

**国泰安璟债券型证券投资基金
更新招募说明书
(2024 年第三号)**

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

目 录

重要提示	1
第一部分 緒言	3
第二部分 釋義	4
第三部分 基金管理人	9
第四部分 基金託管人	20
第五部分 相關服務機構	23
第六部分 基金的募集	25
第七部分 基金合同的生效	29
第八部分 基金份額的申購與贖回	30
第九部分 基金的投資	42
第十部分 基金的業績	54
第十一部分 基金的財產	55
第十二部分 基金資產估值	56
第十三部分 基金的收益與分配	63
第十四部分 基金費用與稅收	65
第十五部分 基金的會計與審計	68
第十六部分 基金的信息披露	69
第十七部分 側袋機制	76
第十八部分 風險揭示	78
第十九部分 基金的終止與清算	87
第二十部分 基金合同內容摘要	89
第二十一部分 託管協議內容摘要	106
第二十二部分 對基金份額持有人的服務	124
第二十三部分 其他應披露事項	125
第二十四部分 招募說明書存放及查閱方式	126
第二十五部分 備查文件	127

重要提示

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

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

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

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

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

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

凭证或选择不将基金资产投资于存托凭证，基金资产并非必然投资存托凭证。

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

本基金可投资国债期货，可能面临市场风险、基差风险、流动性风险。

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

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

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

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

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

投资者应当认真阅读基金招募说明书、基金合同、基金产品资料概要等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。

本招募说明书已经本基金托管人复核。本次招募说明书更新事由为年度更新。本招募说明书所载投资组合报告为2024年3季度报告，净值表现数据截止日为2024年6月30日，主要人员情况截止日为2024年12月11日，除非另有说明，本招募说明书其他所载内容截止日为2024年10月31日。（本报告中财务数据未经审计）

第一部分 緒言

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

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

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

第二部分 释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

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

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

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

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

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

32、存續期：指基金合同生效至終止之間的不定期期限

33、工作日：指上海證券交易所、深圳證券交易所的正常交易日

34、T日：指銷售機構在規定時間受理投資人申購、贖回或其他業務申請的開放日

35、T+n日：指自T日起第n個工作日（不包含T日）

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

37、開放時間：指開放日基金接受申購、贖回或其他交易的時間段

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

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

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

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

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

43、轉托管：指基金份額持有人在本基金的不同銷售機構之間實施的變更所

持基金份額銷售機構的操作

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

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

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

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

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

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

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

51、元：指人民幣元

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

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

54、基金資產淨值：指基金資產總值減去基金負債後的價值

55、基金份額淨值：指計算日基金資產淨值除以計算日基金份額總數

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

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

58、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

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

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

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

62、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

第三部分 基金管理人

一、基金管理人概况

名称：国泰基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区浦东大道1200号2层225室

办公地址：上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦15-20层

设立日期：1998年3月5日

法定代表人：周向勇

注册资本：壹亿壹仟万元人民币

联系人：辛怡

联系电话：（021）31089000，4008-888-688

股权结构：

股东名称	股权比例
中国建银投资有限责任公司	60%
意大利忠利集团	30%
国网英大国际控股集团有限公司	10%

二、主要人员情况

1、董事会成员

周向勇，董事长，硕士研究生，28年金融从业经历。曾任职于中国建设银行总行、中国建银投资有限责任公司。2011年1月加入国泰基金管理有限公司，历任公司总经理助理、副总经理、总经理等，现任公司党委书记、董事长。

王惠平，董事，研究生学历，博士学位，高级会计师，中国非执业注册会计师。1996年9月至2004年7月任职于财政部财政监督司、财政部监督检查局。2004年8月至2011年6月任职于财政部国务院农村税费改革工作小组办公室（国务院农村综合改革工作小组办公室）。历任财政部监督检查局检查一处副处长，财政部国务院农村税费改革工作小组办公室（国务院农村综合改革工作小组办公室）一处处长。2011年7月至2021年6月任职于海南省财政厅，历任海南省财政厅总会计师、副厅长、财政厅党组书记、财政厅厅长。2021年7月至2023年4月任职于海南省社会科学界联合会（海南省社会科学院），历任海南省社会科

学界联合会党组书记、主席兼海南省社会科学院院长。2023 年 4 月起任中央汇金投资有限责任公司派往中国建投董事。2023 年 11 月起任中建投租赁股份有限公司董事。2023 年 9 月起任公司董事。

Santo Borsellino, 董事, 硕士研究生。1994-1995 年在 BANK OF ITALY 负责经济研究; 1995 年在 UNIVERSITY OF BOLOGNA 任金融部助理, 1995-1997 年在 ROLOFINANCE UNICREDITO ITALIANO GROUP - SOFIPA SpA 任金融分析师; 1999-2004 年在 LEHMAN BROTHERS INTERNATIONAL 任股票保险研究员; 2004-2005 年任 URWICK CAPITAL LLP 合伙人; 2005-2006 年在 CREDIT SUISSE 任副总裁; 2006-2008 年在 EURIZONCAPITAL SGR SpA 历任研究员/基金经理。2009-2013 年任 GENERALI INVESTMENTS EUROPE 权益部总监。2013 年 6 月-2019 年 3 月任 GENERALI INVESTMENTS EUROPE 和 GENERALI INSURANCE ASSET MANAGEMENT 总经理。2019 年 4 月-2023 年 12 月任 Investments & Asset Management Corporate Governance Implementation & Institutional Relations 主管和 GENERALI INSURANCE ASSET MANAGEMENT 董事长。2024 年 1 月 1 日起任 GENERALI INVESTMENTS HOLDING S.p.A. 董事长和 GENERALI ASSET MANAGEMENT S.p.A. SGR (GENAM) 副董事长。2013 年 11 月起任公司董事。

游一冰, 董事, 大学本科, 英国特许保险学会高级会员 (FCII) 及英国特许保险师 (Chartered Insurer)。1989 年至 1994 年任中国人民保险公司总公司营业部助理经理; 1994 年至 1996 年任中国保险(欧洲)控股有限公司总裁助理; 1996 年至 1998 年任忠利保险有限公司英国分公司再保险承保人; 1998 年至 2017 年任忠利亚洲中国地区总经理; 2002 年至今任中意人寿保险有限公司董事; 2007 年至今任中意财产保险有限公司董事; 2007 年至 2017 年任中意财产保险有限公司总经理; 2013 年至今任中意资产管理有限公司董事; 2017 年至今任忠利集团大中华区股东代表。2010 年 6 月起任公司董事。

戴建元, 董事, 大学本科, 高级会计师。1994 年 7 月至 1998 年 4 月, 任福建省泉州电业局财务科会计。1998 年 4 月至 2001 年 3 月, 任福建省电力有限公司财务部会计。2001 年 3 月至 2005 年 8 月, 任福建省厦门市电业局总会计师。2005 年 8 月至今, 历任中国电力财务有限公司福建业务部主任、直属营业部副

主任（主持工作、正處級）、直屬營業部主任、辦公室主任、審計部主任、副總經濟師、首席風險師、總風險師。2020 年 12 月起任公司董事。

李昇，董事，碩士研究生，28 年金融從業經歷。曾任職於中國建設銀行總行、中國建銀投資有限責任公司。2024 年 7 月加入國泰基金管理有限責任公司，現任公司黨委副書記、總經理、公司董事。

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

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

馮麗英，獨立董事，大學本科，高級經濟師。1984 年 9 月至 1987 年 6 月，

任北京第二輕工業總公司科員。1987 年 7 月至 1998 年 9 月，歷任中國建設銀行人事部勞動工資處副處長、處長。1998 年 9 月至 1999 年 9 月，任中國國際金融有限責任公司人力資源部高級經理。1999 年 9 月至 2005 年 9 月，任中國信達資產管理有限公司人力資源部副總經理（總經理級）。期間兼任中國耀華浮華玻璃有限責任公司副董事長，中國宏源證券公司監事長。2005 年 9 月至 2011 年 2 月，任中國建設銀行總行人力資源部副總經理（總經理級）。期間兼任建信基金管理有限責任公司監事長。2011 年 2 月至 2015 年 11 月，任中國建設銀行養老金業務部總經理。2015 年 11 月至 2019 年 7 月，任建信養老金管理有限責任公司總裁。2020 年 12 月起任公司董事。

2、監事會成員

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

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

鄧時鋒，監事，碩士研究生。曾任職於天同證券。2001 年 9 月加盟國泰基金管理有限責任公司，歷任行業研究員、基金經理助理，2008 年 4 月至 2018 年 3 月任國泰金鼎價值精選混合型證券投資基金的基金經理，2009 年 5 月至 2018 年 3 月任國泰區位優勢混合型證券投資基金（原國泰區位優勢股票型證券投資基金）的基金經理，2013 年 9 月至 2015 年 3 月任國泰估值優勢股票型證券投資基金（LOF）的基金經理，2015 年 9 月至 2018 年 3 月任國泰央企改革股票型證券投資基金的基金經理，2019 年 7 月至 2020 年 7 月任國泰民安養老目標日期 2040 三年持有期混合型基金中基金（FOF）的基金經理，2021 年 9 月起任國泰國策驅動靈活配置混合型證券投資基金的基金經理。2017 年 7 月至 2019 年 3 月任投資總監（權益），2019 年 4 月至 2020 年 7 月任投資總監（FOF），2020 年 8 月起任投資總監（權益）。2015 年 8 月起任公司職工監事。

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

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

3、高级管理人员

李昇，总经理，简历同上。

张玮，硕士研究生，24年金融从业经历。曾任职于申银万国证券研究所、银河基金管理有限公司、国泰基金管理有限公司、敦和资产管理有限公司。2019年2月再次加入国泰基金管理有限公司，历任公司总经理助理，现任公司党委委员、副总经理。

封雪梅，硕士研究生，26年金融从业经历。曾任职于中国工商银行北京分行营业部、大成基金管理有限公司、信达澳银基金管理有限公司、国寿安保基金管理有限公司。2018年7月加入国泰基金管理有限公司，现任公司副总经理。

倪莹，硕士研究生，23年金融从业经历。曾任职于新晨信息技术有限责任公司。2001年3月加入国泰基金管理有限公司，历任信息技术部总监、运营管理部总监、公司总经理助理等，现任公司首席信息官。

