前海开源基金
First Seafront Fund

前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金

招募说明书

（20241211 更新）

基金管理人：前海开源基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

重要提示

本基金经 2016 年 5 月 3 日中国证券监督管理委员会下发的证监许可[2016]965 号文注册募集，基金合同已于 2016 年 10 月 17 日正式生效。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资人在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括但不限于：市场风险、信用风险、管理风险、流动性风险、操作和技术风险、合规性风险、股指期货投资风险、本基金特有的风险、其他风险及本法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险等。本基金为混合型基金，属于中高风险收益的投资品种，其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金，低于股票型基金。本基金若投资港股通标的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。

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表现的保证。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行承担。投资有风险，投资人在投资本基金前应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同、基金产品资料概要等信息披露文件。

特别风险揭示：本基金基金名称仅表明本基金可以通过港股通机制投资港股，本基金基金资产对港股标的投资比例会根据市场情况、投资策略等发生较大的调整，存在不对港股进行投资的可能。

本招募说明书已经本基金托管人复核（不属于基金托管人法定复核责任范围且其不掌握相关信息的内容除外），有关财务数据和净值表现截止日为 2024 年 09 月 30 日（未经审计）。

目　录

一、绪 言 3
二、释 义 4
三、基金管理人 8
四、基金托管人 19
五、相关服务机构 23
六、基金的募集 45
七、基金合同的生效 46
八、基金份额的申购与赎回 47
九、基金的投资 56
十、基金的财产 68
十一、基金资产的估值 69
十二、基金的收益分配 73
十三、基金的费用与税收 75
十四、基金的会计与审计 77
十五、基金的信息披露 78
十六、风险揭示 84
十七、基金的终止与清算 89
十八、基金合同的内容摘要 91
十九、基金托管协议的内容摘要 114
二十、对基金份额持有人的服务 130
二十一、其他应披露事项 132
二十二、招募说明书的存放及查阅方式 134
二十三、备查文件 135

一、绪 言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性风险管理规定》”)等有关法律法规的规定，以及《前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金基金合同》（以下简称基金合同）的约定编写。

本招募说明书阐述了前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”或“基金”）的投资目标、策略、风险、费率等与投资人投资决策有关的必要事项，投资人在做出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

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

本招募说明书根据本基金的基金合同编写，并经中国证监会注册。基金合同是约定基金合同当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

本招募说明书关于基金产品资料概要的编制、披露及更新等内容，将不晚于 2020 年 9 月 1 日起执行。

二、释 义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

1、基金或本基金：指前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金

2、基金管理人：指前海开源基金管理有限公司

3、基金托管人：指交通银行股份有限公司

4、基金合同：指《前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充

5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充

6、招募说明书或本招募说明书：指《前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》及其更新

7、基金份额发售公告：指《前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金基金份额发售公告》

8、法律法规：指中国（为本招募说明书之目的，在此不包括香港、澳门和台湾地区）现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等

9、《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，自 2004 年 6 月 1 日起实施，并经 2012 年 12 月 28 日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自 2013 年 6 月 1 日起实施，并经 2015 年 4 月 24 日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修改的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订

10、《销售办法》：指中国证监会 2013 年 3 月 15 日颁布、同年 6 月 1 日起实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

11、《信息披露办法》：指中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1 日起实施的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

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

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

14、《沪港通试点规定》：指中国证监会 2014 年 6 月 13 日颁布并实施的《沪港股票市场交易互联互通机制试点若干规定》及颁布机关对其不时做出的修订

15、《沪港通试点办法》：指上海证券交易所 2014 年 9 月 26 日颁布并实施的《上海证券交易所沪港通试点办法》

16、《沪港通登记、存管、结算业务实施细则》：指中国证券登记结算有限公司 2014 年 9 月 26 日颁布、实施的《沪港股票市场交易互联互通机制试点登记、存管、结算业务实施细则》

17、《沪港通交易指引》：指中国证监会 2015 年 03 月 27 日颁布并实施的《公开募集证券投资基金参与沪港通交易指引》

18、港股通：指内地投资者委托内地证券公司，经由上海证券交易所设立的证券交易服务公司，向香港联合交易所有限公司（以下简称“香港联合交易所”）进行申报，买卖规定范围内的香港联合交易所上市的股票

19、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

20、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会

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

22、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

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

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

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

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

27、基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人

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

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

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

31、登记机构：指办理登记业务的机构。基金的登记机构为前海开源基金管理有限公司或接受前海开源基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构

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

33、基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构办理认购、申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户

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

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

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

37、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

38、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

39、T日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日

40、T+n日：指自T日起第n个工作日(不包含T日)

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

42、开放时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

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

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

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

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

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

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

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

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

51、元：指人民币元

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

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

54、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

55、基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

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

57、基金份额的类别：本基金根据是否收取销售服务费，将基金份额分为不同的类别：A 类基金份额和 C 类基金份额。两类基金份额分别设置不同的基金代码，并分别计算和公布基金份额净值及基金份额累计净值

58、A 类基金份额：指不从基金资产中计提销售服务费的基金份额

59、C 类基金份额：指从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额

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

61、不可抗力：指基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

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

63、基金产品资料概要：指《前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要》及其更新（基金合同关于基金产品资料概要的编制、披露及更新等内容，将不晚于 2020 年 9 月 1 日起执行）

三、基金管理人

（一）基金管理人概况

1、名称：前海开源基金管理有限公司

2、住所：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）

3、设立日期：2013 年 1 月 23 日

4、法定代表人：李强

5、批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监许可［2012］1751 号

6、组织形式：有限责任公司

7、办公地址：深圳市福田区深南大道 7006 号万科富春东方大厦 22 楼

8、电话：0755-88601888 传真：0755-83181169

9、联系人：何凌

10、注册资本：人民币 2 亿元

11、存续期限：持续经营

12、股权结构：开源证券股份有限公司出资 25%，北京市中盛金期投资管理有限公司出资 25%，北京长和世纪资产管理有限公司出资 25%，深圳市和合投信投资合伙企业(有限合伙)出资 25%。

（二）主要人员情况

1、基金管理人董事会成员

秦亚峰先生，董事、总经理、代任董事长。清华大学硕士，中国社科院博士，国籍：中国。历任中国银行湖南分行信托咨询公司技术员，中国东方信托湖南证券营业部部门经理，银河证券湖南证券营业部部门经理，亚洲证券湖南证券营业部部门经理，华安财产保险股份有限公司资产管理中心副总经理、总经理，华安财产保险股份有限公司副总经理，华安财保资产管理有限责任公司总经理，华安汇富资本投资管理有限公司董事长。现任前海开源基金管理有限公司董事、总经理、代任董事长。

蔡颖女士，副董事长，硕士研究生，国籍：中国。历任南方证券股份有限公司广州分公司营业部电脑部主管、经纪业务部主管、电子商务部副经理，南方基金管理股份有限公司广州代表处首席代表、南方区域总部高级经理，鹏华基金管理有限公司华南营销中心（广州）副总经理、广州分公司总经理，曾任前海开源基金管理有限公司总经理、前海开源资产管理有限公司董事长。现任东原仁知城市运营服务集团股份有限公司独立董事，前海开源基金管理有限公司副董事长、董事。

王兆华先生，董事，本科学历，国籍：中国。历任中国人民银行西安分行职员，中国工商银行股份有限公司西安经济技术开发区支行副行长、分行信贷处处长，华夏证券股份

有限公司西安营业部总经理、华夏证券股份有限公司济南管理总部党委书记兼总经理、华夏证券股份有限公司总裁助理兼重庆分公司党委书记、总经理，华夏证券股份有限公司总裁助理，开源证券股份有限公司董事长兼总经理，前海开源资产管理有限公司董事长，前海开源基金管理有限公司董事长。现任前海开源基金管理有限公司董事。

范镭先生，董事，本科学历，国籍：中国。历任中国建设银行股份有限公司武汉分行、华安财产保险股份有限公司北京分公司、交通银行股份有限公司天津分行、北京长和世纪资产管理有限公司投资总监。现任北京万盛祥如投资顾问有限公司执行董事，正方天恒资产管理有限公司执行董事、总经理及前海开源基金管理有限公司董事。

SHI SHA（沙石）先生，董事，北京大学经济系本科和硕士，美国纽约州立大学石溪校园(SUNY at Stony Brook)经济学博士学位。国籍：美国。曾任国家计划经济委员会经济研究所研究员，纽约大通银行、荷兰银行助理、副总裁、董事，瑞士银行、巴克莱银行董事、执行董事以及中国金融期货交易所国际事务高级顾问等职。现任施罗德交银理财有限公司独立董事，恒泰期货股份有限公司独立董事，民生期货股份有限公司独立董事，澳帝桦（上海）商贸有限公司中国区外部顾问，以及前海开源基金管理有限公司董事。

龚方雄先生，董事，北京大学物理学学士、运筹学及经济学硕士，费城坦普尔大学物理学硕士，宾夕法尼亚大学沃顿商学院金融经济学博士。国籍：中国香港。历任美国联邦储备银行经济学家，美国银行首席策略师、全球货币及利率市场策略部联席主管，摩根大通中国区研究部主管、首席策略师、首席大中华区经济学家、中国综合公司（企业）投融资主席，摩根大通中国投资银行主席。现任方雄资本国际有限公司董事，香港恒峰资产管理有限公司董事，第一前海国际资本有限公司董事及前海开源基金管理有限公司董事。

孙金钜先生，董事，经济学硕士，国籍：中国。曾任国泰君安证券股份有限公司研究员，新时代证券股份有限公司研究所所长，开源证券股份有限公司总经理助理兼研究所所长。现任开源证券股份有限公司副总经理，前海开源基金管理有限公司董事。

Qing Li（李庆）先生，独立董事，国籍：美国。哥伦比亚大学商学院金融博士，北京大学数学学士,曾入选中国数学奥林匹克国家集训队。特许金融分析师（CFA）。历任美国 Lehman Brothers 股票自营交易部研究员，美国 Fortress Investment Group 基金经理，美国 Tykhe Capital LLC 量化投资基金经理，美国 SAC Capital Advisors 投资组合基金经理。现任美国量化投资基金公司 Siencecast Management 首席执行官、普通合伙人，前海开源基金管理有限公司独立董事。

樊臻宏先生，独立董事，国籍：中国。纽约大学 STERN 商学院商业管理博士学位。历任 ARGONAUT 资本管理公司（对冲基金）分析员，美林证券全球科技策略师，中国人寿资产管理公司国际业务部副总经理及项目部副总经理，春湖投资管理（北京）有限公司总经理，天津汇通太和投资管理有限公司总经理。现任瑞能半导体科技股份有限公司董事，北

京建广资产管理有限公司董事，叮当健康科技集团有限公司（9886.HK）独立非执行董事，前海开源基金管理有限公司独立董事。

Terence Culver 先生，独立董事，硕士学历。国籍：美国。历任哈佛大学国际发展研究所项目经理，联合国 GeSCI 组织全球新兴市场政府顾问及开发专家，哥伦比亚大学国际和公共事务学院副院长等职务。现任美国数字金融集团－DFG Fund 首席执行官、普通合伙人，前海开源基金管理有限公司独立董事。

Samuel T. Lundquist 先生，独立董事，本科学历。国籍：美国。1996 年起在美国宾夕法尼亚大学沃顿商学院工作至今。现任宾夕法尼亚大学沃顿商学院对外事务副院长，前海开源基金管理有限公司独立董事。

2、基金管理人监事会成员

骆新都女士，监事会主席，经济学硕士，经济师，国籍：中国。历任民政部外事处处长，南方证券股份有限公司副总裁，南方基金管理股份有限公司董事长、监事会主席。现任前海开源基金管理有限公司监事会主席。

陆琦先生，监事，理学学士和工学硕士学位。国籍：中国。历任穆迪信息咨询（深圳）有限公司研发工程师、项目研发组组长，南方基金管理股份有限公司风险管理部。2015 年 10 月加入前海开源基金管理有限公司，现任前海开源基金管理有限公司金融工程部总监、基金经理。

傅智先生，监事，本科学历，注册会计师。国籍：中国。历任深圳天健信德会计师事务所审计员，南方基金管理股份有限公司运作保障部总监助理、副总监、执行总监。现任前海开源基金管理有限公司基金核算部总监、基金事务部负责人（兼）。

曾媛媛女士，监事，经济学硕士。国籍：中国。曾任博时基金管理有限公司交易员。2014 年 4 月加入前海开源基金管理有限公司，现任前海开源基金管理有限公司交易部总监。

刘艳女士，监事，金融学硕士。国籍：中国。2006 年 8 月至 2013 年 9 月任长城基金管理有限公司渠道总对总主管。2014 年 10 月加入前海开源基金管理有限公司，现任前海开源基金管理有限公司第三方渠道部总监、上海管理总部总经理。

崔宸龙先生，监事，材料科学与工程博士研究生。国籍：中国。2016 年 11 月至 2017 年 8 月任深圳市前海安康投资发展有限公司研究部研究员。2017 年 8 月加盟前海开源基金管理有限公司，现任前海开源基金管理有限公司投资部负责人、首席 ESG 官、基金经理。

李刚先生，监事，管理学硕士。国籍：中国。历任长江证券股份有限公司营运管理总部业务管理部主管、公司交易所产品创新小组秘书，西部证券股份有限公司信用业务部高级经理、零售业务总部副总经理，长江证券股份有限公司西安营业部副总经理兼投顾总监、深圳深南路营业部总经理。2020 年加入开源证券股份有限公司，现任开源证券股份有限公司私人财富部总经理。

孙达先生，监事，管理学硕士。国籍：中国。历任中国铁路第五工程局土木工程师，北京宝嘉恒基础设施投资有限公司工程部经理。现任北京长和世纪资产管理有限公司投资部总经理。

3、高级管理人员情况

秦亚峰先生，董事、总经理、代任董事长。清华大学硕士，中国社科院博士，国籍：中国。历任中国银行湖南分行信托咨询公司技术员，中国东方信托湖南证券营业部部门经理，银河证券湖南证券营业部部门经理，亚洲证券湖南证券营业部部门经理，华安财产保险股份有限公司资产管理中心副总经理、总经理，华安财产保险股份有限公司副总经理，华安财保资产管理有限责任公司总经理，华安汇富资本投资管理有限公司董事长。现任前海开源基金管理有限公司董事、总经理、代任董事长。

孙辰健先生，督察长。西安交通大学经济学博士，高级经济师。国籍：中国。历任深圳证券交易所交易运行部副经理、西北服务中心主任、信息管理部总监，深圳证券通信有限公司董事、总经理，中证指数有限公司董事，中国证券登记结算有限责任公司北京数据技术分公司副总经理，中证信息技术服务有限责任公司副总经理，华鑫证券有限责任公司副总经理、监事会主席，摩根士丹利华鑫基金管理有限公司董事，华鑫证券投资有限公司、华鑫宽众投资有限公司董事长。2021 年 10 月加入前海开源基金管理有限公司，现任前海开源基金管理有限公司督察长。

王厚琼先生，副总经理、固定收益投资决策委员会主席。本科学历，国籍:中国。历任武汉市无线电厂有限公司技术员，南方证券股份有限公司武汉分公司证券部副经理，南方证券股份有限公司资产管理部，南方基金管理股份有限公司交易管理部副总监。2014 年 10 月加入前海开源基金管理有限公司，现任前海开源基金管理有限公司副总经理、固定收益投资决策委员会主席。

何璁先生，副总经理、首席信息官。硕士研究生，国籍:中国。历任国信证券股份有限公司信息技术部经理，汉唐证券有限责任公司红岭中路营业部副总经理、深圳、东莞银证通负责人，华泰联合证券有限责任公司部门总经理，华林证券股份有限公司总裁助理。2016 年 6 月加入前海开源基金管理有限公司，现任前海开源基金管理有限公司副总经理、首席信息官。

曲扬先生，副总经理、权益投资决策委员会主席。清华大学计算机科学与技术系博士。曾任职南方基金管理股份有限公司，历任研究员、基金经理助理、基金经理。2014 年 7 月加入前海开源基金管理有限公司，现任前海开源基金管理有限公司副总经理、权益投资决策委员会主席。

邱杰先生，副总经理、专户投资决策委员会主席、FOF 投资决策委员会主席。北京大学经济学硕士。曾任职福建省财政厅、南方基金管理股份有限公司、建信基金管理有限责

任公司。2014 年 2 月加入前海开源基金管理有限公司，现任前海开源基金管理有限公司副总经理、专户投资决策委员会主席、FOF 投资决策委员会主席。

4、本基金基金经理

本基金历任基金经理为：曲扬先生，管理时间为 2018 年 7 月 4 日至 2019 年 8 月 7 日；吴国清先生，管理时间为 2016 年 10 月 17 日至今。

吴国清先生，清华大学博士。历任南方基金管理股份有限公司研究员、基金经理助理、投资经理；2015 年 8 月加盟前海开源基金管理有限公司，现任公司执行投资总监、基金经理。2015 年 9 月 25 日至 2020 年 7 月 23 日，任前海开源大海洋战略经济灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2016 年 8 月 16 日至今，任前海开源鼎瑞债券型证券投资基金基金经理；2016 年 10 月 17 日至今，任前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2017 年 3 月 1 日至 2022 年 11 月 16 日，任前海开源沪港深强国产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2017 年 5 月 12 日至 2021 年 9 月 28 日，任前海开源沪港深乐享生活灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2018 年 2 月 9 日至 2024 年 1 月 25 日，任前海开源瑞和债券型证券投资基金基金经理；2018 年 8 月 17 日至 2020 年 7 月 20 日，任前海开源优势蓝筹股票型证券投资基金基金经理；2019 年 7 月 19 日至今，任前海开源一带一路主题精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2020 年 5 月 11 日至今，任前海开源沪港深核心驱动灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2020 年 7 月 20 日至 2022 年 9 月 15 日，任前海开源沪港深隆鑫灵活配置混合型证券投资基金；2020 年 7 月 20 日至今，任前海开源沪港深农业主题精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金经理；2021 年 6 月 1 日至今，任前海开源金银珠宝主题精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。吴国清先生具备基金从业资格。

5、投资决策委员会成员情况

权益投资决策委员会

权益投资决策委员会名单如下：曲扬、邱杰、崔宸龙、吴国清、王霞、杨德龙、肖立强。曲扬为权益投资决策委员会主席，邱杰为权益投资决策委员会副主席，肖立强为权益投资决策委员会秘书。

固定收益投资决策委员会

固定收益投资决策委员会名单如下：王厚琼、刘静、章俊、何崴、李炳智、史延、吴彦、林悦、易千。王厚琼为固定收益投资决策委员会主席，刘静、章俊为固定收益投资决策委员会副主席，何崴为固定收益投资决策委员会执行主席，李炳智为固定收益投资决策委员会秘书。

FOF 投资决策委员会

FOF 投资决策委员会名单如下：邱杰、曲扬、杨德龙、李赫、肖立强。邱杰为 FOF 投资决策委员会主席，曲扬为 FOF 投资决策委员会副主席，李赫为 FOF 投资决策委员会秘书。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

（三）基金管理人的职责

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

2、办理基金备案手续；

3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；

4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

6、编制季度报告、中期报告和年度报告；

7、计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回价格；

8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；

9、按照规定召集基金份额持有人大会；

10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

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

12、中国证监会规定的其他职责。

（四）基金管理人的承诺

1、基金管理人承诺不从事违反《证券法》、《基金法》、《销售办法》、《运作办法》、《信息披露办法》等法律法规的行为，并承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违法行为的发生。

