

国泰安璟债券型证券投资基金
更新招募说明书
(2023 年第一号)

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

目 录

重要提示	1
第一部分 绪言	3
第二部分 释义	4
第三部分 基金管理人	9
第四部分 基金托管人	21
第五部分 相关服务机构	24
第六部分 基金的募集	26
第七部分 基金合同的生效	30
第八部分 基金份额的申购与赎回	31
第九部分 基金的投资	43
第十部分 基金的业绩	55
第十一部分 基金的财产	56
第十二部分 基金资产估值	57
第十三部分 基金的收益与分配	64
第十四部分 基金费用与税收	66
第十五部分 基金的会计与审计	69
第十六部分 基金的信息披露	70
第十七部分 侧袋机制	77
第十八部分 风险揭示	79
第十九部分 基金的终止与清算	88
第二十部分 基金合同内容摘要	90
第二十一部分 托管协议内容摘要	107
第二十二部分 对基金份额持有人的服务	125
第二十三部分 其他应披露事项	126
第二十四部分 招募说明书存放及查阅方式	127
第二十五部分 备查文件	128

重要提示

本基金經中國證券監督管理委員會 2022 年 7 月 25 日證監許可【2022】1623 號文註冊募集。本基金的基金合同生效日為 2023 年 1 月 17 日。

基金管理人保證招募說明書的內容真實、準確、完整。本招募說明書經中國證監會註冊，但中國證監會對本基金募集的註冊，並不表明其對本基金的投資價值和市場前景做出實質性判斷或保證，也不表明投資於本基金沒有風險。

本基金投資於證券市場，基金淨值會因為證券市場波動等因素產生波動。投資人在投資本基金前，需全面認識本基金產品的風險收益特征和產品特性，充分考慮自身的風險承受能力，理性判斷市場，對投資本基金的意願、時機、數量等投資行為做出獨立決策。投資人根據所持有的基金份額享受基金的收益，但同時也需承擔相應的投資風險。基金投資中的風險包括：因經濟、政治、社會環境等因素的變化對證券價格產生影響而形成的系統性風險，個別行業或個別證券特有的非系統性風險，流動性風險，基金管理人在基金管理運作過程中產生的運作管理風險，本基金特定風險，本基金法律文件中涉及基金風險特征的表述與銷售機構對基金的風險評級可能不一致的風險，實施側袋機制對投資者的影響以及由某些不可抗力因素等造成的其他風險等。

本基金可根據投資策略需要或不同配置地市場環境的變化，選擇將部分基金資產投資於港股或選擇不將基金資產投資於港股，基金資產並非必然投資於港股。

本基金資產投資於港股時，會面臨港股通機制下因投資環境、投資標的、市場制度以及交易規則等差異帶來的特有風險，包括港股市場股價波動較大的風險（港股市場實行 T+0 回轉交易，且對個股不設漲跌幅限制，港股股價可能表現出比 A 股更為劇烈的股價波動）、匯率風險（匯率波動可能對基金的投資收益造成損失）、港股通機制下交易日不連貫可能帶來的風險（在內地開市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及時賣出，可能帶來一定的流動性風險）等。

本基金可投資存托憑證，基金淨值可能受到存托憑證的境外基礎證券價格波動影響，存托憑證的境外基礎證券的相關風險可能直接或間接成為本基金的風險。本基金可根據投資策略需要或市場環境的變化，選擇將部分基金資產投資於存托

凭证或选择不将基金资产投资于存托凭证，基金资产并非必然投资存托凭证。

本基金可投资资产支持证券，存在与基础资产相关的风险、与资产支持证券相关的风险、与专项计划管理相关的风险和其他风险。

本基金可投资国债期货，可能面临市场风险、基差风险、流动性风险。

本基金可根据投资策略需要或市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于科创板股票或选择不将基金资产投资于科创板股票，基金资产并非必然投资于科创板股票。

本基金投资科创板股票时，会面临因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括股价波动较大的风险、流动性风险、退市风险、本基金投资集中度相对较高的风险等。

本基金为债券型基金，理论上预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化导致的投资风险，由投资人自行承担。当投资人赎回时，所得或会高于或低于投资人先前所支付的金额。

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，但不保证投资于本基金一定盈利，也不保证最低收益。

投资者应当认真阅读基金招募说明书、基金合同、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，自主做出投资决策，自行承担投资风险。

本招募说明书已经本基金托管人复核。本次招募说明书更新事由为年度更新。本招募说明书所载投资组合报告为 2023 年 2 季度报告，净值表现数据截止日为 2023 年 6 月 30 日，主要人员情况截止日为 2023 年 10 月 26 日，除非另有说明，本招募说明书其他所载内容截止日为 2023 年 9 月 30 日。（本报告中财务数据未经审计）

第一部分 緒言

本招募說明書依據《中華人民共和國證券投資基金法》（以下簡稱“《基金法》”）、《公開募集證券投資基金運作管理辦法》（以下簡稱“《運作辦法》”）、《公開募集證券投資基金銷售機構監督管理辦法》（以下簡稱“《銷售辦法》”）、《公開募集證券投資基金信息披露管理辦法》（以下簡稱“《信息披露辦法》”）、《公開募集開放式證券投資基金流動性風險管理規定》（以下簡稱“《流動性風險管理規定》”）和其他有關法律法規的規定以及《國泰安瓊債券型證券投資基金基金合同》（以下簡稱“基金合同”）編寫。

基金管理人承諾本招募說明書不存在任何虛假記載、誤導性陳述或者重大遺漏，並對其真實性、準確性、完整性承擔法律責任。本基金是根據本招募說明書所載明的資料申請募集的。本基金管理人沒有委託或授權任何其他人提供未在本招募說明書中載明的信息，或對本招募說明書作任何解釋或者說明。

本招募說明書根據本基金的基金合同編寫，並經中國證監會註冊。基金合同是規定基金合同當事人之間權利義務關係的基本法律文件，如本招募說明書內容與基金合同有衝突或不一致之處，均以基金合同為準。基金投資人自依基金合同取得基金份額，即成為基金份額持有人和基金合同當事人，其持有基金份額的行為本身即表明其對基金合同的承認和接受，並按照《基金法》、基金合同及其他有關規定享有權利、承擔義務。基金投資人欲了解基金份額持有人的權利和義務，應詳細查閱基金合同。

第二部分 释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

- 1、基金或本基金：指国泰安璟债券型证券投资基金
- 2、基金管理人：指国泰基金管理有限公司
- 3、基金托管人：指平安银行股份有限公司
- 4、基金合同：指《国泰安璟债券型证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充
- 5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《国泰安璟债券型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
- 6、招募说明书或本招募说明书：指《国泰安璟债券型证券投资基金招募说明书》及其更新
- 7、基金产品资料概要：指《国泰安璟债券型证券投资基金基金产品资料概要》及其更新
- 8、基金份额发售公告：指《国泰安璟债券型证券投资基金基金份额发售公告》
- 9、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等
- 10、《基金法》：指《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 11、《销售办法》：指《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 12、《信息披露办法》：指《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 13、《运作办法》：指《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 14、《流动性风险管理规定》：指《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订
- 15、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

-
- 16、**銀行業監督管理機構**：指中國人民銀行和/或國家金融監督管理總局
- 17、**基金合同當事人**：指受基金合同約束，根據基金合同享有權利並承擔義務的法律主體，包括基金管理人、基金托管人和基金份額持有人
- 18、**個人投資者**：指依據有關法律法規規定可投資於證券投資基金的自然人
- 19、**機構投資者**：指依法可以投資證券投資基金的、在中華人民共和國境內合法登記並存續或經有關政府部門批准設立並存續的企業法人、事業法人、社會團體或其他組織
- 20、**合格境外投資者**：指符合現行有效的相關法律法規規定，使用來自境外的資金進行境內證券期貨投資的境外機構投資者，包括合格境外機構投資者和人民幣合格境外機構投資者
- 21、**投資人、投資者**：指個人投資者、機構投資者、合格境外投資者以及法律法規或中國證監會允許購買證券投資基金的其他投資人的合稱
- 22、**基金份額持有人**：指依基金合同和招募說明書合法取得基金份額的投資人
- 23、**基金銷售業務**：指基金管理人或銷售機構宣傳推介基金，發售基金份額，辦理基金份額的申購、贖回、轉換、轉托管及定期定額投資等業務
- 24、**銷售機構**：指基金管理人以及符合《銷售辦法》和中國證監會規定的其他條件，取得基金銷售業務資格並與基金管理人簽訂了基金銷售服務協議，辦理基金銷售業務的機構
- 25、**登記業務**：指基金登記、存管、過戶、清算和結算業務，具體內容包括投資人基金帳戶的建立和管理、基金份額登記、基金銷售業務的確認、清算和結算、代理發放紅利、建立並保管基金份額持有人名冊和辦理非交易過戶等
- 26、**登記機構**：指辦理登記業務的機構。本基金的登記機構為國泰基金管理有限公司或接受國泰基金管理有限公司委託代為辦理登記業務的機構
- 27、**基金帳戶**：指登記機構為投資人開立的、記錄其持有的、基金管理人所管理的基金份額餘額及其變動情況的帳戶
- 28、**基金交易帳戶**：指銷售機構為投資人開立的、記錄投資人通過該銷售機構辦理認購、申購、贖回、轉換、轉托管、定期定額投資等業務而引起的基金份額變動及結餘情況的帳戶

29、基金合同生效日：指基金募集達到法律法規規定及基金合同規定的條件，基金管理人向中國證監會辦理基金備案手續完畢，並獲得中國證監會書面確認的日期

30、基金合同終止日：指基金合同規定的基金合同終止事由出現後，基金財產清算完畢，清算結果報中國證監會備案並予以公告的日期

31、基金募集期：指自基金份額發售之日起至發售結束之日止的期間，最長不得超過 3 個月

32、存續期：指基金合同生效至終止之間的不定期期限

33、工作日：指上海證券交易所、深圳證券交易所的正常交易日

34、T 日：指銷售機構在規定時間受理投資人申購、贖回或其他業務申請的開放日

35、T+n 日：指自 T 日起第 n 個工作日（不包含 T 日）

36、開放日：指為投資人辦理基金份額申購、贖回或其他業務的工作日（若該工作日為非港股通交易日，則基金管理人有权暫停辦理基金份額的申購和贖回業務）

37、開放時間：指開放日基金接受申購、贖回或其他交易的時間段

38、《業務規則》：指《國泰基金管理有限公可開放式基金業務規則》，是規範基金管理人所管理的開放式證券投資基金登記方面的業務規則，由基金管理人和投資人共同遵守

39、認購：指在基金募集期內，投資人根據基金合同和招募說明書的規定申請購買基金份額的行為

40、申購：指基金合同生效後，投資人根據基金合同和招募說明書的規定申請購買基金份額的行為

41、贖回：指基金合同生效後，基金份額持有人根據基金合同和招募說明書規定的條件要求將基金份額兌換為現金的行為

42、基金轉換：指基金份額持有人按照基金合同和基金管理人屆時有效公告規定的條件，申請將其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份額轉換為基金管理人管理的其他基金基金份額的行為

43、轉托管：指基金份額持有人在本基金的不同銷售機構之間實施的變更所

持基金份額銷售機構的操作

44、定期定額投資計劃：指投資人通過有關銷售機構提出申請，約定每期申購日、申購金額及扣款方式，由銷售機構於每期約定申購日在投資人指定銀行賬戶內自動完成扣款及受理基金申購申請的一種投資方式

45、巨額贖回：指本基金單個開放日，基金淨贖回申請（贖回申請份額總數加上基金轉換中轉出申請份額總數後扣除申購申請份額總數及基金轉換中轉入申請份額總數後的餘額）超過上一開放日基金總份額的 10%

46、港股通：指內地投資者委託內地證券公司，經由上海證券交易所和深圳證券交易所設在香港設立的證券交易服務公司，向香港聯合交易所進行申報，買賣規定範圍內的香港聯合交易所上市的股票

47、基金份額類別：指根據認購/申購費用、銷售服務費收取方式的不同，將本基金基金份額分為不同類別。各類別基金份額分別設置基金代碼，並分別計算和公布基金份額淨值和基金份額累計淨值

48、A 類基金份額：指在投資人認購/申購基金份額時收取認購/申購費用，並不再從本類別基金資產中計提銷售服務費的基金份額

49、C 類基金份額：指從本類別基金資產中計提銷售服務費、不收取認購/申購費用的基金份額

50、銷售服務費：指從相應類別基金份額的基金資產中計提的，用於本基金市場推廣、銷售以及基金份額持有人服務的费用

51、元：指人民幣元

52、基金收益：指基金投資所得紅利、股息、債券利息、票據投資收益、買賣證券價差、銀行存款利息、已實現的其他合法收入及因運用基金財產帶來的成本和費用的節約

53、基金資產總值：指基金擁有的各類有價證券、票據價值、銀行存款本息、基金應收款項及其他資產的價值總和

54、基金資產淨值：指基金資產總值減去基金負債後的價值

55、基金份額淨值：指計算日基金資產淨值除以計算日基金份額總數

56、基金資產估值：指計算評估基金資產和負債的價值，以確定基金資產淨值和基金份額淨值的过程

57、**規定媒介**：指符合中國證監會規定條件的用以進行信息披露的全國性報刊及《信息披露辦法》規定的互聯網網站（包括基金管理人網站、基金托管人網站、中國證監會基金電子披露網站）等媒介

58、**流動性受限資產**：指由於法律法規、監管、合同或操作障礙等原因無法以合理價格予以變現的資產，包括但不限於到期日在 10 個交易日以上的逆回購與銀行定期存款（含協議約定有條件提前支取的銀行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公開發行股票、資產支持證券、因發行人債務違約無法進行轉讓或交易的債券等

59、**摆动定价机制**：指當本基金遭遇大額申購贖回時，通過調整基金份額淨值的方式，將基金調整投資組合的市場衝擊成本分配給實際申購、贖回的投資者，從而減少對存量基金份額持有人利益的不利影響，確保投資人的合法權益不受損害並得到公平對待

60、**侧袋机制**：指將基金投資組合中的特定資產從原有賬戶分離至一個專門賬戶進行處置清算，目的在於有效隔離並化解風險，確保投資者得到公平對待，屬於流動性風險管理工具。側袋機制實施期間，原有賬戶稱為主袋賬戶，專門賬戶稱爲側袋賬戶

61、**特定资产**：包括：（一）無可參考的活躍市場價格且採用估值技術仍導致公允價值存在重大不確定性的資產；（二）按攤余成本計量且計提資產減值準備仍導致資產價值存在重大不確定性的資產；（三）其他資產價值存在重大不確定性的資產

62、**不可抗力**：指基金合同當事人不能預見、不能避免且不能克服的客觀事件

第三部分 基金管理人

一、基金管理人概况

名称：国泰基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区浦东大道 1200 号 2 层 225 室

办公地址：上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 16 层-19 层

设立日期：1998 年 3 月 5 日

法定代表人：邱军

注册资本：壹亿壹仟万元人民币

联系人：辛怡

联系电话：（021）31089000，4008-888-688

股权结构：

股东名称	股权比例
中国建银投资有限责任公司	60%
意大利忠利集团	30%
中国电力财务有限公司	10%

二、主要人员情况

1、董事会成员

暂由总经理周向勇代为履行董事长职务。

王惠平，董事，研究生学历，博士学位，高级会计师，中国非执业注册会计师。1996 年 9 月至 2004 年 7 月任职于财政部财政监督司、财政部监督检查局。2004 年 8 月至 2011 年 6 月任职于财政部国务院农村税费改革工作小组办公室（国务院农村综合改革工作小组办公室）。历任财政部监督检查局检查一处副处长，财政部国务院农村税费改革工作小组办公室（国务院农村综合改革工作小组办公室）一处处长。2011 年 7 月至 2021 年 6 月任职于海南省财政厅，历任海南省财政厅总会计师、副厅长、财政厅党组书记、财政厅厅长。2021 年 7 月至 2023 年 4 月任职于海南省社会科学界联合会（海南省社会科学院），历任海南省社会科学界联合会党组书记、主席兼海南省社会科学院院长。2023 年 4 月起任中央汇金投资有限责任公司派往中国建投董事。2023 年 9 月起任公司董事。

Santo Borsellino, 董事, 碩士研究生。1994-1995 年在 BANK OF ITALY 負責經濟研究; 1995 年在 UNIVERSITY OF BOLOGNA 任金融部助理, 1995-1997 年在 ROLOFINANCE UNICREDITO ITALIANO GROUP - SOFIPA SpA 任金融分析師; 1999-2004 年在 LEHMAN BROTHERS INTERNATIONAL 任股票保險研究員; 2004-2005 年任 URWICK CAPITAL LLP 合夥人; 2005-2006 年在 CREDIT SUISSE 任副總裁; 2006-2008 年在 EURIZONCAPITAL SGR SpA 歷任研究員/基金經理。2009-2013 年任 GENERALI INVESTMENTS EUROPE 權益部總監。2013-2019 年任 GENERALI INVESTMENTS EUROPE 總經理。2019 年 4 月起任 Investments & Asset Management Corporate Governance Implementation & Institutional Relations 主管。2013 年 11 月起任公司董事。

游一冰, 董事, 大學本科, 英國特許保險學會高級會員 (FCII) 及英國特許保險師 (Chartered Insurer)。1989 年至 1994 年任中國人民保險公司總公司營業部助理經理; 1994 年至 1996 年任中國保險(歐洲)控股有限公司總裁助理; 1996 年至 1998 年任忠利保險有限公司英國分公司再保險承保人; 1998 年至 2017 年任忠利亞洲中國地區總經理; 2002 年至今任中意人壽保險有限公司董事; 2007 年至今任中意財產保險有限公司董事; 2007 年至 2017 年任中意財產保險有限公司總經理; 2013 年至今任中意資產管理有限公司董事; 2017 年至今任忠利集團大中華區股東代表。2010 年 6 月起任公司董事。

戴建元, 董事, 大學本科, 高級會計師。1994 年 7 月至 1998 年 4 月, 任福建省泉州電業局財務科會計。1998 年 4 月至 2001 年 3 月, 任福建省電力有限公司財務部會計。2001 年 3 月至 2005 年 8 月, 任福建省廈門市電業局總會計師。2005 年 8 月至今, 歷任中國電力財務有限公司福建業務部主任、直屬營業部副主任(主持工作、正處級)、直屬營業部主任、辦公室主任、審計部主任、副總經理、首席風險師、總風險師。2020 年 12 月起任公司董事。

周向勇, 董事, 碩士研究生, 27 年金融從業經歷。1996 年 7 月至 2004 年 12 月在中國建設銀行總行工作, 先後任辦公室科員、個人銀行業務部主任科員。2004 年 12 月至 2011 年 1 月在中國建銀投資有限責任公司工作, 任辦公室高級業務經理、業務運營組負責人。2011 年 1 月加入國泰基金管理有限公司, 任總經理助理, 2012 年 11 月至 2016 年 7 月任公司副總經理, 2016 年 7 月起任公司

總經理及公司董事。

黃曉衡，獨立董事，碩士研究生，高級經濟師。1975 年 7 月至 1991 年 6 月，在中國建設銀行江蘇省分行工作，先後任職於計劃處、信貸處、國際業務部，歷任副處長、處長。1991 年 6 月至 1993 年 9 月，任中國建設銀行倫敦代表處首席代表。1993 年 9 月至 1994 年 7 月，任中國建設銀行紐約代表處首席代表。1994 年 7 月至 1999 年 3 月，在中國建設銀行總行工作，歷任國際部副總經理、資金計劃部總經理、會計部總經理。1999 年 3 月至 2010 年 1 月，在中國國際金融有限公司工作，歷任財務總監、公司管委會成員、顧問。2010 年 4 月至 2012 年 3 月，任漢石投資管理有限公司（香港）董事總經理。2013 年 8 月至 2016 年 1 月，任中金基金管理有限公司獨立董事。2017 年 3 月起任公司獨立董事。

