户份额的基金份额净值和基金份额累计净值。实施侧袋机制期间本基金暂停披露侧袋账户份额净值。

##### **3、定期报告**

侧袋机制实施期间，基金管理人应当在基金定期报告中披露报告期内特定资产处置进展情况，披露报告期末特定资产可变现净值或净值区间的，需同时注明不作为特定资产最终变现价格的承诺。

**六、 本部分关于侧袋机制的相关规定，凡是直接引用法律法规或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人经与基金托管人协商一致并履行适当程序后，在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。**

## 第十八部分 风险揭示

### 一、投资于本基金的主要风险

#### 1、市场风险

证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响，本基金主要投资于各类证券投资基金，因此将通过持有基金间接承担各种市场因素导致基金收益水平变化而产生的风险，主要包括：

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

（2）经济周期风险。随经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化。基金投资于债券，收益水平也会随之变化，从而产生风险。

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

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

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

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

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

（8）信用风险。基金所投资债券的发行人如出现违约、无法支付到期本息，或由于债券发行人信用等级降低导致债券价格下降，将造成基金资产损失。

#### 2、管理风险

基金运作过程中由于基金投资策略、人为因素、管理系统设置不当造成操作失误或公司

内部失控而可能产生的损失。管理风险包括：

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

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

(3) 技术风险：是指公司管理信息系统设置不当等因素而可能造成的损失。

3、职业道德风险：是指公司员工不遵守职业操守，发生违法、违规行为而可能导致的损失。

#### 4、流动性风险

流动性风险指在开放式基金运作过程中，可能会发生基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。

##### (1) 基金申购、赎回安排

投资人具体请参见基金合同“第六部分、基金份额的申购与赎回”，详细了解本基金的申购以及赎回安排。在本基金发生流动性风险时，基金管理人可以综合利用备用的流动性风险管理工具以减少或应对基金的流动性风险，投资者可能面临赎回申请被暂停接受、赎回款项被延缓支付、基金估值被暂停、基金采用摆动定价等风险。投资者应该了解自身的流动性偏好，并评估是否与本基金的流动性风险匹配。

##### (2) 拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

本基金主要投资于经中国证监会依法核准或注册的基金，投资时严格遵守投资限制分散投资，根据投资策略调整权益、固定收益等基础资产类别的投资比例，通过基金优选体系对不同资产匹配最优的基金品种构建投资组合，并根据组合的流动性需求确定不同的基金配置比例。目前公募基金的市场容量较大，能够满足本基金日常运作要求，不会对市场造成冲击。此外，在组合构建过程中，本基金将持续对组合资产的构成进行权衡和优化，保持组合的分散性，有效管理极端市场情形下的流动性风险。因此，本基金拟投资市场及资产的流动性良好。

##### (3) 巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

在开放式本基金交易过程中，可能会发生巨额赎回的情形。巨额赎回可能会产生基金仓位调整的困难，导致流动性风险，甚至影响基金份额净值。当本基金出现巨额赎回时，基金管理人可以采用部分延期赎回、暂停赎回、延缓支付赎回款项等措施进行流动性风险管理。

#### （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

##### 1) 暂停基金估值

投资人具体请参见基金合同“第十四部分、基金资产估值”中的“七、暂停估值的情形”，详细了解本基金暂停估值的情形及程序。在此情形下，投资人没有可供参考的基金份额净值，基金管理人可暂停接收投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。

##### 2) 摆动定价

当本基金发生大申购或赎回情形时，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。当基金采用摆动定价时，投资者申购或赎回基金份额时的基金份额净值，将会根据投资组合的市场冲击成本而进行调整，使得市场的冲击成本能够分配给实际申购、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。

