

**财通多策略升级混合型证券投资基金  
(LOF)更新招募说明书  
(2023年07月28日公告)**

**基金管理人：财通基金管理有限公司**

**基金托管人：中国工商银行股份有限公司**

## 重要提示

本基金经2015年12月29日中国证券监督管理委员会证监许可[2015]3121号文准予注册募集。本基金基金合同于2016年3月9日正式生效。本基金自2017年9月9日起转为上市开放式基金(LOF)。基金名称变更为“财通多策略升级混合型证券投资基金(LOF)”。本基金于2022年3月3日,增设收取销售服务费的C类份额,基金合同及托管协议名称及有关条款亦做相应变更。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册,但中国证监会对本基金募集申请的注册,并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

投资有风险,投资者认购或申购本基金时应认真阅读本招募说明书,全面认识本基金产品的风险收益特征,充分考虑投资者自身的风险承受能力,并对于认购(或申购)基金的意愿、时机、数量等投资行为做出独立决策。基金管理人提醒投资者基金投资要承担相应风险,包括市场风险、管理风险、估值风险、流动性风险、本基金的特定风险和其他风险等。本基金可以投资科创板股票,会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险,包括流动性风险、退市风险和投资集中风险等。

本基金是混合型证券投资基金,其预期收益和风险水平高于债券型基金产品和货币市场基金、低于股票型基金产品,属于中高风险、中高预期收益的基金产品。基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动,投资者根据所持有的基金份额享受基金收益,同时承担相应的投资风险。

本基金的投资范围包括存托凭证,面临存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险、与存托凭证发行机制相关的风险等。

基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则,在投资者作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行负责。

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，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。

本招募说明书本次更新主要涉及降低管理费、托管费，并已对相应内容做出了更新。本招募说明书所载内容截止日为2023年7月27日，有关财务数据截止日为2023年3月31日。本招募说明书所载的财务数据未经审计。

## 目 录

一、绪 言 .....	4
二、释 义 .....	5
三、基金管理人 .....	11
四、基金托管人 .....	21
五、相关服务机构 .....	28
六、基金的募集 .....	61
七、基金合同的生效 .....	63
八、基金份额的上市交易 .....	64
九、基金份额的申购与赎回 .....	66
十、基金的投资 .....	80
十一、基金的业绩 .....	95
十二、基金的财产 .....	99
十三、基金资产估值 .....	100
十四、基金的收益与分配 .....	105
十五、基金费用与税收 .....	107
十六、基金的会计与审计 .....	110
十七、基金的信息披露 .....	111
十八、侧袋机制 .....	119
十九、风险揭示 .....	122
二十、基金合同的变更、终止与基金财产的清算 .....	129
二十一、基金合同的内容摘要 .....	132
二十二、基金托管协议的内容摘要 .....	151
二十三、对基金份额持有人的服务 .....	167
二十四、其他应披露事项 .....	170
二十五、招募说明书的存放及查阅方式 .....	174
二十六、备查文件 .....	175

## 一、绪 言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性风险管理规定》”)等相关法律法规和《财通多策略升级混合型证券投资基金(LOF)基金合同》(以下简称“《基金合同》”)编写。

本招募说明书阐述了财通多策略升级混合型证券投资基金(LOF)的投资目标、策略、风险、费率等与投资者投资决策有关的全部必要事项,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

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

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

## 二、释 义

在本招募说明书中,除非文意另有所指,下列词语或简称具有如下含义:

1、基金或本基金:指财通多策略升级混合型证券投资基金或财通多策略升级混合型证券投资基金(LOF)

2、基金管理人:指财通基金管理有限公司

3、基金托管人:指中国工商银行股份有限公司

4、基金合同:指《财通多策略升级混合型证券投资基金(LOF)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《财通多策略升级混合型证券投资基金(LOF)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:指《财通多策略升级混合型证券投资基金(LOF)招募说明书》及其更新

7、基金产品资料概要:指《财通多策略升级混合型证券投资基金(LOF)基金产品资料概要》及其更新

8、基金份额发售公告:指《财通多策略升级混合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2012年12月28日经第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议通过,自2013年6月1日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订

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

12、《信息披露办法》：指中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1 日实施的，并经 2020 年 3 月 20 日中国证监会《关于修改部分证券期货规章的决定》修正的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