刘国华，博士研究生，30年金融从业经历。曾任职于山东省国际信托投资公司、万家基金管理有限公司。2008年4月加入国泰基金管理有限公司，历任产品规划部总监、公司首席产品官、公司首席风险官等，现任公司督察长。

4、本基金基金经理

（1）现任基金经理

茅利伟，硕士研究生，11年证券基金从业经历。曾任职于杉杉青骛投资管理有限公司和上海海通证券资产管理有限公司。2022年12月加入国泰基金。2023年6月起任国泰聚鑫纯债债券型证券投资基金的基金经理，2023年7月起兼任国泰鑫享稳健6个月滚动持有债券型证券投资基金的基金经理，2023年8月起

兼任国泰金龙债券证券投资基金的基金经理，2023年10月起兼任国泰惠盈纯债债券型证券投资基金的基金经理，2024年1月起兼任国泰安康定期支付混合型证券投资基金、国泰安瓊债券型证券投资基金和国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2024年5月起兼任国泰浩益混合型证券投资基金的基金经理，2024年12月起兼任国泰兴益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

（2）历任基金经理

本基金自基金合同生效之日起至2024年1月22日由樊利安担任基金经理，自2024年1月23日起至2024年8月28日由樊利安和茅利伟共同担任基金经理，自2024年8月29日起至今由茅利伟担任基金经理。

5、投资决策委员会

本基金管理人设有公司投资决策委员会，其成员在公司高级管理人员、投研部门负责人及业务骨干等相关人员中产生。公司总经理可以推荐上述人员以外的投资管理相关人员担任成员，督察长和运营体系负责人列席公司投资决策委员会会议。公司投资决策委员会主要职责是根据有关法规和基金合同，审议并决策公司投资研究部门提出的公司整体投资策略、基金大类资产配置原则，以及研究相关投资部门提出的重大投资建议等。

投资决策委员会成员组成如下：

主任委员：

李昇：简历同上

执行委员：

张玮：简历同上

委员：

梁杏：总经理助理、量化投资部总监

胡松：投资总监（养老金）、养老金及专户投资部总监

索峰：投资总监（固收）、绝对收益投资部总监

郑有为：研究部副总监

6、上述成员之间均不存在近亲属或家属关系。

三、基金管理人职责

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

金份額的發售、申購、贖回和登記事宜；

- 2、辦理基金備案手續；
- 3、對所管理的不同基金財產分別管理、分別記賬，進行證券投資；
- 4、按照基金合同的約定確定基金收益分配方案，及時向基金份額持有人分配收益；
- 5、進行基金會計核算並編制基金財務會計報告；
- 6、編制季度、中期報告和年度報告；
- 7、計算並公告基金淨值信息，確定基金份額申購、贖回價格；
- 8、辦理與基金財產管理業務活動有關的信息披露事項；
- 9、按照規定召集基金份額持有人大會或配合基金託管人、基金份額持有人依法召集基金份額持有人大會；
- 10、保存基金財產管理業務活動的記錄、賬冊、報表和其他相關資料；
- 11、以基金管理人名義，代表基金份額持有人利益行使訴訟權利或者實施其他法律行為；
- 12、有關法律、法規和中國證監會規定的其他職責。

四、基金管理人承諾

1、基金管理人承諾不從事違反《中華人民共和國證券法》的行為，並承諾建立健全內部控制制度，採取有效措施，防止違反《中華人民共和國證券法》行為的發生。

2、基金管理人承諾不從事違反《基金法》的行為，並承諾建立健全內部控制制度，採取有效措施，防止下列行為發生：

- （1）將其固有財產或者他人財產混同於基金財產從事證券投資；
- （2）不公平地對待其管理的不同基金財產；
- （3）利用基金財產為基金份額持有人以外的第三人謀取利益；
- （4）向基金份額持有人違規承諾收益或者承擔損失；
- （5）法律法規或中國證監會禁止的其他行為。

3、基金管理人承諾加強人員管理，強化職業操守，督促和約束員工遵守國家有關法律、法規及行業規範，誠實信用、勤勉盡責，不從事以下活動：

- （1）越權或違規經營；

-
-
- (2) 違反基金合同或托管協議；
 - (3) 故意損害基金份額持有人或其他基金相關機構的合法權益；
 - (4) 在向中國證監會報送的資料中弄虛作假；
 - (5) 拒絕、干擾、阻撓或嚴重影響中國證監會依法監管；
 - (6) 玩忽職守、濫用職權，不按照規定履行職責；
 - (7) 違反現行有效的有關法律、法規、規章、基金合同和中國證監會的有關規定，洩漏在任職期間知悉的有關證券、基金的商業秘密，尚未依法公開的基金投資內容、基金投資計劃等信息，或利用該信息從事或者明示、暗示他人從事相關的交易活動；
 - (8) 違反證券交易場所業務規則，利用對敲、倒倉等手段操縱市場價格，擾亂市場秩序；
 - (9) 貶損同行，以抬高自己；
 - (10) 以不正當手段謀求業務發展；
 - (11) 有悖社會公德，損害證券投資基金人員形象；
 - (12) 在公開信息披露和廣告中故意含有虛假、誤導、欺詐成分；
 - (13) 其他法律、行政法規以及中國證監會禁止的行為。

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

5、基金管理人承諾不從事其他法規規定禁止從事的行為。

五、基金經理承諾

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

2、不利用職務之便為自己、受僱人或任何第三者謀取利益；

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

4、不以任何形式為其他組織或個人進行證券交易。

六、基金管理人內部控制制度

基金管理人為防范和化解經營運作中面臨的風險，保證經營活動的合法合規

和有效開展，制定了一系列組織機制、管理方法、操作程序與控制措施，形成了公司完整的內部控制體系，並通過相應的具體業務控制流程來嚴格實施。

1、內部控制制度概述

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

2、內部控制的目标

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

3、內部控制的原則

（1）全面性原則。內部控制應覆蓋公司的各項業務、所有部門和崗位，滲透到決策、執行、監督、反饋等所有業務過程和業務環節。

（2）有效性原則。建立科學、合理、有效的內部控制制度，公司全體員工必須竭力維護內部控制制度的有效執行。

（3）相互獨立和制約原則。公司根據業務的需要設立相對獨立的機構、部門和崗位，公司內部部門和崗位的設置必須權責分明、相互制約。內部控制的檢查評價部門必須獨立於各業務執行部門。公司受託資產、自有資產、其他資產的運作必須分離。

（4）適應性原則。公司內部控制應根據公司经营業務發展、新產品的開發、金融創新、法律法規以及市場環境的變化等及時調整和完備，以保證內部控制的有效性和適應性。

（5）防火牆原則。公司各個業務部門，特別是研究、投資、執行、清算等部門和崗位必須在物理上和制度上隔離，對重要業務設立防火牆並實行門禁制度。

（6）成本效益原則。公司運用科學化的經營管理方法降低運作成本，提高經濟效益，力爭以合理的控制成本達到最佳的內控效果。

4、內部控制的措施

（1）公司經過多年的管理實踐，建立並完善了科學的治理結構，充分發揮獨立董事和監事會的監督職能，並在員工中加強職業道德教育和風險觀念，形成了誠信為本和穩健經營的企業文化。公司董事會對內部控制原則進行指導，對公司建立內部控制系統和維持其有效性承擔最終責任；公司經營管理層對內部控制進行管理、實施組織與決策；公司各部門之間有明確的授權分工和風險控制責任，既相互獨立，又相互合作和制約，形成了合理的組織結構、決策授權和風險控制體系。

（2）公司依據自身經營特點建立了包括各崗位以目標責任制自控、相關部門和崗位之間相互制衡、內控檢查評價部門實施監督的、權責統一、嚴密有效的內控防線。

（3）公司建立有效的人力資源管理制度，健全激勵約束機制，確保公司人員具備與崗位要求相適應的職業操守和專業能力。

（4）公司建立科學嚴密的風險評估體系，從总体上明確風險管理的目標和原則，並對公司面臨的內外部風險進行辨識和評估，不斷優化風險控制程序和手段。各部門根據各自業務特點，對業務活動中存在的風險點進行揭示和梳理，有針對性地建立詳細的風險控制流程，並在實際業務中加以控制。

（5）公司建立了完善的授權管理機制，明確了合理的授權標準和流程，確保授權機制的貫徹執行。

（6）公司建立了完善的內部會計控制，公司會計核算與基金會計核算在業務規範、人員崗位和辦公區域上進行嚴格區分，確保基金資產與公司自有資產完全分開，分賬管理，獨立核算。

（7）公司建立了科學、嚴格的崗位分離機制，明確劃分各崗位職責，投資和交易、交易和清算、基金會計和公司會計等重要崗位不得有人員的重疊。重要業務部門和崗位進行物理隔離。

（8）公司建立重大風險應急處置機制，制訂切實有效的應急應變措施，按照預案妥善處理。

（9）公司建立有效的信息交流渠道和溝通機制，明確報告機制路徑和業務匯報體系，保證業務信息在既定路徑高效、有序、準確、完整傳遞，實現自下而

上的及時報告和自上而下的有效反饋。

（10）公司通過建立完整的研究管理、投資決策和交易管理等制度體系，以實現投資管理業務控制。

（11）公司制定規範的信息披露管理辦法，不斷優化完善機制流程，確保公開披露信息的真實、準確、完整、及時。

（12）公司對內部控制建立與實施情況進行監督檢查，評價內部控制的有效性，發現內部控制缺陷，及時加以改進，內控檢查評價部門通過定期或不定期檢查內部控制制度的執行情況，確保公司各項經營管理活動的有效運行。

5、基金管理人內部控制制度聲明書

基金管理人保證以上關於內部控制制度的披露真實、準確，並承諾基金管理人將根據市場變化和業務發展不斷完善內部控制制度，切實維護基金份額持有人的合法權益。

第四部分 基金托管人

一、基金托管人情况

1、基本情况

名称：平安银行股份有限公司

注册住所：广东省深圳市罗湖区深南东路5047号

办公地址：广东省深圳市福田区益田路5023号平安金融中心B座26楼

法定代表人：谢永林

成立日期：1987年12月22日

组织形式：股份有限公司

注册资本：19,405,918,198元

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监许可[2008]1037号

联系人：刘华栋

联系电话：0755-22166388

2、平安银行基本情况

平安银行股份有限公司是一家总部设在深圳的全国性股份制商业银行（深圳证券交易所简称：平安银行，证券代码000001）。其前身是深圳发展银行股份有限公司，于2012年6月吸收合并原平安银行并于同年7月更名为平安银行。中国平安保险（集团）股份有限公司及其子公司合计持有平安银行58%的股份，为平安银行的控股股东。截至2024年6月末，平安银行有109家分行（含香港分行），共1,180家营业机构。