吳群，獨立董事，博士研究生，高級會計師。1986 年 6 月至 1999 年 1 月在中國財政研究院研究生部（原財政部財政研究所研究生部）工作，歷任講師、副研究員、副主任、主任。1991 年起聘任中國財政研究院研究生部碩士生導師。1999 年 1 月至 2003 年 6 月在滬江德勤北京分所工作，歷任技術部/企業風險管理部高級經理、總監，管理諮詢部總監。2003 年 6 月至 2005 年 11 月，在中國電子產業工程有限公司工作，擔任財務部總經理。2005 年 11 月至 2016 年 7 月在中國電子信息產業集團有限公司工作（簡稱“CEC”），歷任審計部副主任、資產部副主任（主持工作）、主任。2014 年 9 月至 2016 年 7 月任中國上市公司協會軍工委副會長，2016 年 8 月至 2018 年 1 月任中國上市公司協會軍工委顧問。2012 年 3 月至 2016 年 7 月，擔任中國電子信息產業集團有限公司總經濟師。在 CEC 工作期間，至 2016 年 11 月，在中國電子信息產業集團有限公司所投資的境內外多個公司擔任董事、監事。2017 年 5 月至 2021 年 6 月任首約科技（北京）有限公司獨立董事。2020 年 8 月起任中國船舶重工集團海洋防務與信息對抗股份有限公司獨立董事。2017 年 10 月起任公司獨立董事。

馮麗英，獨立董事，大學本科，高級經濟師。1984 年 9 月至 1987 年 6 月，任北京第二輕工業總公司科員。1987 年 7 月至 1998 年 9 月，歷任中國建設銀行人事部勞動工資處副處長、處長。1998 年 9 月至 1999 年 9 月，任中國國際金融有限責任公司人力資源部高級經理。1999 年 9 月至 2005 年 9 月，任中國信達資產管理有限公司人力資源部副總經理（總經理級）。期間兼任中國耀華浮華玻璃

有限責任公司副董事長，中國宏源證券公司監事長。2005 年 9 月至 2011 年 2 月，任中國建設銀行總行人力資源部副總經理（總經理級）。期間兼任建信基金管理有限公司監事長。2011 年 2 月至 2015 年 11 月，任中國建設銀行養老金業務部總經理。2015 年 11 月至 2019 年 7 月，任建信養老金管理有限責任公司總裁。2020 年 12 月起任公司董事。

2、監事會成員

楊光琰，監事會主席，碩士研究生。1993 年 7 月至 1995 年 9 月在建設銀行咸陽市分行房地產信貸部擔任科員，1998 年 7 月至 2002 年 4 月在北京競天公誠律師事務所擔任律師，2002 年 4 月至 2007 年 4 月在北京未名律師事務所擔任合夥人，2007 年 4 月至 2012 年 10 月在中國建銀投資有限責任公司先後擔任法律部高級副經理、高級經理、項目法務組負責人、法律二組負責人，2012 年 10 月至 2013 年 2 月在建投投資有限責任公司擔任公司黨委委員、副總經理，2013 年 2 月至 2020 年 4 月在中國投資諮詢有限責任公司擔任公司副總經理，2020 年 4 月至 2022 年 7 月在中國建銀投資有限責任公司先後擔任法律合規部副總經理、法律合規部總經理。2022 年 6 月起任公司紀委書記，2022 年 8 月起任公司監事會主席。

馮一夫，監事，碩士研究生。2009 年 2 月至 2017 年 10 月，任安盛德國投資分析師。2017 年 10 月至 2022 年 7 月，任安盛亞洲及香港投資主管。2022 年 7 月至今，任忠利亞洲首席投資官。2023 年 4 月起任公司監事。

李箐，監事，研究生。1997 年 7 月至 1997 年 8 月，中國電力信託投資有限公司資金部員工。1997 年 8 月至 1999 年 7 月，中電信實業開發總公司財務部員工。1999 年 7 月至 1999 年 12 月，中國電力信託投資有限公司財務部員工。2000 年 1 月起，在中國電力財務有限公司工作，歷任財務部處長、主任助理、主任會計師、副主任、主任，現任審計部主任。2020 年 12 月起任公司監事。

鄧時鋒，監事，碩士研究生。曾任職於天同證券。2001 年 9 月加盟國泰基金管理有限公司，歷任行業研究員、基金經理助理，2008 年 4 月至 2018 年 3 月任國泰金鼎價值精選混合型證券投資基金的基金經理，2009 年 5 月至 2018 年 3 月任國泰區位優勢混合型證券投資基金（原國泰區位優勢股票型證券投資基金）的基金經理，2013 年 9 月至 2015 年 3 月任國泰估值優勢股票型證券投資基金

（LOF）的基金经理，2015年9月至2018年3月任国泰央企改革股票型证券投资基金的基金经理，2019年7月至2020年7月任国泰民安养老目标日期2040三年持有期混合型基金中基金（FOF）的基金经理，2021年9月起任国泰国策驱动灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年7月至2019年3月任投资总监（权益），2019年4月至2020年7月任投资总监（FOF），2020年8月起任投资总监（权益）。2015年8月起任公司职工监事。

吴洪涛，监事，大学本科。曾任职于恒生电子股份有限公司。2003年7月至2008年2月，任金鹰基金管理有限公司运作保障部经理。2008年2月加入国泰基金管理有限公司，历任信息技术部工程师、运营管理部总监助理、运营管理部副总监，现任运营管理部总监。2019年5月起任公司职工监事。

宋凯，监事，大学本科。2008年9月至2012年11月，任毕马威华振会计师事务所上海分所助理经理。2012年11月加入国泰基金管理有限公司，历任审计部总监助理、纪检监察室副主任、审计部总监，现任风险管理部总监。2017年3月起任公司职工监事。

3、高级管理人员

周向勇，总经理，简历情况见董事会成员介绍。

张玮，硕士研究生，23年金融从业经历。2000年至2004年，在申银万国证券研究所任分析师。2004年至2007年，在银河基金管理有限公司历任高级研究员、基金经理。2007年至2015年在国泰基金管理有限公司历任基金经理、研究部总监、权益投资总监等职务。2015年至2019年2月在敦和资产管理有限公司任董事总经理。2019年2月加入国泰基金管理有限公司，任公司总经理助理，2021年3月起担任公司副总经理。

封雪梅，硕士研究生，25年金融从业经历。1998年8月至2001年4月任职于中国工商银行北京分行营业部；2001年5月至2006年2月任职于大成基金管理有限公司，任高级产品经理；2006年3月至2014年12月任职于信达澳银基金管理有限公司，历任市场总监、北京分公司总经理、总经理助理；2015年1月至2018年7月任职于国寿安保基金管理有限公司，任总经理助理；2018年7月加入国泰基金管理有限公司，担任公司副总经理。

倪莹，硕士研究生，22年金融从业经历。曾任新晨信息技术有限责任公司

项目经理；2001年3月加入国泰基金管理有限公司，历任信息技术部总监、信息技术部兼运营管理部总监、公司总经理助理，2019年6月起担任公司首席信息官。

刘国华，博士研究生，29年金融从业经历。曾任职于山东省国际信托投资公司、万家基金管理有限公司；2008年4月加入国泰基金管理有限公司，先后担任产品规划部总监、公司首席产品官、公司首席风险官，2019年3月起担任公司督察长。

4、本基金基金经理

樊利安，硕士，17年证券基金从业经历。曾任职上海鑫地投资管理有限公司、天治基金管理有限公司等。2010年7月加入国泰基金，历任研究员、基金经理助理。2014年10月起任国泰民益灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（原国泰淘新灵活配置混合型证券投资基金）和国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2015年1月至2018年8月任国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2015年3月至2019年1月任国泰国策驱动灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2015年5月至2020年5月任国泰兴益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2015年6月至2019年12月任国泰睿吉灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2015年6月至2018年2月任国泰生益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2015年6月至2017年1月任国泰金泰平衡混合型证券投资基金（由金泰证券投资基金转型而来）的基金经理，2016年5月至2017年11月任国泰融丰定增灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2016年8月至2018年8月任国泰添益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2016年10月至2018年4月任国泰福益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2016年11月至2018年12月任国泰鸿益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2016年12月至2019年12月任国泰普益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2016年12月至2020年5月任国泰安益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2016年12月至2018年3月任国泰鑫益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2016年12月至2018年5月任国泰泽益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2016年12月至2018年6月任国泰景益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2016年12月至2018年8月任国泰信益灵活配

置混合型证券投资基金的基金经理，2016年12月至2018年9月任国泰丰益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017年3月至2018年5月任国泰嘉益灵活配置混合型证券投资基金、国泰众益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017年3月至2018年9月任国泰融信定增灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017年7月至2018年11月任国泰融安多策略灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017年7月至2018年9月任国泰稳益定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017年8月至2018年9月任国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017年11月起兼任国泰融丰外延增长灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（由国泰融丰定增灵活配置混合型证券投资基金转换而来）的基金经理，2018年1月至2018年5月任国泰瑞益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2018年1月至2018年8月任国泰恒益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2018年9月至2020年8月任国泰融信灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（由国泰融信定增灵活配置混合型证券投资基金转换而来）的基金经理，2019年5月至2020年6月任国泰多策略收益灵活配置混合型证券投资基金和国泰民福策略价值灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2019年8月至2020年10月任国泰民利策略收益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2020年6月起兼任国泰宏益一年持有期混合型证券投资基金的基金经理，2020年8月至2022年2月任国泰浩益18个月封闭运作混合型证券投资基金的基金经理，2021年4月起兼任国泰同益18个月持有期混合型证券投资基金的基金经理，2022年2月起兼任国泰浩益混合型证券投资基金（由国泰浩益18个月封闭运作混合型证券投资基金变更而来）和国泰科创板两年定期开放混合型证券投资基金的基金经理，2023年1月起兼任国泰安瓊债券型证券投资基金的基金经理，2023年8月起兼任国泰慧益一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。2015年5月至2016年1月任研究部副总监，2016年1月至2018年7月任研究部副总监（主持工作），2018年7月至2019年7月任研究部总监。

5、投资决策委员会

本基金管理人设有公司投资决策委员会，其成员在公司高级管理人员、投研部门负责人及业务骨干等相关人员中产生。公司总经理可以推荐上述人员以外的

投資管理相關人員擔任成員，督察長和運營體系負責人列席公司投資決策委員會會議。公司投資決策委員會主要職責是根據有關法規和基金合同，審議並決策公司投資研究部門提出的公司整體投資策略、基金大類資產配置原則，以及研究相關投資部門提出的重大投資建議等。

投資決策委員會成員組成如下：

主任委員：

周向勇：總經理

執行委員：

張瑋：副總經理

委員：

胡松：投資總監（養老金）、養老金及專戶投資部總監

索峰：投資總監（固收）、絕對收益投資部總監

梁杏：量化投資部總監

鄭有為：研究部副總監

6、上述成員之間均不存在近親屬或家屬關係。

三、基金管理人職責

1、依法募集資金，辦理或者委託經中國證監會認定的其他機構代為辦理基金份額的發售、申購、贖回和登記事宜；

2、辦理基金備案手續；

3、對所管理的不同基金財產分別管理、分別記賬，進行證券投資；

4、按照基金合同的約定確定基金收益分配方案，及時向基金份額持有人分配收益；

5、進行基金會計核算並編制基金財務會計報告；

6、編制季度、中期報告和年度報告；

7、計算並公告基金淨值信息，確定基金份額申購、贖回價格；

8、辦理與基金財產管理業務活動有關的信息披露事項；

9、按照規定召集基金份額持有人大會或配合基金託管人、基金份額持有人依法召集基金份額持有人大會；

10、保存基金財產管理業務活動的記錄、賬冊、報表和其他相關資料；

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

12、有关法律、法规和中国证监会规定的其他职责。

四、基金管理人承诺

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《基金法》的行为，并承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止下列行为发生：

- （1）将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
- （2）不公平地对待其管理的不同基金财产；
- （3）利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人谋取利益；
- （4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- （5）法律法规或中国证监会禁止的其他行为。

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

- （1）越权或违规经营；
- （2）违反基金合同或托管协议；
- （3）故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益；
- （4）在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；
- （5）拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
- （6）玩忽职守、滥用职权，不按照规定履行职责；
- （7）违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

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

- （9）贬损同行，以抬高自己；

- (10) 以不正當手段謀求業務發展；
- (11) 有悖社會公德，損害證券投資基金人員形象；
- (12) 在公開信息披露和廣告中故意含有虛假、誤導、欺詐成分；
- (13) 其他法律、行政法規以及中國證監會禁止的行為。

4、基金管理人承諾嚴格遵守基金合同的規定，並承諾建立健全內部控制制度，採取有效措施，防止違反基金合同行為的發生。

5、基金管理人承諾不從事其他法規規定禁止從事的行為。

五、基金經理承諾

1、依照有關法律法規和基金合同的規定，本着謹慎的原則為基金份額持有人謀取最大利益；

2、不利用職務之便為自己、受僱人或任何第三者謀取利益；

3、不洩露在任職期間知悉的有關證券、基金的商業秘密，尚未依法公開的基金投資內容、基金投資計劃等信息，且不利用該信息從事或者明示、暗示他人從事相關的交易所活動；

4、不以任何形式為其他組織或個人進行證券交易。

六、基金管理人內部控制制度

基金管理人為防范和化解經營運作中面臨的風險，保證經營活動的合法合規和有效開展，制定了一系列組織機制、管理方法、操作程序與控制措施，形成了公司完整的內部控制體系，並通過相應的具體業務控制流程來嚴格實施。

1、內部控制制度概述

為保證內部控制的系統性和有效性，公司制定了合理、完備、有效、可執行的規章制度體系並結合業務發展、法律法規及監管環境變化，對內部控制制度進行及時的更新和調整，以適應公司經營活動的變化，不斷增強和優化公司制度的完備性、有效性和適時性。

2、內部控制的目标

- (1) 保證公司經營運作合法合規，形成守法經營、規範運作的經營理念；
- (2) 防范和化解風險，提高經營管理效益，確保公司經營的穩健運行和受託資產的安全完整，實現公司持續、穩定、健康發展；
- (3) 確保受託資產、公司財務和其他信息的真實、準確、完整、及時；

（4）维护公司良好的品牌形象。

3、内部控制的原则

（1）全面性原则。内部控制应覆盖公司的各项业务、所有部门和岗位，渗透到决策、执行、监督、反馈等所有业务过程和业务环节。

（2）有效性原则。建立科学、合理、有效的内部控制制度，公司全体员工必须竭力维护内部控制制度的有效执行。

（3）相互独立和制约原则。公司根据业务的需要设立相对独立的机构、部门和岗位，公司内部部门和岗位的设置必须权责分明、相互制约。内部控制的检查评价部门必须独立于各业务执行部门。公司受托资产、自有资产、其他资产的运作必须分离。

（4）适应性原则。公司内部控制应根据公司经营业务发展、新产品的开发、金融创新、法律法规以及市场环境的变化等及时调整和完善，以保证内部控制的有效性和适应性。

（5）防火墙原则。公司各个业务部门，特别是研究、投资、执行、清算等部门和岗位必须在物理上和制度上隔离，对重要业务设立防火墙并实行门禁制度。

（6）成本效益原则。公司运用科学化的经营管理方法降低运作成本，提高经济效益，力争以合理的控制成本达到最佳的内控效果。

4、内部控制的措施

（1）公司经过多年的管理实践，建立并完善了科学的治理结构，充分发挥独立董事和监事会的监督职能，并在员工中加强职业道德教育和风险观念，形成了诚信为本和稳健经营的企业文化。公司董事会对内部控制原则进行指导，对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任；公司经营管理层对内部控制进行管理、实施组织与决策；公司各部门之间有明确的授权分工和风险控制责任，既相互独立，又相互合作和制约，形成了合理的组织结构、决策授权和风险控制体系。

（2）公司依据自身经营特点建立了包括各岗位以目标责任制自控、相关部门和岗位之间相互制衡、内控检查评价部门实施监督的、权责统一、严密有效的内控防线。

（3）公司建立有效的人力资源管理制度，健全激励约束机制，确保公司人

员具备与岗位要求相适应的职业操守和专业能力。

（4）公司建立科学严密的风险评估体系，从总体上明确风险管理的目标和原则，并对公司面临的内外部风险进行辨识和评估，不断优化风险控制程序 and 手段。各部门根据各自业务特点，对业务活动中存在的风险点进行揭示和梳理，有针对性地建立详细的风险控制流程，并在实际业务中加以控制。

（5）公司建立了完善的授权管理机制，明确了合理的授权标准和流程，确保授权机制的贯彻执行。

（6）公司建立了完善的内部会计控制，公司会计核算与基金会计核算在业务规范、人员岗位和办公区域上进行严格区分，确保基金资产与公司自有资产完全分开，分账管理，独立核算。

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

（8）公司建立重大风险应急处置机制，制订切实有效的应急应变措施，按照预案妥善处理。

（9）公司建立有效的信息交流渠道和沟通机制，明确报告机制路径和业务汇报体系，保证业务信息在既定路径高效、有序、准确、完整传递，实现自下而上的及时报告和自上而下的有效反馈。

（10）公司通过建立完整的研究管理、投资决策和交易管理等制度体系，以实现投资管理业务控制。

（11）公司制定规范的信息披露管理办法，不断优化完善机制流程，确保公开披露信息的真实、准确、完整、及时。

（12）公司对内部控制建立与实施情况进行监督检查，评价内部控制的有效性，发现内部控制缺陷，及时加以改进，内控检查评价部门通过定期或不定期检查内部控制制度的执行情况，确保公司各项经营管理活动的有效运行。

5、基金管理人内部控制制度声明书

基金管理人保证以上关于内部控制制度的披露真实、准确，并承诺基金管理人将根据市场变化和业务发展不断完善内部控制制度，切实维护基金份额持有人的合法权益。

第四部分 基金托管人

一、基金托管人情况

1、基本情况

名称：平安银行股份有限公司

注册住所：广东省深圳市罗湖区深南东路5047号

办公地址：广东省深圳市福田区益田路5023号平安金融中心B座26楼

法定代表人：谢永林

成立日期：1987年12月22日

组织形式：股份有限公司

注册资本：19,405,918,198元

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监许可[2008]1037号

联系人：黄然然

联系电话：0755-25879876

2、平安银行基本情况

平安银行股份有限公司是一家总部设在深圳的全国性股份制商业银行（深圳证券交易所简称：平安银行，证券代码000001）。其前身是深圳发展银行股份有限公司，于2012年6月吸收合并原平安银行并于同年7月更名为平安银行。中国平安保险（集团）股份有限公司及其子公司合计持有平安银行58%的股份，为平安银行的控股股东。截至2023年6月末，平安银行有109家分行（含香港分行），共1,205家营业机构。

2023年1-6月，平安银行实现营业收入886.10亿元（同比增长3.7%）、净利润253.87亿元（同比增长14.9%）、资产总额55,005.24亿元（较上年末增长3.4%）、吸收存款本金余额33,815.34亿元（较上年末增长2.1%）、发放贷款和垫款总额34,391.31亿元（较上年末增长3.3%）。

3、主要人员情况

平安银行总行设资产托管事业部，下设客群拓展处、营销推动处、估值核算室、资金清算室、转型发展处、数字平台室、督察合规室、基金服务中心8个处

室，目前部門人員為78人，為客戶提供專業化的託管服務。證券投資基金託管業務相關員工配置齊全且從業經驗豐富，託管部核心管理層具備銀行管理、證券或託管業務十年以上從業經驗。