2、基金管理人的禁止行为：

（1）将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；

（2）不公平地对待公司管理的不同基金财产；

（3）利用基金财产或职务之便为基金份额持有人以外的人牟取利益；

（4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；

（5）侵占、挪用基金财产；

（6）泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

（7）玩忽职守，不按照规定履行职责；

（8）法律法规以及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）违反法律法规、基金合同或托管协议；

（3）故意损害基金份额持有人或基金合同其他当事人的合法权益；

（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；

（7）泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

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

（9）贬损同行，以提高自己；

（10）在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；

（11）以不正当手段谋求业务发展；

（12）有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；

（13）其他法律、行政法规禁止的行为。

4、基金经理承诺

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

（2）不得利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者谋取利益；

（3）不泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

（4）不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

（五）基金管理人的内部控制制度

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

1、内部控制的总体目标

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

（2）建立有效的风险控制系统，确保基金资产的规范运作和其它各项业务的健康运行。

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

（4）确保基金、公司财务和其他信息真实、准确、完整、及时披露或报告。

2、公司内部控制遵循的原则：

（1）全面性原则。内部控制涵盖公司的各个部门或机构、各项业务和各级人员，并包括决策、执行、反馈和监督等各个环节。

（2）独立性原则。公司各机构、部门和岗位职责的设置保持相对独立，公司基金资产、自有资产与其他类型资产的运作相互分离。

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

（4）相互制约原则。公司内部部门和岗位的设置权责分明、相互制衡。

（5）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，合理地控制成本以达到最佳的内部控制效果。

3、内部控制体系

（1）内部控制制度体系

公司制定了合理、完备、有效并易于执行的制度体系。公司制度体系由不同层面的制度构成。按照其效力大小分为四个层面：第一个层面是公司内部控制大纲，它是公司制定各项规章制度的纲要和总览；第二个层面是公司基本管理制度，包括风险控制制度、投资管理制度、基金会计制度、信息披露制度、监察稽核制度、信息技术管理制度、公司财务制度、资料档案管理制度、绩效管理制度、紧急情况处理制度、合规管理制度、制度管理制度、反洗钱内部控制制度、公司机构设置及部门基本职能制度和销售管理制度等；第三个层面是部门管理制度，是在基本管理制度的基础上，对各部门的主要职责、岗位设置、岗位责任等的具体说明；第四个层面是业务管理办法、业务操作指引或细则，是各项具体业务和管理工作的运行办法，是对业务各个细节、流程进行的描述和约束，以及对各项业务职责划分、操作细则或流程的具体规定。它们的制订、修改、实施、废止应该遵循相应的程序，每一层面的内容不得与其以上层面的内容相违背。公司重视对制度的持续检验，结合业务的发展、法规及监管环境的变化以及公司风险控制的要求，不断检视和增强公司制度的完备性、有效性。

（2）内部控制组织架构

1）董事会

负责制定公司的风险管理政策，对风险管理负完全的和最终的责任。

2）监察及风险控制委员会

作为董事会下的专业委员会之一，监察及风险控制委员会负责审核、通过公司内部风险控制制度；负责检查公司内部风险控制制度的执行情况，对公司出现的风险问题和存在的风险隐患进行研究并提出处理意见。

3）督察长

公司设立督察长，经董事会聘任，对董事会负责，独立行使督察权利，向监察及风险控制委员会提交风险管理报告和风险管理建议。根据公司监察稽核工作的需要和董事会授权，督察长可以列席公司相关会议，调阅公司相关档案，就内部控制制度的执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议等职能。督察长定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况，董事会对督察长的报告进行审议。

4）监察稽核部

监察稽核部负责对公司的基金运作、内部管理、系统实施和合法合规情况进行内部监督，形成意见上报总经理及督察长；对公司各部门内部合规和内控制度、流程的建立和落实情况进行检查，对公司的内部合规和内控制度、流程的合理性、有效性进行分析，提出改进意见。

5）风险管理团队

风险管理团队负责建立和完善公司投资风险管理制度与流程，并为每一个部门的风险管理系统的发展提供协助。风险管理团队负责公司投资管理风险、信用风险、市场风险、流动性风险等日常风险管理工作，组织实施公司投资风险管理工作，确保公司各类投资风险得到良好监督与控制。

6）业务部门

风险和合规管理是每一个业务部门最首要的责任。部门负责人对本部门的风险和合规负第一责任，负责履行公司的风险和合规管理程序，负责将本部门的风险和合规管理纳入系统开发和流程设计中，有效识别、监控和降低风险。

4、内部控制措施

（1）授权控制

公司的授权控制贯穿于公司经营活动的始终。股东会、董事会、监事会和管理层充分了解和履行各自的职权，健全公司逐级授权制度，确保公司各项规章制度的贯彻执行。公司各业务部门、分支机构和公司员工在规定授权范围内行使相应的职责。公司重大业务的授权必须采取书面形式，授权书应当明确授权内容和时效。公司授权要适当，对已获授权的部门和人员应建立有效的评价和反馈机制，对已不适用的授权应及时修改或取消授权。

（2）公司研究业务

研究工作保持独立、客观；建立严密的研究工作业务流程，探索并形成科学、有效的研究方法；建立投资标的备选库制度，根据基金合同要求，在充分研究的基础上建立和维

护备选库。建立研究与投资的业务交流制度，保持畅通的交流渠道；建立研究报告质量评价体系，不断提高研究水平。

（3）基金投资业务

基金投资应确立科学的投资理念，根据决策的风险防范原则和效率性原则制定合理的决策程序；在进行投资时应有明确的投资授权制度，并应建立与所授权限相应的约束制度和考核制度。建立严格的投资禁止和投资限制制度，保证基金投资的合法合规性。建立投资风险评估与管理制度，将重点投资限制在规定的风险权限范围内；对于投资结果建立科学的投资管理业绩评价体系。

（4）交易业务

建立集中交易制度，投资指令通过交易部完成；建立交易监测系统、预警系统和交易反馈系统，完善相关的安全设施；交易部对交易指令进行审核，建立公平的交易分配制度，确保各基金利益的公平；交易记录完善，并及时进行反馈、核对和存档保管；同时建立科学的交易绩效评价体系。

（5）基金会计核算

公司根据法律法规及业务的要求建立会计制度，并根据风险控制点建立健全规范的系统和流程，以基金为会计核算主体，独立建账、独立核算；通过合理的估值方法和估值程序等会计措施，真实、完整、及时地记载每一笔业务并正确进行会计核算和业务核算。同时建立会计档案保管制度，确保档案真实完整。

（6）信息披露

公司建立了完善的信息披露制度，保证公开披露的信息真实、准确、完整、及时。公司设立了信息披露负责人，并建立了相应的程序进行信息的收集、组织、审核和发布工作，以此加强对信息的审查核对，使所公布的信息符合法律法规的规定，同时加强对信息披露的检查和评价，对存在的问题及时提出改进办法。

（7）监察稽核

公司设立监察稽核部，监察稽核部在督察长的领导下开展监察稽核工作，保证监察稽核部的独立性和权威性。公司明确监察稽核部及内部各岗位的具体职责，严格制定监察稽核人员的专业任职条件，严格遵守监察稽核的操作程序和组织纪律。

监察稽核部强化内部检查制度，通过定期或不定期检查内部控制制度的执行情况，促使公司各项经营管理活动的规范运行。

公司董事会和管理层充分重视和支持监察稽核工作，对违反法律法规和公司内部控制制度的，追究有关部门和人员的责任，并纳入年度合规专项考核。

5、基金管理人关于内部控制的声明

（1）基金管理人确知建立、实施和维持内部控制制度是基金管理人董事会及管理层的责任；

（2）基金管理人承诺以上关于内部控制的披露真实、准确；

（3）基金管理人承诺根据市场变化和公司发展不断完善内部控制体系和内部控制制度。

四、基金托管人

（一）基金托管人基本情况

1、基金托管人概况

公司法定中文名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）

公司法定英文名称：BANK OF COMMUNICATIONS CO.,LTD

法定代表人：任德奇

住　　所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号

办公地址：上海市长宁区仙霞路 18 号

邮政编码：200336

注册时间：1987 年 3 月 30 日

注册资本：742.63 亿元

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]25 号

联系人：方圆

电　话：95559

交通银行始建于 1908 年，是中国历史最悠久的银行之一，也是近代中国的发钞行之一。1987 年重新组建后的交通银行正式对外营业，成为中国第一家全国性的国有股份制商业银行，总部设在上海。2005 年 6 月交通银行在香港联合交易所挂牌上市，2007 年 5 月在上海证券交易所挂牌上市。交通银行连续 16 年跻身《财富》(FORTUNE)世界 500 强，营业收入排名第 154 位；列《银行家》(The Banker)杂志全球千家大银行一级资本排名第 9 位。

截至 2024 年 9 月 30 日，交通银行资产总额为人民币 14.59 万亿元。2024 年前三季度，交通银行实现净利润(归属于母公司股东)人民币 686.90 亿元。

交通银行总行设资产托管部（下文简称“托管部”）。现有员工具有多年基金、证券和银行的从业经验，具备基金从业资格，以及经济师、会计师、工程师和律师等中高级专业技术职称，员工的学历层次较高，专业分布合理，职业技能优良，职业道德素质过硬，是一支诚实勤勉、积极进取、开拓创新、奋发向上的资产托管从业人员队伍。

2、主要人员情况

任德奇先生，董事长、执行董事，高级经济师。

任先生 2020 年 1 月起任交通银行董事长（其中：2019 年 12 月至 2020 年 7 月代为履行行长职责）、执行董事，2018 年 8 月至 2020 年 1 月任交通银行副董事长（其中：2019 年 4 月至 2020 年 1 月代为履行董事长职责）、执行董事，2018 年 8 月至 2019 年 12 月任交通银行行长；2016 年 12 月至 2018 年 6 月任中国银行执行董事、副行长，其中：2015 年 10 月至 2018 年 6 月兼任中银香港（控股）有限公司非执行董事，2016 年 9 月至 2018

年 6 月兼任中国银行上海人民币交易业务总部总裁；2014 年 7 月至 2016 年 11 月任中国银行副行长，2003 年 8 月至 2014 年 5 月历任中国建设银行信贷审批部副总经理、风险监控部总经理、授信管理部总经理、湖北省分行行长、风险管理部总经理；1988 年 7 月至 2003 年 8 月先后在中国建设银行岳阳长岭支行、岳阳市中心支行、岳阳分行，中国建设银行信贷管理委员会办公室、信贷风险管理部工作。任先生 1988 年于清华大学获工学硕士学位。

张宝江先生，副董事长、执行董事、行长，高级经济师。

张先生 2024 年 6 月起任交通银行行长；曾任中国农业发展银行副行长，安徽省分行行长，总行办公室主任，陕西省分行副行长，总行政策研究室副主任（主持工作）、办公室副主任、研究室副主任等职务。张先生于 1998 年于中央党校研究生院获经济学硕士学位，2004 年于中央党校研究生院获经济学博士学位。

徐铁先生，资产托管部总经理。

徐铁先生 2022 年 4 月起任交通银行资产托管部总经理；2014 年 12 月至 2022 年 4 月任交通银行资产托管部副总经理；2000 年 7 月至 2014 年 12 月，历任交通银行资产托管部客户经理、保险与养老金部副高级经理、高级经理、保险保障业务部高级经理、总经理助理。徐先生 2000 年于复旦大学获经济学硕士学位。

3、基金托管业务经营情况

截至 2024 年 9 月 30 日，交通银行共托管证券投资基金 828 只。此外，交通银行还托管了基金公司特定客户资产管理计划、证券公司客户资产管理计划、理财产品、信托计划、私募投资基金、保险资金、全国社保基金、基本养老保险基金、划转国有股权充实社保基金、养老保障管理基金、企业年金基金、职业年金基金、期货公司资产管理计划、QFI 证券投资资产、QDII 证券投资资产、RQDII 证券投资资产、QDIE、QDLP 和 QFLP 等产品。

（二）基金托管人的内部控制制度

1、内部控制目标

交通银行严格遵守国家法律法规、行业规章及行内相关管理规定，加强内部管理，托管部业务制度健全并确保贯彻执行各项规章，通过对各种风险的识别、评估、控制及缓释，有效地实现对各项业务的风险管控，确保业务稳健运行，保护基金持有人的合法权益。

2、内部控制原则

（1）合法性原则：托管部制定的各项制度符合国家法律法规及监管机构的监管要求，并贯穿于托管业务经营管理活动始终。

（2）全面性原则：托管部建立各二级部自我监控和风险合规部风险管控的内部控制机制，覆盖各项业务、各个部门和各级人员，并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个经营环节，建立全面的风险管理监督机制。

（3）独立性原则：托管部独立负责受托基金资产的保管，保证基金资产与交通银行的自有资产相互独立，对不同的受托基金资产分别设置账户，独立核算，分账管理。

（4）制衡性原则：托管部贯彻适当授权、相互制约的原则，从组织架构的设置上确保各二级部和各岗位权责分明、相互制约，并通过有效的相互制衡措施消除内部控制中的盲点。

（5）有效性原则：托管部在岗位、业务二级部和风险合规部三级内控管理模式的基础上，形成科学合理的内部控制决策机制、执行机制和监督机制，通过行之有效的控制流程、控制措施，建立合理的内控程序，保障各项内控管理目标被有效执行。

（6）效益性原则：托管部内部控制与基金托管规模、业务范围和业务运作环节的风险控制要求相适应，尽量降低经营运作成本，以合理的控制成本实现最佳的内部控制目标。

3、内部控制制度及措施

根据《证券投资基金法》、《中华人民共和国商业银行法》、《商业银行资产托管业务指引》等法律法规，托管部制定了一整套严密、完整的证券投资基金托管管理规章制度，确保基金托管业务运行的规范、安全、高效，包括《交通银行资产托管业务管理办法》、《交通银行资产托管业务风险管理办法》、《交通银行资产托管业务商业秘密管理规定》、《交通银行资产托管业务从业人员行为规范》、《交通银行资产托管业务运营档案管理办法》等，并根据市场变化和基金业务的发展不断加以完善。做到业务分工科学合理，技术系统管理规范，业务管理制度健全，核心作业区实行封闭管理，落实各项安全隔离措施，相关信息披露由专人负责。

托管部通过对基金托管业务各环节的事前揭示、事中控制和事后检查措施实现全流程、全链条的风险管理，聘请国际著名会计师事务所对基金托管业务运行进行国际标准的内部控制评审。

（三）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

交通银行作为基金托管人，根据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和有关证券法规的规定，对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金的申购资金的到账与赎回资金的划付、基金收益分配等行为的合规性进行监督和核查。

交通银行作为基金托管人，发现基金管理人有违反《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关证券法规和《基金合同》的行为，及时通知基金管理人予以纠正，基金管理人收到通知后及时确认并进行调整。交通银行有权对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对交通银行通知的违规事项未能及时纠正的，交通银行按规定报告中国证监会。

交通银行作为基金托管人，发现基金管理人有重大违规行为，按规定报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

五、相关服务机构

（一）基金份额销售机构

1、直销机构

（1）前海开源基金管理有限公司直销柜台

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市福田区深南大道 7006 号万科富春东方大厦 10 层

法定代表人：李强

联系人：何凌

电话：（0755）83181190

传真：（0755）83180622

（2）前海开源基金管理有限公司电子直销交易

前海开源基金网上交易系统（http:// www.qhkyfund.com）

前海开源基金 APP

前海开源基金微信小程序

2、代销机构：

序号	代销机构	销售机构信息
1	深圳市前海排排网基金销售有限责任公司	深圳市前海排排网基金销售有限责任公司 注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司) 办公地址：深圳市福田区沙嘴路尚美红树湾 1 号 A 座写字楼 16 楼 法定代表人：杨柳 客服电话：400-666-7388 网址：www.simuwang.com
2	万家财富基金销售（天津）有限公司	万家财富基金销售（天津）有限公司 注册地址：天津自贸区(中心商务区)迎宾大道 1988 号滨海浙商大厦公寓 2-2413 室 办公地址：北京市东城区朝阳门北大街 9 号泓晟国际中心 16 层 法定代表人：戴晓云 客服电话：010-59013895 网址：www.wanjiawealth.com
3	南京苏宁基金销售有限公司	南京苏宁基金销售有限公司 注册地址：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号 办公地址：江苏省南京市玄武区苏宁大道 1-5 号 法定代表人：钱燕飞 客服电话：95177 网址：www.snjijin.com
4	大河财富基金销售	大河财富基金销售有限公司

	有限公司	注册地址：贵州省贵阳市观山湖区(高新区)湖滨路 109 号瑜赛进丰高新财富中心 26 层 1 号 办公地址：贵州省贵阳市观山湖区湖滨路 17 号友山基金大厦 26 层 1 号 法定代表人：何帅 客服电话：400-888-0008 网址：www.urainf.com
5	兴业银行股份有限公司	兴业银行股份有限公司 注册地址：福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦 办公地址：福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦 法定代表人：吕家进 客服电话：95561 网址：www.cib.com.cn
6	和耕传承基金销售有限公司	和耕传承基金销售有限公司 注册地址：河南自贸试验区郑州片区(郑东)东风南路东康宁街北 6 号楼 5 楼 503 办公地址：河南自贸试验区郑州片区(郑东)东风南路东康宁街北 6 号楼 503 法定代表人：温丽燕 客服电话：4000-555-671 网址：www.hgccpb.com
7	北京富国大通基金销售有限公司	北京富国大通基金销售有限公司 注册地址：北京市海淀区首体南路 9 号 4 楼 3 层 302-01 办公地址：北京市朝阳区安定路 5 号院 3 号楼中建财富国际中心 25 层 法定代表人：许家宝 客服电话：400-088-0088 网址：www.fuguowealth.com
8	江苏汇林保大基金销售有限公司	江苏汇林保大基金销售有限公司 注册地址：南京市高淳区经济开发区古檀大道 47 号 办公地址：南京市鼓楼区中山北路 2 号绿地紫峰大厦 2005 室 法定代表人：吴言林 客服电话：025-66046166 转 849 网址：www.huilinbd.com
9	腾安基金销售（深圳）有限公司	腾安基金销售（深圳）有限公司 注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司) 办公地址：深圳市南山区海天二路 33 号腾讯滨海大厦 15 楼 法定代表人：谭广锋 客服电话：4000-890-555 网址：www.txfund.com
10	阳光人寿保险股份有限公司	阳光人寿保险股份有限公司 注册地址：海南省三亚市迎宾路 360-1 号三亚阳光金融广场 16 层 办公地址：北京市朝阳区光华路阳光金融中心 4、5、

		6、7 层 法定代表人：李科 客服电话：40088-95510 网址：life.sinosig.com
11	上海凯石财富基金销售有限公司	上海凯石财富基金销售有限公司 注册地址：上海市黄浦区西藏南路 765 号 602-115 室 办公地址：上海市黄浦区延安东路 1 号凯石大厦 法定代表人：陈继武 客服电话：400-643-3389 网址：www.vstonewealth.com
12	北京格上富信基金销售有限公司	北京格上富信基金销售有限公司 注册地址：北京市朝阳区东三环北路 19 号楼 701 内 09 室 办公地址：北京市朝阳区东三环北路 19 号楼 701 内 09 室 法定代表人：肖伟 客服电话：400-080-5828 网址：www.igesafe.com
13	上海挖财基金销售有限公司	上海挖财基金销售有限公司 注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 759 号 2 号楼 18 层 03 单元 办公地址：上海市浦东新区杨高南路 759 号 2 号楼 18 层 03 单元 法定代表人：方磊 客服电话：021-50810673 网址：www.wacaijijin.com
14	中国民生银行股份有限公司	中国民生银行股份有限公司 注册地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号 办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号 法定代表人：高迎欣 客服电话：95568 网址：www.cmbc.com.cn
15	中衍期货有限公司	中衍期货有限公司 注册地址：北京市朝阳区东四环中路 82 号 2 座 2-1 座、2-2 座 7 层、B2 座一层 108 单元 办公地址：北京市朝阳区东四环中路 82 号金长安大厦 B 座 7 层 法定代表人：马宏波 客服电话：400-6881-117 网址：www.cdfco.com.cn
16	济安财富（北京）基金销售有限公司	济安财富（北京）基金销售有限公司 注册地址：北京市朝阳区太阳宫中路 16 号院 1 号楼 10 层 1005 办公地址：北京市朝阳区太阳宫中路 16 号院 1 号楼冠捷大厦 11 层 1105 单 法定代表人：杨健 客服电话：400-673-7010 网址：www.jianfortune.com
17	上海万得基金销售	上海万得基金销售有限公司