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

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

15、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

16、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会

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

18、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

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

20、合格境外投资者：指符合《合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者境内证券期货投资管理办法》及相关法律法规规定使用来自境外的资金进行境内证券期货投资的境外机构投资者，包括合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者

21、投资人：指个人投资者、机构投资者和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的合称

22、基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人

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

24、销售机构：指财通基金管理有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议，代为办理基金销售业务的机构

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

26、登记机构：指办理登记业务的机构。本基金的注册登记结算机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金管理人也可以自行或委托其他机构担任登记结算机构

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

28、基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构买卖基金的基金份额变动及结余情况的账户

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

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

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

32、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

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

34、T日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日



- 35、T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日(不包含 T 日)
- 36、开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日
- 37、开放时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段
- 38、《业务规则》：指上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司、财通基金管理有限公司、基金销售机构的相关业务规则
- 39、认购：指在基金募集期内，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为
- 40、申购：指基金合同生效后，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为
- 41、赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为
- 42、基金转换：指基金份额持有人按照基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金基金份额的行为
- 43、场内：通过具有相应业务资格的上海证券交易所会员单位利用上海证券交易所交易系统办理基金份额的认购、申购、赎回和上市交易等业务的场所。通过该等场所办理基金份额的认购、申购、赎回也称为场内认购、场内申购、场内赎回
- 44、场外：指上海证券交易所交易系统外的销售机构利用其自身柜台或者其他交易系统办理基金份额认购、申购和赎回业务的基金销售机构和场所。通过该等场所办理基金份额的认购、申购和赎回也称为场外认购、场外申购和场外赎回
- 45、转托管：指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基金份额销售机构的操作。转托管包括系统内转托管和跨系统转托管
- 46、注册登记系统：指中国证券登记结算有限责任公司开放式基金注册登记系统
- 47、证券登记结算系统：指中国证券登记结算有限责任公司上海分公司证券登记结算系统

48、场外份额：指登记在注册登记系统下的基金份额

49、场内份额：指登记在证券登记结算系统下的基金份额

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

51、元：指人民币元

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

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

54、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

55、各类基金份额净值：指计算日各类别基金资产净值除以计算日该类基金份额总数

56、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

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

58、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

59、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。

60、封闭期：本基金的封闭期为基金合同生效之日至 18 个月后的对应日（若该日为非工作日，则为该日之前的最后一个工作日）之间的期间。本

基金在封闭期内不办理申购与赎回业务

61、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

62、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

63、销售服务费：指从 C 类基金份额的基金资产中计提的，用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务的费用

64、基金份额类别：指本基金根据销售费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别，各基金份额类别分别设置代码，分别计算和公告各类基金份额净值和各类基金份额累计净值

65、A 类基金份额：指在投资者申购基金时收取申购费用而不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额

66、C 类基金份额：指在投资者申购基金份额时不收取申购费用而是从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额

67、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

### 三、基金管理人

#### (一) 基金管理人概况

本基金管理人为财通基金管理有限公司，基本信息如下：

名称：财通基金管理有限公司

住所：上海市虹口区吴淞路619号505室

办公地址：上海市银城中路68号时代金融中心43/45楼

设立日期：2011年6月21日

法定代表人：吴林惠

组织形式：有限责任公司

注册资本：人民币贰亿元

联系人：何亚玲

联系电话：021-2053 7888

股权结构：

股 东	出资额 (万元人民币)	出资比例 (%)
财通证券股份有限公司	8,000	40
杭州市实业投资集团有限公司	6,000	30
浙江瀚叶股份有限公司	6,000	30
合 计	20,000	100

#### (二) 主要人员情况

##### 1、董事会成员：

吴林惠先生，董事长，会计学本科，经济师。历任财通证券有限责任公司经纪业务总部副总经理兼机构运营部副总经理（主持工作）、经纪业务总

部副总经理兼机构运营部总经理，财通证券股份有限公司经纪业务总部副总经理兼机构运营部总经理、运营总监兼机构管理部总经理、运营总监兼运营中心总经理。现任财通证券股份有限公司运营总监，财通基金管理有限公司党委书记、董事长。