4、基金託管業務經營情況

2008年8月15日獲得中國證監會、銀監會核准開辦證券投資基金託管業務。截至2023年6月末，平安銀行股份有限公司託管證券投資基金淨值規模合計6,974億，平安銀行已託管274只證券投資基金，覆蓋了股票型、債券型、混合型、貨幣型、指數型、FOF 等多種類型的基金，滿足了不同客戶多元化的投資理財需求。

二、基金託管人的內部風險控制制度說明

1、內部控制目標

作為基金託管人，平安銀行股份有限公司嚴格遵守國家有關託管業務的法律法規、行業監管要求，自覺形成守法經營、規範運作的經營理念和經營風格；確保基金財產的安全完整，確保有關信息的真實、準確、完整、及時，保護基金份額持有人的合法權益；確保內部控制和風險管理體系的有效性；防範和化解經營風險，確保業務的安全、穩健運行，促進經營目標的實現。

2、內部控制組織結構

平安銀行股份有限公司設有總行獨立一級部門資產託管事業部，是全行資產託管業務的管理和運營部門，專門配備了專職內部監察稽核人員負責託管業務的內部控制和風險管理工作，具有獨立行使監督稽核工作的職權和能力。

3、內部控制制度及措施

資產託管事業部具備系統、完善的制度控制體系，建立了管理制度、控制制度、崗位職責、業務操作流程，可以保證託管業務的規範操作和順利進行；取得基金從業資格的人員符合監管要求；業務管理嚴格實行複核、審核、檢查制度，授權工作實行集中控制，業務印章按規程保管、存放、使用，賬戶資料嚴格保管，制約機制嚴格有效；業務操作區專門設置，封閉管理，實施音像監控；業務信息由專職信息披露人負責，防止泄密；業務實現自動化操作，防止人為事故的发生，技術系統完整、獨立。

三、基金託管人對基金管理人運作基金進行監督的方法和程序

1、監督方法

依照《基金法》及其配套法規和基金合同的約定，監督所托管基金的投资運作。利用行業普遍使用的“資產托管業務系統——監控子系統”，嚴格按照現行法律法規以及基金合同規定，對基金管理人運作基金的投资比例、投資範圍、投資組合等情況進行監督，並定期編寫基金投資運作監督報告，報送中國證監會。在日常為基金投資運作所提供的基金清算和核算服務環節中，對基金管理人發送的投资指令、基金管理人對各基金費用的提取與開支情況進行檢查監督。

2、監督流程

（1）每工作日按時通過監控子系統，對各基金投資運作比例控制指標進行例行監控，發現投資比例超標等異常情況，向基金管理人發出書面通知，與基金管理人進行情況核實，督促其糾正，並及時報告中國證監會。

（2）收到基金管理人的投資指令後，對涉及各基金的投资範圍、投資對象及交易對手等內容進行合法合規性監督。

（3）根據基金投資運作監督情況，定期編寫基金投資運作監督報告，對各基金投資運作的合法合規性、投資獨立性和風格顯著性等方面進行評價，報送中國證監會。

（4）通過技術或非技術手段發現基金涉嫌違規交易，電話或書面要求管理人進行解釋或舉證，並及時報告中國證監會。

第五部分 相关服务机构

一、基金份额销售机构

1、直销机构

序号	机构名称	机构信息	
1	国泰基金管理有限公司直销柜台	地址：上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层-19层	
		客户服务专线：400-888-8688，021-31089000	
		传真：021-31081861	网址：www.gtfund.com
2	国泰基金电子交易平台	电子交易网站：www.gtfund.com 登录网上交易页面 智能手机APP平台：iPhone交易客户端、Android交易客户端、“国泰基金”微信交易平台	
		电话：021-31089000	联系人：赵刚

2、其他销售机构

本基金的其他销售机构信息详见基金管理人网站。基金管理人可根据有关法律法规规定，增减或变更销售机构，并在基金管理人网站上公示。

二、登记机构

名称：国泰基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区浦东大道1200号2层225室

办公地址：上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层-19层

法定代表人：邱军

联系人：辛怡

传真：021-31081800

客户服务专线：400-888-8688，021-31089000

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

住所：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

办公地址：上海市银城中路68号时代金融中心18楼至20楼

负责人：韩炯

联系电话：021-31358666

傳真：021-31358600

經辦律師：黎明、丁媛

聯繫人：丁媛

四、審計基金財產的會計師事務所

名稱：普華永道中天會計師事務所（特殊普通合夥）

住所：中國（上海）自由貿易試驗區陸家嘴環路 1318 號星展銀行大廈 507
單元 01 室

辦公地址：中國上海市浦東新區東育路 588 號前灘中心 42 樓

執行事務合夥人：李丹

聯繫電話：021-23238888

傳真：021-23238800

聯繫人：張曉陽

經辦註冊會計師：張炯、張曉陽

第六部分 基金的募集

一、基金募集的依据

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定，并经中国证监会证监许可【2022】1623 号文《关于准予国泰安瓊债券型证券投资基金注册的批复》准予注册募集。

二、基金类别、运作方式、存续期限、基金份额类别

- 1、基金类别：债券型证券投资基金
- 2、基金运作方式：契约型开放式
- 3、基金存续期限：不定期
- 4、基金份额类别

本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同类别。在投资人认购/申购基金份额时收取认购/申购费用，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额称为 C 类基金份额。

本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置基金代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值并单独公告。投资人可自行选择认购/申购的基金份额类别。

本基金不同类别基金份额之间暂不开通互相转换业务。如后续开通此项业务的，无需召开基金份额持有人大会审议，但调整前基金管理人需及时公告。

在不违反法律法规、基金合同的约定以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，经与基金托管人协商一致，在履行适当程序后，基金管理人可增加或调整基金份额类别设置、停止现有基金份额类别的销售、对基金份额分类办法及规则进行调整等，调整实施前需依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告，不需要召开基金份额持有人大会。

三、基金份额的发售时间、发售方式、发售对象

1、发售时间

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

2、发售方式

本基金的发售将通过销售机构公开发售。具体的销售机构详见基金份额发售公告、基金管理人网站或其他相关文件，基金管理人可根据情况变更或增减销售机构。

3、发售对象

符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、合格境外投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。

四、最低募集份额总额

本基金的最低募集份额总额为 2 亿份。

五、基金份额的发售面值、认购价格及计算公式、认购费用

1、本基金的基金份额发售面值为人民币 1.00 元。

2、认购费用

本基金分为 A 类和 C 类基金份额。投资人在认购 A 类基金份额时支付认购费用，认购 C 类基金份额不支付认购费用，而是从该类别基金资产中计提销售服务费。

募集期内投资人可多次认购本基金，A 类基金份额的认购费用按每笔认购申请单独计算。

本基金 A 类基金份额的认购费率如下：

认购金额（M）	认购费率
M < 100 万元	0.60%
100 万元 ≤ M < 500 万元	0.40%
M ≥ 500 万元	按笔收取，1000 元/笔

A 类基金份额的基金认购费用应在投资人认购 A 类基金份额时收取，基金认购费用不列入基金财产，主要用于基金的市场推广、销售、登记等募集期间发生的各项费用。

3、基金认购份额的计算

本基金采用金额认购的方式。

（1）认购本基金 A 类基金份额的计算公式

认购金额包括认购费用和净认购金额。

當認購費用適用比例費率時，計算公式為：

淨認購金額 = 認購金額 / (1 + 認購費率)

認購費用 = 認購金額 - 淨認購金額

認購份額 = (淨認購金額 + 認購資金利息) / 基金份額發售面值

當認購費用為固定金額時，計算公式為：

認購費用 = 固定金額

淨認購金額 = 認購金額 - 認購費用

認購份額 = (淨認購金額 + 認購資金利息) / 基金份額發售面值

(2) 認購本基金 C 類基金份額的計算公式

本基金 C 類基金份額不收取認購費用。

認購份額 = (認購金額 + 認購資金利息) / 基金份額發售面值

(3) 認購份額餘額的處理方式

認購份額的計算保留到小數點後 2 位，小數點 2 位以後的部分四舍五入，由此誤差產生的收益或損失由基金財產承擔。

例一：某投資人投資 10,000.00 元認購本基金 A 類基金份額，認購費率為 0.60%，假定募集期間認購資金所得利息為 3.00 元，則根據公式計算出：

淨認購金額 = 10,000.00 / (1 + 0.60%) = 9,940.36 元

認購費用 = 10,000.00 - 9,940.36 = 59.64 元

認購份額 = (9,940.36 + 3.00) / 1.00 = 9,943.36 份

即：投資人投資 10,000.00 元認購本基金 A 類基金份額，假定認購資金利息為 3.00 元，則可得到 9,943.36 份 A 類基金份額。

例二：某投資人投資 10,000.00 元認購本基金 C 類基金份額，無認購費用，假定募集期間認購資金所得利息為 3.00 元，則根據公式計算出：

認購份額 = (10,000.00 + 3.00) / 1.00 = 10,003.00 份

即：投資人投資 10,000.00 元認購本基金 C 類基金份額，假定認購資金利息為 3.00 元，則可得到 10,003.00 份 C 類基金份額。

六、認購安排

1、認購時間

投資人認購本基金份額的具體業務辦理時間由基金管理人和基金銷售機構

確定，請參見本基金的基金份額發售公告或基金銷售機構的相關公告。

2、投資人認購本基金份額應提交的文件和辦理的手續

投資人認購本基金所應提交的文件和具體辦理手續詳見本基金的基金份額發售公告或基金銷售機構的相關業務辦理規則。

3、基金份額的認購採用金額認購方式。投資人認購時，需按銷售機構規定的方式全額繳款。若資金未全額到賬則認購無效，基金管理人將認購無效的款項退回。

4、投資人在募集期內可以多次認購基金份額，A 類基金份額的認購費按每筆認購申請單獨計算。認購一經受理不得撤銷。

5、認購申請的確認

銷售機構對認購申請的受理並不代表該申請一定成功，而僅代表銷售機構確實接收到認購申請。認購的確認以登記機構的確認結果為準。對於認購申請及認購份額的確認情況，投資人應及時查詢並妥善行使合法權利，否則，由此產生的投資人任何損失由投資人自行承擔。

6、認購金額的限制

投資人單筆最低認購金額為 1.00 元（含認購費）。各銷售機構對本基金最低認購金額及交易級差有其他規定的，以各銷售機構的業務規定為準。

基金管理人可以對募集期間的單個投資人的累計認購金額進行限制，具體限制和處理方法參見基金份額發售公告或相關公告。

七、募集期利息的處理方式

有效認購款項在募集期間產生的利息將折算為基金份額歸基金份額持有人所有，其中利息轉份額以登記機構的記錄為準。

八、基金募集期間募集的資金應當存入專門賬戶，在基金募集行為結束前，任何人不得動用。

第七部分 基金合同的生效

一、基金合同的生效

本基金基金合同于 2023 年 1 月 17 日正式生效。自基金合同生效日起，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，基金管理人应当在 10 个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并在 6 个月内召集基金份额持有人大会。

法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

第八部分 基金份額的申購與贖回

一、申購和贖回場所

本基金的申購與贖回將通過銷售機構進行。具體的銷售機構詳見基金管理人網站或其他相關文件，基金管理人可根據情況變更或增減銷售機構。若基金管理人或其指定的銷售機構開通電話、傳真或網上等交易方式，基金投資者可以通過上述方式進行申購與贖回，具體參見各銷售機構的相關公告。基金投資者應當在銷售機構辦理基金銷售業務的營業場所或按銷售機構提供的其他方式辦理基金份額的申購與贖回。

二、申購和贖回的開放日及時間

1、開放日及開放時間

投資人在開放日辦理基金份額的申購和贖回，具體辦理時間為上海證券交易所、深圳證券交易所的正常交易日的交易時間（若該工作日為非港股通交易日，則基金管理人有权暫停辦理基金份額的申購和贖回業務），但基金管理人根據法律法規、中國證監會的要求或基金合同的規定公告暫停申購、贖回時除外。

基金合同生效後，若出現新的證券/期貨交易市場、證券/期貨交易所交易時間變更或其他特殊情況，基金管理人將視情況對前述開放日及開放時間進行相應的調整，但應在實施日前依照《信息披露辦法》的有關規定在規定媒介上公告。

2、申購、贖回開始日及業務辦理時間

本基金已于 2023 年 2 月 17 日起開始辦理日常申購、贖回業務。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者時間辦理基金份額的申購、贖回或者轉換。投資人在基金合同约定之外的日期和時間提出申購、贖回或轉換申請且登記機構確認接受的，其基金份額申購、贖回或轉換價格為下一開放日基金份額申購、贖回或轉換的價格。

三、申購與贖回的原則

1、“未知價”原則，即申購、贖回價格以申請當日收市後計算的該類基金份額淨值為基準進行計算；

2、“金額申購、份額贖回”原則，即申購以金額申請，贖回以份額申請；

3、當日的申購與贖回申請可以在基金管理人規定的時間以內撤銷；

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、申购与赎回的程序

1、申购和赎回的申请方式

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

2、申购和赎回的款项支付

投资人申购基金份额时，必须全额交付申购款项，投资人交付申购款项，申购成立；基金份额登记机构确认基金份额时，申购生效。若资金在规定时间内未全额到账则申购不成立，申购款项将退回投资人账户，基金管理人、基金托管人和销售机构等不承担由此产生的利息等任何损失。

基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；基金份额登记机构确认赎回时，赎回生效。基金份额持有人赎回申请生效后，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。如遇交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障、港股通交易系统、港股通资金交收规则限制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时，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 日内对该交易的有效性进行确认。T 日提交的有效申请，投资人应在 T+2 日后（包括该日）及时到销售机构柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功，则申购款项退还给投资人。

销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机

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

基金管理人可以在法律法规允许的范围内，依法对上述申购和赎回申请的确认时间进行调整，并必须在调整实施日前按照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

五、申购和赎回的数量限制

1、申购金额的限制

投资人单笔申购的最低金额为 1.00 元（含申购费）。各销售机构对本基金最低申购金额及交易级差有其他规定的，以各销售机构的业务规定为准。

2、赎回份额的限制

基金份额持有人可将其全部或部分基金份额赎回。单笔赎回申请最低份额为 1.00 份，若某基金份额持有人赎回时在销售机构保留的基金份额不足 1.00 份，则该次赎回时必须一起赎回。

3、本基金不对投资人每个基金交易账户的最低基金份额余额进行限制，但各销售机构对基金交易账户最低份额余额有其他规定的，以各销售机构的业务规定为准。

4、基金管理人可以规定单个投资人累计持有的基金份额上限、单日净申购比例上限、单个投资人单日或单笔申购金额上限，具体规定请参见相关公告。

5、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。

6、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》的有关规定在规定媒介上公告。

六、申购和赎回的价格、费用及其用途

1、本基金基金份额分为 A 类和 C 类基金份额。投资人在申购 A 类基金份

额时支付申购费用，申购 C 类基金份额不支付申购费用，而是从该类别基金资产中计提销售服务费。

2、本基金 A 类基金份额的申购费用

申购费用由申购本基金 A 类基金份额的申购人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、登记结算等各项费用。

本基金 A 类基金份额的申购费率具体如下：

申购金额（M）	申购费率
M < 100 万元	0.80%
100 万元 ≤ M < 500 万元	0.60%
M ≥ 500 万元	按笔收取，1000 元/笔

3、赎回费用

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。

（1）本基金 A 类基金份额的赎回费率

本基金 A 类基金份额对持续持有期少于 7 日的基金份额持有人收取的赎回费，将全额计入基金财产；对持续持有期长于或等于 7 日的基金份额持有人收取的赎回费，将不低于赎回费总额的 25% 计入基金财产，赎回费中未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。

本基金 A 类基金份额的赎回费率具体如下：

赎回申请份额持续持有期（Y）	赎回费率
Y < 7 日	1.50%
7 日 ≤ Y < 30 日	0.10%
Y ≥ 30 日	0.00%

（注：赎回份额持续持有期的计算，以该份额在登记机构的登记日开始计算。）

（2）本基金 C 类基金份额的赎回费率

本基金 C 类基金份额对持续持有期少于 7 日的基金份额持有人收取的赎回费，将全额计入基金财产。

本基金 C 类基金份额的赎回费率具体如下：

赎回申请份额持续持有期（Y）	赎回费率
----------------	------

Y < 7 日	1.50%
Y ≥ 7 日	0.00%

（注：赎回份额持续持有期的计算，以该份额在登记机构的登记日开始计算。）

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

5、基金管理人可以在不违背法律法规规定、对基金份额持有人利益无实质性不利影响及不违反基金合同约定的情况下根据市场情况制定基金持续营销计划，定期和不定期地开展基金持续营销活动。在基金持续营销活动期间，基金管理人可以按相关监管部门要求履行必要手续后，对投资人适当调低基金销售费用。

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。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、申购份额和赎回金额的计算

1、申购份额的计算

基金申购采用金额申购的方式。

（1）申购本基金 A 类基金份额的计算公式

基金的申购金额包括申购费用和净申购金额。

当申购费用适用比例费率时，计算公式为：

净申购金额 = 申购金额 / (1 + 申购费率)

申购费用 = 申购金额 - 净申购金额

申购份额 = 净申购金额 / T 日 A 类基金份额净值

当申购费用为固定金额时，计算公式为：

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 / T 日 A 类基金份额净值

（2）申购本基金 C 类基金份额的计算公式

申购份额 = 申购金额 / T 日 C 类基金份额净值

上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或

损失由基金财产承担。

例三：某投资人投资 10,000.00 元申购本基金 A 类基金份额，对应申购费率为 0.80%，假设 T 日本基金 A 类基金份额的基金份额净值为 1.0412 元，则其可得到的申购份额为：

$$\text{净申购金额} = 10,000.00 / (1 + 0.80\%) = 9,920.63 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 10,000.00 - 9,920.63 = 79.37 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 9,920.63 / 1.0412 = 9,528.08 \text{ 份}$$

即：投资人投资 10,000.00 元申购本基金 A 类基金份额，对应申购费率为 0.80%，假设 T 日 A 类基金份额净值为 1.0412 元，则可得到 9,528.08 份 A 类基金份额。

例四：某投资人投资 10,000.00 元申购本基金 C 类基金份额，无申购费用，假设 T 日本基金 C 类基金份额的基金份额净值为 1.0412 元，则其可得到的申购份额为：

$$\text{申购份额} = 10,000.00 / 1.0412 = 9,604.30 \text{ 份}$$

即：投资人投资 10,000.00 元申购本基金 C 类基金份额，无申购费用，假设 T 日 C 类基金份额净值为 1.0412 元，则可得到 9,604.30 份 C 类基金份额。

2、赎回金额的计算

赎回金额的计算方法如下：

$$\text{赎回费用} = \text{赎回份额} \times \text{T 日该类基金份额净值} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{赎回金额} = \text{赎回份额} \times \text{T 日该类基金份额净值} - \text{赎回费用}$$

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

例五：某基金份额持有人赎回 10,000 份本基金 A 类基金份额，假设该份额的持有时间为 10 日，对应的赎回费率为 0.10%，假设 T 日 A 类基金份额净值是 1.0200 元，则其可获得的赎回金额为：

$$\text{赎回费用} = 10,000 \times 1.0200 \times 0.10\% = 10.20 \text{ 元}$$

$$\text{赎回金额} = 10,000 \times 1.0200 - 10.20 = 10,189.80 \text{ 元}$$

即：基金份额持有人赎回 10,000 份本基金 A 类基金份额，假设该份额的持有时间为 10 日、T 日 A 类基金份额净值是 1.0200 元，则其可获得的赎回金额为