	有限公司	注册地址：中国（上海）自由贸易试验区浦明路 1500 号 8 层 M 座 办公地址：上海市浦东新区浦明路 1500 号万得大厦 法定代表人：简梦雯 客服电话：400-799-1888 网址：www.520fund.com.cn
18	西部证券股份有限公司	西部证券股份有限公司 注册地址：陕西省西安市新城区东新街 319 号 8 幢 10000 室 办公地址：陕西省西安市新城区东新街 319 号 8 幢 10000 室 法定代表人：徐朝晖 客服电话：95582 网址：www.west95582.com
19	南京证券股份有限公司	南京证券股份有限公司 注册地址：南京市江东中路 389 号 办公地址：南京市江东中路 389 号 法定代表人：李剑锋 客服电话：95386 网址：www.njzq.com.cn
20	华源证券股份有限公司	华源证券股份有限公司 注册地址：青海省西宁市南川工业园区创业路 108 号 办公地址：湖北省武汉市江汉区万松街道青年路 278 号中海中心 32F-34F 法定代表人：邓晖 客服电话：95305-8 网址：www.huayuanstock.com
21	深圳前海微众银行股份有限公司	深圳前海微众银行股份有限公司 注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司) 办公地址：广东省深圳市南山区沙河西路 1819 号深圳湾科技生态园 7 栋 A 座 法定代表人：顾敏 客服电话：95384 网址：www.webank.com
22	北京雪球基金销售有限公司	北京雪球基金销售有限公司 注册地址：北京市朝阳区创远路 34 号院 6 号楼 15 层 1501 室 办公地址：北京市朝阳区创远路 34 号院 6 号楼 15 层 1501 室 法定代表人：李楠 客服电话：400-159-9288 网址：www.danjuanapp.com
23	奕丰基金销售有限公司	奕丰基金销售有限公司 注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入住深圳市前海商务秘书有限公司） 办公地址：深圳市南山区海德三道航天科技广场 A 座 17 楼 1704 室 法定代表人：TEO WEE HOWE

		客服电话：400-684-0500 网址：www.ifastps.com.cn
24	宜信普泽（北京）基金销售有限公司	宜信普泽（北京）基金销售有限公司 注册地址：北京市朝阳区建国路 118 号 24 层 2405、2406 办公地址：北京市朝阳区建国路 118 号招商局大厦 24F 法定代表人：汤蕾 客服电话：400-6099-200 网址：www.puzefund.com
25	蚂蚁（杭州）基金销售有限公司	蚂蚁（杭州）基金销售有限公司 注册地址：浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路 969 号 3 幢 5 层 599 室 办公地址：浙江省杭州市西湖区西溪路 556 号 法定代表人：王珺 客服电话：95188-8 网址：www.fund123.cn
26	国元证券股份有限公司	国元证券股份有限公司 注册地址：安徽省合肥市梅山路 18 号 办公地址：安徽省合肥市梅山路 18 号 法定代表人：沈和付 客服电话：95578 网址：www.gyzq.com.cn
27	华安证券股份有限公司	华安证券股份有限公司 注册地址：安徽省合肥市滨湖新区紫云路 1018 号 办公地址：安徽省合肥市滨湖新区紫云路 1018 号 法定代表人：章宏韬 客服电话：95318 网址：www.hazq.com
28	华龙证券股份有限公司	华龙证券股份有限公司 注册地址：兰州市城关区东岗西路 638 号兰州财富中心 21 楼 办公地址：兰州市城关区东岗西路 638 号财富中心 法定代表人：祁建邦 客服电话：95368 网址：www.hlzq.com
29	长城证券股份有限公司	长城证券股份有限公司 注册地址：深圳市福田区福田街道金田路 2026 号能源大厦南塔楼 10-19 层 办公地址：广东省深圳市福田区福田街道金田路 2026 号能源大厦南塔楼 10-19 层 法定代表人：王军 客服电话：95514 网址：www.cgws.com
30	中银国际证券股份有限公司	中银国际证券股份有限公司 注册地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层 办公地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层 法定代表人：宁敏

		客服电话：956026 网址：bocichina.com
31	东方财富证券股份有限公司	东方财富证券股份有限公司 注册地址：西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城 10 栋楼 办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号东方财富大厦 法定代表人：戴彦 客服电话：95357 网址：www.18.cn
32	东北证券股份有限公司	东北证券股份有限公司 注册地址：长春市生态大街 6666 号 办公地址：长春市生态大街 6666 号 法定代表人：李福春 客服电话：95360 网址：www.nesc.cn
33	西南证券股份有限公司	西南证券股份有限公司 注册地址：重庆市江北区金沙门路 32 号 办公地址：重庆市江北区金沙门路 32 号西南证券总部大楼 法定代表人：姜栋林 客服电话：95355 网址：www.swsc.com.cn
34	上海证券有限责任公司	上海证券有限责任公司 注册地址：上海市黄浦区四川中路 213 号 7 楼 办公地址：上海市黄浦区四川中路 213 号 7 楼 法定代表人：李海超 客服电话：4008-918-918 网址：www.shzq.com
35	国联证券股份有限公司	国联证券股份有限公司 注册地址：无锡市金融一街 8 号 办公地址：无锡市金融一街 8 号国联大厦 法定代表人：葛小波 客服电话：95570 网址：www.glsc.com.cn
36	中信证券华南股份有限公司	中信证券华南股份有限公司 注册地址：广州市天河区临江大道 395 号 901 室（部位：自编 01）,1001 室 办公地址：广州市天河区临江大道 395 号 901 室（部位：自编 01）,1001 室 法定代表人：陈可可 客服电话：95548 网址：www.gzs.com.cn
37	德邦证券股份有限公司	德邦证券股份有限公司 注册地址：上海市普陀区曹杨路 510 号南半幢 9 楼 办公地址：上海市黄浦区中山东二路 558 号外滩金融中心 N1 幢 9 层 法定代表人：武晓春 客服电话：400-8888-128 网址：www.tebon.com.cn

38	浙商证券股份有限公司	浙商证券股份有限公司 注册地址：浙江省杭州市江干区五星路 201 号 办公地址：浙江省杭州市江干区五星路 201 号 法定代表人：吴承根 客服电话：95345 网址：www.stocke.com.cn
39	东海证券股份有限公司	东海证券股份有限公司 注册地址：江苏省常州市天宁区延陵西路 23 号投资广场 18 层 办公地址：江苏省常州市天宁区延陵西路 23 号投资广场 18 层 法定代表人：王文卓 客服电话：95531；400-8888-588 网址：www.longone.com.cn
40	恒泰证券股份有限公司	恒泰证券股份有限公司 注册地址：内蒙古自治区呼和浩特市新城区海拉尔东街满世尚都办公商业综合楼 办公地址：北京市西城区德胜门外大街 83 号德胜国际中心 B 座 12 层 法定代表人：祝艳辉 客服电话：956088 网址：www.cnht.com.cn
41	上海联泰基金销售有限公司	上海联泰基金销售有限公司 注册地址：上海市普陀区兰溪路 900 弄 15 号 526 室 办公地址：上海市虹口区北外滩临潼路 188 号 法定代表人：尹彬彬 客服电话：400-118-1188 网址：www.66liantai.com
42	上海基煜基金销售有限公司	上海基煜基金销售有限公司 注册地址：上海市崇明县长兴镇潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室(上海泰和经济发展区) 办公地址：上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 1503 室 法定代表人：王翔 客服电话：400-820-5369；021-6537-0077 网址：www.jigoutong.com;www.jiyufund.com.cn
43	华鑫证券有限责任公司	华鑫证券有限责任公司 注册地址：深圳市福田区香蜜湖街道东海社区深南大道 7888 号东海国际中心一期 A 栋 2301A 办公地址：深圳市福田区香蜜湖街道东海社区深南大道 7888 号东海国际中心一期 A 栋 2301A 法定代表人：俞洋 客服电话：95323；4001-099-918 网址：www.cfsc.com.cn
44	东吴证券股份有限公司	东吴证券股份有限公司 注册地址：苏州工业园区星阳街 5 号 办公地址：苏州工业园区星阳街 5 号 法定代表人：范力 客服电话：95330

		网址：www.dwzq.com.cn
45	财通证券股份有限公司	财通证券股份有限公司 注册地址：浙江省杭州市西湖区天目山路 198 号财通双冠大厦西楼 办公地址：浙江省杭州市西湖区天目山路 198 号财通双冠大厦西楼 法定代表人：章启诚 客服电话：95336 网址：www.ctsec.com
46	江海证券有限公司	江海证券有限公司 注册地址：哈尔滨市香坊区赣水路 56 号 办公地址：哈尔滨市松北区创新三路 833 号 法定代表人：赵洪波 客服电话：956007 网址：www.jhzq.com.cn
47	中邮证券有限责任公司	中邮证券有限责任公司 注册地址：陕西省西安市唐延路 5 号陕西邮政信息大厦 9-11 层 办公地址：北京市东城区珠市口东大街 17 号 法定代表人：郭成林 客服电话：956039；4008-888-005 网址：www.cnpsec.com.cn
48	深圳市新兰德证券投资咨询有限公司	深圳市新兰德证券投资咨询有限公司 注册地址：深圳市福田区梅林街道梅都社区中康路 136 号深圳新一代产业园 2 栋 3401 办公地址：深圳市福田区梅林街道梅都社区中康路 136 号深圳新一代产业园 2 栋 3401 法定代表人：张斌 客服电话：400-066-1199 网址：www.xinlande.com.cn
49	珠海盈米基金销售有限公司	珠海盈米基金销售有限公司 注册地址：珠海市横琴新区环岛东路 3000 号 2719 室 办公地址：广州市海珠区阅江中路 688 号保利国际广场北塔 33 楼、8 楼 法定代表人：肖雯 客服电话：020-89629066 网址：www.yingmi.cn
50	上海利得基金销售有限公司	上海利得基金销售有限公司 注册地址：中国（上海）自由贸易试验区临港新片区海基六路 70 弄 1 号 208-36 室 办公地址：上海市虹口区东大名路 1098 号浦江国际金融广场 53 层 法定代表人：李兴春 客服电话：400-032-5885 网址：www.leadfund.com.cn
51	平安银行股份有限公司	平安银行股份有限公司 注册地址：广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号 办公地址：中国广东省深圳市福田区益田路 5023 号平安金融中心 B 座

		法定代表人：谢永林 客服电话：95511-3-8 网址：bank.pingan.com
52	申万宏源证券有限公司	申万宏源证券有限公司 注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层 办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号世纪商贸广场 45 层 法定代表人：张剑 客服电话：95523；4008-895-523 网址：www.swhysc.com
53	山西证券股份有限公司	山西证券股份有限公司 注册地址：山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼 办公地址：山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼 法定代表人：王怡里 客服电话：95573 网址：www.sxzq.com
54	浦领基金销售有限公司	浦领基金销售有限公司 注册地址：北京市朝阳区望京东园四区 2 号楼 10 层 1001 号 04 室 办公地址：北京市朝阳区望京东园四区 2 号楼 10 层 1001 号 04 室 法定代表人：张莲 客服电话：400-012-5899 网址：www.prolinkfund.com
55	招商证券股份有限公司	招商证券股份有限公司 注册地址：深圳市福田区福田街道福华一路 111 号 办公地址：深圳市福田区福华一路 111 号招商证券大厦 法定代表人：霍达 客服电话：95565 网址：www.cmschina.com
56	长江证券股份有限公司	长江证券股份有限公司 注册地址：湖北省武汉市江汉区淮海路 88 号 办公地址：湖北省武汉市江汉区淮海路 88 号 法定代表人：金才玖 客服电话：95579 网址：www.cjsc.com.cn
57	国金证券股份有限公司	国金证券股份有限公司 注册地址：四川省成都市青羊区东城根上街 95 号 办公地址：四川省成都市青羊区东城根上街 95 号 法定代表人：冉云 客服电话：95310 网址：www.gjzq.com.cn
58	上海云湾基金销售有限公司	上海云湾基金销售有限公司 注册地址：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路 27 号、明月路 1257 号 1 幢 1 层 103-1、103-2 办公区 办公地址：上海市自由贸易试验区新金桥路 27 号 1 号楼

		法定代表人：姚杨 客服电话：400-820-1515 网址：www.zhengtongfunds.com
59	广发银行股份有限公司	广发银行股份有限公司 注册地址：广州市越秀区东风东路 713 号 办公地址：广州市越秀区东风东路 713 号 法定代表人：王凯 客服电话：400-830-8003 网址：www.cgbchina.com.cn
60	广发证券股份有限公司	广发证券股份有限公司 注册地址：广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街 2 号 618 室 办公地址：广东省广州市天河区马场路 26 号广发证券大厦 法定代表人：林传辉 客服电话：95575 网址：www.gf.com.cn
61	国新证券股份有限公司	国新证券股份有限公司 注册地址：北京市西城区车公庄大街 4 号 2 幢 1 层 A2112 室 办公地址：北京市朝阳区朝阳门北大街 18 号中国人保寿险大厦 法定代表人：张海文 客服电话：95390 网址：www.crsec.com.cn
62	中泰证券股份有限公司	中泰证券股份有限公司 注册地址：山东省济南市市中区经七路 86 号 办公地址：山东省济南市市中区经七路 86 号 法定代表人：王洪 客服电话：95538 网址：www.zts.com.cn
63	东方证券股份有限公司	东方证券股份有限公司 注册地址：中国上海市黄浦区中山南路 119 号东方证券大厦 办公地址：中国上海市黄浦区中山南路 119 号东方证券大厦 法定代表人：金文忠 客服电话：95503 网址：www.dfzq.com.cn
64	光大证券股份有限公司	光大证券股份有限公司 注册地址：上海市静安区新闸路 1508 号 办公地址：上海市静安区新闸路 1508 号 法定代表人：刘秋明 客服电话：95525 网址：www.ebscn.com
65	中国银河证券股份有限公司	中国银河证券股份有限公司 注册地址：北京市丰台区西营街 8 号院 1 号楼 7 至 18 层 101 办公地址：北京市丰台区西营街 8 号院 1 号楼青海金融

		大厦 法定代表人：王晟 客服电话：95551 网址：www.chinastock.com.cn
66	中信建投证券股份有限公司	中信建投证券股份有限公司 注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼 办公地址：北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 法定代表人：王常青 客服电话：4008-888-108 网址：www.csc108.com
67	中信证券（山东）有限责任公司	中信证券（山东）有限责任公司 注册地址：青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001 办公地址：青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座 5 层 法定代表人：肖海峰 客服电话：95548 网址：sd.citics.com
68	中国农业银行股份有限公司	中国农业银行股份有限公司 注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号 办公地址：北京市东城区建国门内大街 69 号 法定代表人：谷澍 客服电话：95599 网址：www.abchina.com
69	东莞证券股份有限公司	东莞证券股份有限公司 注册地址：广东省东莞市莞城区可园南路一号 办公地址：广东省东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼 法定代表人：陈照星 客服电话：95328 网址：www.dgzq.com.cn
70	华宝证券股份有限公司	华宝证券股份有限公司 注册地址：上海市自由贸易试验区浦电路 370 号 2、3、4 层 办公地址：上海市自由贸易试验区浦电路 370 号 2、3、4 层 法定代表人：刘加海 客服电话：400-820-9898 网址：www.cnhbstock.com
71	浙江同花顺基金销售有限公司	浙江同花顺基金销售有限公司 注册地址：浙江省杭州市文二西路 1 号元茂大厦 903 室 办公地址：杭州市西湖区文二西路 1 号元茂大厦 903 室 法定代表人：吴强 客服电话：952555 网址：www.5ifund.com
72	民生证券股份有限公司	民生证券股份有限公司 注册地址：中国（上海）自由贸易试验区浦明路 8 号 办公地址：中国(上海)自由贸易试验区浦明路 8 号 法定代表人：顾伟 客服电话：95376

		网址：www.mszq.com
73	华泰证券股份有限公司	华泰证券股份有限公司 注册地址：江苏省南京市建邺区江东中路 228 号 办公地址：江苏省南京市建邺区江东中路 228 号 法定代表人：张伟 客服电话：95597 网址：www.htsc.com.cn
74	平安证券股份有限公司	平安证券股份有限公司 注册地址：深圳市福田区福田街道益田路 5023 号平安金融中心 B 座第 22-25 层 办公地址：深圳市福田区福田街道益田路 5023 号平安金融中心 B 座第 22-25 层 法定代表人：何之江 客服电话：95511-8 网址：stock.pingan.com
75	第一创业证券股份有限公司	第一创业证券股份有限公司 注册地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼 办公地址：广东省深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼 法定代表人：吴礼顺 客服电话：95358 网址：www.firstcapital.com.cn
76	华西证券股份有限公司	华西证券股份有限公司 注册地址：中国（四川）自由贸易试验区成都市高新区天府二街 198 号 办公地址：四川省成都市高新区天府二街 198 号 法定代表人：杨炯洋 客服电话：95584 网址：www.hx168.com.cn
77	诺亚正行基金销售有限公司	诺亚正行基金销售有限公司 注册地址：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 6 层 办公地址：上海市闵行区申滨南路 1226 号诺亚财富中心 法定代表人：吴卫国 客服电话：400-821-5399 网址：www.noah-fund.com
78	上海好买基金销售有限公司	上海好买基金销售有限公司 注册地址：上海市虹口区东大名路 501 号 6211 单元 办公地址：上海市浦东新区张杨路 500 号华润时代广场商务楼 12 楼 法定代表人：陶怡 客服电话：400-700-9665 网址：www.ehowbuy.com
79	上海天天基金销售有限公司	上海天天基金销售有限公司 注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼二层 办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号东方财富大厦 法定代表人：其实 客服电话：95021

		网址：www.1234567.com.cn
80	深圳众禄基金销售股份有限公司	深圳众禄基金销售股份有限公司 注册地址：深圳市罗湖区笋岗街道笋西社区梨园路 8 号 HALO 广场一期四层 12-13 室 办公地址：深圳市罗湖区笋岗街道笋西社区梨园路 8 号 HALO 广场一期四层 12-13 室 法定代表人：薛峰 客服电话：400-678-8887 网址：www.zlfund.cn；www.jjmmw.com
81	上海长量基金销售有限公司	上海长量基金销售有限公司 注册地址：浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室 办公地址：上海市浦东新区东方路 1267 号陆家嘴金融服务广场二期 11 层 法定代表人：张跃伟 客服电话：400-820-2899 网址：www.erichfund.com
82	和讯信息科技有限公司	和讯信息科技有限公司 注册地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号 1002 室 办公地址：北京市朝外大街 22 号泛利大厦 10 层 法定代表人：章知方 客服电话：400-920-0022 网址：www.hexun.com
83	大同证券有限责任公司	大同证券有限责任公司 注册地址：山西省大同市平城区迎宾街 15 号桐城中央 21 层 办公地址：山西省太原市小店区长治路 111 号山西世贸中心 A 座 F12、F13 法定代表人：董祥 客服电话：400-7121-212 网址：www.dtsbc.com.cn
84	万联证券股份有限公司	万联证券股份有限公司 注册地址：广州市天河区珠江东路 11 号 18、19 楼 办公地址：广东省广州市天河区珠江东路 11 号 18,19 楼 法定代表人：王达 客服电话：95322 网址：www.wlzq.cn
85	国信证券股份有限公司	国信证券股份有限公司 注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 16-26 层 办公地址：广东省深圳市福田区福华一路 125 号国信金融大厦 法定代表人：张纳沙 客服电话：95536 网址：www.guosen.com.cn
86	财达证券股份有限公司	财达证券股份有限公司 注册地址：河北省石家庄市自强路 35 号 办公地址：河北省石家庄市桥西区自强路 35 号 法定代表人：张明