王开国先生，独立董事，经济学博士，高级经济师。历任国家国有资产管理局科研所应用室副主任、政策法规司政策研究处处长、科研所副所长；海通证券有限公司副总经理，党组书记、总经理，党组书记、董事长兼总经理，党委书记、董事长兼总经理，党委书记、董事长。现任上海中平国瑀资产管理有限公司董事长，上海金仕达软件科技股份有限公司董事，上海大众公用事业(集团)股份有限公司独立董事、中梁控股集团有限公司独立董事、绿地控股集团股份有限公司独立董事，财通基金管理有限公司独立董事。

李有星先生，独立董事，经济学博士。历任浙江大学金融研究院研究员、首席专家，浙江省法学会首席法律咨询专家，万事利丝绸股份公司独立董事等。现任浙江大学光华法学院教授、博士生导师，浙江大学金融科技研究院副院长，中国法学会证券法学研究会副会长，浙江省法学会金融法学研究会会长，浙江嘉益保温科技股份有限公司独立董事，河北中瓷电子科技股份有限公司独立董事，浙江天能集团股份有限公司独立董事，起步股份有限公司独立董事，浙江金晟环保股份有限公司等独立董事，金华银行股份有限公司独立董事，财通基金管理有限公司独立董事。

朱颖女士，独立董事，会计学硕士，正高级会计师。中国注册会计师协会资深会员、中国注册会计师协会专家库专家，财政部会计领军人才。历任立信会计师事务所审计业务部门经理、合伙人，现任立信会计师事务所高级合伙人，上海立信会计金融学院兼职教授及硕士生导师，东华大学硕士生导师，上海财经大学硕士生导师，上海破产管理人协会监事长，上海市企业清算协会副会长，上海金仕达软件科技股份有限公司独立董事，财通基金管理有限公司独立董事。

徐春庭先生，董事，工学本科，会计师。历任武警绍兴市支队司令部见习参谋、副连职参谋；武警浙江省总队后勤部财务处副连职助理员、助理会

计师、会计师；浙江财政证券公司稽核部职员、经理助理、富阳营业部副总经理；财通证券经纪有限责任公司富阳市心北路证券营业部副总经理（主持工作）、稽核部副经理、计划财务部副经理、副总经理；财通证券有限责任公司计划财务部副总经理、清算存管中心（筹）负责人（主持工作）、副总经理（主持工作）、总经理；财通证券股份有限公司金融衍生品部（筹）主要负责人、总经理；财通证券股份有限公司清算存管中心总经理。现任财通基金管理有限公司党委副书记、公司董事、总经理。

程欣先生，董事，审计学本科，中级审计师。历任金鱼集团风控审计部职员、杭实集团审计部职员、副部长、杭实集团审计部、风险管理部（法律事务部）副部长。现任杭实集团风控法务部副部长，杭实产投控股（杭州）集团有限公司董事，西子清洁能源装备制造股份有限公司董事，财通基金管理有限公司现任董事。

吴燕女士，董事，管理学本科，中级会计师。历任苏州中达联合会计师事务所审计员、江苏亨通光电股份有限公司会计员、审计主管、亨通集团有限公司财务经理、财务规划部总监。现任江苏亨通光电股份有限公司财务总监、浙江瀚叶股份有限公司董事，财通基金管理有限公司现任董事。

傅子龙先生，职工董事，法学硕士，经济师、政工师。历任国核自仪系统工程有限责任公司党群工作部党群管理岗、工会委员、团委副书记；国核商业保理股份有限公司人力资源与党群工作部党建经理、工会委员；现任公司党群工作部总经理助理（主持工作），财通基金管理有限公司职工董事。

## 2、职工监事：

殷平先生，上海社会科学院产业经济学硕士。历任中国建设银行上海分行个人金融部产品经理，上投摩根基金管理有限公司产品研发部总监。2016年11月加入财通基金管理有限公司，现任公司职工监事、战略与产品部总经理。

## 3、经营管理层人员：

徐春庭先生，董事，总经理（简历同上）。

汪海先生，新加坡管理大学财富管理硕士。历任中国建设银行上海分

行徐汇支行计划财务部科员、经理助理，个人金融部客户经理、经理；中国建设银行上海分行财富管理与私人银行部产品经理、个人金融部副总经理。2015年6月加入财通基金管理有限公司，曾任公司总经理助理，现任公司党委委员、副总经理。