10,189.80 元。

例六：某基金份额持有人赎回 10,000 份本基金 C 类基金份额，假设该份额的持有时间为 5 日，对应的赎回费率为 1.50%，假设 T 日 C 类基金份额净值是 1.0192 元，则其可获得的赎回金额为：

$$\text{赎回费用} = 10,000 \times 1.0192 \times 1.50\% = 152.88 \text{ 元}$$

$$\text{赎回金额} = 10,000 \times 1.0192 - 152.88 = 10,039.12 \text{ 元}$$

即：基金份额持有人赎回 10,000 份本基金 C 类基金份额，假设该份额的持有时间为 5 日、T 日 C 类基金份额净值是 1.0192 元，则其可获得的赎回金额为 10,039.12 元。

3、本基金 A 类和 C 类基金份额的基金份额净值的计算，均保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T 日的各类基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，经履行适当程序，可以适当延迟计算或公告。

八、拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

- 1、因不可抗力导致基金无法正常运作。
- 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。
- 3、证券/期货交易所交易时间非正常停市或港股通临时停市，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，或发生其他损害现有基金份额持有人利益的情形。
- 6、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金申购申请。
- 7、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过 50%，或者变相规避 50%集中度的情形。法律法规或中国证监会另有规定的除外。

8、基金管理人、基金托管人、基金銷售機構或登記機構的異常情況導致基金銷售系統、基金登記系統或基金會計系統無法正常运行。

9、申請超過基金管理人設定的基金總規模、單日淨申購比例上限、單個投資人單日或單筆申購金額上限的。

10、港股通交易每日額度不足。

11、法律法規規定或中國證監會認定的其他情形。

發生上述第 1、2、3、5、6、8、10、11 項暫停申購情形之一且基金管理人決定暫停接受投資人申購申請時，基金管理人應當根據有關規定在規定媒介上刊登暫停申購公告。如果投資人的申購申請被拒絕，被拒絕的申購款項將退還給投資人。發生上述第 7、9 項情形時，基金管理人可以採取比例確認等方式對該投資人的申購申請進行限制，基金管理人有权拒絕該等全部或者部分申購申請。在暫停申購的情況消除時，基金管理人應及時恢復申購業務的辦理。

九、暫停贖回或延緩支付贖回款項的情形

發生下列情形時，基金管理人可暫停接受基金份額持有人的贖回申請或延緩支付贖回款項：

1、因不可抗力導致基金管理人不能支付贖回款項。

2、發生基金合同規定的暫停基金資產估值情況時，基金管理人可暫停接受基金份額持有人的贖回申請或延緩支付贖回款項。

3、證券/期貨交易所交易時間非正常停市或港股通臨時停市，導致基金管理人無法計算當日基金資產淨值。

4、連續兩個或兩個以上開放日發生巨額贖回。

5、發生繼續接受贖回申請將損害現有基金份額持有人利益的情形時，基金管理人可暫停接受基金份額持有人的贖回申請。

6、當前一估值日基金資產淨值 50% 以上的資產出現無可參考的活躍市場價格且採用估值技術仍導致公允價值存在重大不確定性時，經與基金托管人協商確認後，基金管理人應當延緩支付贖回款項或暫停接受基金贖回申請。

7、法律法規規定或中國證監會認定的其他情形。

發生上述情形之一且基金管理人決定暫停贖回或延緩支付贖回款項時，基金管理人應及時報中國證監會備案，已確認的贖回申請，基金管理人應足額支付；

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、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）部分延期赎回：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，基金份额持有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该类基金份额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。如基金份额持有人在提交赎回申请时未作明确选择，基金份额持有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，在单个基金份额持有人超过基金总份额 20% 以上的赎回申请的情形下：对于该基金份额持有人当日赎回申请超过上一开放日

基金總份額 20% 以上的部分，基金管理人可以延期辦理贖回申請；對於該基金份額持有人當日贖回申請未超過 20% 的部分，可以根據前段“（1）全額贖回”或“（2）部分延期贖回”的約定方式與其他基金份額持有人的贖回申請一併辦理。延期的贖回申請與下一開放日贖回申請一併處理，無優先權並以下一開放日該類基金份額的基金份額淨值為基礎計算贖回金額，以此類推，直到全部贖回為止。但是，對於未能贖回部分，如該基金份額持有人在提交贖回申請時選擇取消贖回，則其當日未獲受理的部分贖回申請將被撤銷。部分延期贖回不受單筆贖回最低份額的限制。

（4）暫停贖回：連續 2 個開放日以上（含本數）發生巨額贖回，如基金管理人認為有必要，可暫停接受基金的贖回申請；已經接受的贖回申請可以延緩支付贖回款項，但不得超過 20 個工作日，並應當在規定媒介上進行公告。

3、巨額贖回的公告

當發生上述巨額贖回並延期辦理時，基金管理人應當通過郵寄、傳真或者基金管理人網站等方式在 3 個交易日內通知基金份額持有人，說明有關處理方法，並在 2 日內在規定媒介上刊登公告。

十一、暫停申購或贖回的公告和重新開放申購或贖回的公告

1、發生上述暫停申購或贖回情況的，基金管理人應在規定期限內在規定媒介上刊登暫停公告。

2、如發生暫停的時間為 1 日，基金管理人應於重新開放日，在規定媒介上刊登基金重新開放申購或贖回公告，並公布最近 1 個開放日各類基金份額的基金份額淨值。

3、如發生暫停的時間超過 1 日，基金管理人可以根據暫停申購或贖回的時間，依照《信息披露辦法》的有關規定，最遲於重新開放日在規定媒介上刊登重新開放申購或贖回的公告；也可以根據實際情況在暫停公告中明確重新開放申購或贖回的時間，屆時不再另行發布重新開放的公告。

十二、基金轉換

基金管理人可以根據相關法律法規以及基金合同的規定決定開辦本基金與基金管理人管理的其他基金之間的轉換業務，基金轉換可以收取一定的轉換費，相關規則由基金管理人屆時根據相關法律法規及基金合同的規定制定並公告，並

提前告知基金托管人与相关机构。

十三、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。

十四、基金的非交易过户

基金的非交易过户是指基金登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及登记机构认可、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。

十五、基金的转托管

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

十六、定期定额投资计划

基金管理人可以为投资人办理定期定额投资计划，具体规则由基金管理人另行规定。投资人在办理定期定额投资计划时可自行约定每期申购金额，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。

十七、基金份额的冻结和解冻

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

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。

十八、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，本基金的申购与赎回安排详见招募说明书“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

在注重风险和流动性管理的前提下，力争获取超越业绩比较基准的投资收益。

二、投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债、政府支持机构债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、短期融资券、超短期融资券）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、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的相关规定。

基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%；投资于股票、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券的比例合计不超过基金资产的20%（其中港股通标的股票投资比例不超过全部股票资产的50%）；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或变更投资比例限制，基金管理人可在履行适当程序后，可以相应调整本基金的投资范围和投资比例规定。

三、投资策略

1、资产配置策略

本基金将及时跟踪市场环境变化，根据宏观经济运行态势、宏观经济政策变化、证券市场运行状况、国际市场变化情况等因素的深入研究，判断证券市场的发展趋势，综合评价各类资产的风险收益水平，制定债券、股票、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。

2、债券投资策略

本基金在债券投资中将根据对经济周期和市场环境的把握，基于对财政政策、

货币政策的深入分析以及对宏观经济的持续跟踪，灵活运用久期策略、收益率曲线策略、类属配置策略、利率品种投资策略、信用债投资策略、可转换债券和可交换债券投资策略等多种投资策略，构建债券资产组合，并根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预测，动态的对债券投资组合进行调整。

（1）久期策略

本基金将基于对宏观经济政策的分析，积极地预测未来利率变化趋势，并根据预测确定相应的久期目标，调整债券组合的久期配置，以达到提高债券组合收益、降低债券组合利率风险的目的。当预期市场利率水平将上升时，本基金将适当降低组合久期；而预期市场利率将下降时，则适当提高组合久期。在确定债券组合久期的过程中，本基金将在判断市场利率波动趋势的基础上，根据债券市场收益率曲线的当前形态，通过合理假设下的情景分析和压力测试，最后确定最优的债券组合久期。

（2）收益率曲线策略

在组合的久期配置确定以后，本基金将通过对收益率曲线的研究，分析和预测收益率曲线可能发生的形状变化，采用子弹型策略、哑铃型策略或梯形策略，在长期、中期和短期债券间进行配置，以从长、中、短期债券的相对价格变化中获利。

（3）类属配置策略

本基金对不同类型债券的信用风险、税负水平、市场流动性、市场风险等因素进行分析，研究同期限的国债、金融债、企业债、交易所和银行间市场投资品种的利差和变化趋势，制定债券类属配置策略，以获取不同债券类属之间利差变化所带来的投资收益。

（4）利率品种投资策略

本基金对国债、央行票据等利率品种的投资，是在对国内、国外经济趋势进行分析和预测基础上，运用数量方法对利率期限结构变化趋势和债券市场供求关系变化进行分析和预测，深入分析利率品种的收益和风险，并据此调整债券组合的平均久期。在确定组合平均久期后，本基金对债券的期限结构进行分析，运用统计和数量分析技术，选择合适的期限结构的配置策略，在合理控制风险的前提下，综合考虑组合的流动性，决定投资品种。

（5）信用债投资策略

本基金将通过分析宏观经济周期、市场资金结构和流向、信用利差的历史水平等因素，判断当前信用债市场信用利差的合理性、相对投资价值和风险以及信用利差曲线的未来走势，确定信用债券的配置。

本基金如投资于信用债（含资产支持证券，下同），应当遵守下列要求：

本基金投资于 AAA 信用评级的信用债比例不低于信用债资产的 50%，投资于 AA+信用评级的信用债比例不超过信用债资产的 50%，本基金不投资于信用评级为 AA+级以下（不含 AA+级）的信用债。

本基金对信用债评级的认定参照基金管理人选定的评级机构出具的信用评级。本基金投资的短期融资券、超短期融资券的信用评级参照评级机构出具的主体信用评级；其他信用债的信用评级参照评级机构出具的债项信用评级，无债项信用评级的参照主体信用评级。

（6）可转换债券和可交换债券投资策略

可转换债券和可交换债券兼具权益类证券与固定收益类证券的特性，具有抵御下行风险、获取股票价格上涨收益的特点。本基金在对可转换债券和可交换债券条款和标的公司基本面进行深入分析研究的基础上，利用定价模型进行估值分析，投资具有较高安全边际和良好流动性的可转换债券和可交换债券。

3、股票投资策略

本基金以基本面分析为基础，采用自下而上的分析方法，主要从公司的盈利能力、自由现金流状况、估值水平、行业地位等角度，同时结合事件驱动分析策略，综合评价个股的投资价值，选择估值合理、安全边际较高的个股进行投资。

（1）价值投资策略

价值投资策略是通过寻找价值被低估的股票进行投资。本基金将根据不同行业特征和市场特征，综合运用市盈率（P/E）、市净率（P/B）、市销率（P/S）、（P/E）/G、EV/EBITDA 和自由现金流折现等估值指标，精选价值被低估的行业龙头公司进行投资。

（2）事件驱动策略

本基金将持续关注上市公司事件驱动的投资机会，包括公司资产重组、资产注入、兼并收购、股权变动、再融资、管理层变动、股权激励计划、新产品研发

等可能對公司的經營方向、行業地位、核心競爭力產生重要影響的事件進行合理細緻的分析，選擇基本面向好的公司進行投資。

4、港股通標的股票投資策略

本基金將採用“自下而上”精選個股的策略。重點關注具有持續領先優勢或核心競爭力的公司；企業盈利前景廣或成長空間較大的公司；與 A 股同類公司相比具有估值優勢的公司。

5、存托憑證投資策略

本基金將根據投資目標，基於對基礎證券投資價值的深入研究判斷，進行存托憑證的投資。

6、國債期貨投資策略

基金管理人將按照相關法律法規的規定，根據風險管理的原則，以套期保值為目的，結合對宏觀經濟形勢和政策趨勢的判斷、對債券市場進行定性和定量分析，構建量化分析體系，對國債期貨和現貨基差、國債期貨的流動性、波動水平、套期保值的有效性等指標進行跟蹤監控，謹慎進行對國債期貨的投資。

四、投資限制

1、組合限制

基金的投資組合應遵循以下限制：

（1）本基金投資於債券資產的比例不低於基金資產的 80%；

（2）本基金投資於股票、可轉換債券（含分離交易可轉債）、可交換債券的比例合計不超過基金資產的 20%（其中港股通標的股票投資比例不超過全部股票資產的 50%）；

（3）每個交易日日終在扣除國債期貨合約需繳納的交易保證金後，本基金保持不低於基金資產淨值 5% 的現金或者到期日在一年以內的政府債券，其中現金不包括結算備付金、存出保證金和應收申購款等；

（4）本基金持有一家公司發行的證券（同一家公司在境內和香港同時上市的 A+H 股合計計算），其市值不超過基金資產淨值的 10%；

（5）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司發行的證券（同一家公司在境內和香港同時上市的 A+H 股合計計算），不超過該證券的 10%，完全按照有關指數的構成比例進行證券投資的基金品種可以不受此條款規定的比例限制；

（6）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%；

（7）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%；

（8）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%；

（9）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%；

（10）本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；

（11）本基金投资于国债期货的投资限制如下：

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

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

3）本基金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%；

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

（12）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；

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

（14）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股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 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股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 30%；完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述比例限制；

（15）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净

值的 15%；因證券市場波動、上市公司股票停牌、基金規模變動等基金管理人之外的因素致使基金不符合該比例限制的，基金管理人不得主動新增流動性受限資產的投資；

（16）本基金與私募類證券資管產品及中國證監會認定的其他主體為交易對手開展逆回購交易的，可接受質押品的資質要求應當與基金合同约定的投資範圍保持一致；

（17）本基金資產總值不超過基金資產淨值的 140%；

（18）本基金投資存托憑證的比例限制依照境內上市交易的股票執行，與境內上市交易的股票合併計算；

（19）法律法規及中國證監會規定的和《基金合同》约定的其他投資限制。

除上述（3）、（10）、（15）、（16）情形之外，因證券/期貨市場波動、證券發行人合併、基金規模變動等基金管理人之外的因素致使基金投資比例不符合上述規定投資比例的，基金管理人應當在相關證券可交易的 10 個交易日內進行調整，但中國證監會規定的特殊情形除外。法律法規另有規定的從其規定。

基金管理人應當自基金合同生效之日起 6 個月內使基金的投資組合比例符合基金合同的有關約定。在上述期間內，本基金的投資範圍、投資策略應當符合基金合同的約定。基金托管人對基金投資的監督與檢查自基金合同生效之日起開始。

法律法規或監管部門取消或變更上述限制，如適用於本基金，基金管理人在履行適當程序後，則本基金投資不再受相關限制或以變更後的規定為準，無需召開基金份額持有人大會審議。

2、禁止行為

為維護基金份額持有人的合法權益，基金財產不得用於下列投資或者活動：

- （1）承銷證券；
- （2）違反規定向他人貸款或者提供擔保；
- （3）從事承擔無限責任的投資；
- （4）買賣其他基金份額，但是中國證監會另有規定的除外；
- （5）向其基金管理人、基金托管人出資；
- （6）從事內幕交易、操縱證券交易價格及其他不正當的證券交易活動；

（7）法律、行政法規和中國證監會規定禁止的其他活動。

法律法規或監管部門取消或變更上述限制，如適用於本基金，基金管理人在履行適當程序後，則本基金投資不再受相關限制或以變更後的限制為準。

3、關聯交易

基金管理人運用基金財產買賣基金管理人、基金託管人及其控股股東、實際控制人或者與其有重大利害關係的公司發行的證券或者承銷期內承銷的證券，或者從事其他重大關聯交易的，應當符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

五、業績比較基準

中債綜合財富（總值）指數收益率×85%+滬深 300 指數收益率×10%+恒生綜合指數收益率（經匯率調整後）×5%

隨著法律法規和市場環境的變化，如果上述業績比較基準不適用本基金，或者本基金業績比較基準中所使用的指數暫停或終止發布，或者推出更權威的能夠表征本基金風險收益特征的指數，本基金管理人可以依據維護基金份額持有人合法權益的原則，根據實際情況對業績比較基準進行相應調整。調整業績比較基準應經基金託管人同意，報中國證監會備案，並在規定媒介上予以公告，無需召開基金份額持有人大會審議。

六、風險收益特征

本基金為債券型基金，理論上預期收益和預期風險高於貨幣市場基金，但低於混合型基金、股票型基金。本基金投資港股通標的股票時，會面臨港股通機制下因投資環境、投資標的、市場制度以及交易規則等差異帶來的特有風險。

七、基金管理人代表基金行使股東或債權人權利處理原則及方法

1、基金管理人按照國家有關規定代表基金獨立行使股東或債權人權利，保護基金份額持有人的利益；

2、不謀求對上市公司的控股；

3、有利於基金財產的安全與增值；

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招募说明书“侧袋机制”部分的规定。

九、基金投资组合报告

本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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2023年7月19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2023年6月30日，本报告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	35,229,669.68	14.77
	其中：股票	35,229,669.68	14.77
2	固定收益投资	128,117,589.32	53.70
	其中：债券	128,117,589.32	53.70
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-

5	买入返售金融资产	36,261,000.00	15.20
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	38,927,029.22	16.32
7	其他各项资产	32,772.95	0.01
8	合计	238,568,061.17	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	4,676,290.00	2.32
C	制造业	25,746,649.62	12.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	565,390.00	0.28
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	454,013.00	0.23
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	944,552.06	0.47
J	金融业	2,373,218.00	1.18
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	469,557.00	0.23
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	35,229,669.68	17.49

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	000603	盛达资源	233,000	2,816,970.00	1.40
2	688531	日联科技	12,227	1,815,831.77	0.90
3	301035	润丰股份	22,800	1,791,396.00	0.89
4	688036	传音控股	9,933	1,460,151.00	0.72
5	688121	卓然股份	36,749	1,374,412.60	0.68
6	688503	聚和材料	11,004	1,072,890.00	0.53
7	000333	美的集团	18,000	1,060,560.00	0.53
8	300274	阳光电源	8,600	1,003,018.00	0.50
9	688518	联赢激光	32,757	912,610.02	0.45
10	002142	宁波银行	35,300	893,090.00	0.44

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	11,097,110.71	5.51
	其中：政策性金融债	11,097,110.71	5.51
4	企业债券	65,959,823.83	32.74
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	51,060,654.78	25.34
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	128,117,589.32	63.59

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	018008	国开 1802	107,000	11,097,110.71	5.51
2	175289	20 常城 06	100,000	10,492,295.89	5.21
3	102282240	22 海淀国资 MTN001	100,000	10,276,753.42	5.10
4	102380274	23 兴泰金融 MTN001	100,000	10,243,630.68	5.08
5	102282464	22 深业 MTN002	100,000	10,224,150.68	5.07

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

本基金本报告期内未投资股指期货。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

11、投资组合报告附注

（1）本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体（除“国开行”违规外）没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

国开行下属分支机构因未严格执行受托支付、贷款业务严重违反审慎经营规则、发放固定资产贷款未落实实贷实付要求、自营贷款承接本行理财融资、违规转嫁抵押登记费和押品评估费、向不合规的项目发放贷款、违规收取小微企业贷款承诺费等问题，受到银保监局罚款的处罚。

本基金管理人就上述公司受处罚事件进行了及时分析和研究，认为上述公司存在的违规问题对公司经营成果和现金流量未产生重大的实质影响，对该公司投资价值未产生实质影响。本基金管理人将继续对该公司进行跟踪研究。

（2）基金投资的前十名证券中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情况。

（3）其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	31,772.95
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,000.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	32,772.95

（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可转换债券。

（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。

第十部分 基金的业绩

基金业绩截止日为 2023 年 6 月 30 日，并经基金托管人复核。

基金管理人依照恪守信守、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。

1、国泰安璟债券 A：

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
2023 年 1 月 17 日至 2023 年 6 月 30 日	0.24%	0.14%	1.12%	0.14%	-0.88%	0.00%