2024年1-6月，平安银行实现营业收入886.1亿元（同比下降13.0%）、净利润253.87亿元（同比增长1.9%）、资产总额57,540.33亿元（较上年末增长3.0%）、吸收存款本金余额35,708.12亿元（较上年末增长4.8%）、发放贷款和垫款总额3,4229.40亿元（较上年末增长0.2%）。

3、主要人员情况

平安银行总行设资产托管部，下设客群拓展室、营销推动室、估值核算室、资金清算室、企划与综合服务室、数字平台室、督察合规室、基金服务室8个处

室，目前部門人員為75人，為客戶提供專業化的託管服務。證券投資基金託管業務相關員工配置齊全且從業經驗豐富，託管部核心管理層具備銀行管理、證券或託管業務十年以上從業經驗。

4、基金託管業務經營情況

2008年8月15日獲得中國證監會、銀監會核准開辦證券投資基金託管業務。截至2024年6月末，平安銀行股份有限公司託管證券投資基金淨值規模合計7982億，平安銀行已託管293只證券投資基金，覆蓋了股票型、債券型、混合型、貨幣型、指數型、FOF等多種類型的基金，滿足了不同客戶多元化的投資理財需求。

二、基金託管人的內部風險控制制度說明

1、內部控制目標

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

2、內部控制組織結構

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

3、內部控制制度及措施

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

三、基金託管人對基金管理人運作基金進行監督的方法和程序

1、監督方法

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

2、監督流程

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

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

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

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

第五部分 相关服务机构

一、基金份额销售机构

1、直销机构

序号	机构名称	机构信息	
1	国泰基金管理有限公司直销柜台	地址：上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦15-20层	
		客户服务专线：400-888-8688，021-31089000	
		传真：021-31081861	网址：www.gtfund.com
2	国泰基金电子交易平台	电子交易网站：www.gtfund.com 登录网上交易页面 智能手机 APP 平台：iPhone 交易客户端、Android 交易客户端、“国泰基金”微信交易平台	
		电话：021-31089000	联系人：赵刚

2、其他销售机构

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

二、登记机构

名称：国泰基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区浦东大道1200号2层225室

办公地址：上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦15-20层

法定代表人：周向勇

联系人：辛怡

传真：021-31081800

客户服务专线：400-888-8688，021-31089000

三、出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

办公地址：上海市银城中路68号时代金融中心18楼至20楼

负责人：韩炯

联系电话：021-31358666

传真：021-31358600

经办律师：黎明、丁媛

联系人：丁媛

四、审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

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

办公地址：中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼

执行事务合伙人：李丹

联系电话：021-23238888

传真：021-23238800

联系人：张晓阳

经办注册会计师：张炯、张晓阳

第六部分 基金的募集

一、基金募集的依据

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

二、基金类别、运作方式、存续期限、基金份额类别

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

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

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

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

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

三、基金份额的发售时间、发售方式、发售对象

1、发售时间

自基金份额发售之日起最长不得超过3个月，具体发售时间见基金份额发售公告。

2、发售方式

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

3、发售对象

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

四、最低募集份额总额

本基金的最低募集份额总额为 2 亿份。

五、基金份额的发售价、认购价格及计算公式、认购费用

1、本基金的基金份额发售价为人民币 1.00 元。

2、认购费用

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

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

本基金 A 类基金份额的认购费率如下：

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

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

3、基金认购份额的计算

本基金采用金额认购的方式。

（1）认购本基金 A 类基金份额的计算公式

认购金额包括认购费用和净认购金额。

当认购费用适用比例费率时，计算公式为：

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

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

$$\text{认购份额} = (\text{净认购金额} + \text{认购资金利息}) / \text{基金份额发售面值}$$

当认购费用为固定金额时，计算公式为：

$$\text{认购费用} = \text{固定金额}$$

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

$$\text{认购份额} = (\text{净认购金额} + \text{认购资金利息}) / \text{基金份额发售面值}$$

（2）认购本基金 C 类基金份额的计算公式

本基金 C 类基金份额不收取认购费用。

$$\text{认购份额} = (\text{认购金额} + \text{认购资金利息}) / \text{基金份额发售面值}$$

（3）认购份额余额的处理方式

认购份额的计算保留到小数点后 2 位，小数点 2 位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

例一：某投资人投资 10,000.00 元认购本基金 A 类基金份额，认购费率为 0.60%，假定募集期间认购资金所得利息为 3.00 元，则根据公式计算出：

$$\text{净认购金额} = 10,000.00 / (1 + 0.60\%) = 9,940.36 \text{ 元}$$

$$\text{认购费用} = 10,000.00 - 9,940.36 = 59.64 \text{ 元}$$

$$\text{认购份额} = (9,940.36 + 3.00) / 1.00 = 9,943.36 \text{ 份}$$

即：投资人投资 10,000.00 元认购本基金 A 类基金份额，假定认购资金利息为 3.00 元，则可得到 9,943.36 份 A 类基金份额。

例二：某投资人投资 10,000.00 元认购本基金 C 类基金份额，无认购费用，假定募集期间认购资金所得利息为 3.00 元，则根据公式计算出：

$$\text{认购份额} = (10,000.00 + 3.00) / 1.00 = 10,003.00 \text{ 份}$$

即：投资人投资 10,000.00 元认购本基金 C 类基金份额，假定认购资金利息为 3.00 元，则可得到 10,003.00 份 C 类基金份额。

六、认购安排

1、认购时间

投资人认购本基金份额的具体业务办理时间由基金管理人和基金销售机构

確定，請參見本基金的基金份額發售公告或基金銷售機構的相關公告。

2、投資人認購本基金份額應提交的文件和辦理的手續

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

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

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

5、認購申請的確認

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

6、認購金額的限制

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

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

七、募集期利息的處理方式

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

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

第七部分 基金合同的生效

一、基金合同的生效

本基金基金合同于 2023 年 1 月 17 日正式生效。自基金合同生效日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

二、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

《基金合同》生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当在 10 个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并在 6 个月内召集基金份额持有人大会。

法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

第八部分 基金份額的申購與贖回

一、申購和贖回場所

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

二、申購和贖回的開放日及時間

1、開放日及開放時間

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

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

2、申購、贖回開始日及業務辦理時間

本基金已于 2023 年 2 月 17 日起開始辦理日常申購、贖回業務。

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

三、申購與贖回的原則

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

2、“金額申購、份額贖回”原則，即申購以金額申請，贖回以份額申請；

3、當日的申購與贖回申請可以在基金管理人規定的時間以內撤銷；

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

5、办理申购、赎回业务时，应当遵循基金份额持有人利益优先原则，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待。

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

四、申购与赎回的程序

1、申购和赎回的申请方式

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

2、申购和赎回的款项支付

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

基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；基金份额登记机构确认赎回时，赎回生效。基金份额持有人赎回申请生效后，基金管理人将在 T+7 日（包括该日）内支付赎回款项。在发生巨额赎回或基金合同载明的其他暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。如遇交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障、港股通交易系统、港股通资金交收规则限制或其他非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程时，赎回款项划付时间相应顺延。

3、申购和赎回申请的确认

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

销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机

構確實接收到申請。申購、贖回的確認以登記機構的確認結果為準。對於申請的確認情況，投資人應及時查詢並妥善行使合法權利，否則，由此產生的投資人任何損失由投資人自行承擔。

基金管理人可以在法律法規允許的範圍內，依法對上述申購和贖回申請的確認時間進行調整，並必須在調整實施日前按照《信息披露辦法》的有關規定在規定媒介上公告。

五、申購和贖回的数量限制

1、申購金額的限制

投資人單筆申購的最低金額為 1.00 元（含申購費）。各銷售機構對本基金最低申購金額及交易級差有其他規定的，以各銷售機構的業務規定為準。

2、贖回份額的限制

基金份額持有人可將其全部或部分基金份額贖回。單筆贖回申請最低份額為 1.00 份，若某基金份額持有人贖回時在銷售機構保留的基金份額不足 1.00 份，則該次贖回時必須一起贖回。

3、本基金不對投資人每個基金交易賬戶的最低基金份額餘額進行限制，但各銷售機構對基金交易賬戶最低份額餘額有其他規定的，以各銷售機構的業務規定為準。

4、基金管理人可以規定單個投資人累計持有的基金份額上限、單日淨申購比例上限、單個投資人單日或單筆申購金額上限，具體規定請參見相關公告。

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

6、基金管理人可在法律法規允許的情況下，調整上述規定申購金額和贖回份額的数量限制。基金管理人必須在調整實施前依照《信息披露辦法》的有關規定在規定媒介上公告。

六、申購和贖回的价格、費用及其用途

1、本基金基金份額分為 A 類和 C 類基金份額。投資人在申購 A 類基金份

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

2、本基金 A 类基金份额的申购费用

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

本基金 A 类基金份额的申购费率具体如下：

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

3、赎回费用

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。

（1）本基金 A 类基金份额的赎回费率

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

本基金 A 类基金份额的赎回费率具体如下：

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

（注：赎回份额持续持有期的计算，以该份额在登记机构的登记日开始计算。）

（2）本基金 C 类基金份额的赎回费率

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

本基金 C 类基金份额的赎回费率具体如下：

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

Y < 7 日	1.50%
Y ≥ 7 日	0.00%

（注：赎回份额持续持有期的计算，以该份额在登记机构的登记日开始计算。）

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

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

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

七、申购份额和赎回金额的计算

1、申购份额的计算

基金申购采用金额申购的方式。

（1）申购本基金 A 类基金份额的计算公式

基金的申购金额包括申购费用和净申购金额。

当申购费用适用比例费率时，计算公式为：

净申购金额 = 申购金额 / (1 + 申购费率)