吴明建先生，浙江财经学院会计学硕士。历任财通证券股份有限公司计划财务部资金管理部副经理、经理。2019年12月加入财通基金管理有限公司，现任公司党委委员、副总经理、财务负责人，上海财通资产管理有限公司董事长。

刘为臻先生，复旦大学工商管理硕士。历任国泰君安证券股份有限公司信息技术总部系统开发与维护员，国联安基金管理有限公司信息技术部副总监，德邦基金管理有限公司运作保障部总经理。2018年10月加入财通基金管理有限公司，现任公司首席信息官、运营总监。

#### 4、督察长：

方斌先生，浙江大学法律学硕士。历任浙江天健会计师事务所项目经理，中国证监会浙江监管局主任科员，中融基金管理有限公司总经理助理，浙江浙商证券资产管理有限公司合规风控副总监、合规总监兼首席风险官。2022年8月加入财通基金管理有限公司，现任公司督察长，上海财通资产管理有限公司董事。

#### 5、基金经理

现任基金经理：

沈犁先生，上海交通大学工商管理硕士。历任普华永道中天会计师事务所高级审计员，中国国际金融股份有限公司研究员，交银施罗德基金管理有限公司高级研究员，惠理集团高级分析员。2020年8月加入财通基金管理有限公司，曾任基金投资部基金经理助理，现任基金投资部基金经理。

历任基金经理：

2017年11月24日至2021年4月14日：

谈洁颖女士，中国人民大学工商企业管理专业。历任北京大学光华管理学院从事教育管理工作，历任长信基金管理有限责任公司研究助理、研究员、

投资经理助理、专户投资经理、基金经理、投资部副总监、总监，公司投资决策委员会委员。2017年4月至2021年4月就职于财通基金管理有限公司。

2016年3月9日至2019年7月11日：

姚思劼先生，复旦大学理学学士、管理学硕士。2011年7月至2019年7月就职于财通基金管理有限公司。

#### 6、投资决策委员会成员：

徐春庭先生，董事、总经理；

金梓才先生，总经理助理、权益投资总监、基金投资部总经理、基金经理；

马慧祎女士，集中交易部总经理；

朱海东先生，量化投资部副总经理（主持工作）、基金经理；

罗晓倩女士，固收投资部总经理助理、基金经理。

7、上述人员之间不存在近亲属关系。

### （三）基金管理人的职责

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

2、办理基金备案手续。

3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资。

4、按照《基金合同》的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益。

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告。

6、编制季度、中期和年度基金报告。

7、计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回价格。

8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项。

9、按照规定召集基金份额持有人大会。

10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料。

11、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实



施其他法律行为。

12、法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他职责。

#### （四）基金管理人的承诺

1、基金管理人承诺严格遵守现行有效的相关法律法规、《基金合同》和中国证监会的有关规定，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反现行有效的有关法律法规、《基金合同》和中国证监会有关规定的行为发生。

2、基金管理人承诺严格遵守《基金法》及有关法律法规，建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止下列行为发生：

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

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

- （1）越权或违规经营；
- （2）违反《基金合同》或《托管协议》；
- （3）故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益；
- （4）在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；
- （5）拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
- （6）玩忽职守、滥用职权；

（7）违反现行有效的有关法律、法规、规章、《基金合同》和中国证监会的有关规定，泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密和尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；

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

- (9) 贬损同行，以抬高自己；
- (10) 以不正当手段谋求业务发展；
- (11) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；
- (12) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
- (13) 其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

#### (五) 基金经理的承诺

1、依照有关法律法规和《基金合同》的规定，本着谨慎勤勉的原则为基金份额持有人谋取最大利益。

2、不利用职务之便为自己及其代理人、受雇人或任何第三人谋取利益。

3、不违反现行有效的有关法律法规、《基金合同》和中国证监会的有关规定，泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息。

4、不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

#### (六) 基金管理人的风险管理和内部控制制度

##### 1、内部控制的原则

(一) 健全性原则。内部控制机制覆盖公司的各项业务、各个部门和各级岗位，并渗透到决策、执行、监督和反馈等各个环节。

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

(三) 独立性原则。公司各机构、部门和岗位职责应当保持相对独立，公司基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离。