2、国泰安璟债券 C：

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
2023 年 1 月 17 日至 2023 年 6 月 30 日	0.40%	0.14%	1.12%	0.14%	-0.72%	0.00%

注：本基金合同生效日为 2023 年 1 月 17 日。

第十一部分 基金的財產

一、基金資產總值

基金資產總值是指基金擁有的各類有價證券、票據價值、銀行存款本息、基金應收款項及其他資產的價值總和。

二、基金資產淨值

基金資產淨值是指基金資產總值減去基金負債後的價值。

三、基金財產的賬戶

基金託管人根據相關法律法規、規範性文件為本基金開立資金賬戶、證券賬戶、期貨結算賬戶以及投資所需的其他專用賬戶。開立的基金專用賬戶與基金管理人、基金託管人、基金銷售機構和基金登記機構自有的財產賬戶以及其他基金財產賬戶相獨立。

四、基金財產的保管和處分

本基金財產獨立於基金管理人、基金託管人和基金銷售機構的財產，並由基金託管人保管。基金管理人、基金託管人、基金登記機構和基金銷售機構以其自有的財產承擔其自身的法律責任，其債權人不得對本基金財產行使請求凍結、扣押或其他權利。除依法律法規和《基金合同》的規定處分外，基金財產不得被處分。

基金管理人、基金託管人因依法解散、被依法撤銷或者被依法宣告破產等原因進行清算的，基金財產不屬於其清算財產。基金管理人管理運作基金財產所產生的債權，不得與其固有資產產生的債務相互抵銷；基金管理人管理運作不同基金的基金財產所產生的債權債務不得相互抵銷。非因基金財產本身承擔的債務，不得對基金財產強制執行。

第十二部分 基金資產估值

一、估值日

本基金的估值日為本基金相關的證券交易場所的交易日以及國家法律法規規定需要對外披露基金淨值的非交易日。

二、估值對象

基金所擁有的股票、債券、銀行存款本息、資產支持證券、國債期貨合約、應收款項、其他投資等資產及負債。

三、估值原則

基金管理人在確定相關金融資產和金融負債的公允價值時，應符合《企業會計準則》、監管部門有關規定。

1、對存在活躍市場且能夠獲取相同資產或負債報價的投資品種，在估值日有報價的，除會計準則規定的例外情況外，應將該報價不加調整地應用於該資產或負債的公允價值計量。估值日無報價且最近交易日後未發生影響公允價值計量的重大事件的，應採用最近交易日的報價確定公允價值。有充足證據表明估值日或最近交易日的報價不能真實反映公允價值的，應對報價進行調整，確定公允價值。

與上述投資品種相同，但具有不同特征的，應以相同資產或負債的公允價值為基礎，並在估值技術中考慮不同特征因素的影響。特征是指對資產出售或使用的限制等，如果該限制是針對資產持有者的，那麼在估值技術中不應將該限制作為特征考慮。此外，基金管理人不應考慮因其大量持有相關資產或負債所產生的溢價或折價。

2、對不存在活躍市場的投資品種，應採用在當前情況下適用並且有足夠可利用數據和其他信息支持的估值技術確定公允價值。採用估值技術確定公允價值時，應優先使用可觀察輸入值，只有在無法取得相關資產或負債可觀察輸入值或取得不切實可行的情況下，才可以使用不可觀察輸入值。

3、如經濟環境發生重大變化或證券發行人發生影響證券價格的重大事件，使潛在估值調整對前一估值日的基金資產淨值的影響在 0.25% 以上的，應對估值進行調整並確定公允價值。

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

（2）交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种，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；

（3）交易所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）交易所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。在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

（6）对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的固定收益品种，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，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，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。

3、对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种，回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的按照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。

4、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。

5、因持有股票而享有的配股权，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。

6、本基金投资同业存单，采用估值日第三方估值机构提供的估值价格数据进行估值。

7、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。

8、本基金投资的国债期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。国家有最新规定的，按其规定进行估值。

9、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，国家有最新规定的，按其规定进行估值。

10、估值涉及到港币等主要货币对人民币汇率的，应当以基金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。

11、**税收：**对于按照中国法律法规和基金投资境内外股票市场交易互联互通机制涉及的境外交易场所所在地的法律法规规定应交纳的各项税金，本基金将按权责发生制原则进行估值；对于因税收规定调整或其他原因导致基金实际交纳税金与估算的应交税金有差异的，基金将在相关税金调整日或实际支付日进行相应的估值调整。

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、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。

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

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

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对于基金净值信息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基金负债后的价值。任一类基金份额净值是按照每个工作日闭市后，该类基金份额的基金资产净值除以当日该类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。

基金管理人于每个工作日计算基金资产净值及各类基金份额净值，并按规定公告。

2、基金管理人应于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，将各类基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人按约定对外公布。

六、估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当某一类基金份额净值小数点后 4 位以内（含第 4 位）发生估值错误时，视为该类基金份额净值错误。

基金合同的当事人应按照以下约定处理：

1、估值错误类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或登记机构、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

的原因確定估值錯誤的責任方；

（2）根據估值錯誤處理原則或當事人協商的方法對因估值錯誤造成的損失進行評估；

（3）根據估值錯誤處理原則或當事人協商的方法由估值錯誤的責任方進行更正和賠償損失；

（4）根據估值錯誤處理的方法，需要修改基金登記機構交易數據的，由基金登記機構進行更正，並就估值錯誤的更正向有關當事人進行確認。

4、基金份額淨值估值錯誤處理的方法如下：

（1）基金份額淨值計算出現錯誤時，基金管理人應當立即予以糾正，通報基金託管人，並採取合理的措施防止損失進一步擴大。

（2）錯誤偏差達到該類基金份額淨值的 0.25% 時，基金管理人應當通報基金託管人並報中國證監會備案；錯誤偏差達到該類基金份額淨值的 0.5% 時，基金管理人應當公告，並報中國證監會備案。

（3）前述內容如法律法規或監管機構另有規定的，從其規定處理。

七、暫停估值的情形

1、基金投資所涉及的證券/期貨交易市場遇法定節假日或因其他原因暫停營業時；

2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金託管人無法準確評估基金資產價值時；

3、當特定資產占前一估值日基金資產淨值 50% 以上的，經與基金託管人協商確認後，基金管理人應當暫停估值；

4、法律法規、中國證監會和基金合同認定的其他情形。

八、基金淨值的確認

基金資產淨值和各類基金份額淨值由基金管理人負責計算，基金託管人負責進行復核。基金管理人應於每個開放日交易結束後計算當日的基金資產淨值和各類基金份額淨值並發送給基金託管人。基金託管人對淨值計算結果復核確認後發送給基金管理人，由基金管理人按規定對基金淨值信息予以公布。

九、特殊情況的處理

1、基金管理人或基金託管人按上述“四、估值方法”的第 13 項進行估值時，

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、期货交易所、期货公司、登记结算公司及存款银行等第三方机构发送的数据错误或者其他不可抗力等，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

3、对于因税收规定调整或其他原因导致基金实际交纳税金与基金按照权责发生制进行估值的应交税金有差异的，相关估值调整不作为基金资产估值错误处理。

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 基金的收益與分配

一、基金利潤的構成

基金利潤指基金利息收入、投資收益、公允價值變動收益和其他收入扣除相關費用後的餘額，基金已實現收益指基金利潤減去公允價值變動收益後的餘額。

二、基金可供分配利潤

基金可供分配利潤指截至收益分配基準日基金未分配利潤與未分配利潤中已實現收益的孰低數。

三、基金收益分配原則

1、由於本基金 A 類基金份額不收取銷售服務費，而 C 類基金份額收取銷售服務費，各類別基金份額對應的可供分配利潤將有所不同，本基金同一類別的每一基金份額享有同等分配權；

2、在符合有關基金分紅條件的前提下，本基金基金管理人可以根據實際情況進行收益分配，具體分配方案以公告為準，若《基金合同》生效不滿 3 個月可不進行收益分配；

3、本基金收益分配方式分兩種：現金分紅與紅利再投資，基金份額持有人可選擇現金紅利或將現金紅利自動轉為相應類別的基金份額進行再投資；若基金份額持有人不選擇，本基金默認的收益分配方式是現金分紅；

4、基金收益分配後各類基金份額淨值均不能低於面值，即基金收益分配基準日的各類基金份額淨值減去每單位該類基金份額收益分配金額後不能低於面值；

5、法律法規或監管機構另有規定的，從其規定。

在不違反法律法規、基金合同的約定以及對基金份額持有人利益無實質性不利影響的情況下，基金管理人可調整基金收益的分配原則和支付方式，不需召開基金份額持有人大會審議。

四、收益分配方案

基金收益分配方案中應載明截至收益分配基準日的可供分配利潤、基金收益分配對象、分配時間、分配數額及比例、分配方式等內容。

五、收益分配方案的確定、公告與實施

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，在 2 日内在规定媒介公告。

六、基金收益分配中发生的费用

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

七、实施侧袋机制期间的收益分配

本基金实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配。

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、本基金从 C 类基金份额的基金财产中计提的销售服务费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《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；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券/期货交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、基金的开户费用、账户维护费用；
- 10、因投资港股通标的股票而产生的各项合理费用；
- 11、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

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，由基金管理人每月月末向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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，由基金管理人每月月末向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。

3、C 类基金份额的销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.10% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

C 类基金份额的销售服务费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人根据基金管理人的划款指令于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人支付给各销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

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

三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

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

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、《基金合同》生效前的相关费用；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

四、实施侧袋机制期间的基金费用

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

理费。

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确认。

二、基金的年度审计

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

2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意。

3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所需在 2 日内在规定媒介公告。

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。

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

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

三、本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

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

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。

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，基金销售机构亦应在销售机构网站或营业网点登载更新基金产品资料概要；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，基金销售机构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，并在基金份额发售的三日前登载于规定媒介上。

（三）《基金合同》生效公告

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

（四）基金净值信息

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

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过规定网站、基金销售机构网站或者营业网点，披露开放日的各类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，在规定网站披露半年度和年度最后一日的各类基金份额净值和基金份额累计净值。

（五）基金份额申购、赎回价格

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

（六）基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告

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

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

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

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

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

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

（七）临时报告

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

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

- 1、基金份额持有人大会的召开及决定的事项；
- 2、《基金合同》终止、基金清算；
- 3、转换基金运作方式、基金合并；
- 4、更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；
- 5、基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；
- 6、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- 7、基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人的实际控制人变更；
- 8、基金募集期延长或提前结束募集；
- 9、基金管理人的高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；
- 10、基金管理人的董事在最近12个月内变更超过百分之五十，基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近12个月内变动超过百分之三十；
- 11、涉及基金管理业务、基金财产、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，或者從事其他重大關聯交易事項，中國證監會另有規定的情形除外；

14、基金收益分配事項；

15、管理費、托管費、申購費、贖回費、銷售服務費等費用計提標準、計提方式和費率發生變更；

16、任一類基金份額淨值計價錯誤達該類基金份額淨值百分之零點五；

17、本基金開始辦理申購、贖回；

18、本基金發生巨額贖回並延期辦理；

19、本基金連續發生巨額贖回並暫停接受贖回申請或延緩支付贖回款項；

20、本基金暫停接受申購、贖回申請或重新接受申購、贖回申請；

21、發生涉及基金申購、贖回事項調整或潛在影響投資者贖回等重大事項時；

22、基金管理人採用擺動定價機制進行估值；

23、本基金推出新業務或服務；

24、本基金增加或減少基金份額類別，調整基金份額分類辦法及規則；

25、基金信息披露義務人認為可能對基金份額持有人權益或者基金份額的價格產生重大影響的其他事項或中國證監會規定的其他事項。

（八）澄清公告

在《基金合同》存續期限內，任何公共媒介中出現的或者在市場上流傳的消息可能對基金份額價格產生誤導性影響或者引起較大波動，以及可能損害基金份額持有人權益的，相關信息披露義務人知悉後應當立即對該消息進行公開澄清。

（九）清算報告

基金合同終止的，基金管理人應當依法組織基金財產清算小組對基金財產進行清算並作出清算報告。清算報告應當經過符合《中華人民共和國證券法》規定的會計師事務所審計，並由律師事務所出具法律意見書。基金財產清算小組應當將清算報告登載在規定網站上，並將清算報告提示性公告登載在規定報刊上。

（十）基金份額持有人大會決議

基金份額持有人大會決定的事項，應當依法報中國證監會備案，並予以公告。

（十一）實施側袋機制期間的信息披露

本基金實施側袋機制的，相關信息披露義務人應當根據法律法規、基金合同和招募說明書的規定進行信息披露，詳見招募說明書“側袋機制”部分的規定。

（十二）投資國債期貨的相關公告

若本基金投資國債期貨，基金管理人應在季度報告、中期報告、年度報告等定期報告和招募說明書（更新）等文件中披露國債期貨交易情況，包括投資政策、持倉情況、損益情況、風險指標等，並充分揭示國債期貨交易對基金總體風險的影響以及是否符合既定的投資政策和投資目標等。

（十三）投資資產支持證券的相關公告

若本基金投資資產支持證券，基金管理人應在本基金中期報告及年度報告中披露其持有的資產支持證券總額、資產支持證券市值占基金淨資產的比例和報告期內所有的資產支持證券明細。

基金管理人應在本基金季度報告中披露其持有的資產支持證券總額、資產支持證券市值占基金淨資產的比例和報告期末按市值占基金淨資產比例大小排序的前 10 名資產支持證券明細。法律法規或中國證監會另有規定的，從其規定。

（十四）投資港股通標的股票相關公告

若本基金投資港股通標的股票，基金管理人應當在季度報告、中期報告、年度報告等定期報告和招募說明書（更新）等文件中披露港股通標的股票的投資情況。法律法規或中國證監會另有規定的，從其規定。

（十五）中國證監會規定的其他信息。

六、信息披露事務管理

基金管理人、基金託管人應當建立健全信息披露管理制度，指定專門部門及高級管理人員負責管理信息披露事務。

基金信息披露義務人公開披露基金信息，應當符合中國證監會相關基金信息披露內容與格式準則等法規的規定。

基金託管人應當按照相關法律法規、中國證監會的規定和《基金合同》的約定，對基金管理人編制的基金資產淨值、各類基金份額淨值、基金份額申購贖回價格、基金定期報告、更新的招募說明書、基金產品資料概要、基金清算報告等相關基金信息進行復核、審查，並向基金管理人進行書面或電子確認。

基金管理人、基金託管人應當在規定報刊中選擇一家報刊披露本基金信息。基金管理人、基金託管人應當向中國證監會基金電子披露網站報送擬披露的基金信息，並保證相關報送信息的真實、準確、完整、及時。

基金管理人、基金托管人除依法在規定媒介上披露信息外，還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規定媒介披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

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，法律法规另有规定的从其规定。

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办公场所，供社会公众查阅、复制。

八、暂停或延迟信息披露的情形

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相关信息：

- 1、不可抗力；
- 2、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；
- 3、法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情况。

第十七部分 側袋機制

一、側袋機制的實施條件和程序

當基金持有特定資產且存在或潛在大量贖回申請時，根據最大限度保護基金份額持有人利益的原則，基金管理人經與基金託管人協商一致，並諮詢會計師事務所意見後，可以依照法律法規及基金合同的約定啟用側袋機制，無需召開基金份額持有人大會。

基金管理人應當在啟用側袋機制後及時發布臨時公告，並及時聘請符合《中華人民共和國證券法》規定的會計師事務所進行審計並披露專項審計意見。

二、實施側袋機制期間基金份額的申購與贖回

1、啟用側袋機制當日，本基金登記機構以基金份額持有人的原有賬戶份額為基礎，確認相應側袋賬戶基金份額持有人名冊和份額；當日收到的申購申請，按照啟用側袋機制後的主袋賬戶份額辦理；當日收到的贖回申請，僅辦理主袋賬戶份額的贖回申請並支付贖回款項。

2、實施側袋機制期間，基金管理人不得辦理側袋賬戶份額的申購、贖回和轉換；同時，基金管理人按照基金合同和招募說明書的約定辦理主袋賬戶份額的贖回，並根據主袋賬戶運作情況確定申購政策。

3、除基金管理人應按照主袋賬戶的份額淨值辦理主袋賬戶份額的申購和贖回外，本招募說明書“基金份額的申購與贖回”部分的申購、贖回規定適用於主袋賬戶份額。巨額贖回按照單個開放日內主袋賬戶份額淨贖回申請超過前一開放日主袋賬戶總份額的 10% 認定。

4、申購贖回的具体事項安排詳見基金管理人屆時的相关公告。

三、實施側袋機制期間的基金投資

側袋機制實施期間，招募說明書“基金的投資”部分約定的投資組合比例、投資策略、組合限制、業績比較基準、風險收益特征等約定僅適用於主袋賬戶。基金管理人計算各項投資運作指標和基金業績指標應當以主袋賬戶資產為基準。

基金管理人原則上應當在側袋機制啟用後 20 個交易日內完成對主袋賬戶投資組合的調整，因資產流動性受限等中國證監會規定的情形除外。

基金管理人不得在側袋賬戶中進行除特定資產處置變現以外的其他投資操

作。

四、實施側袋機制期間的基金估值

本基金實施側袋機制的，基金管理人和基金托管人應對主袋賬戶資產進行估值並披露主袋賬戶的基金淨值信息，暫停披露側袋賬戶份額淨值。

五、側袋賬戶中特定資產的處置變現和支付

特定資產以可出售、可轉讓、恢復交易等方式恢復流動性後，基金管理人應按照基金份額持有人利益最大化原則，採取將特定資產予以處置變現等方式，及時向側袋賬戶份額持有人支付對應變現款項。

基金管理人應當在終止側袋機制後及時聘請符合《中華人民共和國證券法》規定的會計師事務所進行審計並披露專項審計意見。

六、側袋機制的信息披露

1、臨時公告

在啟用側袋機制、處置特定資產、終止側袋機制以及發生其他可能對投資者利益產生重大影響的事項後基金管理人應及時發布臨時公告。

2、基金淨值信息

基金管理人應按照招募說明書“基金的信息披露”部分規定的基金淨值信息披露方式和頻率披露主袋賬戶的基金淨值信息。實施側袋機制期間本基金暫停披露側袋賬戶份額淨值和累計淨值。

3、定期報告

側袋機制實施期間，基金管理人應當在基金定期報告中披露報告期內特定資產處置進展情況，披露報告期末特定資產可變現淨值或淨值區間的，應同時註明不作為特定資產最終變現價格的承諾。

七、本部分關於側袋機制的相關規定，凡是直接引用法律法規或監管規則的部分，如將來法律法規或監管規則修改導致相關內容被取消或變更的，或將來法律法規或監管規則針對側袋機制的內容有進一步規定的，基金管理人經與基金托管人協商一致並履行適當程序後，可直接對本部分內容進行修改、調整和補充，無需召開基金份額持有人大會審議。

第十八部分 风险揭示

一、系统性风险

系统性风险是指由于经济、政治、社会环境等因素的变化对证券价格造成的影响，其主要包括利率风险、政策风险、经济周期风险、购买力风险。

1、利率风险：对于股票投资而言，利率的变化将导致证券市场资金供求状况、上市公司的融资成本和利润水平等发生变化，同时改变市场参与者对于后市利率变化方向及幅度的预期，这将直接影响证券价格发生变化，进而影响本基金的收益水平。对于债券投资而言，利率的变化不仅会影响债券的价格及投资人对于后市的预期，而且会带来票息的再投资风险，对基金的收益造成影响。

2、政策风险：因国家宏观政策（如货币政策、财政政策、产业政策、区域发展政策，进出口贸易政策等）发生变化，导致市场价格波动而产生风险。

3、经济周期风险：宏观经济运行具有周期性的特点，宏观经济的运行状况将直接影响上市公司的经营、盈利情况。证券市场对宏观经济运行状况的直接反应将影响本基金的收益水平。