申购费用 = 申购金额 - 净申购金额

申购份额 = 净申购金额 / T 日 A 类基金份额净值

当申购费用为固定金额时，计算公式为：

申购费用 = 固定金额

净申购金额 = 申购金额 - 申购费用

申购份额 = 净申购金额 / T 日 A 类基金份额净值

（2）申购本基金 C 类基金份额的计算公式

申购份额 = 申购金额 / T 日 C 类基金份额净值

上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或

损失由基金财产承担。

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

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

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

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

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

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

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

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

2、赎回金额的计算

赎回金额的计算方法如下：

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

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

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

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

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

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

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

10,189.80 元。

例六：某基金份額持有人贖回 10,000 份本基金 C 類基金份額，假設該份額的持有時間為 5 日，對應的贖回費率為 1.50%，假設 T 日 C 類基金份額淨值是 1.0192 元，則其可獲得的贖回金額為：

$$\text{贖回費用} = 10,000 \times 1.0192 \times 1.50\% = 152.88 \text{ 元}$$

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

即：基金份額持有人贖回 10,000 份本基金 C 類基金份額，假設該份額的持有時間為 5 日、T 日 C 類基金份額淨值是 1.0192 元，則其可獲得的贖回金額為 10,039.12 元。

3、本基金 A 類和 C 類基金份額的基金份額淨值的計算，均保留到小數點後 4 位，小數點後第 5 位四舍五入，由此產生的收益或損失由基金財產承擔。T 日的各類基金份額淨值在當天收市後計算，並在 T+1 日內公告。遇特殊情況，經履行適當程序，可以適當延遲計算或公告。

八、拒絕或暫停申購的情形

發生下列情況時，基金管理人可拒絕或暫停接受投資人的申購申請：

- 1、因不可抗力導致基金無法正常運作。
- 2、發生基金合同規定的暫停基金資產估值情況時，基金管理人可暫停接受投資人的申購申請。
- 3、證券/期貨交易所交易時間非正常停市或港股通臨時停市，導致基金管理人無法計算當日基金資產淨值。
- 4、接受某筆或某些申購申請可能會影響或損害現有基金份額持有人利益時。
- 5、基金資產規模過大，使基金管理人無法找到合適的投資品種，或其他可能對基金業績產生負面影響，或發生其他損害現有基金份額持有人利益的情形。
- 6、當前一估值日基金資產淨值 50% 以上的資產出現無可參考的活躍市場價格且採用估值技術仍導致公允價值存在重大不確定性時，經與基金託管人協商確認後，基金管理人應當暫停接受基金申購申請。
- 7、基金管理人接受某筆或者某些申購申請有可能導致單一投資者持有基金份額的比例達到或者超過 50%，或者變相規避 50% 集中度的情形。法律法規或中國證監會另有規定的除外。

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

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

10、港股通交易每日額度不足。

11、法律法規規定或中國證監會認定的其他情形。

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

九、暫停贖回或延緩支付贖回款項的情形

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

1、因不可抗力導致基金管理人不能支付贖回款項。

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

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

4、連續兩個或兩個以上開放日發生巨額贖回。

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

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

7、法律法規規定或中國證監會認定的其他情形。

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

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

十、巨额赎回的情形及处理方式

1、巨额赎回的认定

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

2、巨额赎回的处理方式

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

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

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

（3）若本基金发生巨额赎回，在单个基金份额持有人超过基金总份额20%以上的赎回申请的情形下：对于该基金份额持有人当日赎回申请超过上一开放日

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

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

3、巨額贖回的公告

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

十一、暫停申購或贖回的公告和重新開放申購或贖回的公告

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

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

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

十二、基金轉換

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

提前告知基金托管人与相关机构。

十三、基金份额的转让

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

十四、基金的非交易过户

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

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

十五、基金的转托管

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

十六、定期定额投资计划

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

十七、基金份额的冻结和解冻

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

基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益一并冻结，被冻结部分份额仍然

参与收益分配。法律法规或监管机构另有规定的除外。

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

十九、实施侧袋机制期间本基金的申购与赎回

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

第九部分 基金的投资

一、投资目标

在注重风险和流动性管理的前提下，力争获取超越业绩比较基准的投资收益。

二、投资范围

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

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

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

三、投资策略

1、资产配置策略

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

2、债券投资策略

本基金在债券投资中将根据对经济周期和市场环境的把握，基于对财政政策、

貨幣政策的深入分析以及對宏觀經濟的持續跟蹤，靈活運用久期策略、收益率曲線策略、類屬配置策略、利率品種投資策略、信用債投資策略、可轉換債券和可交換債券投資策略等多種投資策略，構建債券資產組合，並根據對債券收益率曲線形態、息差變化的預測，動態的對債券投資組合進行調整。

（1）久期策略

本基金將基於對宏觀經濟政策的分析，積極地預測未來利率變化趨勢，並根據預測確定相應的久期目標，調整債券組合的久期配置，以達到提高債券組合收益、降低債券組合利率風險的目的。當預期市場利率水平將上升時，本基金將適當降低組合久期；而預期市場利率將下降時，則適當提高組合久期。在確定債券組合久期的過程中，本基金將在判斷市場利率波動趨勢的基礎上，根據債券市場收益率曲線的當前形態，通過合理假設下的情景分析和壓力測試，最後確定最優的債券組合久期。

（2）收益率曲線策略

在組合的久期配置確定以後，本基金將通過對收益率曲線的研究，分析和預測收益率曲線可能發生的形狀變化，採用子彈型策略、啞鈴型策略或梯形策略，在長期、中期和短期債券間進行配置，以從長、中、短期債券的相對價格變化中獲利。

（3）類屬配置策略

本基金對不同類型債券的信用風險、稅負水平、市場流動性、市場風險等因素進行分析，研究同期限的國債、金融債、企業債、交易所和銀行間市場投資品種的利差和變化趨勢，制定債券類屬配置策略，以獲取不同債券類屬之間利差變化所帶來的投資收益。

（4）利率品種投資策略

本基金對國債、央行票據等利率品種的投資，是在對國內、國外經濟趨勢進行分析和預測基礎上，運用數量方法對利率期限結構變化趨勢和債券市場供求關係變化進行分析和預測，深入分析利率品種的收益和風險，並據此調整債券組合的平均久期。在確定組合平均久期後，本基金對債券的期限結構進行分析，運用統計和數量分析技術，選擇合適的期限結構的配置策略，在合理控制風險的前提下，綜合考慮組合的流動性，決定投資品種。

（5）信用债投资策略

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

本基金如投资于信用债（含资产支持证券，下同），应当遵守下列要求：

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

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

（6）可转换债券和可交换债券投资策略

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

3、股票投资策略

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

（1）价值投资策略

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

（2）事件驱动策略

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

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

4、港股通標的股票投資策略

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

5、存托憑證投資策略

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

6、國債期貨投資策略

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

四、投資限制

1、組合限制

基金的投資組合應遵循以下限制：

（1）本基金投資於債券資產的比例不低於基金資產的 80%；

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

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

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

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

（6）本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；

（7）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

（8）本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；

（9）本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

（10）本基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

（11）本基金投资于国债期货的投资限制如下：

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

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

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

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

（12）基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

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

（14）本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 30%；完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述比例限制；

（15）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净

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

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

（17）本基金資產總值不超過基金資產淨值的 140%；

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

（19）法律法規及中國證監會規定的和《基金合同》约定的其他投資限制。

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

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

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

2、禁止行為

為維護基金份額持有人的合法權益，基金財產不得用於下列投資或者活動：

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

（7）法律、行政法規和中國證監會規定禁止的其他活動。

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

3、關聯交易

基金管理人運用基金財產買賣基金管理人、基金託管人及其控股股東、實際控制人或者與其有重大利害關係的公司發行的證券或者承銷期內承銷的證券，或者從事其他重大關聯交易的，應當符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益優先原則，防範利益衝突，建立健全內部審批機制和評估機制，按照市場公平合理價格執行。相關交易必須事先得到基金託管人的同意，並按法律法規予以披露。重大關聯交易應提交基金管理人董事會審議，並經過三分之二以上的獨立董事通過。基金管理人董事會應至少每半年對關聯交易事項進行審查。

五、業績比較基準

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

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

六、風險收益特征

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

七、基金管理人代表基金行使股東或債權人權利處理原則及方法

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

2、不謀求對上市公司的控股；

3、有利於基金財產的安全與增值；

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

八、侧袋机制的实施和投资运作安排

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

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

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

九、基金投资组合报告

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

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2024年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至2024年9月30日，本报告所列财务数据未经审计。

1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	58,557,746.41	14.30
	其中：股票	58,557,746.41	14.30
2	固定收益投资	307,874,471.76	75.16
	其中：债券	307,874,471.76	75.16
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-

5	买入返售金融资产	34,977,436.63	8.54
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	8,064,803.74	1.97
7	其他各项资产	136,377.94	0.03
8	合计	409,610,836.48	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	26,485,846.41	7.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,767,200.00	3.20
E	建筑业	739,450.00	0.20
F	批发和零售业	2,607,600.00	0.71
G	交通运输、仓储和邮政业	2,142,000.00	0.58
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	14,815,650.00	4.03
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	58,557,746.41	15.93

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	000543	皖能电力	510,000	4,243,200.00	1.15
2	600023	浙能电力	600,000	4,038,000.00	1.10
3	601838	成都银行	242,600	3,820,950.00	1.04
4	600926	杭州银行	270,000	3,807,000.00	1.04
5	601825	沪农商行	500,000	3,715,000.00	1.01
6	600642	申能股份	360,000	3,074,400.00	0.84
7	002475	立讯精密	64,200	2,790,132.00	0.76
8	002984	森麒麟	98,000	2,688,140.00	0.73
9	600036	招商银行	70,000	2,632,700.00	0.72
10	603279	景津装备	110,000	2,296,800.00	0.62

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	115,387,880.43	31.39
2	央行票据	-	-
3	金融债券	60,869,935.48	16.56
	其中：政策性金融债	30,335,114.51	8.25
4	企业债券	66,502,935.33	18.09
5	企业短期融资券	12,328,465.57	3.35
6	中期票据	41,344,345.36	11.25
7	可转债（可交换债）	1,617,264.66	0.44
8	同业存单	9,823,644.93	2.67
9	其他	-	-
10	合计	307,874,471.76	83.76

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明

细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	019749	24 国债 15	350,000	35,088,679.45	9.55

2	240006	24 付息国债 06	300,000	30,743,054.79	8.36
3	232480001	24 中行二级资本债 01A	260,000	26,857,113.44	7.31
4	240001	24 付息国债 01	200,000	20,794,721.31	5.66
5	019740	24 国债 09	140,000	14,109,568.22	3.84

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资股指期货。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