##### 3) 侧袋机制

侧袋机制是一种流动性风险管理工具，是将特定资产分离至专门的侧袋账户进行处置清算，并以处置变现后的款项向基金份额持有人进行支付，目的在于有效隔离并化解风险，但基金启用侧袋机制后，侧袋账户份额将停止披露基金份额净值，并不得办理申购、赎回和转换，仅主袋账户份额正常开放赎回，因此启用侧袋机制时持有基金份额的持有人将在启用侧袋机制后同时拥有主袋账户份额和侧袋账户份额，侧袋账户份额不能赎回，其对应特定资产的变现时间具有不确定性，最终变现价格也具有不确定性并且有可能大幅低于启用侧袋机制时的特定资产的估值，基金份额持有人可能因此面临损失。

实施侧袋机制期间，基金管理人计算各项投资运作指标和基金业绩指标时以主袋账户资产为基准，不反映侧袋账户特定资产的真实价值及变化情况。本基金不披露侧袋账户份额的净值，即便基金管理人在基金定期报告中披露报告期末特定资产可变现净值或净值区间的，也不作为特定资产最终变现价格的承诺，对于特定资产的公允价值和最终变现价格，基金管理人不承担任何保证和承诺的责任。

基金管理人将根据主袋账户运作情况合理确定申购政策，因此实施侧袋机制后主袋账户份额存在暂停申购的可能。

#### 5、合规性风险

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

## 6、投资管理风险：

(1) 本基金为混合型基金中基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金；

(2) 基金选择方法及模型风险；

(3) 基金经理主观判断错误的风险；

(4) 其他风险。

## 7、投资资产支持证券的风险

资产支持证券的投资风险主要包括流动性风险、利率风险及评级风险等。由于资产支持证券的投资收益来自于基础资产产生的现金流或剩余权益，因此资产支持证券投资还面临基础资产特定原始权益人的破产风险及现金流预测风险等与基础资产相关的风险。

## 8、本基金投资港股通标的股票的风险

本基金通过“内地与香港股票市场交易互联互通机制”投资于香港市场，在市场进入、投资额度、可投资对象、分红派息、税务政策等方面都有一定的限制，而且此类限制可能会不断调整，这些限制因素的变化可能对本基金进入或退出当地市场造成障碍，从而对投资收益以及正常的申购赎回产生直接或间接的影响。比如：

### (1) 港股交易失败风险

港股通业务试点期间存在每日额度限制。在香港联合交易所开市前阶段，当日额度使用完毕的，新增的买单申报将面临失败的风险；在香港联合交易所持续交易时段，当日额度使用完毕的，当日本基金面临不能通过港股通进行买入交易的风险。如果未来港股通相关业务规则发生变化，以新的业务规则为准。

### (2) 汇率风险

本基金以人民币募集和计价，但本基金通过港股通投资香港证券市场。港币相对于人民币的汇率变化将会影响本基金以人民币计价的基金资产价值，从而导致基金资产面临潜在风险。人民币对港币的汇率的波动也可能加大基金净值的波动，从而对基金业绩产生影响。此外，由于基金运作中的汇率取自汇率发布机构，如果汇率发布机构出现汇率发布时间延迟或是汇率数据错误等情况，可能会对基金运作或者投资者的决策产生不利影响。

### (3) 港股通可投资标的范围调整带来的风险

现行的港股通规则对港股通下可投资的港股范围进行了限制，并定期或不定期根据范围限制规则对具体的可投资标的进行调整，对于调出投资范围的港股，只能卖出不能买入，因



此本基金存在因港股通可投资标的的范围调整，不能及时买入投资标的的风险。

#### （4）境外市场的风险

1) 香港出现台风、黑色暴雨或者香港联合交易所规定的其他情形时，联交所将可能停市，本基金将面临在停市期间无法进行港股通交易的风险；出现境内证券交易所证券交易服务公司认定的交易异常情况时，境内证券交易所证券交易服务公司可能暂停提供部分或者全部港股通服务，本基金将面临在暂停服务期间无法进行港股通交易的风险。