		客服电话：95363 网址：95363.com
87	国泰君安证券股份有限公司	国泰君安证券股份有限公司 注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号 办公地址：上海市静安区南京西路 768 号国泰君安大厦 法定代表人：朱健 客服电话：95521 网址：www.gtja.com
88	招商银行股份有限公司	招商银行股份有限公司 注册地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 办公地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 法定代表人：缪建民 客服电话：95555 网址：www.cmbchina.com
89	京东肯特瑞基金销售有限公司	京东肯特瑞基金销售有限公司 注册地址：北京市海淀区西 三旗建材城中路 12 号 17 号平房 157 办公地址：北京市大兴区科创十一街京东总部二号楼 法定代表人：邹保威 客服电话：400-098-8511；400-088-8816 网址：kenterui.jd.com
90	北京创金启富基金销售有限公司	北京创金启富基金销售有限公司 注册地址：北京市丰台区金泽路 161 号 1 号楼 3 层 309 办公地址：北京市丰台区金泽路 161 号 1 号楼 3 层 309 法定代表人：梁蓉 客服电话：010-66154828 网址：www.5irich.com
91	珠海华润银行股份有限公司	珠海华润银行股份有限公司 注册地址：珠海市吉大九洲大道东 1346 号 办公地址：广东省珠海市吉大九洲大道东 1346 号珠海华润银行大厦 法定代表人：宗少俊 客服电话：0756-96588；400-880-0338 网址：www.crbank.com.cn
92	深圳秋实惠智基金销售有限公司	深圳秋实惠智基金销售有限公司 注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司) 办公地址：北京市朝阳区东三环北路 2 号南银大厦 2308-9 室 法定代表人：张秋林 客服电话：400-9987-593 网址：fund.qiushicaifu.com
93	北京度小满基金销售有限公司	北京度小满基金销售有限公司 注册地址：北京市海淀区西北旺东路 10 号院西区 4 号楼 1 层 103 室 办公地址：北京市海淀区西北旺东路 10 号院西区 4 号楼 1 层 103 室

		法定代表人：盛超 客服电话：95055-4 网址：www.duxiaomanfund.com
94	福克斯（北京）基金销售有限公司	福克斯（北京）基金销售有限公司 注册地址：北京市怀柔区怀北镇怀北路 308 号 办公地址：北京市朝阳区光华路 15 号院(亿利生态广场)1 号楼 10 层 1001 室 法定代表人：储德军 客服电话：010-65042486 网址：www.haofunds.com
95	玄元保险代理有限公司	玄元保险代理有限公司 注册地址：中国(上海)自由贸易试验区张杨路 707 号 1105 室 办公地址：中国(上海)自由贸易试验区张杨路 707 号 1105 室 法定代表人：马永谙 客服电话：400-080-8208 网址：www.licaimofang.com
96	中证金牛（北京）基金销售有限公司	中证金牛（北京）基金销售有限公司 注册地址：北京市丰台区东管头 1 号 2 号楼 2-45 室 办公地址：北京市丰台区丽泽金融商务区铭丰大厦 4 层 401 法定代表人：吴志坚 客服电话：4008-909-998 网址：www.jnlc.com
97	深圳新华信通基金销售有限公司	深圳新华信通基金销售有限公司 注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司） 办公地址：深圳市福田区深南大道 2003 号华嵘大厦 1806 法定代表人：戴媛 客服电话：400-000-5767 网址：www.xintongfund.com
98	鼎信汇金(北京)投资管理有限公司	鼎信汇金(北京)投资管理有限公司 注册地址：北京市朝阳区霄云路 40 号院 1 号楼 3 层 306 室 办公地址：北京市朝阳区霄云路 40 号院 1 号楼 3 层 306 室 法定代表人：齐凌峰 客服电话：400-158-5050 网址：www.9ifund.com
99	上海中正达广基金销售有限公司	上海中正达广基金销售有限公司 注册地址：上海市徐汇区龙兰路 277 号 1 号楼 1203、1204 室 办公地址：上海市徐汇区龙兰路 277 号 1 号楼 1203、1204 室 法定代表人：黄欣 客服电话：400-6767-523 网址：www.zhongzhengfund.com

100	华瑞保险销售有限公司	华瑞保险销售有限公司 注册地址：上海市嘉定区南翔镇众仁路 399 号运通星财富广场 1 号楼 B 座 14 层 办公地址：上海市嘉定区南翔镇众仁路 399 号运通星财富广场 1 号楼 B 座 14 层 法定代表人：王树科 客服电话：952303 网址：www.huaruisales.com
101	中国人寿保险股份有限公司	中国人寿保险股份有限公司 注册地址：北京市西城区金融大街 16 号 办公地址：北京市西城区金融大街 16 号 法定代表人：白涛 客服电话：95519 网址：www.e-chinalife.com
102	上海攀赢基金销售有限公司	上海攀赢基金销售有限公司 注册地址：上海市闸北区广中西路 1207 号 306 室 办公地址：上海市浦东新区银城路 116 号大华银行大厦 7 楼 法定代表人：郑新林 客服电话：8621-68889082 网址：www.pytz.cn
103	深圳市金海九州基金销售有限公司	深圳市金海九州基金销售有限公司 注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司） 办公地址：广东省深圳市福田区福华一路富德生命保险大厦 11 楼 法定代表人：彭维熙 客服电话：400-677-3333 网址：www.jhjzfund.com
104	华福证券有限责任公司	华福证券有限责任公司 注册地址：福建省福州市鼓楼区鼓屏路 27 号 1#楼 3 层、4 层、5 层 办公地址：上海市浦东新区滨江大道 5129 号 N1 座 法定代表人：苏军良 客服电话：95547 网址：www.hfzq.com.cn
105	泛华普益基金销售有限公司	泛华普益基金销售有限公司 注册地址：成都市成华区建设路 9 号高地中心 1101 室 办公地址：成都市金牛区花照壁西顺街 399 号 1 栋 1 单元龙湖西宸天街 B 座 12 层 法定代表人：王建华 客服电话：400-080-3388 网址：www.puyifund.com
106	财咨道信息技术有限公司	财咨道信息技术有限公司 注册地址：辽宁省沈阳市浑南区白塔二南街 18-2 号 B 座 601 办公地址：辽宁省沈阳市浑南区白塔二南街 18-2 号 B 座 601 法定代表人：朱荣晖

		客服电话：4000035811 网址：www.jinjiwo.com
107	上海陆享基金销售有限公司	上海陆享基金销售有限公司 注册地址：中国(上海)自由贸易试验区临港新片区环湖西二路 888 号 1 幢 1 区 14032 室 办公地址：上海市浦东新区世纪大道 1196 号世纪汇广场 2 座 16 楼 01、08 单元 法定代表人：粟旭 客服电话：400-168-1235 网址：www.luxxfund.com
108	江苏银行股份有限公司	江苏银行股份有限公司 注册地址：江苏省南京市中华路 26 号 办公地址：江苏省南京市中华路 26 号 法定代表人：葛仁余 客服电话：95319 网址：www.jsbchina.cn
109	宁波银行股份有限公司	宁波银行股份有限公司 注册地址：浙江省宁波市鄞州区宁东路 345 号 办公地址：浙江省宁波市鄞州区宁东路 345 号 法定代表人：陆华裕 客服电话：95574 网址：www.nbcb.com.cn
110	上海爱建基金销售有限公司	上海爱建基金销售有限公司 注册地址：上海市黄浦区西藏中路 336 号 1806-13 室 办公地址：上海市徐汇区肇嘉浜路 746 号 法定代表人：吴文新 客服电话：400-803-2733 网址：www.ajwm.com.cn
111	东莞农村商业银行股份有限公司	东莞农村商业银行股份有限公司 注册地址：广东省东莞市东城区鸿福东路 2 号 办公地址：广东省东莞市东城区鸿福东路 2 号 法定代表人：卢国锋 客服电话：0769-961122 网址：www.drcbank.com
112	嘉实财富管理有限公司	嘉实财富管理有限公司 注册地址：海南省三亚市天涯区凤凰岛 1 号楼 7 层 710 号 办公地址：海南省三亚市天涯区凤凰岛 1 号楼 7 层 710 号 法定代表人：张峰 客服电话：400-021-8850 网址：www.harvestwm.cn
113	中山证券有限责任公司	中山证券有限责任公司 注册地址：深圳市南山区粤海街道海珠社区芳芷一路 13 号舜远金融大厦 1 栋 23 层 办公地址：深圳市南山区粤海街道海珠社区芳芷一路 13 号舜远金融大厦 1 栋 23 层 法定代表人：李永湖 客服电话：95329

		网址：www.zszq.com
114	中信期货有限公司	中信期货有限公司 注册地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层 办公地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层 法定代表人：窦长宏 客服电话：400-990-8826 网址：www.citicsf.com
115	联储证券股份有限公司	联储证券股份有限公司 注册地址：山东省青岛市崂山区香港东路 195 号 8 号楼 15 层 办公地址：山东省青岛市崂山区香港东路 195 号 8 号楼 15 层 法定代表人：吕春卫 客服电话：956006 网址：www.lczq.com
116	国投证券股份有限公司	国投证券股份有限公司 注册地址：深圳市福田区福田街道福华一路 119 号安信金融大厦 办公地址：深圳市福田区福田街道福华一路 119 号安信金融大厦 法定代表人：段文务 客服电话：95517 网址：www.essence.com.cn
117	开源证券股份有限公司	开源证券股份有限公司 注册地址：陕西省西安市高新区锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层 办公地址：陕西省西安市高新区锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层 法定代表人：李刚 客服电话：95325 网址：www.kysec.cn
118	中国中金财富证券有限公司	中国中金财富证券有限公司 注册地址：深圳市南山区粤海街道海珠社区科苑南路 2666 号中国华润大厦 L4601-L4608 办公地址：深圳市南山区粤海街道海珠社区科苑南路 2666 号中国华润大厦 46 层 法定代表人：高涛 客服电话：95532；4006-008-008 网址：www.ciccwm.com
119	民商基金销售（上海）有限公司	民商基金销售（上海）有限公司 注册地址：上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区(东座)6 楼 A31 室 办公地址：上海市浦东新区张杨路 707 号生命人寿大厦 32 楼 法定代表人：贲惠琴 客服电话：021-50206003 网址：www.msftec.com

120	泰信财富基金销售有限公司	泰信财富基金销售有限公司 注册地址：北京市朝阳区建国路乙 118 号 10 层 1206 办公地址：北京市朝阳区建国路乙 118 号 10 层 1206 法定代表人：彭浩 客服电话：400-004-8821 网址：www.taixincf.com
121	上海中欧财富基金销售有限公司	上海中欧财富基金销售有限公司 注册地址：中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 1008-1 室 办公地址：上海市虹口区公平路 18 号 8 栋嘉昱大厦 6 楼 法定代表人：许欣 客服电话：400-100-2666 网址：www.zocaifu.com
122	申万宏源西部证券有限公司	申万宏源西部证券有限公司 注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室 办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室 法定代表人：王献军 客服电话：95523；400-800-0562 网址：www.swhysc.com
123	通华财富（上海）基金销售有限公司	通华财富（上海）基金销售有限公司 注册地址：上海市虹口区同丰路 667 弄 107 号 201 室 办公地址：上海市浦东新区金沪路 55 号通华科技大厦 10 层 法定代表人：周欣 客服电话：400-101-9301 网址：www.tonghuafund.com
124	上海有鱼基金销售有限公司	上海有鱼基金销售有限公司 注册地址：上海自由贸易试验区浦东大道 2123 号 3 层 3E-2655 室 办公地址：上海市徐汇区桂平路 391 号国际商务中心 B 座 20 楼 法定代表人：周锋 客服电话：021-61265457 网址：www.youyufund.com
125	上海国信嘉利基金销售有限公司	上海国信嘉利基金销售有限公司 注册地址：上海市徐汇区华泾路 507 号 4 幢 2 层 223 室 办公地址：上海市浦东新区居里路 99 号 法定代表人：付钢 客服电话：021-68809999 网址：www.gxjlcn.com
126	长沙银行股份有限公司	长沙银行股份有限公司 注册地址：湖南省长沙市岳麓区滨江路 53 号楷林商务中心 B 座 办公地址：湖南省长沙市岳麓区滨江路 53 号楷林商务中心 B 座 法定代表人：赵小中

		客服电话：0731-96511 网址：bankofchangsha.com
127	博时财富基金销售有限公司	博时财富基金销售有限公司 注册地址：深圳市福田区莲花街道福新社区益田路 5999 号基金大厦 19 层 办公地址：深圳市福田区莲花街道福新社区益田路 5999 号基金大厦 19 层 法定代表人：王德英 客服电话：400-610-5568 网址：www.boserawealth.com
128	上海大智慧基金销售有限公司	上海大智慧基金销售有限公司 注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 428 号 1 号楼 1102 单元 办公地址：上海市浦东新区杨高南路 428 弄由由世纪广场 1 号楼 法定代表人：张俊 客服电话：021-20219988 网址：www.wg.com.cn
129	北京坤元基金销售有限公司	北京坤元基金销售有限公司 注册地址：北京市石景山区古城大街特钢公司十一区(首特创业基地 A 座)八层 816 号 办公地址：北京市朝阳区东三环中路 7 号院北京财富中心写字楼 A 座 30 层 法定代表人：杜福胜 客服电话：4006498989 网址：www.kunyuanfund.com
130	中信百信银行股份有限公司	中信百信银行股份有限公司 注册地址：北京市朝阳区安定路 5 号院 3 号楼 8 层 办公地址：北京市朝阳区安定路 5 号院 3 号楼 6-11 层 法定代表人：李如东 客服电话：400-818-0100 网址：www.aibank.com
131	中信证券股份有限公司	中信证券股份有限公司 注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场(二期)北座 办公地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号中信证券大厦/北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦 法定代表人：张佑君 客服电话：95548 网址：www.citics.com
132	贵州省贵文文化基金销售有限公司	贵州省贵文文化基金销售有限公司 注册地址：贵州省贵阳市南明区龙洞堡电子商务港太升国际 A 栋 2 单元 5 层 17 号 办公地址：贵州省贵阳市南明区龙腾路贵文投资大楼 4 楼 法定代表人：陈成 客服电话：0851-85407888 网址：www.gwcaifu.com
133	北京虹点基金销售	北京虹点基金销售有限公司

	有限公司	注册地址：北京市朝阳区工人体育场北路甲 2 号裙房 2 层 222 单元 办公地址：北京市朝阳区东三环北路 17 号 10 层 1015 室 法定代表人：张晓杰 客服电话：400-618-0707 网址：www.hongdianfund.com
134	北京汇成基金销售有限公司	北京汇成基金销售有限公司 注册地址：北京市西城区宣武门外大街甲 1 号 4 层 401-2 办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲 1 号环球财讯中心 D 座 4 层 法定代表人：王伟刚 客服电话：400-055-5728 网址：www.hcfunds.com
135	大连网金基金销售有限公司	大连网金基金销售有限公司 注册地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号诺德大厦 2 层 202 室 办公地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号诺德大厦 2 层 202 室 法定代表人：樊怀东 客服电话：4000-899-100 网址：www.yibaijin.com
136	天风证券股份有限公司	天风证券股份有限公司 注册地址：湖北省武汉市东湖新技术开发区高新大道 446 号天风证券大厦 20 层 办公地址：湖北省武汉市武昌区中北路 217 号天风大厦 2 号楼 法定代表人：庞介民 客服电话：95391 网址：www.tfzq.com
137	海通证券股份有限公司	海通证券股份有限公司 注册地址：上海市广东路 689 号 办公地址：上海市黄浦区中山南路 888 号海通外滩金融广场 法定代表人：周杰 客服电话：95553 网址：www.htsec.com
138	湘财证券股份有限公司	湘财证券股份有限公司 注册地址：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼 办公地址：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼 法定代表人：高振营 客服电话：95351 网址：www.xcsc.com
139	长城国瑞证券有限公司	长城国瑞证券有限公司 注册地址：厦门市思明区莲前西路 2 号莲富大厦 17 楼 办公地址：北京市丰台区凤凰嘴街 2 号院 1 号楼中国长

		城资产大厦 15-16 楼；厦门市思明区台北路 1 号海西金谷广场 T2 办公楼 13-14 层 法定代表人：李鹏 客服电话：400-0099-886 网址：www.gwgsc.com
140	杭州银行股份有限公司	杭州银行股份有限公司 注册地址：浙江省杭州市庆春路 46 号 办公地址：浙江省杭州市庆春路 46 号 法定代表人：宋剑斌 客服电话：95398；400-8888-508 网址：www.hzbank.com.cn

（二）登记机构

名称：前海开源基金管理有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市福田区深南大道 7006 号万科富春东方大厦 22 楼

法定代表人：李强

联系人：罗炜

电话：（0755）83181579

传真：（0755）83181121

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称：广东信达律师事务所

注册地址：深圳市福田区益田路 6001 号太平金融大厦 12 楼

办公地址：深圳市福田区益田路 6001 号太平金融大厦 12 楼

负责人：张炯

经办律师：杨扬、胡云云

电话：（0755）88265288

传真：（0755）88265537

（四）审计基金资产的会计师事务所

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层

办公地址：北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层

执行事务合伙人：毛鞍宁

经办注册会计师：高鹤、邓雯

联系人：高鹤

电话：（010）58153000、（0755）25028288

传真：（010）85188298、（0755）

六、基金的募集

本基金由基金管理人依照《基金法》和其他有关法律法规，以及基金合同的规定，经中国证监会 2016 年 5 月 3 日证监许可[2016]965 号文注册募集。募集期自 2016 年 9 月 6 日至 2016 年 10 月 13 日，共募集有效认购份额 260,252,626.81 份，利息结转份额 35,166.77 份，合计 260,287,793.58 份，募集户数为 361 户。

本基金为契约型开放式混合型基金，基金存续期限为不定期。

七、基金合同的生效

（一）基金备案的条件

本基金合同于 2016 年 10 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 万元的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。

法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。

八、基金份额的申购与赎回

（一）申购和赎回场所

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

若基金管理人或其指定的销售机构开通电话、传真或电子等交易方式，投资人可以通过上述方式进行申购与赎回，具体办法由基金管理人或其指定的销售机构另行公告。

（二）申购和赎回的开放日及时间

1、开放日及开放时间

投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，本基金的申购与赎回的开放日为上海证券交易所、深圳证券交易所、香港联合交易所的正常交易日（若该交易日为非港股通交易日，则本基金不开放），但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。开放日的具体业务办理时间见相关公告。

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

2、申购、赎回开始日及业务办理时间

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

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

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

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

本基金已于 2016 年 11 月 1 日开放日常申购赎回业务。

（三）申购与赎回的原则

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

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；

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

5、遵循“基金份额持有人利益优先”原则，基金管理人在办理基金份额申购、赎回业务时，如果发生申购、赎回损害持有人利益的情形时，应当及时暂停申购、赎回业务。

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

（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。

投资人在提交申购申请时须按销售机构规定的方式备足申购资金，投资人在提交赎回申请时须持有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回申请不成立。

2、申购和赎回的款项支付

投资人申购基金份额时，必须在规定的时间内全额交付申购款项，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。

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。投资人赎回申请成功后，基金管理人将在 T＋7 日(包括该日)内支付赎回款项。在发生巨额赎回或基金合同载明的其他暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。

遇证券、期货交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其他非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程，则赎回款项划付时间相应顺延。

3、申购和赎回申请的确认

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

基金销售机构对申购、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该申购、赎回申请。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。

（五）申购和赎回的限制

1、本基金对单个投资人不设累计持有的基金份额上限，但法律法规、中国证监会和《基金合同》另有规定的除外。

2、本基金首次申购和追加申购的单笔最低限额均为人民币 10 元（含申购费）。各销售机构对最低申购限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。