11、投资组合报告附注

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

中国银行及下属分支机构因办理经常项目资金收付，未对交易单证的真实性及其与外汇收支的一致性进行合理审查；信贷资金用途管控不到位，贷款资金回流至母公司；信用卡汽车分期业务管理不审慎；员工行为管理及贷款业务严重违反审慎经营规则；员工行为管理及贷款业务严重违反审慎经营规则；违规报送统计报表等原因，受到监管机构公开处罚。

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

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

（3）其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	26,690.11
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	109,687.83
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	136,377.94

（4）报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110059	浦发转债	1,108,106.30	0.30
2	113053	隆 22 转债	509,158.36	0.14

（5）报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

第十部分 基金的业绩

基金业绩截止日为2024年6月30日，并经基金托管人复核。

基金管理人依照恪守职守、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。

1、国泰安璟债券 A：

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
2023年1月17日至 2023年12月31日	-1.23%	0.14%	1.26%	0.14%	-2.49%	0.00%
2024年上半年	1.89%	0.13%	3.59%	0.14%	-1.70%	-0.01%
2023年1月17日至 2024年6月30日	0.64%	0.14%	4.89%	0.14%	-4.25%	0.00%

2、国泰安璟债券 C：

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
2023年1月17日至 2023年12月31日	-1.14%	0.14%	1.26%	0.14%	-2.40%	0.00%
2024年上半年	1.85%	0.13%	3.59%	0.14%	-1.74%	-0.01%
2023年1月17日至 2024年6月30日	0.69%	0.14%	4.89%	0.14%	-4.20%	0.00%

注：本基金合同生效日为2023年1月17日。

第十一部分 基金的財產

一、基金資產總值

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

二、基金資產淨值

基金資產淨值是指基金資產總值減去基金負債後的價值。

三、基金財產的賬戶

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

四、基金財產的保管和處分

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

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

第十二部分 基金資產估值

一、估值日

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

二、估值對象

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

三、估值原則

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

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

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

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

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

四、估值方法

1、證券交易所上市的有價證券的估值

（1）交易所上市的有價證券（包括股票等），以其估值日在證券交易所掛牌的市價（收盤價）估值；估值日無交易的，且最近交易日後經濟環境未發生重大變化或證券發行機構未發生影響證券價格的重大事件的，以最近交易日的市價（收盤價）估值；如最近交易日後經濟環境發生了重大變化或證券發行機構發生影響證券價格的重大事件的，可參考類似投資品種的現行市價及重大變化因素，調整最近交易市價，確定公允價格；

（2）交易所上市交易或掛牌轉讓的不含權固定收益品種，選取估值日第三方估值機構提供的相應品種當日的估值淨價進行估值；

（3）交易所上市交易或掛牌轉讓的含權固定收益品種，選取估值日第三方估值機構提供的相應品種當日的唯一估值淨價或推薦估值淨價進行估值；

（4）交易所上市交易的可轉換債券以每日收盤價作為估值全價；

（5）交易所上市不存在活躍市場的有價證券，採用估值技術確定公允價值。交易所市場掛牌轉讓的資產支持證券，採用估值技術確定公允價值。在估值技術難以可靠計量公允價值的情況下，按成本估值；

（6）對在交易所市場發行未上市或未掛牌轉讓的固定收益品種，對存在活躍市場的情況下，應以活躍市場上未經調整的報價作為估值日的公允價值；對於活躍市場報價未能代表估值日公允價值的情況下，應對市場報價進行調整以確認估值日的公允價值；對於不存在市場活動或市場活動很少的情況下，應採用估值技術確定其公允價值，在估值技術難以可靠計量公允價值的情況下，按成本估值。

2、處於未上市期間的有價證券應區分如下情況處理：

（1）送股、轉增股、配股和公開增發的新股，按估值日在證券交易所掛牌的同一股票的估值方法估值；該日無交易的，以最近一日的市價（收盤價）估值；

（2）首次公開發行未上市的股票、債券，採用估值技術確定公允價值，在估值技術難以可靠計量公允價值的情況下，按成本估值；

（3）在發行時明確一定期限限售期的股票，包括但不限於非公開發行股票、首次公開發行股票時公司股東公開發售股份、通過大宗交易取得的帶限售期的股票等，不包括停牌、新發行未上市、回購交易中的質押券等流通受限股票，按監

管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

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

4、同一证券同时在两个或两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。

5、因持有股票而享有的配股权，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

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

7、持有的银行定期存款或通知存款以本金列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入。

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

9、本基金投资存托凭证的估值核算依照境内上市交易的股票执行，国家有最新规定的，按其规定进行估值。

10、估值涉及到港币等主要货币对人民币汇率的，应当以基金估值日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价为准。

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

12、当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以

确保基金估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。

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

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

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

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

五、估值程序

1、基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。任一类基金份额净值是按照每个工作日闭市后，该类基金份额的基金资产净值除以当日该类基金份额的余额数量计算，精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入。基金管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人于每个工作日计算基金资产净值及各类基金份额净值，并按规定公告。

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

六、估值错误的处理

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

基金合同的当事人应按照以下约定处理：

1、估值错误类型

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

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

2、估值错误处理原则

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

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

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

（4）估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

（1）查明估值错误发生的原因，列明所有的当事人，并根据估值错误发生

的原因確定估值錯誤的責任方；

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

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

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

4、基金份額淨值估值錯誤處理的方法如下：

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

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

（3）前述內容如法律法規或監管機構另有規定的，從其規定處理。

七、暫停估值的情形

1、基金投資所涉及的證券/期貨交易市場遇法定節假日或因其他原因暫停營業時；

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

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

4、法律法規、中國證監會和基金合同認定的其他情形。

八、基金淨值的確認

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

九、特殊情況的處理

1、基金管理人或基金託管人按上述“四、估值方法”的第 13 項進行估值時，

所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

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

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

十、实施侧袋机制期间的基金资产估值

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

第十三部分 基金的收益與分配

一、基金利潤的構成

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

二、基金可供分配利潤

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

三、基金收益分配原則

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

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

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

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

5、法律法規或監管機構另有規定的，從其規定。

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

四、收益分配方案

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

五、收益分配方案的確定、公告與實施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，在2日内在规定媒介公告。

六、基金收益分配中发生的费用

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

七、实施侧袋机制期间的收益分配

本基金实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配。

第十四部分 基金費用與稅收

一、基金費用的種類

- 1、基金管理人的管理費；
- 2、基金托管人的托管費；
- 3、本基金從 C 類基金份額的基金財產中計提的銷售服務費；
- 4、《基金合同》生效後與基金相關的信息披露費用；
- 5、《基金合同》生效後與基金相關的會計師費、律師費、仲裁費和訴訟費；
- 6、基金份額持有人大會費用；
- 7、基金的證券/期貨交易費用；
- 8、基金的銀行匯劃費用；
- 9、基金的開戶費用、賬戶維護費用；
- 10、因投資港股通標的股票而產生的各項合理費用；
- 11、按照國家有關規定和《基金合同》約定，可以在基金財產中列支的其他費用。

二、基金費用計提方法、計提標準和支付方式

1、基金管理人的管理費

本基金的管理費按前一日基金資產淨值的 0.50% 年費率計提。管理費的計算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{當年天數}$$

H 為每日應計提的基金管理費

E 為前一日的基金資產淨值

基金管理費每日計提，按月支付，由基金管理人每月月末向基金托管人發送基金管理費劃款指令，基金托管人核實後於次月前 5 個工作日內從基金財產中一次性支付給基金管理人。若遇法定節假日、公休假或不可抗力等，支付日期順延。

2、基金托管人的托管費

本基金的托管費按前一日基金資產淨值的 0.10% 的年費率計提。托管費的計算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{當年天數}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

3、C 类基金份额的销售服务费

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

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

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

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

三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

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

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、《基金合同》生效前的相关费用；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

四、实施侧袋机制期间的基金费用

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

理费。

五、基金税收

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

第十五部分 基金的会计与审计

一、基金会计政策

1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；

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

3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；

4、会计制度执行国家有关会计制度；

5、本基金独立建账、独立核算；

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

7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对确认。

二、基金的年度审计

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

2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意。

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

第十六部分 基金的信息披露

一、本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《流动性风险管理规定》、《基金合同》及其他有关规定。

二、信息披露义务人

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

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

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

三、本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

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

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

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

五、公开披露的基金信息

公開披露的基金信息包括：

（一）基金招募說明書、《基金合同》、基金托管協議、基金產品資料概要

1、《基金合同》是界定《基金合同》當事人的各項權利、義務關係，明確基金份額持有人大會召開的規則及具體程序，說明基金產品的特性等涉及基金投資者重大利益的事項的法律文件。

2、基金招募說明書應當最大限度地披露影響基金投資者決策的全部事項，說明基金認購、申購和贖回安排、基金投資、基金產品特性、風險揭示、信息披露及基金份額持有人服務等內容。《基金合同》生效後，基金招募說明書的信息發生重大變更的，基金管理人應當在三個工作日內，更新基金招募說明書並登載在規定網站上；基金招募說明書其他信息發生變更的，基金管理人至少每年更新一次。基金終止運作的，基金管理人不再更新基金招募說明書。

3、基金托管協議是界定基金托管人和基金管理人在基金財產保管及基金運作監督等活動中的權利、義務關係的法律文件。

4、基金產品資料概要是基金招募說明書的摘要文件，用於向投資者提供簡明的基金概要信息。《基金合同》生效後，基金產品資料概要的信息發生重大變更的，基金管理人應當在三個工作日內，更新基金產品資料概要，並登載在規定網站，基金銷售機構亦應在銷售機構網站或營業網點登載更新基金產品資料概要；基金產品資料概要其他信息發生變更的，基金管理人至少每年更新一次。基金終止運作的，基金管理人不再更新基金產品資料概要。

基金募集申請經中國證監會註冊後，基金管理人在基金份額發售的三日內，將基金份額發售公告、基金招募說明書提示性公告和《基金合同》提示性公告登載在規定報刊上，將基金份額發售公告、基金招募說明書、基金產品資料概要、《基金合同》和基金托管協議登載在規定網站上，基金銷售機構將基金產品資料概要登載在基金銷售機構網站或營業網點；基金托管人應當同時將《基金合同》、基金托管協議登載在網站上。