(四) 相互制约原则。公司内部部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡。

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

## 2、内部控制的主要内容

### (1) 控制环境

公司建立健全的法人治理结构，充分发挥独立董事和监事的监督职能，严禁不正当关联交易、利益输送和内部人控制现象的发生，保护投资者利益和公司合法权益。

公司管理层树立内控优先的风险管理理念，培养全体员工的风险防范意识，建立风险控制优先、风险控制人人有责、一线人员第一责任的公司内控文化，保证全体员工及时了解国家法律法规和公司规章制度，使风险意识贯穿到公司各个部门、各个岗位和各个环节。

公司建立决策科学、运营规范、管理高效的运行机制，确保公司各项决策、决议的执行中，“执行—复核”机制贯穿全程。各部门及岗位有明确的授权分工、工作职责和业务流程，通过重要凭据传递及信息沟通制度，实现相关部门、相关岗位之间的监督制衡。

公司建立有效的人力资源管理制度，健全激励约束机制。通过法律法规培训、制度教育、执业操守教育和行为准则教育等，确保公司人员了解与从业有关的法规与监管部门规定，熟知公司相关规章制度、岗位职责与操作流程，具备与岗位要求相适应的操守和专业胜任能力。

### (2) 风险评估

公司建立科学严密的风险评估体系，对公司的业务风险、人员风险、法律风险和财务风险等进行识别、评估和分析，及时防范和化解风险。通过科学的风险量化技术和严格的风险限额控制对投资风险实现定量分析和管理。通过收集与投资组合相关的会计和市场数据，建立一个投资风险测评与绩效评估的信息技术平台。由风险管理部和金融工程小组定期向风险控制委员会和投资决策委员会提交风险测评报告。

### (3) 内控机制

公司全部的经营管理决策，均按照明确成文的决策程序与规定进行，防止超越或违反决策程序的随意决策行为的发生。

操作层面上，公司依据自身经营特点，以各岗位目标责任制为基础形成第一道内控防线，以相关部门、相关岗位之间相互监督制衡形成第二道内控防线，以法律合规部、风险管理部、风险控制委员会、督察长对公司各机构、各部门、各岗位、各项业务全面实施监督反馈形成第三道内控防线，并建立内部违规违章行为的处罚机制。同时，按照分级管理、规范操作、有限授权、业务跟踪的原则，制定公司授权管理制度，并严格区分业务授权与管理授权。

#### （4）信息与沟通

公司建立了内部办公自动化信息系统与业务汇报体系，通过建立有效的信息交流渠道，保证公司员工及各级管理人员可以充分了解与其职责相关的信息，保证信息及时送达适当的人员进行处理。

#### （5）监督与内部稽核

本公司设立了独立于各业务部门的法律合规部，其中监察稽核人员履行内部稽核职能，检查、评价公司内部控制制度合理性、完备性和有效性，监督公司内部控制制度的执行情况，揭示公司内部管理及基金运作中的相关风险，及时提出改进意见，促进公司内部管理制度有效地执行。监察稽核人员具有相对的独立性，定期不定期出具监察稽核报告。

#### （6）风险管理

风险管理的工作覆盖到全公司所有业务环节，以风险控制委员会为平台，从事前、事中、事后三个层面进行全面的风险管理。事前风险管理主要通过风险管理部门介入公司的业务流程检查、参加业务部门专题会议和进行访谈的方式，不定期组织员工开展风险文化教育活动来提升风险防范意识；事中风险控制则是对相关业务进行全程的跟踪，以及实现业务人员风险控制、业务操作规范化、精细化来进行；事后风险管理则主要通过风险事件的

分析与总结来开展。公司层面的风险管理工作包括对公司投资风险、业务风险、操作风险、信息系统风险、法律风险、合规风险的系统评估，对公司层面的风险进行详细的梳理，对发现的问题和风险，及时进行解决。在投资风险环节，针对不同产品所具有的特定投资风险进行量化研究和分析，超过阈值由风险管理部门及时提醒业务部门，并根据风险管理制度的规定，报告相关责任人；在业务风险环节，协助营销部门和产品研究部门前瞻性地对新产品的风险和结构进行规划和分析，对发现的问题及时与业务部门进行沟通和了解，切实解决实际业务中所遇到的困难和问题；在操作风险环节，对公司层面的制度、流程、系统和项目等方面，建立并完善风险控制机制，发现和解决后台运行中存在的问题，加强评估公司信息系统和信息系统安全风险。