2) 香港市场证券交易价格并无涨跌幅上下限的规定，因此每日涨跌幅空间相对较大。

3) 只有内地与香港两地均为交易日且能够满足结算安排的交易日才为港股通交易日。

4) 内地与香港股票市场交易互联互通机制关于股票分红、代理投票、交收安排等方面对本基金投资安排产生影响的相关规定。

（5）本基金会根据市场环境的变化以及投资策略的需要进行调整，选择将部分基金资产投资于港股通标的股票或选择不将基金资产投资于港股通标的股票，因此本基金存在不对港股进行投资的可能。

#### 9、投资存托凭证的风险

本基金投资存托凭证，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。除价格波动风险外，本基金还将面临存托凭证发行机制相关的风险，包括存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险；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；存托协议自动约束存托凭证持有人的风险；因多地上市造成存托凭证价格差异以及波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；存托凭证退市的风险；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。

#### 10、本基金特有的风险

投资者认/申购本基金份额后需至少持有一年方可赎回，即在一年持有期内基金份额持有人不能提出赎回申请。

本基金《基金合同》生效后，连续五十个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元人民币的情形，基金合同将自动终止。

本基金为基金中基金，投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集的各类基金，将面临基金投资的特有风险：

### （1）基金公司经营管理风险

基金公司的经营业绩受到多种因素的影响，如管理能力、财务状况、市场前景、行业竞争、人员素质等，以上因素均会导致基金公司的投资业绩产生波动。如果本基金所投资的基金所属基金公司经营不善，有可能导致其管理的基金净值下降，从而使本基金面临投资收益下降的风险。

### （2）基金运作风险

由于本基金投资于不同基金公司发行的基金，在基金运作过程中，基金管理人对所投资基金发生的投资风格变化、基金经理变更、基金仓位变动等可能影响投资决策的信息无法及时获取，可能产生信息不对称的风险。

此外，所投资基金的实际操作风险、基金转型、基金合并或清盘等风险将会对本基金的收益造成一定影响。

### （3）基金投资风险

由于本基金投资于不同投资目标和投资策略的基金，本基金将间接承担所投资基金净值波动所带来的风险。此外，本基金所投资基金的持仓可能集中于某一行业或某一证券发行人，从而增加本基金净值的波动。

### （4）巨额赎回引起的净值波动风险

本基金投资的基金可能因为遭遇巨额赎回而面临投资组合较大调整，导致所投资基金的净值出现较大波动，从而影响本基金的净值。

## 11、其他风险

（1）随着符合本基金投资理念的新投资工具的出现和发展，如果投资于这些工具，基金可能会面临一些特殊的风险；

（2）因技术因素而产生的风险，如计算机系统不可靠产生的风险；

（3）因基金业务快速发展而在制度建设、人员配备、内控制度建立等方面不完善而产生的风险；

（4）因人为因素而产生的风险、如内幕交易、欺诈行为等产生的风险；

（5）对主要业务人员如基金经理的依赖而可能产生的风险；

（6）战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金资产的损失，影响基金收益水平，从而带来风险；

（7）其他意外导致的风险。

## 二、声明

1、投资人投资于本基金，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，本基金还通过基金管理人指定的基金代销机构代理销售，基金管理人与基金代销机构都不能保证其收益或本金安全。

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

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效，生效后方可执行，自表决通过之日起五日内报中国证监会备案，自决议生效之日起两日内在规定媒介公告。

### 二、 《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：

1、基金份额持有人大会决定终止的；

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

3、连续五十个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元人民币情形的；

4、《基金合同》约定的其他情形；

5、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### 三、 基金财产的清算

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

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

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

#### 4、基金财产清算程序：

- (1) 《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；
- (2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- (3) 对基金财产进行估值和变现；
- (4) 制作清算报告；
- (5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- (6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；
- (7) 对基金财产进行分配。

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

#### 四、 清算费用

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

#### 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并确认后 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 20 年以上。