4、购买力风险：购买力风险又称通货膨胀风险，是由于通货膨胀、货币贬值造成投资人实际收益水平下降的风险。

二、非系统性风险

非系统性风险是指个别行业或个别证券特有的风险，包括上市公司经营风险、信用风险等。

1、经营风险：上市公司的经营状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务等都会导致公司盈利发生变化，从而导致证券价格变动的风险。

2、信用风险：指基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资债券的发行人出现违约、无法支付到期本息，或者由于债券发行人信用等级下降等原因造成的基金资产损失的风险。

三、流动性风险

（一）本基金的申购、赎回安排

本基金为普通开放式基金，投资人可在本基金的开放日办理基金份额的申购和赎回业务，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的

交易時間（若該工作日為非港股通交易日，則基金管理人有权暫停辦理基金份額的申購和贖回業務），但基金管理人根據法律法規、中國證監會的要求或基金合同的規定公告暫停申購、贖回時除外。

為切實保護存量基金份額持有人的合法權益，遵循基金份額持有人利益優先原則，本基金管理人將合理控制基金份額持有人集中度，審慎確認申購贖回業務申請，包括但不限於：

1、當接受申購申請對存量基金份額持有人利益構成潛在重大不利影響時，基金管理人應當採取設定單一投資者申購金額上限或基金單日淨申購比例上限、拒絕大額申購、暫停基金申購等措施，切實保護存量基金份額持有人的合法權益。基金管理人基於投資運作與風險控制的需要，可採取上述措施對基金規模予以控制。

2、當發生大額申購或贖回情形時，基金管理人可以採用擺動定價機制，以確保基金估值的公平性。

3、當前一估值日基金資產淨值 50% 以上的資產出現無可參考的活躍市場價格且採用估值技術仍導致公允價值存在重大不確定性時，經與基金託管人協商確認後，基金管理人應當暫停接受基金申購申請、贖回申請或延緩支付贖回款項。

提示投資人注意本基金的申購贖回安排和相應的流動性風險，合理安排投資計劃。

（二）本基金擬投資市場、行業及資產的流動性風險

1、本基金投資的內地 A 股市場，港股通機制下的港股市場，銀行間和交易所的債券市場等具有發展成熟、容量較大、交易活躍、流動性充裕的特徵，能夠滿足本基金開放式運作的流動性要求。同時，本基金在充分把握市場行情與投資機會的前提下，適當進行分散投資，以實現相對均衡的配置，保障了資產組合的流動性。在極端市場行情下，存在基金管理人可能無法以合理價格及時變現或調整基金投資組合的風險。本基金管理人將發揮專業研究優勢，持續優化組合配置，以控制流動性風險。

2、資產支持證券只能通過特定的渠道進行轉讓交易，存在市場交易不活躍導致的流動性風險。

3、國債期貨合約流動性風險可分為兩類：一類為流通量風險，是指期貨合

约无法及时以所希望的价格建立或了结头寸的风险，此类风险往往是由市场缺乏广度或深度导致的；另一类为资金量风险，是指资金量无法满足保证金要求，使得所持有的头寸面临被强制平仓的风险。

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。

（三）巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

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、部分延期赎回：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，基金份额持有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该类基金份额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。如基金份额持有人在提交赎回申请时未作明确选择，基金份额持有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，在单个基金份额持有人超过基金总份额20%以上的赎回申请的情形下：对于该基金份额持有人当日赎回申请超过上一开放日基金总份额20%以上的部分，基金管理人可以延期办理赎回申请；对于该基金份额持有人当日赎回申请未超过20%的部分，可以根据“全额赎回”或“部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。即当基金管理人认为有能力支付该基金份额持有人当日赎回申请未超过20%的部分以及其他基金

份额持有人的赎回申请时，按正常赎回程序执行；当基金管理人认为支付该基金份额持有人当日赎回申请未超过 20% 的部分及其他基金份额持有人的赎回申请有困难或认为因支付该等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。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该类基金份额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。但是，对于未能赎回部分，如该基金份额持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。部分延期赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

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。

（四）备用的流动性风险管理工具的实施情形、程序及对投资者的潜在影响
基金管理人经与基金托管人协商，在确保投资者得到公平对待的前提下，可依照法律法规及基金合同的约定，综合运用各类流动性风险管理工具，对赎回申请进行适度调整，作为特定情形下基金管理人流动性风险管理的辅助措施。备用的流动性风险管理工具的实施情形包括：

- 1、发生基金合同规定的暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形；
- 2、基金发生巨额赎回；
- 3、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% 以上的情形；
- 4、基金份额持续持有期限小于 7 日；
- 5、发生基金合同约定的暂停估值的情形；
- 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；
- 7、基金实施侧袋机制；
- 8、法律法规规定、中国证监会认定或基金合同约定的其他情形。

实施备用流动性风险管理工具的决策程序依照基金管理人流动性风险管理

制度的規定辦理。基金管理人應時刻防範可能產生的流動性風險，對流動性風險進行日常監控，切實保護持有人的合法權益。

採取備用流動性風險管理工具，可能對投資人造成無法贖回、贖回延期辦理、贖回款項延期支付、贖回時承擔沖擊成本產生資金損失等影響。

四、運作管理風險

1、管理風險：在基金管理運作過程中，基金管理人的知識、技能、經驗、判斷等主觀因素會影響其對相關信息和經濟形勢、證券價格走勢的判斷，從而影響基金收益水平。

2、交易風險：指在基金投資交易過程中由於各種原因造成的風險。

3、運作風險：由於運營系統、網絡系統、計算機或交易軟件等發生技術故障等突發情況而造成的風險，或者由於操作過程中的疏忽和錯誤而產生的風險。

4、道德風險：指業務人員道德行為違規產生的風險，包括由內幕交易、違規操作、欺詐行為等原因造成的風險。

五、本基金特定風險

1、本基金為債券型基金，理論上預期收益和預期風險高於貨幣市場基金，但低於混合型基金、股票型基金。

本基金投資於股票、可轉換債券（含分離交易可轉債）、可交換債券的比例合計不超過基金資產的 20%（其中港股通標的股票投資比例不超過全部股票資產的 50%），理論上預期收益和預期風險可能高於普通純債型基金。

2、本基金投資港股通標的股票時，會面臨港股通機制下因投資環境、投資標的、市場制度以及交易規則等差異帶來的特有風險。

（1）港股市場股價波動較大的風險

港股市場實行 T+0 回轉交易，且對個股不設漲跌幅限制，港股股價可能表現出比 A 股更為劇烈的股價波動。

（2）港股交易失敗風險

港股通業務存在每日額度限制。在香港聯合交易所有限公司開市前階段，當日額度使用完畢的，新增的買單申報將面臨失敗的風險；在聯交所持續交易時段，當日額度使用完畢的，當日本基金將面臨不能通過港股通進行買入交易的風險。如果未來港股通相關業務規則發生變化，以新的業務規則為準。

（3）匯率風險

本基金以人民幣計價，但本基金通過港股通投資香港證券市場。港幣相對於人民幣的匯率變化將會影響本基金以人民幣計價的基金資產價值，從而導致基金資產面臨潛在風險。匯率波動可能對基金的投资收益造成損失。人民幣對港幣的匯率的波動也可能加大基金淨值的波動，從而對基金業績產生影響。此外，由於基金運作中的匯率取自匯率發布機構，如果匯率發布機構出現匯率發布時間延遲或是匯率數據錯誤等情況，可能會對基金運作或者投資者的決策產生不利影響。

（4）港股通機制下交易日不連貫可能帶來的風險

在內地開市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及時賣出，可能帶來一定的流動性風險。

（5）境外市場的風險

本基金投資內地與香港股票市場交易互聯互通機制允許買賣的規定範圍內的香港聯合交易所有限公司上市的股票，投資將受到香港市場宏觀經濟運行情況、貨幣政策、財政政策、產業政策、交易規則、結算、託管以及其他運作風險等多種因素的影響，上述因素的波動和變化可能會使基金資產面臨潛在風險。

3、本基金可投資資產支持證券，主要存在以下風險：1）特定原始權益人破產風險、現金流預測風險等與基礎資產相關的風險；2）資產支持證券信用增級措施相關風險、資產支持證券的利率風險、評級風險等與資產支持證券相關的風險；3）管理人違約違規風險、託管人違約違規風險、專項計劃賬戶管理風險、資產服務機構違規風險等與專項計劃管理相關的風險；4）政策風險、稅收風險、發生不可抗力事件的風險、技術風險和操作風險等其他風險。

4、本基金可投資國債期貨，可能面臨市場風險、基差風險、流動性風險。市場風險是因期貨市場價格波動使所持有的期貨合約價值發生變化的風險。基差風險是期貨市場的特有風險之一，是指由於期貨與現貨間的價差的波動，影響套期保值或套利效果，使之發生意外損益的風險。流動性風險可分為兩類：一類為流通量風險，是指期貨合約無法及時以所希望的价格建立或了結頭寸的風險，此類風險往往是由市場缺乏廣度或深度導致的；另一類為資金量風險，是指資金量無法滿足保證金要求，使得所持有的頭寸面臨被強制平倉的風險。

5、投資存託憑證的風險

本基金可投資存托憑證，基金淨值可能受到存托憑證的境外基礎證券價格波動影響，存托憑證的境外基礎證券的相關風險可能直接或間接成為本基金的風險。

本基金可根據投資策略需要或市場環境的變化，選擇將部分基金資產投資於存托憑證或選擇不將基金資產投資於存托憑證，基金資產並非必然投資存托憑證。

6、科创板股票投资风险

本基金可投資國內上市的科创板股票，會面臨因投資標的、市場制度以及交易規則等差異帶來的特有風險，包括不限於如下風險：

（1）股價波動較大的風險。科创板對個股每日漲跌幅限制為 20%，且新股上市後的前 5 個交易日不設置漲跌幅限制，股價可能表現出比 A 股其他板塊更為劇烈的波動；

（2）流動性風險。科创板投資者門檻較高，流動性可能弱於 A 股其他板塊，投資者可能在特定階段對科创板個股形成一致性預期，存在基金持有股票無法正常成交的風險；

（3）退市風險。科创板執行比 A 股其他板塊更為嚴格的退市標準，且退市程序存在一定差別，因此上市公司退市風險更大，可能會對基金淨值產生不利影響；

（4）本基金投資集中度相對較高的風險。因科创板上市公司商業模式、盈利模式等可能存在一定的相似性，因此，持倉股票股價存在同向波動的可能，從而產生對基金淨值不利的影響。

六、本基金法律文件中涉及基金風險特征的表述與銷售機構對基金的風險評級可能不一致的風險

本基金基金合同、招募說明書等法律文件中涉及基金風險收益特征或風險狀況的表述僅為主要基於基金投資方向與策略特點的概括性表述；而本基金各銷售機構依據中國證券投資基金業協會發布的《基金募集機構投資者適當性管理實施指引（試行）》及內部評級標準，將基金產品按照風險由低到高順序進行風險級別評定劃分，其風險評級結果所依據的評價要素可能更多、範圍更廣，與本基金法律文件中的風險收益特征或風險狀況表述並不必然一致或存在對應關係。同時，不同銷售機構因其採取的具體評價標準和方法的差異，對同一產品風險級別的評定也可能各有不同；銷售機構還可能根據監管要求、市場變化及基金實際運作情

况等适时调整对本基金的风险评级。敬请投资人知悉，在购买本基金时按照销售机构的要求完成风险承受能力与产品风险之间的匹配检验，并须及时关注销售机构对于本基金风险评级的调整情况，谨慎作出投资决策。

七、实施侧袋机制对投资者的影响

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

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

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。

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

八、其他风险

除以上主要风险以外，基金还可能遇到以下风险：

1、因技术因素而产生的风险，如基金在交易时所采用的电脑系统可能因突发性事件或不可抗力原因出现故障，由此给基金投资带来风险；

2、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；

3、因人为因素而产生的风险，如基金经理违反职业操守的道德风险，以及因内幕交易、欺诈行为等产生的违规风险；

4、人才流失风险，公司主要业务人员的离职如基金经理的离职等可能会在一定程度上影响工作的连续性，并可能对基金运作产生影响；

5、因业务竞争压力可能产生的风险；

6、因不可预见或不可抗力因素导致的风险，如战争、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；

7、其他意外导致的风险。

第十九部分 基金的終止與清算

一、《基金合同》的變更

1、變更基金合同涉及法律法規規定或基金合同约定應經基金份額持有人大會決議通過的事項的，應召開基金份額持有人大會決議通過。對於法律法規規定和基金合同约定可未經基金份額持有人大會決議通過的事項，由基金管理人和基金託管人同意後變更並公告，並報中國證監會備案。

2、關於《基金合同》變更的基金份額持有人大會決議自生效後方可執行，自決議生效後兩日內在規定媒介公告。

二、《基金合同》的終止事由

有下列情形之一，經履行相關程序後，《基金合同》應當終止：

- 1、基金份額持有人大會決定終止的；
- 2、基金管理人、基金託管人職責終止，在 6 個月內沒有新基金管理人、新基金託管人承接的；
- 3、《基金合同》約定的其他情形；
- 4、相關法律法規和中國證監會規定的其他情況。

三、基金財產的清算

1、基金財產清算小組：自出現《基金合同》終止事由之日起 30 個工作日內成立基金財產清算小組，基金管理人組織基金財產清算小組並在中國證監會的監督下進行基金清算。

2、基金財產清算小組組成：基金財產清算小組成員由基金管理人、基金託管人、符合《中華人民共和國證券法》規定的註冊會計師、律師以及中國證監會指定的人員組成。基金財產清算小組可以聘用必要的工作人員。

3、基金財產清算小組職責：基金財產清算小組負責基金財產的保管、清理、估價、變現和分配。基金財產清算小組可以依法進行必要的民事活動。

4、基金財產清算程序：

- （1）《基金合同》終止情形出現時，由基金財產清算小組統一接管基金；
- （2）對基金財產和債權債務進行清理和確認；
- （3）對基金財產進行估值和變現；

（4）制作清算報告；

（5）聘請符合《中華人民共和國證券法》規定的會計師事務所對清算報告進行外部審計，聘請律師事務所對清算報告出具法律意見書；

（6）將清算報告報中國證監會備案並公告；

（7）對基金剩餘財產進行分配。

5、基金財產清算的期限為 6 個月，但因本基金所持證券的流動性受到限制而不能及時變現的，清算期限相應順延。

四、清算費用

清算費用是指基金財產清算小組在進行基金財產清算過程中發生的所有合理費用，清算費用由基金財產清算小組優先從基金財產中支付。

五、基金財產清算剩餘資產的分配

依據基金財產清算的分配方案，將基金財產清算後的全部剩餘資產扣除基金財產清算費用、交納所欠稅款並清償基金債務後，按基金份額持有人持有的基金份額比例進行分配。

六、基金財產清算的公告

清算過程中的有關重大事項須及時公告；基金財產清算報告經符合《中華人民共和國證券法》規定的會計師事務所審計並由律師事務所出具法律意見書後報中國證監會備案並公告。基金財產清算公告於基金財產清算報告報中國證監會備案後 5 個工作日內由基金財產清算小組進行公告，基金財產清算小組應當將清算報告登載在規定網站上，並將清算報告提示性公告登載在規定報刊上。

七、基金財產清算賬冊及文件的保存

基金財產清算賬冊及有關文件由基金託管人保存，保存期限不低於法律法規規定的最低期限。

第二十部分 基金合同内容摘要

一、基金管理人、基金托管人、基金份额持有人的权利与义务

1、基金管理人的权利

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

- （1）依法募集资金；
- （2）自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
- （3）依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- （4）销售基金份额；
- （5）按照规定召集基金份额持有人大会；
- （6）依据《基金合同》及有关法律规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- （7）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- （8）选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；
- （9）担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；
- （10）依据《基金合同》及有关法律规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、期货经纪机构

或其他為基金提供服務的外部機構；

（16）在符合有關法律、法規的前提下，制訂和調整有關基金認購、申購、贖回、轉換、定期定額投資和非交易過戶等業務規則；

（17）法律法規及中國證監會規定的和《基金合同》約定的其他權利。

2、基金管理人的义务

根據《基金法》、《運作辦法》及其他有關規定，基金管理人的義務包括但不限於：

（1）依法募集資金，辦理或者委託經中國證監會認定的其他機構代為辦理基金份額的發售、申購、贖回和登記事宜；

（2）辦理基金備案手續；

（3）自《基金合同》生效之日起，以誠實信用、謹慎勤勉的原則管理和運用基金財產；

（4）配備足夠的具有專業資格的人員進行基金投資分析、決策，以專業化的經營方式管理和運作基金財產；

（5）建立健全內部風險控制、監察與稽核、財務管理及人事管理等制度，保證所管理的基金財產和基金管理人的財產相互獨立，對所管理的不同基金分別管理，分別記賬，進行證券投資；

（6）除依據《基金法》、《基金合同》及其他有關規定外，不得利用基金財產為自己及任何第三人謀取利益，不得委託第三人運作基金財產；

（7）依法接受基金托管人的監督；

（8）採取適當合理的措施使計算基金份額認購、申購、贖回和注銷價格的方法符合《基金合同》等法律文件的規定，按有關規定計算並公告基金淨值信息，確定基金份額申購、贖回的價格；

（9）進行基金會計核算並編制基金財務會計報告；

（10）編制基金季度報告、基金中期報告和基金年度報告；

（11）嚴格按照《基金法》、《基金合同》及其他有關規定，履行信息披露及報告義務；

（12）保守基金商業秘密，不洩露基金投資計劃、投資意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有關規定另有規定外，在基金信息公開披露前應予保密，不

向他人泄露，但因监管机构、司法机关等有权机关的要求，或因审计、法律等外部专业顾问提供服务需要提供的情况除外；

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

（14）按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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

（16）按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料不低于法律法规规定的最低期限；

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

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

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

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

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

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

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

（24）基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期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）建立並保存基金份額持有人名冊；

（27）法律法規及中國證監會規定的和《基金合同》約定的其他義務。

3、基金託管人的權利

根據《基金法》、《運作辦法》及其他有關規定，基金託管人的權利包括但不限於：

（1）自《基金合同》生效之日起，依法律法規和《基金合同》的規定安全保管基金財產；

（2）依《基金合同》約定獲得基金託管費以及法律法規規定或監管部門批准的其他費用；

（3）監督基金管理人對本基金的投資運作，如發現基金管理人有違反《基金合同》及國家法律法規行為，對基金財產、其他當事人的利益造成重大損失的情形，應呈報中國證監會，並採取必要措施保護基金投資者的利益；

（4）根據相關市場規則，為基金開設資金賬戶、證券賬戶、期貨結算賬戶等投資所需賬戶，為基金辦理證券交易資金清算；

（5）提議召開或召集基金份額持有人大會；

（6）在基金管理人更換時，提名新的基金管理人；

（7）法律法規及中國證監會規定的和《基金合同》約定的其他權利。

4、基金託管人的義務

根據《基金法》、《運作辦法》及其他有關規定，基金託管人的義務包括但不限於：

（1）以誠實信用、勤勉盡責的原則持有並安全保管基金財產；

（2）設立專門的基金託管部門，具有符合要求的營業場所，配備足夠的、合格的熟悉基金託管業務的專職人員，負責基金財產託管事宜；

（3）建立健全內部風險控制、監察與稽核、財務管理及人事管理等制度，確保基金財產的安全，保證其託管的基金財產與基金託管人自有財產以及不同的基金財產相互獨立；對所託管的不同的基金分別設置賬戶，獨立核算，分賬管理，保證不同基金之間在賬戶設置、資金劃撥、賬冊記錄等方面相互獨立；