风险管理工作主要由督察长管辖的风险管理部及法律合规部进行开展，在组织结构及报告制度上均独立于公司日常的投资、运营部门。风险报告由风险管理部及法律合规部进行调查取证和撰写签发，能保证报告独立性与客观公正。

### 3、基金管理人关于内部控制的声明

(1) 本公司确知建立、实施和维持内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任。

(2) 上述关于内部控制的披露真实、准确。

(3) 本公司承诺将根据市场环境变化及公司的发展不断完善内部控制制度。

## 四、基金托管人

### （一）基金托管人基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

成立时间：1984 年 1 月 1 日

法定代表人：陈四清

注册资本：人民币 35,640,625.7089 万元

联系电话：010-66105799

联系人：郭明

### （二）主要人员情况

截至 2022 年 12 月，中国工商银行资产托管部共有员工 213 人，平均年龄 34 岁，95% 以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

### （三）基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自 1998 年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本养老保险、企业年金基金、QFII 资产、QDII 资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII 专户资产、ESCROW 等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至

2022年12月，中国工商银行共托管证券投资基金1337只。自2003年以来，本行连续二十年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的86项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

#### （四）基金托管人的内部控制制度

中国工商银行资产托管部自成立以来，各项业务飞速发展，始终保持在资产托管行业的优势地位。这些成绩的取得，是与资产托管部“一手抓业务拓展，一手抓内控建设”的做法是分不开的。资产托管部非常重视改进和加强内部风险管理工作，在积极拓展各项托管业务的同时，把加强风险防范和控制的力度，精心培育内控文化，完善风险控制机制，强化业务项目全过程风险管理作为重要工作来做。从2005年至今共十六次顺利通过评估组织内部控制和安全措施最权威的ISAE3402审阅，全部获得无保留意见的控制及有效性报告。充分表明独立第三方对我行托管服务在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可，也证明中国工商银行托管服务的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨，达到国际先进水平。目前，ISAE3402审阅已经成为年度化、常规化的内控工作手段。”

##### 1、内部风险控制目标

保证业务运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，强化和建立守法经营、规范运作的经营思想和经营风格，形成一个运作规范化、管理科学化、监控制度化的内控体系；防范和化解经营风险，保证托管资产的安全完整；维护持有人的权益；保障资产托管业务安全、有效、稳健运行。

保证业务运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，强化和建立守法经营、规范运作的经营思想和经营风格，形成一个运作规范化、管理科学化、监控制度化的内控体系；防范和化解经营风险，保证托管资产的安全完整；维护持有人的权益；保障资产托管业务安全、有效、稳健运行。

##### 2、内部风险控制组织结构

中国工商银行资产托管业务内部风险控制组织结构由中国工商银行稽核监察部门（内控合规部、内部审计局）、资产托管部内设风险控制处及资产托管部各业务处室共同组成。总行稽核监察部门负责制定全行风险管理政策，对各业务部门风险控制工作进行指导、监督。资产托管部内部设置专门负责稽核监察工作的内部风险控制处，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，对业务的运行独立行使稽核监察职权。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

中国工商银行资产托管业务内部风险控制组织结构由中国工商银行稽核监察部门（内控合规部、内部审计局）、资产托管部内设风险控制处及资产托管部各业务处室共同组成。总行稽核监察部门负责制定全行风险管理政策，对各业务部门风险控制工作进行指导、监督。资产托管部内部设置专门负责稽核监察工作的内部风险控制处，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，对业务的运行独立行使稽核监察职权。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