## 第二十部分 基金合同的内容摘要

### 一、 基金合同当事人及权利义务

#### (一) 基金管理人的权利与义务

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

(1) 依法募集资金；

(2) 自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；

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

(4) 销售基金份额；

(5) 按照规定召集基金份额持有人大会；

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

(7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

(8) 选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；

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

(10) 依据《基金合同》及有关法律、法规规定决定基金收益的分配方案；

(11) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；

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

(13) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；

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

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

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

(17) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

(1) 依法募集资金，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 20 年以上；

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

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

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

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

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

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

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

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

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(26) 建立并保存基金份额持有人名册；

(27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## (二) 基金托管人的权利与义务

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

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

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

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

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



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

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

- (1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；
- (2) 设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；
- (3) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；
- (4) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；
- (5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
- (6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户等投资所需账户，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 20 年以上；
- (12) 保存基金份额持有人名册；
- (13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
- (14) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；
- (15) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，召集基金份额持有人大会或配合

基金管理人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

(16) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；

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

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

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

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

(21) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(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》取得基金份额，即成为本基金份额持有人和《基金合同》的当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为《基金合同》当事人并不以在《基金合同》上书面签章或签字为必要条件。

每份基金份额具有同等的合法权益。

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

(1) 分享基金财产收益；

(2) 参与分配清算后的剩余基金财产；

(3) 依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；

(4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会；

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

(6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；

(7) 监督基金管理人的投资运作；

(8) 对基金管理人、基金托管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；

(9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

- (1) 认真阅读并遵守《基金合同》、《招募说明书》等信息披露文件；
- (2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；
- (3) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；
- (4) 交纳基金认购、申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；
- (5) 在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；
- (6) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；
- (7) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- (8) 返还在基金交易过程中因各种原因获得的不当得利；
- (9) 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。

本基金的基金份额持有人大会暂不设立日常机构。

### (一) 召开事由

1、除法律法规，基金合同和中国证监会另有规定外，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；
- (5) 调整基金管理人、基金托管人的报酬标准，但法律法规要求调整该等报酬标准的除外；
- (6) 变更基金类别；
- (7) 本基金与其他基金的合并；
- (8) 变更基金投资目标、范围或策略；
- (9) 变更基金份额持有人大会程序；

(10) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；

(11) 单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；

(12) 对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

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

2、在不违反有关法律法规和《基金合同》约定，并对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

(1) 法律法规要求增加的基金费用的收取；

(2) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式；

(3) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；

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

(5) 《基金合同》明确约定无需召开基金份额持有人大会的情况；

(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调整有关认购、申购、赎回、转换、基金交易、非交易过户、转托管等业务规则；

(7) 基金推出新业务或服务，或调整基金份额类别设置；

(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开时，由基金托管人召集。

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

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

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

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

（三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

（1）会议召开的时间、地点和会议形式；

（2）会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；

（3）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；

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

（5）会务常设联系人姓名及联系电话；

（6）出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；

（7）召集人需要通知的其他事项。

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

3、如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对表决意见的计票

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

#### （四）基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式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证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；

（2）经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的 50%（含 50%）。

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

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

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

（3）本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的 50%（含 50%）；

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

参加基金份额持有人大会的持有人的基金份额低于第1款第(2)项、或者第2款第(3)项规定比例的，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应当有代表三分之一以上基金份额的持有人参加，方可召开。

3、在法律法规及监管机构允许的前提下，基金份额持有人大会可通过网络、电话或其他方式召开，基金份额持有人可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式进行表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

4、基金份额持有人授权他人代为出席会议并表决的，在法律法规及监管机构允许的前提下，授权方式可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式，具体方式在会议通知中列明。

#### (五) 议事内容与程序

##### 1、议事内容及提案权

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

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

##### 2、议事程序

###### (1) 现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的50%以上(含50%)选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主

持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

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

## （2）通讯开会

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

## （六）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1、一般决议，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）通过方为有效；除下列第 2 项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。除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书面表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