（4）除依據《基金法》、《基金合同》及其他有關規定外，不得利用基金財產為自己及任何第三人謀取利益，不得委託第三人託管基金財產；

-
-
- (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、期货结算账户等投资所需账户，按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
- (7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露，但因监管机构、司法机关等有权机关的要求，或因审计、法律等外部专业顾问提供服务需要提供的情况除外；
- (8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、各类基金份额净值、基金份额申购、赎回价格及法律法规规定的相关内容；
- (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、基金季度报告、基金中期报告和基金年度报告出具意见，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不低于法律法规规定的最低期限；
- (12) 从基金管理人或其委托的登记机构处接收并保存基金份额持有人名册；
- (13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
- (14) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；
- (15) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
- (16) 按照法律法规和《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。

5、基金份额持有人的权利

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。

6、基金份额持有人的义务

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任何原因获得的不当得利；
- （9）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

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

本基金份额持有人大会不设日常机构。

（一）召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会（法律法规、中国证监会另有规定或基金合同另有约定的除外）：

- （1）终止《基金合同》；
- （2）更换基金管理人；
- （3）更换基金托管人；
- （4）转换基金运作方式；
- （5）调整基金管理人、基金托管人的报酬标准或提高销售服务费率；
- （6）变更基金类别；
- （7）本基金与其他基金的合并；
- （8）变更基金投资目标、范围或策略；
- （9）变更基金份额持有人大会程序；
- （10）基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；

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

（12）对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

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

2、在法律法规规定和《基金合同》约定的范围内且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，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、销售服务费率或在现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下变更收费方式；

（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重大变化；

（5）在法律法规规定或中国证监会许可的范围内且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，增加或调整基金份额类别设置、停止现有基金份额类别的销售或调整基金份额分类办法及规则；

（6）在法律法规规定或中国证监会许可的范围内且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金推出新业务或服务；

（7）按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

（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

自收到書面提議之日起 10 日內決定是否召集，並書面告知提出提議的基金份額持有人代表和基金託管人。基金管理人決定召集的，應當自出具書面決定之日起 60 日內召開；基金管理人決定不召集，代表基金份額 10%以上（含 10%）的基金份額持有人仍認為有必要召開的，应当向基金託管人提出書面提議。基金託管人應當自收到書面提議之日起 10 日內決定是否召集，並書面告知提出提議的基金份額持有人代表和基金管理人；基金託管人決定召集的，應當自出具書面決定之日起 60 日內召開並告知基金管理人，基金管理人應當配合。

5、代表基金份額 10%以上（含 10%）的基金份額持有人就同一事項要求召開基金份額持有人大會，而基金管理人、基金託管人都不召集的，單獨或合計代表基金份額 10%以上（含 10%）的基金份額持有人有權自行召集，並至少提前 30 日報中國證監會備案。基金份額持有人依法自行召集基金份額持有人大會的，基金管理人、基金託管人應當配合，不得阻礙、干擾。

6、基金份額持有人會議的召集人負責選擇確定開會時間、地點、方式和權益登記日。

（三）召開基金份額持有人大會的通知時間、通知內容、通知方式

1、召開基金份額持有人大會，召集人應於會議召開前 30 日，在規定媒介公告。基金份額持有人大會通知應至少載明以下內容：

- （1）會議召開的時間、地點和會議形式；
- （2）會議擬審議的事項、議事程序和表決方式；
- （3）有權出席基金份額持有人大會的基金份額持有人的權益登記日；
- （4）授權委託證明的內容要求（包括但不限於代理人身份，代理權限和代理有效期限等）、送達時間和地點；
- （5）會務常設聯繫人姓名及聯繫電話；
- （6）出席會議者必須準備的文件和必須履行的手續；
- （7）召集人需要通知的其他事項。

2、採取通訊開會方式並進行表決的情況下，由會議召集人決定在會議通知中說明本次基金份額持有人大會所採取的具體通訊方式、委託的公證機關及其聯繫方式和聯繫人、表決意見寄交的截止時間和收取方式。

3、如召集人為基金管理人，還應另行書面通知基金託管人到指定地點對表

決意見的計票進行監督；如召集人為基金託管人，則應另行書面通知基金管理人到指定地點對表決意見的計票進行監督；如召集人為基金份額持有人，則應另行書面通知基金管理人和基金託管人到指定地點對表決意見的計票進行監督。基金管理人或基金託管人拒不派代表對表決意見的計票進行監督的，不影響表決意見的計票效力。

（四）基金份額持有人出席會議的方式

基金份額持有人大會可通過現場開會方式、通訊開會方式或法律法規、監管機構允許的其他方式召開，會議的召開方式由會議召集人確定。

1、現場開會。由基金份額持有人本人出席或以代理投票授權委託證明委派代表出席，現場開會時基金管理人和基金託管人的授權代表應當列席基金份額持有人大會，基金管理人或基金託管人不派代表列席的，不影響表決效力。現場開會同時符合以下條件時，可以進行基金份額持有人大會議程：

（1）親自出席會議者持有基金份額的憑證、受託出席會議者出具的委託人持有基金份額的憑證及委託人的代理投票授權委託證明符合法律法規、《基金合同》和會議通知的規定，並且持有基金份額的憑證與基金管理人持有的登記資料相符；

（2）經核對，匯總到會者出示的在權益登記日持有基金份額的憑證顯示，有效的基金份額不少於本基金在權益登記日基金總份額的二分之一（含二分之一）。若到會者在權益登記日代表的有效的基金份額少於本基金在權益登記日基金總份額的二分之一，召集人可以在原公告的基金份額持有人大會召開時間的 3 個月以後、6 個月以內，就原定審議事項重新召集基金份額持有人大會。重新召集的基金份額持有人大會到會者在權益登記日代表的有效的基金份額應不少於本基金在權益登記日基金總份額的三分之一（含三分之一）。

2、通訊開會。通訊開會系指基金份額持有人將其對表決事項的投票以書面形式或基金合同约定的其他方式在表決截止日以前送達至召集人指定的地址或系統。通訊開會應以書面方式或基金合同约定的其他方式進行表決。

在同時符合以下條件時，通訊開會的方式視為有效：

（1）會議召集人按《基金合同》約定公布會議通知後，在 2 個工作日內連續公布相關提示性公告；

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

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

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

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

4、在会议召开方式上，在法律法规和监管机构允许的情况下，本基金亦可采用其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开基金份额持有人大会，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。表决方式上，在法律法规和监管机构允许的情况下，基金份额持有人也可以采用网络、电话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载明。

（五）议事内容与程序

1、议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如《基金合同》的重大修改、决定终止《基金合同》、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合

并、法律法规及《基金合同》规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

2、议事程序

（1）现场开会

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

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

（2）通讯开会

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

（六）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

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

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持

表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。除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，除非在计票时监督员及公证机关均认为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基金份额持有人身份文件的表决视为有效出席的基金份额持有人，表面符合会议通知规定的表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

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

（七）计票

1、现场开会

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

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

（3）如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有怀疑，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

在通訊開會的情況下，計票方式為：由大會召集人授權的兩名監督員在基金託管人授權代表（若由基金託管人召集，則為基金管理人授權代表）的監督下進行計票，並由公證機關對其計票過程予以公證。基金管理人或基金託管人拒派代表對表決意見的計票進行監督的，不影響計票和表決結果。

（八）生效與公告

基金份額持有人大會的決議，召集人應當自通過之日起 5 日內報中國證監會備案。

基金份額持有人大會的決議自表決通過之日起生效。

基金份額持有人大會決議自生效之日起 2 日內在規定媒介上公告。如果採用通訊方式進行表決，在公告基金份額持有人大會決議時，必須將公證書全文、公證機構、公證員姓名等一同公告。

基金管理人、基金託管人和基金份額持有人應當執行生效的基金份額持有人大會的決議。生效的基金份額持有人大會決議對全體基金份額持有人、基金管理人、基金託管人均有約束力。

（九）實施側袋機制期間基金份額持有人大會的特殊約定

若本基金實施側袋機制，則相關基金份額或表決權的比例指主袋份額持有人和側袋份額持有人分別持有或代表的基金份額或表決權符合該等比例，但若相關基金份額持有人大會召集和審議事項不涉及側袋帳戶的，則僅指主袋份額持有人持有或代表的基金份額或表決權符合該等比例：

1、基金份額持有人行使提議權、召集權、提名權所需單獨或合計代表相關基金份額 10%以上（含 10%）；

2、現場開會的到會者在權益登記日代表的基金份額不少於本基金在權益登記日相關基金份額的二分之一（含二分之一）；

3、通訊開會的直接出具表決意見或授權他人代表出具表決意見的基金份額持有人所持有的基金份額不少於在權益登記日相關基金份額的二分之一（含二分之一）；

4、在參與基金份額持有人大會投票的基金份額持有人所持有的基金份額小於在權益登記日相關基金份額的二分之一、召集人在原公告的基金份額持有人大會召開時間的 3 個月以後、6 個月以內就原定審議事項重新召集的基金份額持有

人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）相关基金份额的持有人参与或授权他人参与基金份额持有人大会投票；

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

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

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

同一主侧袋账户内的每份基金份额具有平等的表决权。

（十）本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规的部分，如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人应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自生效后方可执行，自决议生效后两日内在规定媒介公告。

（二）《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：

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

（三）基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起30个工作日内成立基金财产清算小组，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《中华人民共和国证券法》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）聘请符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- （6）将清算报告报中国证监会备案并公告；
- （7）对基金剩余财产进行分配。

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

（四）清算费用

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

（五）基金财产清算剩余资产的分配

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

（六）基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报

中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算小组进行公告，基金财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

（七）基金财产清算账册及文件的保存

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

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，应经友好协商、调解解决。如经友好协商、调解未能解决的，则任何一方有权将争议提交上海国际经济贸易仲裁委员会，仲裁地点为上海市，按照该会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

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（为本基金合同之目的，不包括香港、澳门和台湾地区）法律管辖。

五、基金合同存放地和投资人取得基金合同的方式

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

第二十一部分 托管协议内容摘要

一、基金托管协议当事人

（一）基金管理人

名称：国泰基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区浦东大道 1200 号 2 层 225 室

办公地址：上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 16 层-19 层

邮政编码：200082

法定代表人：邱军

成立时间：1998 年 3 月 5 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监基字【1998】5 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：壹亿壹仟万元人民币

存续期间：持续经营

经营范围：基金设立、基金业务管理，及中国证监会批准的其他业务

（二）基金托管人

名称：平安银行股份有限公司(简称：平安银行)

注册住所：广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号

办公地址：广东省深圳市福田区益田路 5023 号

法定代表人：谢永林

成立日期：1987 年 12 月 22 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：19,405,918,198 元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监许可[2008]1037 号

联系人：刘华栋

联系电话：(0755) 2216 6388

经营范围：办理人民币存、贷、结算、汇兑业务；人民币票据承兑和贴现；

各項信託業務；經監管機構批准發行或買賣人民幣有價證券；外匯存款、匯款；境內境外借款；在境內境外發行或代理發行外幣有價證券；貿易、非貿易結算；外幣票據的承兌和貼現；外匯放款；代客買賣外匯及外幣有價證券，自營外匯買賣；資信調查、諮詢、見證業務；保險兼業代理業務；黃金進口業務；經有關監管機構批准或允許的其他業務。

二、基金託管人對基金管理人的業務監督和核査

（一）基金託管人根據有關法律法規的規定及基金合同的約定，對基金投資範圍、投資對象進行監督。基金合同明確約定基金投資風格或證券選擇標準的，基金管理人應按照基金託管人要求的格式提供投資品種池，以便基金託管人運用相關技術系統，對基金實際投資是否符合基金合同關於證券選擇標準的約定進行監督，對存在疑義的事項進行核査。

本基金的投資範圍為具有良好流動性的金融工具，包括國內依法發行上市的股票（包括主板、創業板及其他中國證監會允許基金投資的股票、存託憑證）、港股通標的股票、債券（包括國債、央行票據、金融債、企業債、公司債、公开发行的次級債、地方政府債、政府支持機構債券、中期票據、可轉換債券（含分離交易可轉債）、可交換債券、短期融資券、超短期融資券）、資產支持證券、債券回購、銀行存款、同業存單、貨幣市場工具、國債期貨以及法律法規或中國證監會允許基金投資的其他金融工具，但須符合中國證監會的相關規定。

基金的投資組合比例為：本基金投資於債券資產的比例不低於基金資產的 80%；投資於股票、可轉換債券（含分離交易可轉債）、可交換債券的比例合計不超過基金資產的 20%（其中港股通標的股票投資比例不超過全部股票資產的 50%）；每個交易日日終在扣除國債期貨合約需繳納的交易保證金後，本基金保持不低於基金資產淨值 5% 的現金或者到期日在一年以內的政府債券，其中現金不包括結算備付金、存出保證金和應收申購款等。

如法律法規或監管機構以後允許基金投資其他品種或變更投資比例限制，基金管理人在履行適當程序後，可以相應調整本基金的投資範圍和投資比例規定。

（二）基金託管人根據有關法律法規的規定及基金合同的約定，對基金投資、融資比例進行監督。基金託管人按下述比例和調整期限進行監督：

（1）本基金投資於債券資產的比例不低於基金資產的 80%；

（2）本基金投資於股票、可轉換債券（含分離交易可轉債）、可交換債券的比例合計不超過基金資產的 20%（其中港股通標的股票投資比例不超過全部股票資產的 50%）；

（3）每個交易日日終在扣除國債期貨合約需繳納的交易保證金後，本基金保持不低於基金資產淨值 5% 的現金或者到期日在一年以內的政府債券，其中現金不包括結算備付金、存出保證金和應收申購款等；

（4）本基金持有一家公司發行的證券（同一家公司在境內和香港同時上市的 A+H 股合計計算），其市值不超過基金資產淨值的 10%；

（5）本基金管理人管理且由本基金託管人託管的全部基金持有一家公司發行的證券（同一家公司在境內和香港同時上市的 A+H 股合計計算），不超過該證券的 10%，完全按照有關指數的構成比例進行證券投資的基金品種可以不受此條款規定的比例限制；

（6）本基金投資於同一原始權益人的各類資產支持證券的比例，不得超過基金資產淨值的 10%；

（7）本基金持有的全部資產支持證券，其市值不得超過基金資產淨值的 20%；

（8）本基金持有的同一（指同一信用級別）資產支持證券的比例，不得超過該資產支持證券規模的 10%；

（9）本基金管理人管理且由本基金託管人託管的全部基金投資於同一原始權益人的各類資產支持證券，不得超過其各類資產支持證券合計規模的 10%；

（10）本基金持有資產支持證券期間，如果其信用等級下降、不再符合投資標準，應在評級報告發布之日起 3 個月內予以全部賣出；

（11）本基金投資於國債期貨的投資限制如下：

1）本基金在任何交易日日終，持有的買入國債期貨合約價值，不得超過基金資產淨值的 15%；

2）本基金在任何交易日日終，持有的賣出國債期貨合約價值不得超過基金持有的債券總市值的 30%；

3）本基金在任何交易日內交易（不包括平倉）的國債期貨合約的成交金額不得超過上一交易日基金資產淨值的 30%；

4）本基金所持有的債券（不含到期日在一年以內的政府債券）市值和買入、

賣出國債期貨合約價值，合計（軋差計算）應當符合基金合同關於債券投資比例的有關約定；

（12）基金財產參與股票發行申購，本基金所申報的金額不超過本基金的總資產，本基金所申報的股票數量不超過擬發行股票公司本次發行股票的總量；

（13）本基金進入全國銀行間同業市場進行債券回購的最長期限為 1 年，債券回購到期後不得展期；

（14）本基金管理人管理且由本基金托管人托管的全部開放式基金持有一家上市公司發行的可流通股票，不得超過該上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投資組合持有一家上市公司發行的可流通股票，不得超過該上市公司可流通股票的 30%；完全按照有關指數的構成比例進行證券投資的開放式基金以及中國證監會認定的特殊投資組合可不受前述比例限制；

（15）本基金主動投資於流動性受限資產的市值合計不得超過本基金資產淨值的 15%；因證券市場波動、上市公司股票停牌、基金規模變動等基金管理人之外的因素致使基金不符合該比例限制的，基金管理人不得主動新增流動性受限資產的投資；

（16）本基金與私募類證券資管產品及中國證監會認定的其他主體為交易對手開展逆回購交易的，可接受質押品的資質要求應當與基金合同约定的投資範圍保持一致；

（17）本基金資產總值不超過基金資產淨值的 140%；

（18）本基金投資存托憑證的比例限制依照境內上市交易的股票執行，與境內上市交易的股票合併計算；

（19）法律法規及中國證監會規定的和《基金合同》约定的其他投資限制。

除上述（3）、（10）、（15）、（16）情形之外，因證券/期貨市場波動、證券發行人合併、基金規模變動等基金管理人之外的因素致使基金投資比例不符合上述規定投資比例的，基金管理人應當在相關證券可交易的 10 個交易日內進行調整，但中國證監會規定的特殊情形除外。法律法規另有規定的從其規定。

基金管理人應當自基金合同生效之日起 6 個月內使基金的投資組合比例符合基金合同的有關約定。在上述期間內，本基金的投資範圍、投資策略應當符合基金合同的約定。基金托管人對基金投資的監督與檢查自基金合同生效之日起開

始。

法律法規或監管部門取消或變更上述限制，如適用於本基金，基金管理人在履行適當程序後，則本基金投資不再受相關限制或以變更後的規定為準，無需召開基金份額持有人大會審議。

（三）基金託管人根據有關法律法規的規定及基金合同的約定，通過事後監督方式對基金管理人基金投資禁止行為進行監督。

根據法律法規有關基金從事關聯交易的規定，基金管理人和基金託管人應事先相互提供與本機構有控股關係的股東、與本機構有重大利害關係的公司名單及有關關聯方發行的證券名單。基金管理人和基金託管人有責任確保關聯交易名單的真實性、準確性、完整性，並負責及時將更新後的名單發送給對方。

（四）基金託管人根據有關法律法規的規定及基金合同的約定，對基金管理人參與銀行間債券市場進行監督。基金管理人應在基金投資運作之前向基金託管人提供符合法律法規及行業標準的、經慎重選擇的、本基金適用的銀行間債券市場交易對手名單，並約定各交易對手所適用的交易結算方式。基金管理人應嚴格按照交易對手名單的範圍在銀行間債券市場選擇交易對手。基金託管人監督基金管理人是否按事前提供的銀行間債券市場交易對手名單進行交易。基金管理人可以每半年對銀行間債券市場交易對手名單及結算方式進行更新，新名單確定前已與本次剔除的交易對手所進行但尚未結算的交易，仍應按照協議進行結算。如基金管理人根據市場情況需要臨時調整銀行間債券市場交易對手名單及結算方式的，應向及時向基金託管人說明理由，協商解決。

基金管理人負責對交易對手的資信控制，按銀行間債券市場的交易規則進行交易，並負責解決因交易對手不履行合同而造成的糾紛及損失，基金託管人不承擔由此造成的任何法律責任及損失。若未履約的交易對手在基金託管人與基金管理人確定的時間前仍未承擔違約責任及其他相關法律責任的，基金管理人可以對相應損失先行予以承擔，然後再向相關交易對手追償。基金託管人則根據銀行間債券市場成交單對合同履行情況進行監督。如基金託管人事後發現基金管理人沒有按照事先約定的交易對手或交易方式進行交易時，基金託管人應及時提醒基金管理人，基金託管人不承擔由此造成的任何損失和責任。

（五）基金託管人根據有關法律法規的規定及基金合同的約定，對基金投資

中期票据进行监督。

（六）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金资产净值计算、各类基金份额的基金份额净值计算、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。

（七）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及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函，就基金托管人的合理疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