（二）基金份額發售公告

基金管理人應當就基金份額發售的具體事宜編制基金份額發售公告，並在基金份額發售的三日內登載於規定媒介上。

（三）《基金合同》生效公告

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

（四）基金净值信息

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

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

基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在规定网站披露半年度和年度最后一日的各类基金份额净值和基金份额累计净值。

（五）基金份额申购、赎回价格

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

（六）基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告

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

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

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

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

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

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

（七）临时报告

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

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

- 1、基金份额持有人大会的召开及决定的事项；
- 2、《基金合同》终止、基金清算；
- 3、转换基金运作方式、基金合并；
- 4、更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；
- 5、基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；
- 6、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- 7、基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人的实际控制人变更；
- 8、基金募集期延长或提前结束募集；
- 9、基金管理人的高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；
- 10、基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十，基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十；
- 11、涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼或仲裁；
- 12、基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；
- 13、基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证

券，或者從事其他重大關聯交易事項，中國證監會另有規定的情形除外；

14、基金收益分配事項；

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

16、任一類基金份額淨值計價錯誤達該類基金份額淨值百分之零點五；

17、本基金開始辦理申購、贖回；

18、本基金發生巨額贖回並延期辦理；

19、本基金連續發生巨額贖回並暫停接受贖回申請或延緩支付贖回款項；

20、本基金暫停接受申購、贖回申請或重新接受申購、贖回申請；

21、發生涉及基金申購、贖回事項調整或潛在影響投資者贖回等重大事項時；

22、基金管理人採用摆动定價機制進行估值；

23、本基金推出新業務或服務；

24、本基金增加或減少基金份額類別，調整基金份額分類辦法及規則；

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

（八）澄清公告

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

（九）清算報告

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

（十）基金份額持有人大會決議

基金份額持有人大會決定的事項，應當依法報中國證監會備案，並予以公告。

（十一）實施側袋機制期間的信息披露

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

（十二）投資國債期貨的相關公告

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

（十三）投資資產支持證券的相關公告

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

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

（十四）投資港股通標的股票相關公告

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

（十五）中國證監會規定的其他信息。

六、信息披露事務管理

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

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

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

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

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

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

七、信息披露文件的存放与查阅

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

八、暂停或延迟信息披露的情形

当出现下述情况时，基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金相关信息：

- 1、不可抗力；
- 2、基金投资所涉及的证券/期货市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 3、法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情况。

第十七部分 側袋機制

一、側袋機制的實施條件和程序

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

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

二、實施側袋機制期間基金份額的申購與贖回

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

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

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

4、申購贖回的具体事項安排詳見基金管理人屆時的相关公告。

三、實施側袋機制期間的基金投資

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

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

基金管理人不得在側袋賬戶中進行除特定資產處置變現以外的其他投資操

作。

四、实施侧袋机制期间的基金估值

本基金实施侧袋机制的，基金管理人和基金托管人应对主袋账户资产进行估值并披露主袋账户的基金净值信息，暂停披露侧袋账户份额净值。

五、侧袋账户中特定资产的处置变现和支付

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

基金管理人应当在终止侧袋机制后及时聘请符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所进行审计并披露专项审计意见。

六、侧袋机制的信息披露

1、临时公告

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

2、基金净值信息

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

3、定期报告

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

七、本部分关于侧袋机制的相关规定，凡是直接引用法律法规或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，或将来法律法规或监管规则针对侧袋机制的内容有进一步规定的，基金管理人经与基金托管人协商一致并履行适当程序后，可直接对本部分内容进行修改、调整 and 补充，无需召开基金份额持有人大会审议。

第十八部分 风险揭示

一、系统性风险

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

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

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

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

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

二、非系统性风险

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

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

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

三、流动性风险

（一）本基金的申购、赎回安排

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

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

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

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

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

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

提示投資人注意本基金的申購贖回安排和相應的流動性風險，合理安排投資計劃。

（二）本基金擬投資市場、行業及資產的流動性風險

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

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

3、國債期貨合約流動性風險可分為兩類：一類為流通量風險，是指期貨合

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

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

（三）巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

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

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

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

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

份額持有人的贖回申請時，按正常贖回程序執行；當基金管理人認為支付該基金份額持有人當日贖回申請未超過 20% 的部分及其他基金份額持有人的贖回申請有困難或認為因支付該等贖回申請而進行的財產變現可能會對基金資產淨值造成較大波動時，基金管理人在當日接受贖回比例不低於上一開放日基金總份額的 10% 的前提下，可對其餘贖回申請延期辦理。延期的贖回申請與下一開放日贖回申請一併處理，無優先權並以下一開放日該類基金份額的基金份額淨值為基礎計算贖回金額，以此類推，直到全部贖回為止。但是，對於未能贖回部分，如該基金份額持有人在提交贖回申請時選擇取消贖回，則其當日未獲受理的部分贖回申請將被撤銷。部分延期贖回不受單筆贖回最低份額的限制。

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

（四）備用的流動性風險管理工具的實施情形、程序及對投資者的潛在影響
基金管理人經與基金託管人協商，在確保投資者得到公平對待的前提下，可依照法律法規及基金合同的約定，綜合運用各類流動性風險管理工具，對贖回申請進行適度調整，作為特定情形下基金管理人流動性風險管理的輔助措施。備用的流動性風險管理工具的實施情形包括：

- 1、發生基金合同規定的暫停贖回或延緩支付贖回款項的情形；
- 2、基金發生巨額贖回；
- 3、基金發生巨額贖回，且單個基金份額持有人的贖回申請超過上一開放日基金總份額 20% 以上的情形；
- 4、基金份額持續持有期限小於 7 日；
- 5、發生基金合同约定的暫停估值的情形；
- 6、當發生大額申購或贖回情形時，基金管理人可以採用擺動定價機制，以確保基金估值的公平性。具體處理原則與操作規範遵循相關法律法規以及監管部門、自律規則的規定；
- 7、基金實施側袋機制；
- 8、法律法規規定、中國證監會認定或基金合同约定的其他情形。

實施備用流動性風險管理工具的決策程序依照基金管理人流動性風險管理

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

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

四、運作管理風險

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

2、交易風險：指在基金投資交易過程中由於各種原因造成的風險。

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

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

五、本基金特定風險

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

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

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

（1）港股市場股價波動較大的風險

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

（2）港股交易失敗風險

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

（3）匯率風險

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

（4）港股通機制下交易日不連貫可能帶來的風險

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

（5）境外市場的風險

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

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

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

5、投資存託憑證的風險

本基金可投资存托凭证，基金净值可能受到存托凭证的境外基础证券价格波动影响，存托凭证的境外基础证券的相关风险可能直接或间接成为本基金的风险。

本基金可根据投资策略需要或市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于存托凭证或选择不将基金资产投资于存托凭证，基金资产并非必然投资存托凭证。

6、科创板股票投资风险

本基金可投资国内上市的科创板股票，会面临因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于如下风险：

（1）股价波动较大的风险。科创板对个股每日涨跌幅限制为 20%，且新股上市后的前 5 个交易日不设置涨跌幅限制，股价可能表现出比 A 股其他板块更为剧烈的波动；

（2）流动性风险。科创板投资者门槛较高，流动性可能弱于 A 股其他板块，投资者可能在特定阶段对科创板个股形成一致性预期，存在基金持有股票无法正常成交的风险；

（3）退市风险。科创板执行比 A 股其他板块更为严格的退市标准，且退市程序存在一定差别，因此上市公司退市风险更大，可能会对基金净值产生不利影响；

（4）本基金投资集中度相对较高的风险。因科创板上市公司商业模式、盈利模式等可能存在一定的相似性，因此，持仓股票股价存在同向波动的可能，从而产生对基金净值不利的影响。

六、本基金法律文件中涉及基金风险特征的表述与销售机构对基金的风险评级可能不一致的风险

本基金基金合同、招募说明书等法律文件中涉及基金风险收益特征或风险状况的表述仅为主要基于基金投资方向与策略特点的概括性表述；而本基金各销售机构依据中国证券投资基金业协会发布的《基金募集机构投资者适当性管理实施指引（试行）》及内部评级标准，将基金产品按照风险由低到高顺序进行风险级别评定划分，其风险评级结果所依据的评价要素可能更多、范围更广，与本基金法律文件中的风险收益特征或风险状况表述并不必然一致或存在对应关系。同时，不同销售机构因其采取的具体评价标准和方法的差异，对同一产品风险级别的评定也可能各有不同；销售机构还可能根据监管要求、市场变化及基金实际运作情

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

七、实施侧袋机制对投资者的影响

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

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

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

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

八、其他风险

除以上主要风险以外，基金还可能遇到以下风险：

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

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

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

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

5、因业务竞争压力可能产生的风险；

6、因不可预见或不可抗力因素导致的风险，如战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金资产的损失，影响基金收益水平；

7、其他意外导致的风险。

第十九部分 基金的终止与清算

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

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，自决议生效后两日内在规定媒介公告。

二、《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：

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

三、基金财产的清算

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

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

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

4、基金财产清算程序：

- （1）《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；
- （2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- （3）对基金财产进行估值和变现；

（4）制作清算報告；

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

（6）將清算報告報中國證監會備案並公告；

（7）對基金剩餘財產進行分配。

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

四、清算費用

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

五、基金財產清算剩餘資產的分配

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

六、基金財產清算的公告

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

七、基金財產清算賬冊及文件的保存

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

第二十部分 基金合同內容摘要

一、基金管理人、基金托管人、基金份額持有人的權利與義務

1、基金管理人的權利

根據《基金法》、《運作辦法》及其他有關規定，基金管理人的權利包括但不限於：

- （1）依法募集資金；
- （2）自《基金合同》生效之日起，根據法律法規和《基金合同》獨立運用並管理基金財產；
- （3）依照《基金合同》收取基金管理費以及法律法規規定或中國證監會批准的其他費用；
- （4）銷售基金份額；
- （5）按照規定召集基金份額持有人大會；
- （6）依據《基金合同》及有關法律法規監督基金托管人，如認為基金托管人違反了《基金合同》及國家有關法律法規，應呈報中國證監會和其他監管部門，並採取必要措施保護基金投資者的利益；
- （7）在基金托管人更換時，提名新的基金托管人；
- （8）選擇、更換基金銷售機構，對基金銷售機構的相關行為進行監督和處理；
- （9）擔任或委託其他符合條件的機構擔任基金登記機構辦理基金登記業務並獲得《基金合同》規定的費用；
- （10）依據《基金合同》及有關法律法規決定基金收益的分配方案；
- （11）在《基金合同》約定的範圍內，拒絕或暫停受理申購與贖回申請；
- （12）依照法律法規為基金的利益对被投資公司行使股東權利，為基金的利益行使因基金財產投資於證券所產生的權利；
- （13）在法律法規允許的前提下，為基金的利益依法為基金進行融資；
- （14）以基金管理人的名義，代表基金份額持有人的利益行使訴訟權利或者實施其他法律行為；
- （15）選擇、更換律師事務所、會計師事務所、證券經紀商、期貨經紀機構