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

## （七）计票

### 1、现场开会

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



金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

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

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

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

## 2、通讯开会

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

### (八) 生效与公告

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

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

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

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

### (九) 实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定

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

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

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

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

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

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

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

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

同一主侧袋账户内的每份基金份额具有平等的表决权。

（十）基金管理人代表本基金出席本基金持有的基金份额持有人大会并参与表决的特别约定

本基金持有的基金召开基金份额持有人大会时，本基金管理人应代表本基金基金份额持有人的利益参与所持有基金的份额持有人大会，并在遵循本基金份额持有人利益优先原则的前提下行使相关投票权利。本基金管理人需将表决意见事先征求基金托管人的意见，并将表决意见在定期报告中予以披露。

法律法规对于本基金参与本基金持有的基金召开基金份额持有人大会的程序或要求另有规定的，从其规定。

（十一）本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人经与基金托管人协商一致报监管机关并提前公告后，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本合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于法律法规规定和基金合同约定可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效，生效后方可执行，自表决通过之日起五日内报中国证监会备案，自决议生效之日起两日内在规定媒介公告。

#### （二） 《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：

1、基金份额持有人大会决定终止的；

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

3、连续五十个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元人民币情形的；

4、《基金合同》约定的其他情形；

5、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

#### （三） 基金财产的清算

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

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

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

4、基金财产清算程序：

（1）《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；

(2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；

(3) 对基金财产进行估值和变现；

(4) 制作清算报告；

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

(6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；

(7) 对基金财产进行分配。

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

#### (四) 清算费用

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

#### (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并确认后 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 20 年以上。

### 四、 争议的处理和适用的法律

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会，根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，仲裁费由败诉方承担。

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

《基金合同》受中国法律（为《基金合同》之目的，不包括香港、澳门特别行政区及台湾地区法律）管辖。

## **五、 基金合同存放地和投资者取得合同的方式**

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

## 第二十一部分 基金托管协议的内容摘要

### 一、 基金托管协议当事人

#### （一）基金管理人

名称：广发基金管理有限公司

住所：广东省珠海市横琴新区环岛东路 3018 号 2608 室

法定代表人：孙树明

设立日期：2003 年 8 月 5 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证券监督管理委员会证监基金字[2003]91 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：14,097.8 万元人民币

存续期限：持续经营

联系电话：020-83936666

#### （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

基金托管资格批文及文号：证监基金字[2002]75 号

### 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，包括证券投资基金（包括香港互认基

金及其他经中国证监会依法核准或注册的基金，不包括 QDII 基金）、国内依法发行上市的股票（包括创业板及其他依法发行上市的股票及存托凭证）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、企业债券、公司债券、可转换债券（含可分离交易可转换债券的纯债部分）、可交换债券、公开发行的次级债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券等以及经法律法规或中国证监会允许投资的其他债券类金融工具）、资产支持证券、债券回购、银行存款（含协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

本基金为混合型基金中基金，基金的投资组合比例为：本基金投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金份额的资产不低于基金资产的 80%；投资于股票型基金（包括股票指数基金）的比例占基金资产的 0%-30%；本基金持有的现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；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。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或对投资比例要求有变更的，基金管理人在履行适当程序后，可以做出相应调整。

管理人在首次进行港股通投资前，需提前通知托管人投资的相关事宜。

（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）本基金投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金份额的资产不低于基金资产的 80%；

（2）本基金投资于股票型基金（包括股票指数基金）的比例占基金资产的 0%-30%；

（3）本基金每个交易日日终应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

（4）本基金持有一家公司发行的证券（若同一家公司在内地和香港同时上市的 A+H 股合并计算），其市值不超过基金资产净值的 10%；

（5）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券（同一家公司在内地和香港同时上市的 A+H 股合并计算），不超过该证券的 10%；