3、投资人赎回本基金各类基金份额时，可申请将其持有的部分或全部基金份额赎回，但每笔最低赎回份额不得低于 10 份；各类基金份额的账户最低余额为 10 份基金份额，若某笔赎回将导致投资人在销售机构托管的本基金某类基金份额余额不足 10 份时，该笔赎回业务应包括账户内全部该类基金份额，否则，基金管理人有权将剩余部分的该类基金份额强制赎回。各销售机构对最低赎回份额及账户最低余额有其他规定的，以各销售机构的业务规定为准。

4、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益，具体请参见相关公告。

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

（六）申购和赎回的价格、费用及其用途

1、本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码，分别计算和公告两类基金份额净值和两类基金份额累计净值。本基金两类基金份额净值的计算，保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T 日的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，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

2、申购费率

对于本基金 A 类和 C 类基金份额，投资人在申购时均需交纳前端申购费，两类基金份额申购费率相同。

（1）投资人通过代销机构申购本基金 A/C 类基金份额的申购费率见下表：

申购金额 M（元）（含申购费）	申购费率
M ＜50 万	1.50%
50 万≤ M ＜250 万	1.00%
250 万 ≤ M ＜500 万	0.60%
M ≥500 万	每笔 1,000 元

（2）本基金对通过基金管理人直销柜台和电子直销交易系统申购的投资人实施差别的申购费率，详见基金管理人官网或相关公告。

部分销售机构如实行优惠费率，请投资人参见销售机构公告。

本基金 A 类和 C 类基金份额的申购费用应在投资人申购基金份额时收取。投资人在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。

申购费用由投资人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用。

3、申购份额的计算及余额的处理方式

基金的申购金额包括申购费用和净申购金额。

（1）当投资人选择申购 A 类和 C 类基金份额时，申购份额的计算方法如下：

1）A 类和 C 类基金份额的申购费率适用比例费率时：

净申购金额=申购金额/（1＋申购费率）

申购费用=申购金额-净申购金额

申购份额=净申购金额/申购当日该类基金份额净值

2）A 类和 C 类基金份额的申购费率适用固定金额时：

净申购金额=申购金额-固定金额

申购费用=固定金额

申购份额=净申购金额/申购当日该类基金份额净值

申购的有效份额单位为份，上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

举例一：某投资人投资 8 万元申购本基金 A 类/C 类基金份额，对应费率为 1.50%，假设申购当日该类基金份额的基金份额净值为 1.080 元,则可得到的申购份额为：

净申购金额＝80,000/（1＋1.50%）＝78,817.73 元

申购费用＝80,000－78,817.73＝1182.27 元

申购份额＝78,817.73/1.080＝72979.38 份

即：投资人投资 8 万元申购本基金 A 类/C 类基金份额，假设申购当日 A 类/C 类基金份额的基金份额净值为 1.080 元，则其可得到 72979.38 份 A 类/C 类基金份额。

4、赎回费率

（1）本基金 A 类基金份额的赎回费率如下表所示：

持有时间 D（天）	A 类基金份额赎回费率
D＜7	1.50%
7 ≤ D ＜30	0.75%
30 ≤ D ＜330	0.50%
D≥330	0%

投资者可将其持有的全部或部分 A 类基金份额赎回。赎回费由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。对持续持有期少于 330 日的 A 类基金份额持有人收取的赎回费全额计入基金财产。

（2）本基金 C 类基金份额赎回费率如下表所示：

持有时间 D（天）	C 类基金份额赎回费率
D＜7	1.50%
7≤D＜30	0.50%
D≥30	0%

投资者可将其持有的全部或部分 C 类基金份额赎回。赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。对持续持有期少于 30 日的 C 类基金份额持有人收取的赎回费全额计入基金财产。

5、赎回金额的计算及处理方式

本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额的赎回金额的计算方式相同，按照各自对应的当日该类基金份额净值和赎回费率计算，净赎回金额为赎回总金额扣减赎回费用。赎回金额的计算方式如下：

赎回总金额=赎回份额×赎回当日该类基金份额净值

赎回费用=赎回总金额×赎回费率

净赎回金额=赎回总金额-赎回费用

赎回金额单位为元，计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

举例二：某投资人赎回本基金 1 万份 A 类基金份额，持有时间为 300 天，对应的赎回费率为 0.50%，假设赎回当日 A 类基金份额的基金份额净值是 1.088 元，则其可得到的赎回金额为：

赎回金额=10,000×1.088=10,880.00 元

赎回费用=10,880.00×0.50%=54.40 元

净赎回金额=10,880.00-54.40=10825.60 元

即：投资人赎回本基金 1 万份 A 类基金份额，持有期限为 300 天，假设赎回当日 A 类基金份额的基金份额净值是 1.088 元，则其可得到的净赎回金额为 10825.60 元。

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

7、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管

部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金认购费率、基金申购费率和基金销售服务费率。

（七）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。

3、证券、期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值或者无法办理申购业务。

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，或其他损害现有基金份额持有人利益的情形。

6、因基金收益分配、基金投资组合内某个或某些证券即将上市等原因，使短期内继续接受申购可能会影响或损害现有基金份额持有人利益的。

7、基金管理人、基金托管人、基金销售机构或登记机构的异常情况导致基金销售系统、基金登记系统或基金会计系统无法正常运行。

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

9、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。

10、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

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

（八）暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况。

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

4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

5、接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时。

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

7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付，并以受理赎回申请当日的该类基金份额净值为依据计算赎回金额。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。

（九）巨额赎回的情形及处理方式

1、巨额赎回的认定

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

2、巨额赎回的处理方式

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

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

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

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

3、巨额赎回的公告

当发生上述巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式（包括但不限于短信、电子邮件或由基金销售机构通知等方式）在 3 个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，并在 2 日内在指定媒介上刊登公告。

（十）暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

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

2、如发生暂停的时间为 1 日，基金管理人应于重新开放日，在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近 1 个开放日两类基金份额的基金份额净值。

3、如发生暂停的时间超过 1 日，基金管理人可以根据暂停申购或赎回的时间，依照《信息披露办法》的有关规定，最迟于重新开放日在指定媒介上刊登重新开放申购或赎回的公告；也可以根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间，届时不再另行发布重新开放的公告。

（十一）基金转换

基金管理人已于 2016 年 11 月 1 日起开通本基金与基金管理人旗下其他基金之间的转换业务，具体内容详见 2016 年 10 月 28 日在指定媒介上发布的《前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定投业务的公告》。

（十二）基金的非交易过户

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

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

（十三）基金的转托管

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

（十四）定期定额投资计划

基金管理人已于 2016 年 11 月 1 日起开通本基金的定期定额投资业务，具体内容详见 2016 年 10 月 28 日在指定媒介上发布的《前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定投业务的公告》。

（十五）基金份额的冻结、解冻和质押

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

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

（十六）基金份额的转让

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

九、基金的投资

（一）投资目标

本基金主要通过精选投资于核心资源主题相关证券，在合理控制风险并保持基金资产良好流动性的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。

（二）投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、沪港股票市场交易互联互通机制试点允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

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

基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的比例为 0-95%（其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的 0-95%，投资于港股通标的股票的比例占基金资产的 0-95%），投资于核心资源主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的 80%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

本基金所称“核心资源”是指能够被企业占有和利用，为企业创造经济价值，进而给企业带来核心竞争力的稀缺资源以及生产或经营条件。以核心资源为主题，本基金将重点配置拥有上述核心资源开发、经营或使用权的上市公司发行的股票。

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

本基金参与股指期货交易，应符合法律法规规定和基金合同约定的投资限制并遵守相关期货交易所的业务规则。

（三）投资策略

本基金的投资策略主要有以下六方面内容：

1、大类资产配置

在大类资产配置中，本基金综合运用定性和定量的分析手段，在对宏观经济因素进行充分研究的基础上，判断宏观经济周期所处阶段。本基金将依据经济周期理论，结合对证

券市场的系统性风险以及未来一段时期内各大类资产风险和预期收益率的评估，制定本基金在股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例。

本基金通过对股票等权益类、债券等固定收益类和现金资产分布的实时监控，根据经济运行周期变动、市场利率变化、市场估值、证券市场变化等因素以及基金的风险评估进行灵活调整。在各类资产中，根据其参与市场基本要素的变动，调整各类资产在基金投资组合中的比例。

2、股票投资策略

（1）核心资源主题相关股票的界定

本基金所称“核心资源”是指能够被企业占有和利用，为企业创造经济价值，进而给企业带来核心竞争力的稀缺资源以及生产或经营条件。以核心资源为主题，本基金将重点配置拥有上述核心资源开发、经营或使用权的上市公司发行的股票。

本基金将在拥有上述核心资源的上市公司中，重点关注具有良好发展潜力的核心资源及拥有该资源开发经营权的上市公司。具体而言，本基金将重点筛选出具备下列条件之一的上市公司所发行的股票：

1）沪港深市场中拥有耕地、林木资源、金属矿产资源开发经营权的上市公司；

2）沪港深市场中拥有河流、湖泊、海洋等自然资源开发经营权并将上述自然资源用于动物、植物、微生物种植养殖或捕捞的优势企业中的上市公司；

3）沪港深市场中拥有煤炭、综合性油气、油气勘探生产、油气炼制营销等资源的上市公司；

4）沪港深市场中拥有旅游胜地、文物古迹等自然地理和历史人文资源的上市公司；

5）沪港深市场中拥有商业用地、住宅用地、建材用地、工业用地（非自用）开发经营权的上市公司；

6）沪港深市场中从事风力发电、太阳能发电、水力发电、核能发电等自然资源开发利用的上市公司。

根据申银万国行业分类，符合上述条件的上市公司，集中分布于农林牧渔、采掘、钢铁、有色金属、旅游、房地产、电气设备、公用事业等行业。

（2）核心资源主题相关股票的投资策略

本基金将精选有良好增值潜力的、与核心资源主题相关的上市公司股票构建股票投资组合。在个股选择上，本基金将根据上市公司所处行业特点，综合考虑公司质地和业绩弹性等因素，寻找基本面健康、业绩向上弹性较大、估值有优势的公司进行投资。在公司质地方面，选择治理结构优良、竞争优势强、管理水平高、资产负债表健康的公司；在业绩弹性方面，重点考虑盈利能力相对产能利用率、价格、成本弹性较大的公司；在估值方面，综合考虑市净率、市销率、EV/EBITDA、重置价值、市盈率等估值指标，选择估值具有

较好安全边际的公司。通过对备选公司以上方面的分析，本基金将优选出具有综合优势的股票构建投资组合，并根据行业趋势、估值水平等因素进行动态调整。

（3）港股通标的股票投资策略

本基金可通过沪港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场，不使用合格境内机构投资者(QDII)境外投资额度进行境外投资。本基金将遵循核心资源主题相关股票的投资策略，优先将基本面健康、业绩向上弹性较大、具有估值优势的港股纳入本基金的股票投资组合。

3、债券投资策略

在债券投资策略方面，本基金将以核心资源主题相关债券为主线，在综合研究的基础上实施积极主动的组合管理，采用宏观环境分析和微观市场定价分析两个方面进行债券资产的投资。在宏观环境分析方面，结合对宏观经济、市场利率、债券供求等因素的综合分析，根据交易所市场与银行间市场类属资产的风险收益特征，定期对投资组合类属资产进行优化配置和调整，确定不同类属资产的最优权重。

在微观市场定价分析方面，本基金以中长期利率趋势分析为基础，结合经济趋势、货币政策及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素，重点选择那些流动性较好、风险水平合理、到期收益率与信用质量相对较高的债券品种。具体投资策略有收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略等积极投资策略。

4、权证投资策略

在权证投资方面，本基金根据权证对应公司基本面研究成果确定权证的合理估值，发现市场对股票权证的非理性定价；利用权证衍生工具的特性，通过权证与证券的组合投资，来达到改善组合风险收益特征的目的。

5、资产支持证券投资策略

本基金通过对资产支持证券发行条款的分析、违约概率和提前偿付比率的预估，借用必要的数量模型来谋求对资产支持证券的合理定价，在严格控制风险、充分考虑风险补偿收益和市场流动性的条件下，谨慎选择风险调整后收益较高的品种进行投资。

本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。

6、股指期货投资策略

本基金以套期保值为目的，参与股指期货交易。

本基金参与股指期货投资时机和数量的决策建立在对证券市场总体行情的判断和组合风险收益分析的基础上。基金管理人将根据宏观经济因素、政策及法规因素和资本市场因素，结合定性和定量方法，确定投资时机。基金管理人将结合股票投资的总体规模，以及中国证监会的相关限定和要求，确定参与股指期货交易的投资比例。

基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

基金管理人在进行股指期货投资前将建立股指期货投资决策部门或小组，负责股指期货的投资管理的相关事项，同时针对股指期货投资管理制定投资决策流程和风险控制等制度，并经基金管理人董事会批准后执行。

若相关法律法规发生变化时，基金管理人期货投资管理遵从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。

（四）投资决策依据及程序

1、决策依据

以《基金法》、基金合同、公司章程等有关法律法规为决策依据，并以维护基金份额持有人利益作为最高准则。

2、决策程序

（1）投资决策委员会制定整体投资战略。

（2）研究部根据自身以及其他研究机构的研究成果，构建股票备选库、精选库，对拟投资对象进行持续跟踪调研，并提供个股、债券决策支持。

（3）基金经理根据投资决策委员会的投资战略，设计和调整投资组合，交由交易部执行。设计和调整投资组合需要考虑的基本因素包括：每日基金申购和赎回净现金流量；基金合同的投资限制和比例限制；研究员的投资建议；基金经理的独立判断；绩效与风险评估小组的建议等。

（4）交易部按有关交易规则执行，并将有关信息反馈基金经理。

（5）基金绩效评估岗及风险管理岗定期进行基金绩效评估，并向投资决策委员会提交综合评估意见和改进方案。

（6）风险控制委员会对识别、防范、控制基金运作各个环节的风险全面负责，尤其重点关注基金投资组合的风险状况；基金绩效评估岗及风险管理岗重点控制基金投资组合的市场风险和流动性风险。

（五）业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×70%＋中证全债指数收益率×30%。

业绩比较基准选择理由：

沪深 300 指数是由中证指数公司编制发布、表征 A 股市场走势的权威指数。该指数是由上海和深圳证券市场中选取 300 只 A 股作为样本编制而成的成份股指数。其样本覆盖了沪深市场六成左右的市值，具有良好的市场代表性。本基金选择该指数来衡量股票投资部分的绩效。

中证全债指数是中证指数公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数。该指数的样本由银行间市场和沪深交易所市场的国债、金融债券及企业债券组成，中证指数公司每日计算并发布中证全债的收盘指数及相应的债券属性指标。该指数的一个重要特点在于对异常价格和无价情况下使用了模型价，能更为真实地反映债券的实际价值和收益率特征。本基金选择该指数来衡量债券投资部分的绩效。

根据本基金的投资范围和投资比例约束，设定本基金的基准为沪深 300 指数收益率×70%＋中证全债指数收益率×30%，该基准能客观衡量本基金的投资绩效。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时，本基金管理人协商基金托管人后可以在报中国证监会备案以后变更业绩比较基准并及时公告，但不需要召集基金份额持有人大会。

（六）风险收益特征

本基金为混合型基金，属于中高风险收益的投资品种，其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金，低于股票型基金。本基金如果投资港股通标的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。

（七）投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金股票投资占基金资产的比例为 0-95%（其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的 0-95%，投资于港股通标的股票的比例占基金资产的 0-95%），投资于核心资源主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的 80%；

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

（3）本基金持有一家公司发行的证券，其市值（同一家公司在境内和香港同时上市的 A+H 股合计计算）不超过基金资产净值的 10%；

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

（5）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

（6）本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

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

（8）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%；

（9）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%；

（10）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%；

（11）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%；

（12）本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

（13）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；

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

（15）本基金投资流通受限证券，基金管理人应事先根据中国证监会相关规定，与基金托管人在本基金托管协议中明确基金投资流通受限证券的比例，根据比例进行投资。基金管理人应制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险；

（16）本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；

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

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

（19）本基金投资单只中期票据的额度不得超过其发行总额度的 10%，并且不得超过基金资产净值的 10%；

（20）本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值不得超过基金资产净值的 10%；

（21）本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

（22）本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；本基金管理人应当按照中国金融期货交易所要求的内容、格式与时限向交易所报告所交易和持有的卖出期货合约情况、交易目的及对应的证券资产情况等；

（23）本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；

（24）本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；

（25）本基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

（26）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

基金管理人运用基金财产投资证券衍生品种的，应当根据风险管理的原则，并制定严格的授权管理制度和投资决策流程。基金管理人运用基金财产投资证券衍生品种的具体比例，应当符合中国证监会的有关规定。

本基金在开始进行股指期货投资之前，应与基金托管人就股指期货清算、估值、交割等事宜另行具体协商。

除上述第（2）、（12）、（17）、（18）项外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准，但须提前公告。

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

（1）承销证券；

（2）违反规定向他人贷款或者提供担保；

（3）从事承担无限责任的投资；

（4）买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；

（5）向其基金管理人、基金托管人出资；

（6）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

（7）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

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

法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准，但须提前公告，不需要经基金份额持有人大会审议。

（八）基金管理人代表基金行使股东权利及债权人权利的处理原则及方法

1、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；

2、有利于基金资产的安全与增值；

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

4、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利，保护基金份额持有人的利益。

（九）基金的投资组合报告

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

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定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 2024 年 09 月 30 日（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	408,259,630.30	88.23
-	其中：股票	408,259,630.30	88.23
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
-	其中：债券	-	-
-	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
-	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	41,057,796.60	8.87
8	其他资产	13,426,596.43	2.90

9	合计	462,744,023.33	100.00

注：权益投资中通过港股通交易机制投资的港股公允价值为6,219,546.43元，占资产净值比例1.41%。

2.报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	130,241,139.54	29.43
C	制造业	271,798,944.33	61.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
-	合计	402,040,083.87	90.83

2.2报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例(%)
材料	6,219,546.43	1.41
合计	6,219,546.43	1.41

注：以上分类采用彭博行业分类标准（BICS）。

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	300748	金力永磁	2,737,403	39,528,099.32	8.93
2	600549	厦门钨业	1,855,500	38,817,060.00	8.77
3	300224	正海磁材	3,576,307	38,552,589.46	8.71
4	600111	北方稀土	1,771,850	36,553,265.50	8.26
5	000831	中国稀土	1,290,300	36,528,393.00	8.25
6	600392	盛和资源	3,340,961	33,576,658.05	7.59

7	600489	中金黄金	1,993,662	30,303,662.40	6.85
8	601899	紫金矿业	1,664,900	30,201,286.00	6.82
9	600010	包钢股份	14,369,600	24,859,408.00	5.62
10	600547	山东黄金	789,446	23,122,873.34	5.22

4.报告期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

9.报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

10.报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1 本期国债期货投资政策

无。

10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

10.3 本期国债期货投资评价

无。

11.投资组合报告附注

11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

11.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	73,978.92
2	应收证券清算款	10,252,817.99
3	应收股利	-

4	应收利息	-
5	应收申购款	3,099,799.52
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	13,426,596.43

11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

（十）基金的业绩

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

前海开源沪港深核心资源混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2016.10.17-2016.12.31	-0.40%	0.19%	0.05%	0.51%	-0.45%	-0.32%
2017.1.1-2017.12.31	12.45%	0.31%	14.79%	0.45%	-2.34%	-0.14%
2018.1.1-2018.12.31	-10.89%	1.01%	-15.97%	0.93%	5.08%	0.08%
2019.1.1-2019.12.31	32.30%	1.74%	26.39%	0.87%	5.91%	0.87%
2020.1.1-2020.12.31	46.81%	2.18%	20.09%	1.00%	26.72%	1.18%
2021.1.1-2021.12.31	45.34%	2.03%	-1.72%	0.82%	47.06%	1.21%
2022.1.1-2022.12.31	3.10%	1.84%	-14.45%	0.90%	17.55%	0.94%
2023.1.1-2023.12.31	-5.87%	1.31%	-6.52%	0.59%	0.65%	0.72%
2024.1.1-2024.9.30	6.91%	1.83%	13.84%	0.82%	-6.93%	1.01%
2016.10.17-2024.9.30	192.31%	1.61%	31.06%	0.81%	161.25%	0.80%