或其他為基金提供服務的外部機構；

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

（17）法律法規及中國證監會規定的和《基金合同》約定的其他權利。

2、基金管理人的义务

根據《基金法》、《運作辦法》及其他有關規定，基金管理人的義務包括但不限於：

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

（2）辦理基金備案手續；

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

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

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

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

（7）依法接受基金托管人的監督；

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

（9）進行基金會計核算並編制基金財務會計報告；

（10）編制基金季度報告、基金中期報告和基金年度報告；

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

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

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

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

（14）按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

（25）执行生效的基金份额持有人大会的决议；

（26）建立並保存基金份額持有人名冊；

（27）法律法規及中國證監會規定的和《基金合同》約定的其他義務。

3、基金託管人的權利

根據《基金法》、《運作辦法》及其他有關規定，基金託管人的權利包括但不限於：

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

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

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

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

（5）提議召開或召集基金份額持有人大會；

（6）在基金管理人更換時，提名新的基金管理人；

（7）法律法規及中國證監會規定的和《基金合同》約定的其他權利。

4、基金託管人的義務

根據《基金法》、《運作辦法》及其他有關規定，基金託管人的義務包括但不限於：

（1）以誠實信用、勤勉盡責的原則持有並安全保管基金財產；

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

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

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

-
-
- (5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
- (6) 按规定开设基金财产的资金账户、证券账户、期货结算账户等投资所需账户，按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
- (7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露，但因监管机构、司法机关等有权机关的要求，或因审计、法律等外部专业顾问提供服务需要提供的情况除外；
- (8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、各类基金份额净值、基金份额申购、赎回价格及法律法规规定的相关内容；
- (9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
- (10) 对基金财务会计报告、基金季度报告、基金中期报告和基金年度报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行；如果基金管理人未执行《基金合同》规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；
- (11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料不低于法律法规规定的最低期限；
- (12) 从基金管理人或其委托的登记机构处接收并保存基金份额持有人名册；
- (13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
- (14) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；
- (15) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
- (16) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；
- (17) 参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- (18) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行业监督管理机构，并通知基金管理人；
- (19) 因违反《基金合同》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿

責任不因其退任而免除；

（20）按規定監督基金管理人按法律法規和《基金合同》規定履行自己的義務，基金管理人因違反《基金合同》造成基金財產損失時，應為基金份額持有人利益向基金管理人追償；

（21）執行生效的基金份額持有人大會的決議；

（22）法律法規及中國證監會規定的和《基金合同》約定的其他義務。

5、基金份額持有人的權利

根據《基金法》、《運作辦法》及其他有關規定，基金份額持有人的權利包括但不限於：

（1）分享基金財產收益；

（2）參與分配清算後的剩餘基金財產；

（3）依法轉讓或者申請贖回其持有的基金份額；

（4）按照規定要求召開基金份額持有人大會或者召集基金份額持有人大會；

（5）出席或者委派代表出席基金份額持有人大會，對基金份額持有人大會審議事項行使表決權；

（6）查閱或者複製公開披露的基金信息資料；

（7）監督基金管理人的投資運作；

（8）對基金管理人、基金託管人、基金服務機構損害其合法權益的行為依法提起訴訟或仲裁；

（9）法律法規及中國證監會規定的和《基金合同》約定的其他權利。

6、基金份額持有人的義務

根據《基金法》、《運作辦法》及其他有關規定，基金份額持有人的義務包括但不限於：

（1）認真閱讀並遵守《基金合同》、招募說明書等信息披露文件；

（2）了解所投資基金產品，了解自身風險承受能力，自主判斷基金的投資價值，自主做出投資決策，自行承擔投資風險；

（3）關注基金信息披露，及時行使權利和履行義務；

（4）交納基金認購、申購款項及法律法規和《基金合同》所規定的費用；

（5）在其持有的基金份額範圍內，承擔基金虧損或者《基金合同》終止的

有限責任；

- （6）不從事任何有損基金及其他《基金合同》當事人合法權益的活動；
- （7）執行生效的基金份額持有人大會的決議；
- （8）返還在基金交易過程中因任何原因獲得的不當得利；
- （9）法律法規及中國證監會規定的和《基金合同》約定的其他義務。

二、基金份額持有人大會召集、議事及表決的程序和規則

基金份額持有人大會由基金份額持有人組成，基金份額持有人的合法授權代表有權代表基金份額持有人出席會議並表決。基金份額持有人持有的每一基金份額擁有平等的投票權。

本基金份額持有人大會不設日常機構。

（一）召開事由

1、當出現或需要決定下列事由之一的，應當召開基金份額持有人大會（法律法規、中國證監會另有規定或基金合同另有約定的除外）：

- （1）終止《基金合同》；
- （2）更換基金管理人；
- （3）更換基金託管人；
- （4）轉換基金運作方式；
- （5）調整基金管理人、基金託管人的報酬標準或提高銷售服務費率；
- （6）變更基金類別；
- （7）本基金與其他基金的合併；
- （8）變更基金投資目標、範圍或策略；
- （9）變更基金份額持有人大會程序；
- （10）基金管理人或基金託管人要求召開基金份額持有人大會；

（11）單獨或合計持有本基金總份額 10%以上（含 10%）基金份額的基金份額持有人（以基金管理人收到提議當日的基金份額計算，下同）就同一事項書面要求召開基金份額持有人大會；

（12）對基金合同當事人權利和義務產生重大影響的其他事項；

（13）法律法規、《基金合同》或中國證監會規定的其他應當召開基金份額持有人大會的事項。

2、在法律法规规定和《基金合同》约定的范围内且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

（1）法律法规要求增加的基金费用的收取；

（2）在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率、销售服务费率或在对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下变更收费方式；

（3）因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；

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

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

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

（7）按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

（二）会议召集人及召集方式

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

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。

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

4、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当

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

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

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

（三）召開基金份額持有人大會的通知時間、通知內容、通知方式

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

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

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

3、如召集人為基金管理人，還應另行書面通知基金託管人到指定地點對表

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

（四）基金份額持有人出席會議的方式

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

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

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

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

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

在同時符合以下條件時，通訊開會的方式視為有效：

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

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

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

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

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

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

（五）议事内容与程序

1、议事内容及提案权

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

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

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

2、议事程序

（1）现场开会

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

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

（2）通讯开会

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

（六）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

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

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持

表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。除基金合同另有约定外，转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》、本基金与其他基金合并以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

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

（七）计票

1、现场开会

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

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

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

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

2、通讯开会

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

（八）生效與公告

基金份額持有人大會的決議，召集人應當自通過之日起5日內報中國證監會備案。

基金份額持有人大會的決議自表決通過之日起生效。

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

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

（九）實施側袋機制期間基金份額持有人大會的特殊約定

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

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

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

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

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

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

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

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

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

同一主侧袋账户内的每份基金份额具有平等的表决权。

（十）本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规的部分，如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人与基金托管人协商一致并提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

三、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

（一）《基金合同》的变更

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

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，自决议生效后两日内在规定媒介公告。

（二）《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：

1、基金份额持有人大会决定终止的；

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

3、《基金合同》约定的其他情形；

4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

（三）基金财产的清算

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

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

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

4、基金财产清算程序：

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

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

（四）清算费用

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

（五）基金财产清算剩余资产的分配

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

（六）基金财产清算的公告

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

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

（七）基金财产清算账册及文件的保存

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

四、争议的处理

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，应经友好协商、调解解决。如经友好协商、调解未能解决的，则任何一方有权将争议提交上海国际经济贸易仲裁委员会，仲裁地点为上海市，按照该会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

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

《基金合同》受中国（为本基金合同之目的，不包括香港、澳门和台湾地区）法律管辖。

五、基金合同存放地和投资人取得基金合同的方式

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

第二十一部分 托管协议内容摘要

一、基金托管协议当事人

（一）基金管理人

名称：国泰基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区浦东大道1200号2层225室

办公地址：上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦15-20层

邮政编码：200082

法定代表人：周向勇

成立时间：1998年3月5日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监基字【1998】5号

组织形式：有限责任公司

注册资本：壹亿壹仟万元人民币

存续期间：持续经营

经营范围：基金设立、基金业务管理，及中国证监会批准的其他业务

（二）基金托管人

名称：平安银行股份有限公司(简称：平安银行)

注册住所：广东省深圳市罗湖区深南东路5047号

办公地址：广东省深圳市福田区益田路5023号

法定代表人：谢永林

成立日期：1987年12月22日

组织形式：股份有限公司

注册资本：19,405,918,198元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监许可[2008]1037号

联系人：刘华栋

联系电话：(0755) 2216 6388

经营范围：办理人民币存、贷、结算、汇兑业务；人民币票据承兑和贴现；

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

二、基金託管人對基金管理人的業務監督和核査

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

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

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

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

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

（1）本基金投資於債券資產的比例不低於基金資產的 80%；

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

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

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

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

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

（7）本基金持有的全部資產支持證券，其市值不得超過基金資產淨值的 20%；

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

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

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

（11）本基金投資於國債期貨的投資限制如下：

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

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

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

4）本基金所持有的債券（不含到期日在一年以內的政府債券）市值和買入、

卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定；

（12）基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

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

（14）本基金管理人管理且由本基金托管人托管的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的15%；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%；完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述比例限制；

（15）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的15%；因证券市场波动、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；

（16）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；

（17）本基金资产总值不超过基金资产净值的140%；

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

（19）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述（3）、（10）、（15）、（16）情形之外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在相关证券可交易的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。法律法规另有规定的从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起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。基金托管人对基金投资的监督与检查自基金合同生效之日起开

始。

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

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

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

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

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

（五）基金託管人根據有關法律法規的規定及基金合同的約定，對基金投資

中期票據進行監督。

（六）基金託管人根據有關法律法規的規定及基金合同的約定，對基金資產淨值計算、各類基金份額的基金份額淨值計算、應收資金到賬、基金費用開支及收入確定、基金收益分配、相關信息披露、基金宣傳推介材料中登載基金業績表現數據等進行監督和核査。