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

(7) 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%；

(8) 本基金持有单只基金的市值，不得超过基金资产净值的 20%，且不得持有其他基金中基金；

(9) 除 ETF 联接基金外，本基金管理人管理的全部基金持有单只基金不得超过被投资基金净资产的 20%，被投资基金净资产规模以最近定期报告披露的规模为准；

(10) 本基金投资商品基金的比例不得超过基金资产的 10%；

(11) 本基金投资货币市场基金的比例不得超过基金资产的 15%；

(12) 本基金投资其他基金，被投资基金的运作期限应当不少于 1 年、最近定期报告披露的季末基金净资产应不低于 1 亿元；

(13) 在本基金开放日，本基金投资于流通受限基金的市值不得超过基金资产净值的 10%；流通受限基金是指封闭运作基金、定期开放基金等由基金合同规定明确在一定期限锁定期内不可赎回的基金，但不包括 ETF、LOF 等可上市交易的基金；

(14) 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%；

(15) 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%；

(16) 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%；

(17) 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%；

(18) 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；

(19) 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；

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

(21) 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；

(22) 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；

(23) 基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

(24) 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；

(25) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

因证券市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述第(8)、(9)项时，基金管理人应当在 20 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。除上述第(3)、(8)、(9)、(18)、(21)、(22)条外，因证券市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间，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本基金合同生效之日起开始。

(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。

法律法规或监管部门取消上述组合限制、禁止行为规定或从事关联交易的条件和要求，本基金可不受相关限制。法律法规或监管部门对上述组合限制、禁止行为规定或从事关联交易的条件和要求进行变更的，本基金可以变更后的规定为准；经与基金托管人协商一致，基金管理人可依据法律法规或监管部门规定直接对基金合同进行变更，该变更无须召开基金份额持有人大会审议。

（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，在中国证监会规定媒介披露所投资非公开发行股票的名称、数量、总成本、账面价值，以及总成本和账面价值占基金资产净值的比例、锁定期等信息。

7. 基金托管人在力所能及的范围内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，本着便于基金财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。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的方式。特殊情况下，采用基金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。

(十二) 侧袋机制实施期间，本部分约定的投资组合比例、组合限制等约定仅适用于主袋账户。

### 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、有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，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，聘请符合《证券法》规定的会计师事务所进行验资，出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的 2 名或 2 名以上中国注册会计师签字方为有效。
3. 若基金募集期限届满或基金停止募集时，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。
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）证券投资基金账户

基金管理人根据本基金投资证券投资基金的需要，在与基金托管人协商一致后，基金管理人负责为本基金开立证券投资基金账户，用于办理本基金投资于其他证券投资基金时的基金份额登记和交割。管理人负责管理使用上述账户，托管人负责保管上述账户的开户文件复印件。

### （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 20 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/计算日基金份额余额总数。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。

基金管理人每个估值日计算基金资产净值和基金份额净值,并按规定披露。

## 2. 复核程序

基金管理人每个估值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,按照基金管理人对于基金资产净值的计算结果对外予以公布,基金托管人对该结果不承认任何责任。

## (二) 基金资产估值方法和特殊情形的处理

### 1. 估值对象

基金所拥有的证券投资基金、股票、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

### 2. 估值方法

#### (1) 基金估值方法

##### 1) 非上市基金估值

①本基金投资的境内非货币市场基金,按所投资基金估值日的基金份额净值估值。

②本基金投资的境内货币市场基金,按所投资基金前一估值日后至估值日期间(含节假日)的万份收益计提估值日基金收益。

##### 2) 上市基金估值

①本基金投资的 ETF 基金、境内上市定期开放式基金、封闭式基金,按所投资基金估值日的收盘价估值。

②本基金投资的境内上市开放式基金(LOF),按所投资基金估值日的基金份额净值估值。

③本基金投资的境内上市交易型货币市场基金,如所投资基金披露份额净值,则按所投资基金估值日的份额净值估值;如所投资基金披露万份(百份)收益,则按所投资基金前一估值日后至估值日期间(含节假日)的万份(百份)收益计提估值日基金收益。