前海开源沪港深核心资源混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2016.10.17-2016.12.31	-0.40%	0.19%	0.05%	0.51%	-0.45%	-0.32%
2017.1.1-2017.12.31	11.14%	0.30%	14.79%	0.45%	-3.65%	-0.15%
2018.1.1-2018.12.31	-10.03%	1.00%	-15.97%	0.93%	5.94%	0.07%
2019.1.1-2019.12.31	32.07%	1.74%	26.39%	0.87%	5.68%	0.87%
2020.1.1-2020.12.31	46.68%	2.18%	20.09%	1.00%	26.59%	1.18%

2021.1.1-2021.12.31	45.13%	2.03%	-1.72%	0.82%	46.85%	1.21%
2022.1.1-2022.12.31	3.01%	1.84%	-14.45%	0.90%	17.46%	0.94%
2023.1.1-2023.12.31	-5.98%	1.31%	-6.52%	0.59%	0.54%	0.72%
2024.1.1-2024.9.30	6.82%	1.83%	13.84%	0.82%	-7.02%	1.01%
2016.10.17-2024.9.30	189.67%	1.60%	31.06%	0.81%	158.61%	0.79%

十、基金的财产

（一）基金资产总值

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

（二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

（三）基金财产的账户

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

（四）基金财产的保管和处分

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

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

十一、基金资产的估值

（一）估值日

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

（二）估值对象

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

（三）估值方法

1、证券交易所上市的有价证券的估值

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

2、交易所市场交易的固定收益品种的估值

（1）对在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（另有规定的除外），选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；

（2）对在交易所市场上市交易的可转换债券，按估值日收盘价减去可转换债券收盘价中所含债券应收利息后得到的净价进行估值；

（3）对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募债券，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；

（4）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，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、银行间市场交易的固定收益品种的估值

（1）银行间市场交易的固定收益品种，选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值。

（2）对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的固定收益品种，按成本估值。

4、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、配股和公开增发的股票，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和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

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

5、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

6、本基金投资股指期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

7、估值计算中涉及到港币、美元、英镑、欧元、日元等主要货币对人民币汇率的，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。

8、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。

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

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

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布，由此给基金份额持有人和基金造成的损失以及因该交易日基金资产净值计算顺延错误而引起的损失，由基金管理人负责赔付。

（四）估值程序

1、基金份额净值是按照每个估值日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到 0.001 元，小数点后第 4 位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人于每个估值日计算基金资产净值及两类基金份额净值，并按规定公告。

2、基金管理人应每个估值日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个估值日对基金资产估值后，将两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，由基金管理人对外公布。

（五）估值错误的处理

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

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。对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平不能预见、不能避免、不能克服，则属不可抗力，按照下述规定执行。

由于不可抗力原因造成投资人的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

2、估值错误处理原则

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

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

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

（4）估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

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

4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

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

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

（3）前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

（六）暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

3、出现基金管理人认为属于会导致基金管理人不能出售或评估基金资产的紧急事故的任何情况时；

4、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一致的；

5、法律法规、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

（七）基金净值的确认

用于基金信息披露的基金资产净值和两类基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个估值日交易结束后计算当日的基金资产净值和两类基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金净值予以公布。

（八）特殊情形的处理

基金管理人、基金托管人按估值方法的第8项进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

由于交易所及登记结算公司发送的数据错误，或由于其他不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

十二、基金的收益分配

（一）基金利润的构成

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

（二）基金可供分配利润

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

（三）基金收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；若投资者选择红利再投资方式进行收益分配，收益的计算以权益登记日当日收市后计算的两类基金份额净值为基准转为相应类别的基金份额进行再投资；

3、基金收益分配后两类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的两类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、本基金两类基金份额在费用收取上不同，其对应的可分配收益可能有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在对基金份额持有人利益无实质不利影响的情况下，基金管理人可在法律法规允许的前提下酌情调整以上基金收益分配原则，此项调整不需要召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在指定媒介公告。

（四）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。由于不同基金份额类别对应的可分配收益不同，基金管理人可相应制定不同的收益分配方案。

（五）收益分配方案的确定、公告与实施

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

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

（六）基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足于支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为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。

十三、基金的费用与税收

（一）基金费用的种类

1、基金管理人的管理费；

2、基金托管人的托管费；

3、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、证券、期货账户开户费用、银行账户维护费用；

10、因投资相关规定范围内的香港联合交易所上市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 0.60%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×0.60%÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人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×0.10%÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

3、基金的销售服务费

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年费率为 0.10%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务。

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×0.10% ÷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 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划款指令，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。销售服务费由登记机构代收并按照相关合同规定支付给基金销售机构。若遇法定节假日、公休日等，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）基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率和销售服务费率等相关费率。基金管理人必须依照有关规定于新的费率实施日前在指定媒介刊登公告。

（五）基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十四、基金的会计与审计

（一）基金会计政策

1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；

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

3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；

4、会计制度执行国家有关会计制度；

5、本基金独立建账、独立核算；

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

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

（二）基金的年度审计

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

2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意。

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

十五、基金的信息披露

（一）本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《基金合同》及其他有关规定。相关法律法规对信息披露的披露方式、登载媒介、报备方式等规定发生变化时，本基金从其最新规定。

（二）信息披露义务人

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

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

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

（三）本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；

2、对证券投资业绩进行预测；

3、违规承诺收益或者承担损失；

4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构；

5、登载任何自然人、法人和非法人组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；

6、中国证监会禁止的其他行为。

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

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

（五）公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

1、基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议、基金产品资料概要

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

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

理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在指定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。

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

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

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

2、基金份额发售公告

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

3、《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备案文件的次日在指定媒介上登载《基金合同》生效公告。

4、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公告一次基金资产净值和两类基金份额净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过指定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日的两类基金份额净值和两类基金份额累计净值。

基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在指定网站披露半年度和年度最后一日的两类基金份额净值和两类基金份额累计净值。

5、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。

6、基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告

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

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

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

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

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。

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基金定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本基金的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

7、临时报告

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

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

（1）基金份额持有人大会的召开及决定的事项；

（2）《基金合同》终止、基金清算；

（3）转换基金运作方式、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，或者从事其他重大关联交易事项，但中国证监会另有规定的除外；

（14）基金收益分配事项；

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

（16）基金份额净值估值错误达基金份额净值百分之零点五；

（17）本基金开始办理申购、赎回；

（18）本基金发生巨额赎回并延期办理；

（19）本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；

（20）本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；

（21）发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；

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

8、澄清公告

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

9、基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

10、基金投资股指期货的信息披露

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

11、基金投资资产支持证券的信息披露

若本基金投资了资产支持证券，需按照法规要求在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露资产支持证券的交易情况。基金管理人应在基金年报及中期报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产

的比例和报告期内所有的资产支持证券明细；在基金季度报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期末按市值占基金净资产比例大小排序的前 10 名资产支持证券明细。

12、基金投资港股通标的股票的相关公告

基金管理人应当在基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中按届时有效的法律法规或监管机构的要求披露港股通标的股票的投资情况。若中国证监会对公开募集证券投资基金通过沪港股票市场交易互联互通机制投资香港股票市场的信息披露另有规定的，从其规定。

13、中国证监会规定的其他信息。

（六）信息披露事务管理

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

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

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

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

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

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

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

（七）信息披露文件的存放与查阅

依法必须披露的信息发布后，基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于各自住所，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、基金投资所涉及的证券、期货交易所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、出现基金管理人认为属于会导致基金管理人不能出售或评估基金资产的紧急事故的任何情况时；

4、法律法规规定、中国证监会或基金合同认定的其他情形。

（九）本基金信息披露事项以法律法规规定及本章节约定的内容为准。

十六、风险揭示

本基金的风险主要包括：市场风险、信用风险、管理风险、流动性风险、操作和技术风险、合规性风险、股指期货投资风险、本基金特有的风险、其他风险及本法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险等。

（一）市场风险

基金主要投资于证券市场，而证券市场价格因受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响而产生波动，从而导致基金收益水平发生变化，产生风险。主要的风险因素包括：

1、政策风险

因财政政策、货币政策、产业政策、地区发展政策等国家宏观政策发生变化，导致市场价格波动，影响基金收益而产生风险。

2、经济周期风险

随着经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化，基金投资的收益水平也会随之变化，从而产生风险。

3、利率风险

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

4、上市公司经营风险

上市公司的经营状况受多种因素的影响，如管理能力、行业竞争、市场前景、技术更新、财务状况、新产品研究开发等都会导致公司盈利发生变化。如果基金所投资的上市公司经营不善，其股票价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，使基金投资收益下降。上市公司还可能出现难以预见的变化。虽然基金可以通过投资多样化来分散这种非系统风险，但不能完全避免。

5、通货膨胀风险

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

6、债券收益率曲线变动的风险

债券收益率曲线变动风险是指与收益率曲线非平行移动有关的风险，单一的久期指标并不能充分反映这一风险的存在。

7、再投资风险

市场利率下降将影响固定收益类证券利息收入的再投资收益率，这与利率上升所带来的价格风险互为消长。

（二）信用风险

基金在交易过程中可能发生交收违约或者所投资债券的发行人违约、拒绝支付到期本息等情况，从而导致基金资产损失。

（三）管理风险

基金管理人的专业技能、研究能力及投资管理水平直接影响到其对信息的占有、分析和对经济形势、证券价格走势的判断，进而影响基金的投资收益水平。同时，基金管理人的投资管理制度、风险管理和内部控制制度是否健全，能否有效防范道德风险和其他合规性风险，以及基金管理人的职业道德水平等，也会对基金的风险收益水平造成影响。

（四）流动性风险

1、我国证券市场作为新兴转轨市场，市场整体流动性风险较高。基金投资组合中的股票和债券会因各种原因面临较高的流动性风险，使证券交易的执行难度提高，买入成本或变现成本增加。此外，基金投资者的赎回需求可能造成基金仓位调整和资产变现困难，加剧流动性风险。

为了克服流动性风险，本基金将在坚持分散化投资和精选个股原则的基础上，通过一系列风险控制指标加强对流动性风险的跟踪、防范和控制，但基金管理人并不保证完全避免此类风险。

2、本基金主要的流动性风险管理方法说明

（1）在申购、赎回安排方面，本基金将加强对开放式基金申购环节的管理，合理控制基金份额持有人集中度，审慎确认大额申购申请，在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，基金管理人将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对基金规模予以控制，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。

（2）本基金拟投资市场主要为证券交易所、全国银行间债券市场等流动性较好的规范型交易场所，主要投资对象为具有良好流动性的金融工具（包括国内依法发行上市的股票、债券和货币市场工具等），同时本基金基于分散投资的原则在行业和个券方面未有高集中度的特征，综合评估在正常市场环境下本基金的流动性风险适中。

（3）在本基金出现巨额赎回情形下，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况或巨额赎回份额占比情况决定全额赎回或部分延期赎回。同时，如本基金单个基金份额持有人在单个开放日申请赎回基金份额超过基金总份额一定比例以上的，基金管理人有权实施延期办理赎回申请的措施。具体内容详见本招募说明书第八章。

（4）本基金可能实施备用的流动性风险管理工具，以更好地应对流动性风险。基金管理人经与基金托管人协商，在确保投资者得到公平对待的前提下，可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，对赎回申请等进行适度调整，作为特定情形下基金管理人流动性风险管理的辅助措施，包括但不限于：1）延期办理巨额赎回申

请；2）暂停接受赎回申请；3）延缓支付赎回款项；4）收取短期赎回费，本基金对持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5%的赎回费；5）暂停基金估值，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一致，本基金将暂停基金估值。

当基金管理人实施流动性风险管理工具时，可能对投资者具有一定的潜在影响，包括但不限于不能申购本产品、赎回申请不能确认或者赎回款项延迟到账、如持有期限少于 7 日会产生较高的赎回费造成收益损失等。提示投资者了解自身的流动性偏好、合理做好投资安排。

（五）操作和技术风险

基金的相关当事人在各业务环节的操作过程中，可能因内部控制不到位或者人为因素造成操作失误或违反操作规程而引致风险，如越权交易、内幕交易、交易错误和欺诈等。

此外，在开放式基金的后台运作中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行甚至导致基金份额持有人利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理人、基金托管人、登记机构、销售机构、证券交易所和证券登记结算机构等。

（六）合规性风险

指基金管理或运作过程中，违反国家法律、法规或基金合同有关规定的风险。

（七）股指期货投资风险

1、基差风险。标的股票指数价格与股指期货价格之间的价差被称为基差。在股指期货交易中因基差波动的不确定性而导致的风险被称为基差风险；

2、合约品种差异造成的风险。合约品种差异造成的风险，是指类似的合约品种，在相同因素的影响下，价格变动不同。表现为两种情况：A.价格变动的方向相反；B.价格变动的幅度不同。类似合约品种的价格，在相同因素作用下变动幅度上的差异，也构成了合约品种差异的风险；

3、标的物风险。股指期货交易中，标的物风险是由于投资组合与股指期货的标的指数的结构不完全一致，导致投资组合特定风险无法完全锁定所带来的风险；

4、衍生品模型风险。本基金在构建股指期货组合时，可能借助模型进行期货合约的选择。由于模型设计、资本市场的剧烈波动或不可抗力，按模型结果调整股指期货合约或者持仓比例也可能将给本基金的收益带来影响。

（八）本基金特有的风险

本基金为主动管理灵活配置混合型基金，其投资风格和投资范围决定了本基金具有如下特有风险：

1、股票最低仓位风险

基金管理人重视股票投资风险的防范，虽然股票投资仓位在 0%－95%内灵活配置，但无法完全规避股票市场的下跌风险。

2、资产配置偏离优化水平风险

本基金为混合型基金，资产配置策略对基金的投资业绩具有较大的影响。在类别资产配置中可能会由于市场环境、公司治理、制度建设等因素的不同影响，导致资产配置偏离优化水平，为组合绩效带来风险。

3、港股交易失败风险：本基金可通过港股通投资于港股，现行的港股通规则，对港股通设有每日额度上限的限制；本基金可能因为港股通市场每日额度不足，而不能买入看好之投资标的进而错失投资机会的风险。在香港联合交易所有限公司开市前阶段，当日额度使用完毕的，新增的买单申报将面临失败的风险；在联交所持续交易时段，当日额度使用完毕的，当日本基金将面临不能通过港股通进行买入交易的风险。

4、汇率风险：本基金将投资港股通标的股票，在交易时间内提交订单依据的港币买入参考汇率和卖出参考汇率，并不等于最终结算汇率。港股通交易日日终，中国证券登记结算有限责任公司进行净额换汇，将换汇成本按成交金额分摊至每笔交易，确定交易实际适用的结算汇率。故本基金投资面临汇率风险。

5、境外市场的风险

（1）本基金将按照政策相关规定投资于香港市场，在市场进入、投资额度、可投资对象、税务政策等方面都有一定的限制，而且此类限制可能会不断调整，这些限制因素的变化可能对本基金进入或退出当地市场造成障碍，从而对投资收益以及正常的申购赎回产生直接或间接的影响。

（2）香港市场交易规则有别于内地 A 股市场规则，参与香港股票投资还将面临包括但不限于如下特殊风险：

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

2）只有沪港两地均为交易日且能够满足结算安排的交易日才为港股通交易日；

3）香港出现台风、黑色暴雨或者联交所规定的其他情形时，联交所将可能停市，投资者将面临在停市期间无法进行交易的风险；出现上交所证券交易服务公司认定的交易异常情况时，上交所证券交易服务公司将可能暂停提供部分或者全部港股通服务，投资者将面临在暂停服务期间无法进行港股通交易的风险；

4）投资者因港股通股票权益分派、转换、上市公司被收购等情形或者异常情况，所取得的港股通股票以外的联交所上市证券，只能通过港股通卖出，但不得买入，交易所另有规定的除外；因港股通股票权益分派或者转换等情形取得的联交所上市股票的认购权利在联交所上市的，可以通过港股通卖出，但不得行权；因港股通股票权益分派、转换或者上市公司被收购等所取得的非联交所上市证券，可以享有相关权益，但不得通过港股通买入或卖出；

5）代理投票。由于中国证券登记结算有限责任公司是在汇总投资者意愿后再向香港结算提交投票意愿，中国证券登记结算有限责任公司对投资者设定的意愿征集期比香港结算的征集期稍早结束；投票没有权益登记日的，以投票截止日的持有作为计算基准；投票数量超出持有数量的，按照比例分配持有基数。以上所述因素可能会给本基金投资带来特殊交易风险。

6、其他投资风险

本基金的投资风格和决策过程决定了本基金具有其他投资风险。例如，本基金还投资于股指期货、权证等高风险品种，相应的市场波动也可能给基金财产带来较高的风险。

（九）其他风险

1、因基金业务快速发展而在制度建设、人员配备、风险管理和内控制度等方面不完善而产生的风险；

2、因金融市场危机、行业竞争压力可能产生的风险；

3、战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，可能严重影响证券市场运行，导致基金资产损失；

4、其他意外导致的风险。

（十）本法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险

本法律文件投资章节有关风险收益特征的表述是基于投资范围、投资比例、证券市场普遍规律等做出的概述性描述，代表了一般市场情况下本基金的长期风险收益特征。销售机构(包括基金管理人直销机构和代销机构)根据相关法律法规对本基金进行风险评价，不同的销售机构采用的评价方法也不同，因此销售机构的风险等级评价与法律文件中风险收益特征的表述可能存在不同，投资人在购买本基金时需按照销售机构的要求完成风险承受能力与产品风险之间的匹配检验。

十七、基金的终止与清算

（一）基金合同的变更

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

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，并自决议生效后两个工作日内在指定媒介公告。

（二）基金转换运作方式或者与其他基金合并

基金转换运作方式或者与其他基金合并，应当按照法律法规及基金合同规定的程序进行。实施方案若未在基金合同中明确约定，应当经基金份额持有人大会审议通过。基金管理人应当提前发布提示性通知，明确有关实施安排，说明对现有基金份额持有人的影响以及基金份额持有人享有的选择权，并在实施前预留至少二十个开放日或者交易日供基金份额持有人做出选择。

（三）基金合同的终止事由

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

1、基金份额持有人大会决定终止的；

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

3、《基金合同》约定的其他情形；

4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

（四）基金财产的清算

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

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

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

4、基金财产清算程序：

（1）《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；

（2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；

（3）对基金财产进行估值和变现；

（4）制作清算报告；

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

（6）将清算报告报中国证监会备案并公告；

（7）对基金剩余财产进行分配。

5、基金财产清算的期限为 6 个月。

（五）清算费用

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

（六）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。

（七）基金财产清算的公告

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

（八）基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

十八、基金合同的内容摘要

一、基金合同当事人的权利、义务

（一）基金份额持有人的权利与义务

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

（1）分享基金财产收益；

（2）参与分配清算后的剩余基金财产；

（3）依法申请赎回或转让其持有的基金份额；

（4）按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会；

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

（6）查阅或者复制公开披露的基金信息资料；

（7）监督基金管理人的投资运作；

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

（9）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

（1）认真阅读并遵守《基金合同》、招募说明书（更新）等信息披露文件；

（2）了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；

（3）关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；

（4）缴纳基金认购、申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；

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

（6）不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；

（7）执行生效的基金份额持有人大会的决议；

（8）返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；

（9）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

（二）基金管理人的权利与义务

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

（1）依法募集资金；

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

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

（4）销售基金份额；

（5）按照规定召集基金份额持有人大会；

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

（7）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

（8）选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；

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

（10）依据《基金合同》及有关法律规定决定基金收益的分配方案；

（11）在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；

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

（13）在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；

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

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

（16）在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则；

（17）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

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

（2）办理基金备案手续；

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

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

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

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

（7）依法接受基金托管人的监督；

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

（9）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

（10）编制季度报告、中期报告和年度报告；

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

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

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

（14）按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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