（七）基金託管人發現基金管理人的上述事項及投資指令或實際投資運作違反法律法規、基金合同和本託管協議的規定，應及時以電話提醒或書面提示等方式通知基金管理人限期糾正。基金管理人應積極配合和協助基金託管人的監督和核査。基金管理人收到書面通知後應在下一工作日及時核對並以書面形式給基金託管人發出回函，就基金託管人的合理疑義進行解釋或舉證，說明違規原因及糾正期限，並保證在規定期限內及時改正。在上述規定期限內，基金託管人有权隨時對通知事項進行復査，督促基金管理人改正。基金管理人對基金託管人通知的違規事項未能在限期內糾正的，基金託管人應報告中國證監會。

（八）基金管理人應有義務配合和協助基金託管人依照法律法規、基金合同和本託管協議對基金業務執行核査。對基金託管人發出的書面提示，基金管理人應在規定期限內答復並改正，或就基金託管人的合理疑義進行解釋或舉證；對基金託管人按照法律法規、基金合同和本託管協議的要求需向中國證監會報送基金監督報告的事項，基金管理人應積極配合提供相關數據資料和制度等。

（九）若基金託管人發現基金管理人依據交易程序已經生效的指令違反法律、行政法規和其他有關規定，或者違反基金合同約定的，應當立即通知基金管理人，由此造成的損失由基金管理人承擔，基金託管人在履行其通知義務後，予以免責。

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

三、基金管理人對基金託管人的業務核査

（一）基金管理人對基金託管人履行託管職責情況進行核査，核査事項包括基金託管人安全保管基金財產、開設基金財產的資金賬戶、證券賬戶、期貨結算

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

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

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

四、基金財產的保管

（一）基金財產保管的原則

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

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

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

（二）基金募集期間及募集資金的驗資

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

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

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

（三）基金銀行賬戶的開立和管理

1. 基金託管人應負責本基金的銀行賬戶的開設和管理。

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

3. 基金銀行賬戶的開立和管理應符合銀行業監督管理機構的有關規定。

（四）基金證券賬戶和結算備付金賬戶的開立和管理

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

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

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

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

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

（五）债券托管专户的开设和管理

基金合同生效后，基金托管人根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司、银行间清算所股份有限公司的有关规定，在中央国债登记结算有限责任公司、银行间清算所股份有限公司根据有关规定以本基金的名义为基金开立债券托管账户，并代表本基金进行银行间市场债券的结算。基金管理人和基金托管人共同代表本基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议。

（六）其他账户的开立和管理

1. 因业务发展需要而开立的其他账户，可以根据法律法规和基金合同的规定开立，在基金管理人和基金托管人商议后由基金托管人负责开立。新账户按有关规定使用并管理。

2. 法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

（七）基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的有关实物证券等有价凭证由基金托管人存放于基金托管人的保管库，也可存入中央国债登记结算有限责任公司、中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司或票据营业中心的代保管库，保管凭证由基金托管人持有。实物证券等有价凭证的购买和转让，由基金管理人和基金托管人共同

办理。基金托管人对由基金托管人以外机构实际有效控制的证券不承担保管责任。

（八）与基金财产有关的重大合同的保管

与基金财产有关的重大合同的签署，由基金管理人负责。由基金管理人代表基金签署的、与基金财产有关的重大合同的原件分别由基金管理人、基金托管人保管。除本协议另有规定外，基金管理人代表基金签署的与基金财产有关的重大合同包括但不限于基金年度审计合同、基金信息披露协议及基金投资业务中产生的重大合同，基金管理人应保证基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。重大合同的保管期限不少于法律法规规定的最低期限。

五、基金资产净值计算和会计核算

（一）基金资产净值的计算、复核与完成的时间及程序

1. 基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

任一类基金份额净值是按照每个工作日闭市后，该类基金份额的基金资产净值除以当日该类基金份额的余额数量计算，精确到0.0001元，小数点后第5位四舍五入。基金管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人于每个工作日计算基金资产净值及各类基金份额净值，并按规定公告。

2. 复核程序

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

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

（二）基金资产估值方法和特殊情形的处理

1. 估值对象

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

2. 估值方法

（1）证券交易所上市的有价证券的估值

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

2) 交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；

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

4) 交易所上市交易的可转换债券以每日收盘价作为估值全价；

5) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所市场挂牌转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值。在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

6) 对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的固定收益品种，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为估值日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表估值日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认估值日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，应采用估值技术确定其公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

（2）处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

2) 首次公开发行未上市的股票、债券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

3) 在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、

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

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

（4）同一证券同时在两个或两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。

（5）因持有股票而享有的配股权，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

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

（7）持有的银行定期存款或通知存款以本金列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入。

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

（9）本基金投资存托凭证的估值核算依照境内上市交易的股票执行，国家有最新规定的，按其规定进行估值。

（10）估值涉及到港币等主要货币对人民币汇率的，应当以基金估值日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价为准。

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

应的估值调整。

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

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

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

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

3. 特殊情形的处理

基金管理人、基金托管人按估值方法的第（13）项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

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

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

（三）基金份额净值错误的处理方式

1. 当某一类基金份额净值小数点后4位以内（含第4位）发生估值错误时，视为该类基金份额净值错误；基金份额净值计算出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；错误偏差达到该类基金份额净值的0.25%时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到该类基金份额净值的0.5%时，基金管理人应当公告，并报中国证监会备案；当发生净值计算错误时，由基金管理人负责处理，由此给

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

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

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

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

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

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

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

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

5. 前述內容如法律法規或者監管部門另有規定的，從其規定處理。如果行

業另有通行做法，雙方當事人應本着平等和保護基金份額持有人利益的原則進行協商。

（四）暫停估值與公告基金份額淨值的情形

1. 基金投資所涉及的證券/期貨交易市場遇法定節假日或因其他原因暫停營業時；

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

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

4. 法律法規、中國證監會和基金合同認定的其他情形。

（五）基金會計制度

按國家有關部門規定的會計制度執行。

（六）基金賬冊的建立

基金管理人進行基金會計核算並編制基金財務會計報告。基金管理人獨立地設置、記錄和保管本基金的全套賬冊。基金託管人按規定製作相關賬冊並與基金管理人核對。若基金管理人和基金託管人對會計處理方法存在分歧，應以基金管理人的處理方法為準。若當日核對不符，暫時無法查找到錯賬的原因而影響到基金資產淨值的計算和公告的，以基金管理人的賬冊為準。

（七）基金財務報表與報告的編制和復核

1. 財務報表的編制

基金財務報表由基金管理人編制，基金託管人復核。

2. 報表復核

基金託管人在收到基金管理人編制的基金財務報表後，進行獨立的復核。核對不符時，應及時通知基金管理人共同查出原因，進行調整，直至雙方數據完全一致。

3. 財務報表的編制與復核時間安排

1) 報表的編制

基金合同生效後，基金招募說明書的信息發生重大變更的，基金管理人應當在三個工作日內，更新基金招募說明書並登載在規定網站上，基金招募說明書其

他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次；基金产品资料概要的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金产品资料概要并登载在规定网站及基金销售机构网站或营业网点，基金产品资料概要其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。

基金管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载在规定网站上，并将年度报告提示性公告登载在规定报刊上。基金管理人应当在上半年结束之日起两个月内，编制完成基金中期报告，将中期报告登载在规定网站上，并将中期报告提示性公告登载在规定报刊上。基金管理人应当在季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，将季度报告登载在规定网站上，并将季度报告提示性公告登载在规定报刊上。基金合同生效不足两个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。

2) 报表的复核

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

基金管理人应留足充分的时间，便于基金托管人复核相关报表及报告。

（八）基金管理人应在编制季度报告、中期报告或者年度报告之前及时向基金托管人提供基金业绩比较基准的基础数据和编制结果。

六、基金份额持有人名册的保管

基金份额持有人名册至少应包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。基金份额持有人名册由基金登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，基金管理人和基金托管人应分别保管基金份额持有人名册，保存期不少于法律法规规定的最低期限。如不能妥善保管，则按相关法规承担责任。

基金托管人依法编制中期报告和年度报告前有向基金管理人搜集资料的权利，基金管理人应将有关资料送交基金托管人，不得无故拒绝或延误提供，并保证其的真实性、准确性和完整性。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。

七、争议解决方式

因本协议产生或与之相关的争议，双方当事人应通过协商、调解解决，协商、

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

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

本协议受中国（为本协议之目的，不包括香港、澳门和台湾地区）法律管辖。

八、托管协议的变更、终止与基金财产的清算

（一）托管协议的变更程序

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

（二）基金托管协议终止出现的情形

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

（三）基金财产的清算

1. 基金财产清算小组

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

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

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

2. 基金财产清算程序

基金合同终止，应当按法律法规和基金合同的有关规定对基金财产进行清算。

基金財產清算程序主要包括：

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

（四）清算費用

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

（五）基金財產按下列順序清償：

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

基金財產未按前款 1) -3) 項規定清償前，不分配給基金份額持有人。

（六）基金財產清算的公告

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

（七）基金財產清算賬冊及文件的保存

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

第二十二部分 对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务。以下是主要的服务内容，基金管理人根据基金份额持有人的需要和市场的变化，有权增加、修改这些服务项目。

一、客户服务专线

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

二、客户投诉及建议受理服务

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

三、短信提示发送服务

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

四、电子邮件电子刊物发送服务

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

五、联系基金管理人

- 1、网址：www.gtfund.com
- 2、电子邮箱：service@gtfund.com
- 3、客户服务热线：400-888-8688（全国免长途话费），021-31089000
- 4、客户服务传真：021-31081700
- 5、基金管理人办公地址：上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦15-20层
邮编：200082

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

第二十三部分 其他应披露事项

公告名称	披露媒介	日期
国泰安瓊债券型证券投资基金基金经理变更公告	《上海证券报》	2024/1/24
国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《中国证券报》	2024/3/27
国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《中国证券报》	2024/7/25
国泰安瓊债券型证券投资基金基金经理变更公告	《上海证券报》	2024/8/30

第二十四部分 招募说明书存放及查阅方式

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

第二十五部分 备查文件

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

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

国泰基金管理有限公司

二零二四年十二月十二日