3) 如遇所投资基金不公布基金份额净值、进行折算或拆分、估值日无交易等特殊情况下，基金管理人根据以下原则进行估值：

①以所投资基金的基金份额净值估值的，若所投资基金与本基金估值频率一致但未公布估值日基金份额净值，按其最近公布的基金份额净值为基础估值。

②以所投资基金的收盘价估值的，若估值日无交易，且最近交易后市场环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后市场环境发生了重大变化的，可使用最新的基金份额净值为基础或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，确定公允价值。

③如果所投资基金前一估值日至估值日期间发生分红除权、折算或拆分，基金管理人应根据基金份额净值或收盘价、单位及份额分红金额、折算拆分比例、持仓份额等因素合理确定公允价值。

#### (2) 证券交易所上市的有价证券的估值

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

3) 对在交易所市场上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价进行估值；

4) 对在交易所市场上市交易的可转换债券，以每日收盘价作为估值全价；

5) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所市场挂牌转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值；

6) 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估值日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表估值日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认估值日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，应采用估值技术确定其公允价值。

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

(4) 全国银行间市场交易的固定收益品种的估值

1) 银行间市场交易不含权的固定收益品种，选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，选取第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价；

2) 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) 同一证券同时在两个或两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。

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

(7) 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。

(8) 估值中的汇率选取原则：港股通投资持有外币证券资产估值涉及到的主要货币对人民币汇率，以估值日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价为准。

(9) 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。

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

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

### 3. 特殊情形的处理

(1) 基金管理人或基金托管人按估值方法的第(9)项进行估值时,所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

(2) 由于不可抗力原因,或由于证券交易所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) 基金份额净值错误的处理方式

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”)的直接损失按下述“估值错误处理原则”给予赔偿,承担赔偿责任。

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

#### 2、估值错误处理原则

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

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

(3) 因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但估值错误责任方仍应对估值错误负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造

成其他当事人的利益损失(“受损方”),则估值错误责任方应赔偿受损方的损失,并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利;如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方,则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给估值错误责任方。

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

### 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后,有关的当事人应当及时进行处理,处理的程序如下:

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

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

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

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

### 4、基金份额净值估值错误处理的方法如下:

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

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

(3) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的,从其规定处理。

#### (四) 暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;

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

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

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；在每个季度结束之日起 15 个工作日内完成基金季度报告的编制并公告；在上半年结束之日起两个月内完成基金中期报告的编制并公告；在每年结束之日起三个月内完成基金年度报告的编制并公告。基金年度报告的财务会计报告应当经过符合《证券法》规定的会计师事务所审计。基金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。

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

## 六、 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，除非仲裁裁决另有规定。

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

本协议受中国法律管辖。

## 七、 托管协议的变更、终止与基金财产的清算

### （一）托管协议的变更程序

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

### （二）基金托管协议终止出现的情形

1. 基金合同终止；
2. 基金托管人解散、依法被撤销、破产或由其他基金托管人接管基金资产；
3. 基金管理人解散、依法被撤销、破产或由其他基金管理人接管基金管理权；
4. 发生法律法规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、符合《证券法》规定的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

（3）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为 6 个月。

4. 清算费用

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

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符合《证券法》规定的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

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 20 年以上。



## 第二十二部分 对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务。基金管理人根据基金份额持有人的需要和市场的变化，有权增加或变更服务项目。主要服务内容如下：

### 一、持有人注册登记服务

基金管理人担任基金注册登记机构，为基金份额持有人提供注册登记服务，配备安全、完善的电脑系统及通讯系统，准确、及时地为基金份额持有人办理基金账户业务、基金份额的登记、权益分配时红利的登记、权益分配时红利的派发、基金交易份额的清算过户等服务。