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

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

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

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

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

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

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

（23）以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；（24）基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人；

（25）执行生效的基金份额持有人大会的决议；

（26）建立并保存基金份额持有人名册；

（27）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

（三）基金托管人的权利与义务

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

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

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

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

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

（5）提议召开或召集基金份额持有人大会；

（6）在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

（7）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

（1）以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

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

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

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

（5）保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

（6）按规定开设基金财产的资金账户、证券账户和期货账户等投资所需账户，按照《基金合同》及《托管协议》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

（7）保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》、《托管协议》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露，因审计、法律等外部专业顾问提供的情况除外；

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

（9）办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

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

（11）保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；

（12）从基金管理人或其委托的登记机构处接收并保存基金份额持有人名册；

（13）按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

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

（15）依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、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》及《托管协议》的规定监督基金管理人的投资运作；

（17）参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

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

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

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

（21）执行生效的基金份额持有人大会的决议；

（22）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

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调整销售服务费；

（6）变更基金类别；

（7）本基金与其他基金的合并；

（8）变更基金投资目标、范围或策略；

（9）变更基金份额持有人大会程序；

（10）基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；

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

（12）对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

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

2、在不违背法律法规和基金合同的约定，以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，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、变更收费方式或调整基金份额类别设置；

（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）基金管理人、登记机构、基金销售机构调整有关认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务规则；

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

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

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

（三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

（1）会议召开的时间、地点和会议形式；

（2）会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；

（3）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；

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

（5）会务常设联系人姓名及联系电话；

（6）出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；

（7）召集人需要通知的其他事项。

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

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

（四）基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式等基金合同约定的方式或法律法规、中国证监会允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。基金管理人、基金托管人须为基金份额持有人行使投票权提供便利。

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

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

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

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

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

（2）召集人按基金合同约定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金

份额持有人的表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取表决意见的，不影响表决效力；

（3）本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）；

（4）上述第（3）项中直接出具表决意见的基金份额持有人或受托代表他人出具表决意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具表决意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《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、如果参加基金份额持有人大会的持有人的基金份额低于在权益登记日基金总份额的二分之一，则召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月后、六个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应有代表三分之一以上（含三分之一）基金份额的持有人参加，方可召开。

4、在法律法规或监管机构允许的情况下，经基金份额持有人大会会议通知载明，基金份额持有人也可以选择网络、电话或其他方式进行表决，或者采用网络、电话或其他方式授权他人代为出席会议并表决，为此，基金份额持有人需在会议通知载明的期限内，以会议通知载明的有效方式向会议召集人提交相应有效的表决票或授权委托书。

（五）议事内容与程序

1、议事内容及提案权

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

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

2、议事程序

（1）现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人

和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

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

（2）通讯开会

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

（六）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

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

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

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

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

（七）计票

1、现场开会

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

基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

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

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

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

2、通讯开会

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

（八）生效与公告

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

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

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

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

（九）本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规、监管规则的部分，如将来法律法规、监管规则修改导致相关内容被取消或变更的或法律法规、监管规则增加新的持有人大会机制的，基金管理人提前公告后，可直接对本部分内容进行修改、调整或补充，无需召开基金份额持有人大会审议。

三、基金收益分配原则、执行方式

（一）基金利润的构成

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

（二）基金可供分配利润

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

（三）基金收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；若投资者选择红利再投资方式进行收益分配，收益的计算以权益登记日当日收市后计算的两类基金份额净值为基准转为相应类别的基金份额进行再投资；

3、基金收益分配后两类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的两类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、本基金两类基金份额在费用收取上不同，其对应的可分配收益可能有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在对基金份额持有人利益无实质不利影响的情况下，基金管理人可在法律法规允许的前提下酌情调整以上基金收益分配原则，此项调整不需要召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在指定媒介公告。

（四）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。由于不同基金份额类别对应的可分配收益不同，基金管理人可相应制定不同的收益分配方案。

（五）收益分配方案的确定、公告与实施

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

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

（六）基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足于支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为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。

四、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、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、证券、期货账户开户费用、银行账户维护费用；

10、因投资相关规定范围内的香港联合交易所上市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 0.60%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×0.60%÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人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×0.10%÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

3、基金的销售服务费

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年费率为 0.10%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务。

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×0.10% ÷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 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划款指令，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。销售服务费由登记机构代收并按照相关合同规定支付给基金销售机构。若遇法定节假日、公休日等，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）基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率和销售服务费率等相关费率。基金管理人必须依照有关规定于新的费率实施日前在指定媒介刊登公告。

（五）基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

五、基金财产的投资范围和投资限制

（一）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（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、沪港股票市场交易互联互通机制试点允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

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

基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的比例为 0-95%（其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的 0-95%，投资于港股通标的股票的比例占基金资产的 0-95%），投资于核心资源主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的 80%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

本基金所称“核心资源”是指能够被企业占有和利用，为企业创造经济价值，进而给企业带来核心竞争力的稀缺资源以及生产或经营条件。以核心资源为主题，本基金将重点配置拥有上述核心资源开发、经营或使用权的上市公司发行的股票。

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

本基金参与股指期货交易，应符合法律法规规定和基金合同约定的投资限制并遵守相关期货交易所的业务规则。

（二）投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金股票投资占基金资产的比例为 0-95%（其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的 0-95%，投资于港股通标的股票的比例占基金资产的 0-95%），投资于核心资源主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的 80%；

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

（3）本基金持有一家公司发行的证券，其市值（同一家公司在境内和香港同时上市的 A+H 股合计计算）不超过基金资产净值的 10%；

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

（5）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

（6）本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

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

（8）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%；

（9）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%；

（10）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%；

（11）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%；

（12）本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

（13）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；

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

（15）本基金投资流通受限证券，基金管理人应事先根据中国证监会相关规定，与基金托管人在本基金托管协议中明确基金投资流通受限证券的比例，根据比例进行投资。基金管理人应制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险；

（16）本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；

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

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

（19）本基金投资单只中期票据的额度不得超过其发行总额度的 10%，并且不得超过基金资产净值的 10%；

（20）本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值不得超过基金资产净值的 10%；

（21）本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

（22）本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；本基金管理人应当按照中国金融期货交易所要求的内容、格式与时限向交易所报告所交易和持有的卖出期货合约情况、交易目的及对应的证券资产情况等；

（23）本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；

（24）本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；

（25）本基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

（26）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

基金管理人运用基金财产投资证券衍生品种的，应当根据风险管理的原则，并制定严格的授权管理制度和投资决策流程。基金管理人运用基金财产投资证券衍生品种的具体比例，应当符合中国证监会的有关规定。

本基金在开始进行股指期货投资之前，应与基金托管人就股指期货清算、估值、交割等事宜另行具体协商。

除上述第（2）、（12）、（17）、（18）项外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准，但须提前公告。

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

（1）承销证券；

（2）违反规定向他人贷款或者提供担保；

（3）从事承担无限责任的投资；

（4）买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；

（5）向其基金管理人、基金托管人出资；

（6）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

（7）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

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

法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准，但须提前公告，不需要经基金份额持有人大会审议。

六、基金资产估值

（一）估值日

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

（二）估值对象

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

（三）估值方法

1、证券交易所上市的有价证券的估值

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

2、交易所市场交易的固定收益品种的估值

（1）对在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（另有规定的除外），选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；

（2）对在交易所市场上市交易的可转换债券，按估值日收盘价减去可转换债券收盘价中所含债券应收利息后得到的净价进行估值；

（3）对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募债券，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；

（4）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，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、银行间市场交易的固定收益品种的估值

（1）银行间市场交易的固定收益品种，选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值。

（2）对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的固定收益品种，按成本估值。

4、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、配股和公开增发的股票，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和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

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

5、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

6、本基金投资股指期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

7、估值计算中涉及到港币、美元、英镑、欧元、日元等主要货币对人民币汇率的，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。

8、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。

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

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

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布，由此给基金份额持有人和基金造成的损失以及因该交易日基金资产净值计算顺延错误而引起的损失，由基金管理人负责赔付。

（四）估值程序

1、基金份额净值是按照每个估值日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到 0.001 元，小数点后第 4 位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人于每个估值日计算基金资产净值及两类基金份额净值，并按规定公告。

2、基金管理人应每个估值日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或本基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个估值日对基金资产估值后，将两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，由基金管理人对外公布。

（五）估值错误的处理

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

本基金合同的当事人应按照以下约定处理：

1、估值错误类型

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

上述估值错误的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等。对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平不能预见、不能避免、不能克服，则属不可抗力，按照下述规定执行。

由于不可抗力原因造成投资人的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

2、估值错误处理原则

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

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

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

（4）估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

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

4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

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

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

（3）前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

（六）暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

3、出现基金管理人认为属于会导致基金管理人不能出售或评估基金资产的紧急事故的任何情况时；

4、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一致的；

5、法律法规、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

（七）基金净值的确认

用于基金信息披露的基金资产净值和两类基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个估值日交易结束后计算当日的基金资产净值和两类基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金净值予以公布。

（八）特殊情形的处理

基金管理人、基金托管人按估值方法的第8项进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

由于交易所及登记结算公司发送的数据错误，或由于其他不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

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

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，并自决议生效后两个工作日内在指定媒介公告。

（二）基金转换运作方式或者与其他基金合并

基金转换运作方式或者与其他基金合并，应当按照法律法规及基金合同规定的程序进行。实施方案若未在基金合同中明确约定，应当经基金份额持有人大会审议通过。基金管理人应当提前发布提示性通知，明确有关实施安排，说明对现有基金份额持有人的影响以及基金份额持有人享有的选择权，并在实施前预留至少二十个开放日或者交易日供基金份额持有人做出选择。

（三）《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

1、基金份额持有人大会决定终止的；

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

3、《基金合同》约定的其他情形；

4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

（四）基金财产的清算

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

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

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

4、基金财产清算程序：

（1）《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；

（2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；

（3）对基金财产进行估值和变现；

（4）制作清算报告；

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

（6）将清算报告报中国证监会备案并公告；

（7）对基金剩余财产进行分配。

5、基金财产清算的期限为 6 个月。

（五）清算费用

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

（六）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。

（七）基金财产清算的公告

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

（八）基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

八、争议的处理和适用的法律

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，任何一方当事人均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点为上海市，仲裁裁决是终局的，并对各方当事人均有约束力。除非仲裁裁决另有规定，仲裁费用和律师费用由败诉方承担。

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

《基金合同》受中国法律管辖。

九、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

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

十九、基金托管协议的内容摘要

（一）基金托管协议当事人

1、基金管理人

名称：前海开源基金管理有限公司

住所：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市福田区深南大道 7006 号万科富春东方大厦 22 楼

法定代表人：李强

成立时间：2013 年 1 月 23 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监许可［2012］1751 号

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

注册资本：人民币 2 亿元

组织形式：有限责任公司

存续期间：持续经营

2、基金托管人

名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）

住所：上海市浦东新区银城中路 188 号（邮政编码：200120）

办公地址：上海市长宁区仙霞路 18 号（邮政编码：200336）

法定代表人：牛锡明

成立时间：1987 年 3 月 30 日

批准设立机关及批准设立文号：国务院国发(1986)字第 81 号文和中国人民银行银发［1987］40 号文

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字［1998］25 号

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项业务；提供保管箱服务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务；经营结汇、售汇业务。

注册资本：742.62 亿元人民币

组织形式：股份有限公司

存续期间：持续经营

（二）基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

1、基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权

（1）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》和本协议的约定，对基金的投资范围、投资对象进行监督。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、沪港股票市场交易互联互通机制试点允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

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

基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的比例为 0-95%（其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的 0-95%，投资于港股通标的股票的比例占基金资产的 0-95%），投资于核心资源主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的 80%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

本基金所称“核心资源”是指能够被企业占有和利用，为企业创造经济价值，进而给企业带来核心竞争力的稀缺资源以及生产或经营条件。以核心资源为主题，本基金将重点配置拥有上述核心资源开发、经营或使用权的上市公司发行的股票。

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

本基金参与股指期货交易，应符合法律法规规定和基金合同约定的投资限制并遵守相关期货交易所的业务规则。

基金托管人对基金管理人业务进行监督和核查的义务自基金合同生效日起开始履行。

（2）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》和本协议的约定，对基金投资比例进行监督。

根据《基金合同》的约定，本基金投资组合比例应符合以下规定：

1）本基金股票投资占基金资产的比例为 0-95%（其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的 0-95%，投资于港股通标的股票的比例占基金资产的 0-95%），投资于核心资源主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的 80%；

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

3）本基金持有一家公司发行的证券，其市值（同一家公司在境内和香港同时上市的 A+H 股合计计算）不超过基金资产净值的 10%；

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

5）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

6）本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

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

8）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%；

9）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%；

10）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%；

11）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%；

12）本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

13）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；

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

15）本基金持有的所有流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的 15%；本基金持有的同一流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的 5%；

16）本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；

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

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

19）本基金投资单只中期票据的额度不得超过其发行总额度的 10%，并且不得超过基金资产净值的 10%；

20）本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值不得超过基金资产净值的 10%；

21）本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

22）本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；本基金管理人应当按照中国金融期货交易所要求的内容、格式与时限向交易所报告所交易和持有的卖出期货合约情况、交易目的及对应的证券资产情况等；

23）本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；

24）本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；

25）本基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

26）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。基金管理人运用基金财产投资证券衍生品种的，应当根据风险管理的原则，并制定严格的授权管理制度和投资决策流程。基金管理人运用基金财产投资证券衍生品种的具体比例，应当符合中国证监会的有关规定。

本基金在开始进行股指期货投资之前，应与基金托管人就股指期货清算、估值、交割等事宜另行具体协商。

除上述第 2）、12）、17）、18）项外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准，但须提前公告。

（3）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同和本协议的约定，对基金投资禁止行为进行监督。基金财产不得用于下列投资或者活动。

1）承销证券；

2）违反规定向他人贷款或者提供担保；

3）从事承担无限责任的投资；

4）买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；

5）向其基金管理人、基金托管人出资；

6）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

7）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

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

法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准，但须提前公告，不需要经基金份额持有人大会审议。

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

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

基金管理人向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的银行间市场交易对手的名单。基金托管人在收到名单后 2 个工作日内电话或回函确认收到该名单。基金管理人应定期和不定期对银行间市场现券及回购交易对手的名单进行更新。基金托管人在收到名单后 2 个工作日内电话或书面回函确认，新名单自基金托管人确认当日生效。新名单生效前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。

2）基金管理人参与银行间市场交易时，有责任控制交易对手的资信风险，由于交易对手资信风险引起的损失,基金管理人应当负责向相关责任人追偿。

（5）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同和本协议的约定，对基金管理人选择存款银行进行监督。

基金投资银行定期存款的，基金管理人应根据法律法规的规定及基金合同的约定，确定符合条件的所有存款银行的名单，并及时提供给基金托管人，基金托管人应据以对基金投资银行存款的交易对手是否符合有关规定进行监督。

本基金投资银行存款应符合如下规定：

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

2）基金管理人与基金托管人应根据相关规定，就本基金银行存款业务另行签订书面协议，明确双方在相关协议签署、账户开设与管理、投资指令传达与执行、资金划拨、账目核对、到期兑付、文件保管以及存款证实书的开立、传递、保管等流程中的权利、义务和职责，以确保基金财产的安全，保护基金份额持有人的合法权益。

3）基金托管人应加强对基金银行存款业务的监督与核查，严格审查、复核相关协议、账户资料、投资指令、存款证实书等有关文件，切实履行托管职责。

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

（6）基金托管人对基金投资流通受限证券的监督

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

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

3）基金管理人应在基金首次投资流通受限证券前,向基金托管人提供经基金管理人董事会批准的有关基金投资流通受限证券的投资决策流程、风险控制制度。基金投资非公开发行股票,基金管理人还应提供基金管理人董事会批准的流动性风险处置预案。上述资料应包括但不限于基金投资流通受限证券的投资额度和投资比例控制情况。 基金管理人应至少于首次执行投资指令之前两个工作日将上述资料书面发至基金托管人,保证基金托管人有足够的时间进行审核。基金托管人应在收到上述资料后两个工作日内,以书面或其他双方认可的方式确认收到上述资料。

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

5）基金托管人应对基金管理人提供的有关书面信息进行审核，基金托管人认为上述资料可能导致基金投资出现风险的,有权要求基金管理人在投资流通受限证券前就该风险的消除或防范措施进行补充书面说明,并保留查看基金管理人风险管理部门就基金投资流通受限证券出具的风险评估报告等备查资料的权利。否则,基金托管人有权拒绝执行有关指令。

因拒绝执行该指令造成基金财产损失的,基金托管人不承担任何责任,并有权报告中国证监会。

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

（7）基金托管人对基金投资中期票据的监督。

1）基金投资中期票据应遵守相关法律法规的规定，并与基金托管人签订《基金投资中期票据风险控制补充协议》。

2）基金管理人应将经董事会批准的相关投资决策流程、风险控制制度以及基金投资中期票据相关流动性风险处置预案提供给基金托管人，基金托管人对基金管理人是否遵守相关制度、流动性风险处置预案以及相关投资额度和比例的情况进行监督。

基金管理人确定基金投资中期票据的，应根据《托管协议》及相关补充协议的约定向基金托管人提供其托管基金拟购买中期票据的数量和价格、应划付的金额等执行指令所需相关信息，并保证上述信息的真实、准确、完整。

基金托管人应对基金管理人提供的有关书面信息进行审核，基金托管人认为上述资料可能导致基金投资出现风险的，有权要求基金管理人在投资中期票据前就该风险的消除或防范措施进行补充书面说明，并保留查看基金管理人风险管理部门就基金投资中期票据出具的风险评估报告等备查资料的权利。否则，基金托管人有权拒绝执行有关指令。因拒绝执行该指令造成基金财产损失的，基金托管人不承担任何责任，并有权报告中国证监会。

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

（8）基金托管人根据法律法规的规定及《基金合同》和本协议的约定，对基金投资其他方面进行监督。

2、基金托管人应根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金资产净值计算、两类基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确认、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查。如果基金管理人未经基金托管人的审核擅自将不实的业绩表现数据印制在宣传推介材料上，则基金托管人对此不承担任何责任，并有权在发现后报告中国证监会。

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

基金托管人发现基金管理人的投资指令或实际投资运作违反《基金法》及其他有关法规、《基金合同》和本协议规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对，并以电话或书面形式向基金托管人反馈，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在限期内，基金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，基金托管人有权报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人有重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人在限期内纠正。

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

基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反《基金合同》约定的，应当立即通知基金管理人，并有权向中国证监会报告。

（三）基金管理人对基金托管人的业务核查

根据《基金法》及其他有关法规、《基金合同》和本协议规定，基金管理人对基金托管人履行托管职责的情况进行核查，核查事项包括但不限于基金托管人是否安全保管基金财产、开立基金财产的资金账户和证券账户及债券托管账户等投资所需账户，是否及时、准确复核基金管理人计算的基金资产净值和两类基金份额净值，是否根据基金管理人指令办理清算交收，是否按照法规规定和《基金合同》规定进行相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

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

基金管理人发现基金托管人未对基金资产实行分账管理、擅自挪用基金资产、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、《基金合同》、本协议及其他有关规定的，应及时以书面形式通知基金托管人在限期内纠正，基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金管理人发出回函。在限期内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应报告中国证监会。对基金管理人按照法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的，基金托管人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金托管人在限期内纠正。

（四）基金财产的保管

1、基金财产保管的原则

（1）基金托管人应安全保管基金财产，未经基金管理人符合本协议约定的指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何资产。