（八）基金管理人负有义务配合和协助基金托管人依照法律法规、基金合同和本托管协议对基金业务执行核查。对基金托管人发出的书面提示，基金管理人应在规定时间内答复并改正，或就基金托管人的合理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。

（九）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，由此造成的损失由基金管理人承担，基金托管人在履行其通知义务后，予以免责。

（十）基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为，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、基金管理人对基金托管人的业务核查

（一）基金管理人对基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户、证券账户、期货结算

賬戶等投資所需賬戶、復核基金管理人計算的基金資產淨值和各類基金份額的基金份額淨值、根據基金管理人指令辦理清算交收、相關信息披露和監督基金投資運作等行為。

（二）基金管理人發現基金託管人擅自挪用基金財產、未對基金財產實行分賬管理、未執行或無故延遲執行基金管理人資金撥款指令、洩露基金投資信息等違反《基金法》、基金合同、本協議及其他有關規定時，應及時以書面形式通知基金託管人限期糾正。基金託管人收到通知後應及時核對並以書面形式給基金管理人發出回函，說明違規原因及糾正期限，並保證在規定期限內及時改正。在上述規定期限內，基金管理人有权隨時對通知事項進行復查，督促基金託管人改正。基金託管人應積極配合基金管理人的核實行為，包括但不限於：提交相關資料以供基金管理人核實託管財產的完整性和真實性，在規定期限內答復基金管理人並改正。

（三）基金管理人發現基金託管人有重大違規行為，應及時報告中國證監會，同時通知基金託管人限期糾正，並將糾正結果報告中國證監會。基金託管人無正當理由，拒絕、阻撓對方根據本協議規定行使監督權，或採取拖延、欺詐等手段妨礙對方進行有效監督，情節嚴重或經基金管理人提出警告仍不改正的，基金管理人應報告中國證監會。

四、基金財產的保管

（一）基金財產保管的原則

1. 基金財產應獨立於基金管理人、基金託管人的固有財產。
2. 基金託管人應安全保管基金財產。未經基金管理人依據合法程序作出的合法合規指令，基金託管人不得自行運用、處分、分配基金的任何財產。
3. 基金託管人按照規定開設基金財產的資金賬戶、證券賬戶、期貨結算賬戶等投資所需賬戶。
4. 基金託管人對所託管的不同基金財產分別設置賬戶，確保基金財產的完整與獨立。
5. 基金託管人根據基金管理人的指令，按照基金合同和本協議的約定保管基金財產，如有特殊情況雙方可另行協商解決。
6. 對於因為基金投資產生的應收資產，應由基金管理人負責與有關當事人

確定到賬日期並通知基金託管人，到賬日基金財產沒有到達基金賬戶的，基金託管人應及時通知基金管理人採取措施進行催收。由此給基金財產造成損失的，基金管理人應負責向有關當事人追償基金財產的損失，基金託管人對此不承擔相應責任。

7. 除依據法律法規和基金合同的規定外，基金託管人不得委託第三人託管基金財產。

（二）基金募集期間及募集資金的驗資

1. 基金募集期間募集的資金應存於在基金託管人的營業機構開立的“基金募集專戶”，該賬戶由基金管理人開立並管理。

2. 基金募集期滿或基金停止募集時，募集的基金份額總額、基金募集金額、基金份額持有人人數符合《基金法》、《運作辦法》等有關規定後，基金管理人應將屬於基金財產的全部資金劃入基金託管人開立的基金銀行賬戶，同時在規定時間內，聘請符合《中華人民共和國證券法》規定的會計師事務所進行驗資，出具驗資報告。出具的驗資報告由參加驗資的 2 名或 2 名以上中國註冊會計師簽字方為有效。

3. 若基金募集期限屆滿，未能達到基金合同生效的條件，由基金管理人按規定辦理退款等事宜，基金託管人應提供充分協助。

（三）基金銀行賬戶的開立和管理

1. 基金託管人應負責本基金的銀行賬戶的開設和管理。

2. 基金託管人根據有關規定以本基金的名義在其營業機構開立銀行賬戶，並根據基金管理人合法合規的指令辦理資金收付。基金管理人授權基金託管人辦理本基金銀行賬戶的開立、銷戶、變更工作，本基金銀行賬戶無需預留印鑑，具體按基金託管人要求辦理。基金銀行賬戶的開立和使用，限於滿足開展本基金業務的需要。基金託管人和基金管理人不得假借本基金的名義開立任何其他銀行賬戶；亦不得使用基金的任何賬戶進行本基金業務以外的活動。

3. 基金銀行賬戶的開立和管理應符合銀行業監督管理機構的有關規定。

（四）基金證券賬戶和結算備付金賬戶的開立和管理

1. 基金託管人在中國證券登記結算有限責任公司上海分公司、深圳分公司為基金開立基金託管人與本基金聯名的證券賬戶。

2. 基金證券賬戶的開立和使用，僅限於滿足開展本基金業務的需要。基金託管人和基金管理人不得借出或未經對方同意擅自轉讓基金的任何證券賬戶，亦不得使用基金的任何賬戶進行本基金業務以外的活動。

3. 基金證券賬戶的開立和證券賬戶卡的保管由基金託管人負責，賬戶資產的管理和運用由基金管理人負責。

4. 基金託管人以自身法人名義在中國證券登記結算有限責任公司開立結算備付金賬戶，並代表所託管的基金完成與中國證券登記結算有限責任公司的一級法人清算工作，基金管理人應予以積極協助。結算備付金等的收取按照中國證券登記結算有限責任公司的規定執行。

5. 若中國證監會或其他監管機構在本託管協議訂立日之後允許基金從事其他投資品種的投資業務，涉及相關賬戶的開立、使用的，若無相關規定，則基金託管人比照上述關於賬戶開立、使用的規定執行。

（五）債券託管專戶的開設和管理

基金合同生效後，基金託管人根據中國人民銀行、中央國債登記結算有限責任公司、銀行間清算所股份有限公司的有關規定，在中央國債登記結算有限責任公司、銀行間清算所股份有限公司根據有關規定以本基金的名義為基金開立債券託管賬戶，並代表本基金進行銀行間市場債券的結算。基金管理人和基金託管人共同代表本基金簽訂全國銀行間債券市場債券回購主協議。

（六）其他賬戶的開立和管理

1. 因業務發展需要而開立的其他賬戶，可以根據法律法規和基金合同的規定開立，在基金管理人和基金託管人商議後由基金託管人負責開立。新賬戶按有關規定使用並管理。

2. 法律法規等有關規定對相關賬戶的開立和管理另有規定的，從其規定辦理。

（七）基金財產投資的有關有價憑證等的保管

基金財產投資的有關實物證券等有價憑證由基金託管人存放於基金託管人的保管庫，也可存入中央國債登記結算有限責任公司、中國證券登記結算有限責任公司上海分公司/深圳分公司或票據營業中心的代保管庫，保管憑證由基金託管人持有。實物證券等有價憑證的購買和轉讓，由基金管理人和基金託管人共同

辦理。基金托管人對由基金托管人以外機構實際有效控制的證券不承擔保管責任。

（八）與基金財產有關的重大合同的保管

與基金財產有關的重大合同的簽署，由基金管理人負責。由基金管理人代表基金簽署的、與基金財產有關的重大合同的原件分別由基金管理人、基金托管人保管。除本協議另有規定外，基金管理人代表基金簽署的與基金財產有關的重大合同包括但不限於基金年度審計合同、基金信息披露協議及基金投資業務中產生的重大合同，基金管理人應保證基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。重大合同的保管期限不少於法律法規規定的最低期限。

五、基金資產淨值計算和會計核算

（一）基金資產淨值的計算、復核與完成的時間及程序

1. 基金資產淨值

基金資產淨值是指基金資產總值減去基金負債後的價值。

任一類基金份額淨值是按照每個工作日閉市後，該類基金份額的基金資產淨值除以當日該類基金份額的餘額數量計算，精確到 0.0001 元，小數點後第 5 位四舍五入。基金管理人可以設立大額贖回情形下的淨值精度應急調整機制。國家另有規定的，從其規定。

基金管理人於每個工作日計算基金資產淨值及各類基金份額淨值，並按規定公告。

2. 復核程序

基金管理人應於每個工作日對基金資產估值。但基金管理人根據法律法規或基金合同的規定暫停估值時除外。基金管理人每個工作日對基金資產估值後，將各類基金份額淨值結果發送基金托管人，經基金托管人復核無誤後，由基金管理人按約定對外公布。

3. 根據有關法律法規，基金資產淨值計算和基金會計核算的義務由基金管理人承擔。本基金的基金會計責任方由基金管理人擔任，因此，就與本基金有關的會計問題，如經相關各方在平等基礎上充分討論後，仍無法達成一致意見的，按照基金管理人對基金淨值信息的計算結果對外予以公布。

（二）基金資產估值方法和特殊情形的處理

1. 估值對象

基金所拥有的股票、债券、银行存款本息、资产支持证券、国债期货合约、应收款项、其他投资等资产及负债。

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

2) 交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种，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；

3) 交易所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) 交易所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。在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

6) 对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的固定收益品种，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，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，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。

（3）对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种，回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的按照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。

（4）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。

（5）因持有股票而享有的配股权，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。

（6）本基金投资同业存单，采用估值日第三方估值机构提供的估值价格数据进行估值。

（7）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。

（8）本基金投资的国债期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。国家有最新规定的，按其规定进行估值。

（9）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，国家有最新规定的，按其规定进行估值。

（10）估值涉及到港币等主要货币对人民币汇率的，应当以基金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。

（11）税收：对于按照中国法律法规和基金投资境内外股票市场交易互联互通机制涉及的境外交易场所所在地的法律法规规定应交纳的各项税金，本基金将按权责发生制原则进行估值；对于因税收规定调整或其他原因导致基金实际交纳税金与估算的应交税金有差异的，基金将在相关税金调整日或实际支付日进行相

应的估值调整。

（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）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。

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

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

3. 特殊情形的处理

基金管理人、基金托管人按估值方法的第（13）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。

由于证券交易所、期货交易所、期货公司、登记结算公司及存款银行等第三方机构发送的数据错误或者其他不可抗力等，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

对于因税收规定调整或其他原因导致基金实际交纳税金与基金按照权责发生制进行估值的应交税金有差异的，相关估值调整不作为基金资产估值错误处理。

（三）基金份额净值错误的处理方式

1. 当某一类基金份额净值小数点后4位以内（含第4位）发生估值错误时，视为该类基金份额净值错误；基金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；错误偏差达到该类基金份额净值的0.25%时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到该类基金份额净值的0.5%时，基金管理人应当公告，并报中国证监会备案；当发生净值计算错误时，由基金管理人负责处理，由此给

基金份額持有人和基金造成損失的，應由基金管理人先行賠付，基金管理人按差錯情形，有權向其他當事人追償。

2. 當基金份額淨值計算差錯給基金和基金份額持有人造成損失需要進行賠償時，基金管理人和基金託管人應根據實際情況界定雙方各自分別承擔的責任，經確認後按以下條款進行賠償：

A. 本基金的基金會計責任方由基金管理人擔任，與本基金有關的會計問題，如經雙方在平等基礎上充分討論後，尚不能達成一致時，按基金管理人的建議執行，由此給基金份額持有人和基金財產造成的損失，由基金管理人負責賠付，基金託管人不承擔任何責任。

B. 若基金管理人計算的基金份額淨值已由基金託管人復核確認後公告，而且基金託管人未對計算過程提出疑義或要求基金管理人書面說明，基金份額淨值出錯且造成基金份額持有人損失的，應根據法律法規的規定對投資者或基金支付賠償金，就實際向投資者或基金支付的賠償金額，基金管理人和基金託管人按照管理費和託管費的比例各自分別承擔相應的責任。

C. 如基金管理人和基金託管人對基金份額淨值的計算結果，雖然多次重新計算和核對，尚不能達成一致時，為避免不能按時公布基金份額淨值的情形，以基金管理人的計算結果對外公佈，由此給基金份額持有人和基金造成的損失，由基金管理人負責賠付，基金託管人不承擔任何責任。

D. 由於基金管理人提供的信息錯誤（包括但不限於基金申購或贖回金額等），進而導致基金份額淨值計算錯誤而引起的基金份額持有人和基金財產的損失，由基金管理人負責賠付，基金託管人不承擔任何責任。

3. 由於證券交易所、期貨交易所、期貨公司、登記結算公司及存款銀行等第三方機構發送的数据錯誤或者由於其他不可抗力等，基金管理人和基金託管人雖然已經採取必要、適當、合理的措施進行檢查，但未能發現錯誤的，由此造成的基金資產估值錯誤，基金管理人和基金託管人免除賠償責任。但基金管理人、基金託管人應當積極採取必要的措施減輕或消除由此造成的影響。

4. 基金管理人和基金託管人由於各自技術系統設置而產生的淨值計算尾差，以基金管理人計算結果為準。

5. 前述內容如法律法規或者監管部門另有規定的，從其規定處理。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）暂停估值与公告基金份额净值的情形

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

2. 因不可抗力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。基金托管人按规定制作相关账册并与基金管理人核对。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。

基金管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载在规定网站上，并将年度报告提示性公告登载在规定报刊上。基金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）基金管理人应在编制季度报告、中期报告或者年度报告之前及时向基金托管人提供基金业绩比较基准的基础数据和编制结果。

六、基金份额持有人名册的保管

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，基金管理人和基金托管人应分别保管基金份额持有人名册，保存期不少于法律法规规定的最低期限。如不能妥善保管，则按相关法规承担责任。

基金托管人依法编制中期报告和年度报告前有向基金管理人搜集资料的权利，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，并保证其的真实性、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。

七、争议解决方式

因本协议产生或与之相关的争议，双方当事人应通过协商、调解解决，协商、

調解不能解決的，則任何一方有權將爭議提交上海國際經濟貿易仲裁委員會，仲裁地點為上海市，按照該會屆時有效的仲裁規則進行仲裁。仲裁裁決是終局的，對仲裁各方當事人均具有約束力，仲裁費用由敗訴方承擔。

爭議處理期間，雙方當事人應恪守基金管理人和基金托管人職責，各自繼續忠實、勤勉、盡責地履行基金合同和本托管協議規定的義務，維護基金份額持有人的合法權益。

本協議受中國（為本協議之目的，不包括香港、澳門和台灣地區）法律管轄。

八、托管協議的變更、終止與基金財產的清算

（一）托管協議的變更程序

本協議雙方當事人經協商一致，可以對協議進行修改。修改後的新協議，其內容不得與基金合同的規定有任何衝突。基金托管協議的變更報中國證監會備案後生效。

（二）基金托管協議終止出現的情形

1. 基金合同終止；
2. 基金托管人解散、依法被撤銷、破產或由其他基金托管人接管基金資產；
3. 基金管理人解散、依法被撤銷、破產或由其他基金管理人接管基金管理權；
4. 發生法律法規和中國證監會或基金合同規定的終止事項。

（三）基金財產的清算

1. 基金財產清算小組

1) 自出現《基金合同》終止事由之日起 30 個工作日內成立基金財產清算小組，基金管理人組織基金財產清算小組並在中國證監會的監督下進行基金清算。

2) 基金財產清算小組成員由基金管理人、基金托管人、符合《中華人民共和國證券法》規定的注冊會計師、律師以及中國證監會指定的人員組成。基金財產清算小組可以聘用必要的工作人員。

3) 基金財產清算小組負責基金財產的保管、清理、估價、變現和分配。基金財產清算小組可以依法進行必要的民事活動。

2. 基金財產清算程序

基金合同終止，應當按法律法規和基金合同的有關規定對基金財產進行清算。

基金財產清算程序主要包括：

- 1) 基金合同終止情形出現時，由基金財產清算小組統一接管基金；
 - 2) 對基金財產和債權債務進行清理和確認；
 - 3) 對基金財產進行估值和變現；
 - 4) 制作清算報告；
 - 5) 聘請符合《中華人民共和國證券法》規定的會計師事務所對清算報告進行外部審計，聘請律師事務所對清算報告出具法律意見書；
 - 6) 將清算報告報中國證監會備案並公告；
 - 7) 對基金剩餘財產進行分配。
3. 基金財產清算的期限為 6 個月，但因基金所持證券的流動性受到限制而不能及時變現的，清算期限相應順延。

（四）清算費用

清算費用是指基金財產清算小組在進行基金財產清算過程中發生的所有合理費用，清算費用由基金財產清算小組優先從基金財產中支付。

（五）基金財產按下列順序清償：

- 1) 支付清算費用；
- 2) 交納所欠稅款；
- 3) 清償基金債務；
- 4) 按基金份額持有人持有的基金份額比例進行分配。

基金財產未按前款 1) -3) 項規定清償前，不分配給基金份額持有人。

（六）基金財產清算的公告

清算過程中的有關重大事項須及時公告；基金財產清算報告經符合《中華人民共和國證券法》規定的會計師事務所審計並由律師事務所出具法律意見書後報中國證監會備案並公告。基金財產清算公告於基金財產清算報告報中國證監會備案後 5 個工作日內由基金財產清算小組進行公告，基金財產清算小組應當將清算報告登載在規定網站上，並將清算報告提示性公告登載在規定報刊上。

（七）基金財產清算賬冊及文件的保存

基金財產清算賬冊及有關文件由基金託管人保存，保存期限不低於法律法規規定的最低期限。

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。以下是主要的服务内容，基金管理人根据基金份额持有人的需要和市场的变化，有权增加、修改这些服务项目。

一、客户服务专线

- 1、理财咨询：人工理财咨询、账户查询、投资人个人资料完善等。
- 2、全天候的7×24小时电话自助查询（基金净值、账户信息等）。

二、客户投诉及建议受理服务

投资人可以通过电话、信函、电邮、传真等方式提出咨询、建议、投诉等需求，基金管理人将尽快给予回复，并在处理进程中随时给予跟踪反馈。

三、短信提示发送服务

投资人可以通过拨打基金管理人客户服务电话、网站申请订制（退订）免费的手机短信资讯。基金管理人定期或不定期向投资人发送短信资讯。

四、电子邮件电子刊物发送服务

投资人可以通过拨打基金管理人客户服务电话、网站申请订制（退订）免费的电子邮件资讯。基金管理人定期或不定期向投资人发送电子资讯。

五、联系基金管理人

- 1、网址：www.gtfund.com
- 2、电子邮箱：service@gtfund.com
- 3、客户服务热线：400-888-8688（全国免长途话费），021-31089000
- 4、客户服务传真：021-31081700
- 5、基金管理人办公地址：上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层

-19层

邮编：200082

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 其他应披露事项

公告名称	披露媒介	日期
国泰安瓊债券型证券投资基金基金合同生效公告	《上海证券报》	2023/1/18
国泰安瓊债券型证券投资基金开放日常申购、赎回及转换业务的公告	《上海证券报》	2023/2/16
国泰基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票及相关风险提示的公告	《上海证券报》	2023/2/22
国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《中国证券报》	2023/7/19
国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《中国证券报》	2023/9/8
国泰基金管理有限公司关于董事长变更及总经理代为履行董事长职务的公告	《中国证券报》	2023/9/28

第二十四部分 招募说明书存放及查阅方式

本招募说明书存放在本基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所，投资人可在办公时间免费查阅；也可按工本费购买本招募说明书复制件或复印件，但应以招募说明书正本为准。基金管理人和基金托管人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

第二十五部分 备查文件

以下备查文件存放在本基金管理人、基金托管人的办公场所。投资人可在办公时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

- 一、中国证监会关于准予国泰安璟债券型证券投资基金注册的批复文件
- 二、《国泰安璟债券型证券投资基金基金合同》
- 三、《国泰安璟债券型证券投资基金托管协议》
- 四、法律意见书
- 五、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 六、基金托管人业务资格批件、营业执照
- 七、中国证监会要求的其他文件

国泰基金管理有限公司

2023年10月27日