### 二、持有人交易记录查询及对账单服务

#### 1、基金交易确认服务

注册登记机构保留基金份额持有人名册上列明的所有基金份额持有人的基金投资记录。基金份额持有人每次交易结束后（T 日），本基金销售网点将于 T+3 日开始为基金份额持有人提供该笔交易成交确认单的查询服务。基金份额持有人也可以在 T+3 日通过本基金管理人客户服务中心查询基金交易情况。基金管理人直销机构网点应根据在直销机构网点进行交易的基金份额持有人的要求打印成交确认单。基金销售机构应根据在销售网点进行交易的基金份额持有人的要求进行成交确认。

#### 2、对账单服务

本公司至少每年度以电子邮件、短信或其他形式向通过广发基金直销系统持有本公司基金份额的持有人提供基金保有情况信息。

基金份额持有人可通过以下方式查阅对账单：

1) 基金份额持有人可登录本基金管理人的网站账户自助查询系统查阅对账单。

2) 基金份额持有人可通过网站、电话等方式向本基金管理人定制电子形式的定期对账单。基金交易对账单分为季度对账单和年度对账单，记录该基金份额持有人最近一季度或一年内所有申购、赎回等交易发生的时间、金额、数量、价格以及当前账户的余额等。季度对账单在每季结束后的 20 个工作日内向定制季度对账单服务的基金份额持有人以电子邮件形式发送，年度对账单在每年度结束后 20 个工作日内对所有基金份额持有人以电子邮件形式发送。

#### 3、基金份额持有人交易记录查询服务

本基金份额持有人可通过基金管理人的客户服务中心（包括电话呼叫中心和网站账户自

助查询系统)和本基金管理人的销售网点查询历史交易记录。

### 三、信息定制服务

基金份额持有人在申请开立本公司基金账户时如预留电子邮件地址，可订制电子邮件服务，内容包括交易确认及相关基金资讯信息等；如预留手机号码，可订制手机短信服务，内容包括基金净值播报、交易确认等。已开立本公司基金账户未预留相关资料的基金份额持有人可到销售网点或通过基金管理人的客户服务中心（包括电话呼叫中心和网站账户自助查询系统）办理资料变更。

### 四、信息查询

基金管理人为每个基金账户提供一个基金账户查询密码，基金份额持有人可以凭基金账号和该密码通过基金管理人的电话呼叫中心（Call Center）查询客户基金账户信息；同时可以修改通信地址、电话、电子邮件等信息；另外还可登录本基金管理人网站查询基金申购与赎回的交易情况、账户余额、基金产品信息。

### 五、投诉受理

基金份额持有人可以通过基金管理人提供的网站在线客服、呼叫中心人工坐席、书信、电子邮件、传真等渠道对基金管理人和销售机构所提供的服务进行投诉。基金份额持有人还可以通过销售机构的服务电话进行投诉。

### 六、服务联系方式

#### 1、客户服务中心

电话呼叫中心（Call Center）：95105828 或 020-83936999，该电话可转人工服务。

传真：020-34281105

#### 2、互联网网站

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

电子信箱：[services@gffunds.com.cn](mailto:services@gffunds.com.cn)

## 第二十三部分 其他应披露事项

公告事项	披露日期
关于面向特定投资者通过直销柜台认、申购旗下所有基金实施费率优惠的公告	2022-05-19
广发基金管理有限公司关于旗下基金2022年第1季度报告提示性公告	2022-04-21
广发悦享一年持有期混合型基金中基金（FOF）开放日常申购和定期定额投资业务的公告	2022-03-23
广发悦享一年持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同生效公告	2022-01-26
广发悦享一年持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同及招募说明书提示性公告	2021-12-23

## 第二十四部分 招募说明书存放及查阅方式

本基金招募说明书存放在基金管理人、基金托管人的办公场所和营业场所，供社会公众查阅、复制。

## 第二十五部分 备查文件

- (一) 中国证监会注册广发悦享一年持有期混合型基金中基金（FOF）募集的文件
- (二) 《广发悦享一年持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》
- (三) 《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》
- (四) 《广发悦享一年持有期混合型基金中基金（FOF）托管协议》
- (五) 法律意见书