（2）基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。

（3）基金托管人按照规定开立基金财产的资金账户、证券账户和债券托管账户、期货账户及等投资所需账户。

（4）基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，与基金托管人的其他业务和其他基金的托管业务实行严格的分账管理，确保基金财产的完整和独立。

（5）对于因为基金投资产生的应收资产和基金申购过程中产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金资产没有到达基金银行存款账户的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失。基金托管人对此不承担任何责任。

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

2、基金募集资产的验证

基金募集期满或基金提前结束募集之日起 10 日内，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，由基金管理人聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的 2 名以上（含 2 名）中国注册会计师签字有效。验资完成，基金管理人应将募集到的全部资金存入基金托管人为基金开立的基金银行存款账户中，基金托管人在收到资金当日出具相关证明文件。若基金募集期限届满，未能达到基金合同生效的条件，由基金管理人按规定办理退款等事宜。

3、基金的银行存款账户的开立和管理

（1）基金托管人应负责本基金银行存款账户的开立和管理。

（2）基金托管人以本基金的名义在其营业机构开立基金的银行存款账户，并根据中国人民银行规定计息。本基金的银行预留印鉴由基金托管人制作、保管和使用。本基金的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益，均需通过本基金的银行存款账户进行。

（3）本基金银行存款账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立其他任何银行存款账户；亦不得使用基金的任何银行存款账户进行本基金业务以外的活动。

（4）基金托管人可以通过申请开通本基金银行存款账户的企业网上银行业务进行资金支付，并使用交通银行企业网上银行（简称“交通银行网银”）办理托管资产的资金结算汇划业务。

（5）基金银行存款账户的管理应符合《中华人民共和国票据法》、《人民币银行账户结算管理办法》、《现金管理暂行条例实施细则》、《人民币利率管理规定》、《支付结算办法》以及银行业监督管理机构的其他规定。

4、基金证券交收账户、资金交收账户的开立和管理

基金托管人以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司开立证券账户。

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

基金管理人不得对基金证券交收账户、资金交收账户进行证券的超卖或超买。

基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户即资金交收账户，用于证券交易资金的结算。基金托管人以本基金的名义在托管人处开立基金的证券交易资金结算的二级结算备付金账户。

5、债券托管账户的开立和管理

（1）基金合同生效后，基金托管人负责向人民银行进行报备，并在备案通过后在中央国债登记结算有限责任公司及银行间市场清算所股份有限公司以本基金的名义开立债券托管账户，并由基金托管人负责基金的债券及资金的清算。基金管理人负责申请基金进入全国银行间同业拆借市场进行交易，由基金管理人在中国外汇交易中心开设同业拆借市场交易账户。

（2）基金管理人代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议，协议正本由基金管理人保存。

6、其他账户的开立和管理

若中国证监会或其他监管机构在本托管协议订立日之后允许基金从事其他投资品种的投资业务，涉及相关账户的开立、使用的，由基金管理人协助基金托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定，开立有关账户。该账户按有关规则使用并管理。

7、基金财产投资的有关实物证券、银行存款定期存单等有价凭证的保管

实物证券由基金托管人存放于基金托管人的保管库。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。基金托管人对由基金托管人以外机构实际有效控制的本基金资产不承担保管责任。

银行存款定期存单等有价凭证由基金托管人负责保管。

8、与基金财产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同的原件分别由基金托管人、基金管理人保管，相关业务程序另有限制除外。除本协议另有规定外，基金管理人在代基金签署与基金有关的重大合同时应尽可能保证持有二份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件，基金管理人应及时将正本送达基金托管人处。合同的保管期限按照国家有关规定执行。

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

（五）基金资产净值计算和会计核算

1、基金资产净值及基金份额净值的计算与复核

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

基金管理人应每个估值日对基金资产估值，但基金管理人根据法律法规或基金合同的规定暂停估值时除外。估值原则应符合《基金合同》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》及其他法律、法规的规定。用于基金信息披露的基金资产净值和两类基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个估值日交易结束后计算当日的基金资产净值，以约定方式发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核后，将复核结果反馈给基金管理人，由基金管理人对两类基金份额净值予以公布。

本基金按以下方法估值：

（1）证券交易所上市的有价证券的估值

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

（2）交易所市场交易的固定收益品种的估值

1）对在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（另有规定的除外），选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；

2）对在交易所市场上市交易的可转换债券，按估值日收盘价减去可转换债券收盘价中所含债券应收利息后得到的净价进行估值；

3）对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募债券，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；

4）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，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）银行间市场交易的固定收益品种的估值

1）银行间市场交易的固定收益品种，选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值。

2）对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的固定收益品种，按成本估值。

（4）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、配股和公开增发的股票，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和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

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

（5）同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

（6）本基金投资股指期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

（7）估值计算中涉及到港币、美元、英镑、欧元、日元等主要货币对人民币汇率的，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。

（8）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。

（9）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。

基金管理人、基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序以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，发现方应及时通知对方，以约定的方法、程序和相关法律法规的规定进行估值，以维护基金份额持有人的利益。

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。因此，就与本基金有关的会计问题，本基金的会计责任方是基金管理人。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，基金管理人有权按照其对基金净值的计算结果对外予以公布，由此给基金份额持有人和基金造成的损失以及因该交易日基金资产净值计算顺延错误而引起的损失，由基金管理人负责赔付。

2、净值差错处理

当发生净值计算错误时，由基金管理人负责处理，由此给基金份额持有人和基金造成损失的，由基金管理人对基金份额持有人或者基金先行支付赔偿金。基金管理人和基金托管人应根据实际情况界定双方承担的责任，经确认后按以下条款进行赔偿。

（1）如采用本协议第八条第（一）款“基金资产净值及基金份额净值的计算与复核”中估值方法的第1－7、9进行处理时，若基金管理人净值计算出错，基金托管人在复核过程中没有发现，且造成基金份额持有人损失的，应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金，就实际向投资者或基金支付的赔偿金额，由基金管理人与基金托管人按照管理费率和托管费率的比例各自承担相应的责任；

（2）如基金管理人和基金托管人对基金份额净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对，尚不能达成一致时，为避免不能按时公布基金份额净值的情形，以基金管理人的计算结果对外公布，由此给基金份额持有人和基金造成的损失以及因该交易日基金资产净值计算顺延错误而引起的损失，由基金管理人负责赔付，基金托管人不负赔偿责任；

（3）基金管理人、基金托管人按股票估值方法的第 8 项进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

由于交易所及登记结算公司发送的数据错误，有关会计制度变化或由于其他不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施消除或降低由此造成的影响。

针对净值差错处理，如果法律法规或证监会有新的规定，则按新的规定执行；如果行业有通行做法，在不违背法律法规且不损害投资者利益的前提下，双方应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则重新协商确定处理原则。

3、基金会计制度

按国家有关部门制定的会计制度执行。

4、基金账册的建立

基金管理人和基金托管人在《基金合同》生效后，应按照双方约定的同一记账方法和会计处理原则，分别独立地设置、登录和保管本基金的全套账册，对双方各自的账册定期进行核对，互相监督，以保证基金财产的安全。若双方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。

5、会计数据和财务指标的核对

双方应每个交易日核对账目，如发现双方的账目存在不符的，基金管理人和基金托管人必须及时查明原因并纠正，确保核对一致。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。

6、基金定期报告的编制和复核

基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。月度报表的编制，应于每月终了后 5 个工作日内完成。定期报告文件应按中国证监会的要求公告。季度报表的编制，应于每季度终了后 15 个工作日内完成；更新的招募说明书在基金合同生效后每 6 个月公告一次，于截止日后的 45 日内公告。半年度报告在基金会计年度前 6 个月结束后的 60 日内公告；年度报告在会计年度结束后 90 日内公告。

基金管理人在月度报表完成当日，对报表盖章后，以传真方式将有关报表提供基金托管人；基金托管人在 2 个工作日内进行复核，并将复核结果及时书面通知基金管理人。基金管理人在季度报表完成当日，以约定方式将有关报表提供基金托管人；基金托管人在 5 个工作日内进行复核，并将复核结果反馈给基金管理人。基金管理人在更新招募说明书完

成当日，将有关报告提供基金托管人，基金托管人在收到 15 日内进行复核，并将复核结果反馈给基金管理人。基金管理人在半年度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人，基金托管人在收到后 20 日内进行复核，并将复核结果反馈给基金管理人。基金管理人在年度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人，基金托管人在收到后 30 日内复核，并将复核结果反馈给基金管理人。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，调整以双方认可的账务处理方式为准。如果基金管理人与基金托管人不能于应当发布公告之日前就相关报表达成一致，基金管理人有权按照其编制的报表对外发布公告，基金托管人有权就相关情况报证监会备案。

基金托管人在对财务报表、季度报告、半年度报告或年度报告复核完毕后，可以出具复核确认书（盖章）或以其他双方约定的方式确认，以备有权机构对相关文件审核检查。

（六）基金份额持有人名册的保管

基金管理人可委托基金登记机构登记和保管基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容包括但不限于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，包括基金募集期结束时的基金份额持有人名册、基金权益登记日的基金份额持有人名册、基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册、每年最后一个交易日的基金份额持有人名册，由基金登记机构负责编制和保管，并对基金份额持有人名册的真实性、完整性和准确性负责。

基金管理人应根据基金托管人的要求定期和不定期向基金托管人提供基金份额持有人名册。

1、基金管理人于《基金合同》生效日及《基金合同》终止日后 10 个工作日内向基金托管人提供由登记机构编制的基金份额持有人名册；

2、基金管理人于基金份额持有人大会权益登记日后 5 个工作日内向基金托管人提供由登记机构编制的基金份额持有人名册；

3、基金管理人于每年最后一个交易日后 10 个工作日内向基金托管人提供由登记机构编制的基金份额持有人名册；

4、除上述约定时间外，如果确因业务需要，基金托管人与基金管理人商议一致后，由基金管理人向基金托管人提供由登记机构编制的基金份额持有人名册。

基金托管人以电子版形式妥善保管基金份额持有人名册，并定期刻成光盘备份，保存期限为 15 年。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。若基金管理人或基金托管人由于自身原因无法妥善保管基金份额持有人名册，应按有关法规规定各自承担相应的责任。

（七）争议解决方式

相关各方当事人同意，因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议，应通过友好协商或者调解解决。托管协议当事人不愿通过协商、调解解决或者协商、调解不成的，任何

一方当事人均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点在上海市，仲裁裁决是终局的，并对相关各方当事人均有约束力。除非仲裁裁决另有规定，仲裁费用和律师费用由败诉方承担。

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

本协议受中华人民共和国法律管辖。

（八）基金托管协议的变更、终止与基金财产的清算

1、基金托管协议的变更

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行修改。修改后的新协议，其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突。修改后的新协议，应报中国证监会备案。

2、基金托管协议的终止

（1）《基金合同》终止；

（2）基金托管人解散、依法被撤销、破产，被依法取消基金托管资格或因其他事由造成其他基金托管人接管基金财产；

（3）基金管理人解散、依法被撤销、破产，被依法取消基金管理资格或因其他事由造成其他基金管理人接管基金管理权。

（4）发生《基金法》、《销售办法》、《运作办法》或其他法律法规规定的终止事项。

3、基金财产的清算

（1）基金财产清算小组

在基金财产清算小组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照《基金合同》和本协议的规定继续履行保护基金资产安全的职责。

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

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

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

（2）基金财产清算程序

1）《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；

2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；

3）对基金财产进行估值和变现；

4）制作清算报告；

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

6）将清算报告报中国证监会备案并公告；

7）对基金剩余财产进行分配。

基金财产清算的期限为 6 个月。

（3）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。

（4）基金剩余财产的分配

基金财产按如下顺序进行清偿：

1）支付基金财产清算费用；

2）缴纳基金所欠税款；

3）清偿基金债务；

4）清算后如有余额，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

（5）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。基金财产清算小组做出的清算报告经会计师事务所审计、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。

（6）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期限不少于 15 年。

二十、对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金投资人提供一系列的客户服务。基金管理人将根据基金投资人的需要和市场的变化，增加或变更服务项目。主要服务内容如下：

（一）短信、邮件信息发送服务

基金管理人至少每年度以手机短信、电子邮件或其他形式向通过前海开源电子直销系统持有基金管理人基金份额的基金投资人提供基金保有情况信息。基金投资人可根据需要，通过基金管理人客服热线或官方网站订制、修改或取消该类服务。

1、手机短信服务可提供的定制内容包括基金净值、基金交易确认、分红确认、月末账户余额等信息。

2、电子邮件服务可提供的定制内容包括基金净值、基金交易确认、分红确认、月末账户余额等信息。

3、除发送基金投资人定制的上述信息外，基金管理人会不定期向留有手机号码和电子邮箱地址的基金投资人发送节日及生日问候、产品推广等信息。若基金投资人不需要接收到该类信息，可通过基金管理人客服热线取消该项服务。

4、手机短信依托于外部通讯服务商发送，电子邮件通过互联网进行信息传送，基金管理人根据服务规则发送相关信息，但不对信息的送达做出承诺和保证。由于基金投资人提供的手机号、电子邮箱不详、错误、未及时变更或通讯故障、延误等原因可能造成对账单无法按时或准确送达，请及时到原基金销售网点或致电基金管理人客户服务中心办理相关信息查询、核对或变更。如需补发对账单，敬请拨打客服热线电话。

（二）客户服务中心（CALL-CENTER）电话服务

呼叫中心人工座席每个交易日（8：30-17：00）为基金投资人提供服务，客服热线服务内容包括业务咨询、信息查询、服务投诉、信息定制、资料修改等专项服务。

客服热线：4001-666-998

（三）电子查询服务

基金投资人可通过基金管理人电子查询系统（网上查询系统、微信查询系统、APP 查询系统）完成基金账户的查询业务。

官方网站：http://www.qhkyfund.com

微信小程序：前海开源基金

官方 APP：前海开源基金

（四）投诉受理服务

基金投资人可以拨打基金管理人客服热线或以书信、电子邮件等方式，对基金管理人和销售网点所提供的服务进行投诉。

对于工作日期间受理的投诉，以“及时回复”为处理原则，对于不能及时回复的投诉，基金管理人承诺在 3 个工作日之内对基金投资人的投诉做出回复。对于非工作日提出的投诉，基金管理人将在顺延到下 1 个工作日进行回复。

客服邮箱：service@qhkyfund.com

（五）电子直销交易系统开户与交易服务

基金投资人可以登录基金管理人电子直销交易系统（网上交易系统、微信交易系统和 APP 交易系统）进行开户与交易。适用业务范围包括：基金账户开户、认购、申购、赎回、账户资料变更、分红方式变更、信息查询等业务。电子直销交易业务规则以公告为准。

（六）定期投资计划

基金管理人将利用直销网点或其他销售网点为基金投资人提供定期投资的服务。通过定期投资计划，基金投资人可以通过相关渠道，定期申购基金份额。定期投资计划业务规则以公告为准。

（七）如本招募说明书存在任何您/贵机构无法理解的内容，请通过以上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。

二十一、其他应披露事项

（一）前海开源基金管理有限公司（以下简称“本公司”）的从业人员在前海开源资产管理有限公司（以下简称“前海开源资管公司”或“子公司”）兼任董事、监事及领薪情况如下：

本公司王雅琴女士兼任前海开源资管公司董事；

本公司汤力女士兼任前海开源资管公司监事；

上述人员均不在前海开源资管公司领薪。本公司除上述人员以外未有从业人员在前海开源资管公司兼任职务的情况。

（二）2023 年 10 月 26 日至 2024 年 10 月 25 日披露的公告：

2024-10-25 前海开源基金管理有限公司旗下全部基金 2024 年第三季度报告提示性公告
2024-10-25 前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金 2024 年第 3 季度报告
2024-10-23 前海开源基金管理有限公司关于暂停海银基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告
2024-10-10 前海开源基金管理有限公司关于旗下沪港深系列基金主要投资市场节假日暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告
2024-10-09 前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金恢复大额申购、转换转入业务的公告
2024-10-08 前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金限制大额申购、转换转入业务的公告
2024-09-27 关于旗下部分基金恢复上海国信嘉利基金销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告
2024-09-27 前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金改聘会计师事务所的公告
2024-09-12 前海开源基金管理有限公司关于旗下沪港深系列基金主要投资市场节假日暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告
2024-09-07 前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金于香港交易所休市期间暂停申购、赎回、定投、转换等业务的公告
2024-09-06 前海开源基金管理有限公司关于香港交易所临时休市的提示性公告
2024-08-30 前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金 2024 年中期报告
2024-08-30 前海开源基金管理有限公司旗下全部基金 2024 年中期报告提示性公告
2024-07-19 前海开源基金管理有限公司关于终止北京中植基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告
2024-07-19 前海开源基金管理有限公司旗下全部基金 2024 年第二季度报告提示性公告
2024-07-19 前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金 2024 年第 2 季度报告
2024-07-18 前海开源基金管理有限公司关于终止与喜鹊财富基金销售有限公司合

作关系的公告
2024-06-28 前海开源基金管理有限公司关于旗下沪港深系列基金主要投资市场节假日暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告
2024-05-23 关于旗下部分基金增加上海证券有限责任公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告
2024-05-15 关于防范不法分子冒用前海开源基金名义进行非法活动的风险提示
2024-05-11 前海开源基金管理有限公司关于旗下沪港深系列基金主要投资市场节假日暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告
2024-04-22 前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告
2024-03-30 前海开源基金管理有限公司旗下全部基金 2023 年年度报告提示性公告
2024-03-30 前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金 2023 年年度报告
2024-03-29 关于旗下部分基金增加江苏银行股份有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告
2024-03-27 前海开源基金管理有限公司关于旗下沪港深系列基金主要投资市场节假日暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告
2024-03-06 关于旗下部分基金增加西部证券股份有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告
2024-03-05 关于旗下部分基金增加贵州省贵文文化基金销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告
2024-01-22 前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告
2024-01-22 前海开源基金管理有限公司旗下全部基金 2023 年第四季度报告提示性公告
2024-01-19 关于旗下部分基金增加德邦证券股份有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告
2024-01-10 关于旗下部分基金增加江海证券有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告
2024-01-05 前海开源基金管理有限公司关于终止与北京增财基金销售有限公司合作关系的公告
2023-12-30 前海开源基金管理有限公司关于旗下沪港深系列基金主要投资市场节假日暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告
2023-12-27 前海开源基金管理有限公司关于调整旗下部分证券投资基金通过腾安基金销售（深圳）有限公司办理业务最低限额的公告
2023-12-21 前海开源基金管理有限公司关于旗下沪港深系列基金主要投资市场节假日暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告
2023-12-14 前海开源基金管理有限公司关于调整旗下部分证券投资基金通过上海好买基金销售有限公司办理业务最低限额的公告
2023-12-07 前海开源基金管理有限公司关于调整旗下基金在直销柜台的单笔最低申购金额的公告
2023-11-29 前海开源基金管理有限公司关于持续完善客户身份信息的提示公告

注：其他披露事项详见基金管理人发布的相关公告。

二十二、招募说明书的存放及查阅方式

本招募说明书按相关法律法规，存放在基金管理人、基金销售机构等的办公场所，投资人可在办公时间免费查阅；也可在支付工本费后在合理时间内获取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。投资人也可以直接登录基金管理人的网站进行查阅。

基金管理人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

二十三、备查文件

（一）备查文件包括：

1、中国证监会准予注册前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金募集的文件

2、《前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

3、《前海开源沪港深核心资源灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

4、法律意见书

5、基金管理人业务资格批件、营业执照

6、基金托管人业务资格批件、营业执照

7、中国证监会要求的其他文件

（二）备查文件的存放地点和投资人查阅方式：

1、存放地点：《基金合同》、《托管协议》存放在基金管理人和基金托管人处；其余备查文件存放在基金管理人处。

2、查阅方式：投资人可在营业时间免费到存放地点查阅，也可按工本费购买复印件。

前海开源基金管理有限公司

2024 年 12 月 11 日