### 3、内部风险控制原则

（1）合法性原则。内控制度应当符合国家法律法规及监管机构的监管要求，并贯穿于托管业务经营管理活动的始终。

（2）完整性原则。托管业务的各项经营管理活动都必须有相应的规范程序和监督制约；监督制约应渗透到托管业务的全过程和各个操作环节，覆盖所有的部门、岗位和人员。

（3）及时性原则。托管业务经营活动必须在发生时能准确及时地记录；按照“内控优先”的原则，新设机构或新增业务品种时，必须做到已建立相关的规章制度。

（4）审慎性原则。各项业务经营活动必须防范风险，审慎经营，保证基金资产和其他委托资产的安全与完整。

（5）有效性原则。内控制度应根据国家政策、法律及经营管理的需要适时修改完善，并保证得到全面落实执行，不得有任何空间、时限及人员的例外。



(6) 独立性原则。设立专门履行托管人职责的管理部门；直接操作人员和控制人员必须相对独立，适当分离；内控制度的检查、评价部门必须独立于内控制度的制定和执行部门。

(1) 合法性原则。内控制度应当符合国家法律法规及监管机构的监管要求，并贯穿于托管业务经营管理活动的始终。

(2) 完整性原则。托管业务的各项经营管理活动都必须有相应的规范程序和监督制约；监督制约应渗透到托管业务的全过程和各个操作环节，覆盖所有的部门、岗位和人员。

(3) 及时性原则。托管业务经营活动必须在发生时能准确及时地记录；按照“内控优先”的原则，新设机构或新增业务品种时，必须做到已建立相关的规章制度。

(4) 审慎性原则。各项业务经营活动必须防范风险，审慎经营，保证基金资产和其他委托资产的安全与完整。

(5) 有效性原则。内控制度应根据国家政策、法律及经营管理的需要适时修改完善，并保证得到全面落实执行，不得有任何空间、时限及人员的例外。

(6) 独立性原则。设立专门履行托管人职责的管理部门；直接操作人员和控制人员必须相对独立，适当分离；内控制度的检查、评价部门必须独立于内控制度的制定和执行部门。

#### 4、内部风险控制措施实施

(1) 严格的隔离制度。资产托管业务与传统业务实行严格分离，建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度，并采取了良好的防火墙隔离制度，能够确保资产独立、环境独立、人员独立、业务制度和管理独立、网络独立。

(2) 高层检查。主管行领导与部门高级管理层作为工行托管业务政策和策略的制定者和管理者，要求下级部门及时报告经营管理情况和特殊情况，以检查资产托管部在实现内部控制目标方面的进展，并根据检查情况提出内部控制措施，督促职能管理部门改进。

(3) 人事控制。资产托管部严格落实岗位责任制, 建立“自控防线”、“互控防线”、“监控防线”三道控制防线, 健全绩效考核和激励机制, 树立“以人为本”的内控文化, 增强员工的责任心和荣誉感, 培育团队精神和核心竞争力。并通过进行定期、定向的业务与职业道德培训、签订承诺书, 使员工树立风险防范与控制理念。

(4) 经营控制。资产托管部通过制定计划、编制预算等方法开展各种业务营销活动、处理各项事务, 从而有效地控制和配置组织资源, 达到资源利用和效益最大化目的。

(5) 内部风险管理。资产托管部通过稽核监察、风险评估等方式加强内部风险管理, 定期或不定期地对业务运作状况进行检查、监控, 指导业务部门进行风险识别、评估, 制定并实施风险控制措施, 排查风险隐患。

(6) 数据安全控制。我们通过业务操作区相对独立、数据和传真加密、数据传输线路的冗余备份、监控设施的运用和保障等措施来保障数据安全。

(7) 应急准备与响应。资产托管业务建立专门的灾难恢复中心, 制定了基于数据、应用、操作、环境四个层面的完备的灾难恢复方案, 并组织员工定期演练。为使演练更加接近实战, 资产托管部不断提高演练标准, 从最初的按照预订时间演练发展到现在的“随机演练”。从演练结果看, 资产托管部完全有能力在发生灾难的情况下两个小时内恢复业务。

(1) 严格的隔离制度。资产托管业务与传统业务实行严格分离, 建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度, 并采取了良好的防火墙隔离制度, 能够确保资产独立、环境独立、人员独立、业务制度和管理独立、网络独立。

(2) 高层检查。主管行领导与部门高级管理层作为中国工商银行托管业务政策和策略的制定者和管理者, 要求下级部门及时报告经营管理情况和特别情况, 以检查资产托管部在实现内部控制目标方面的进展, 并根据检查情况提出内部控制措施, 督促职能管理部门改进。

(3) 人事控制。资产托管部严格落实岗位责任制, 建立“自控防线”、“互控防线”、“监控防线”三道控制防线, 健全绩效考核和激励机制, 树立“以人

为本”的内控文化，增强员工的责任心和荣誉感，培育团队精神和核心竞争力。并通过进行定期、定向的业务与职业道德培训、签订承诺书，使员工树立风险防范与控制理念。

(4) 经营控制。资产托管部通过制定计划、编制预算等方法开展各种业务营销活动、处理各项事务，从而有效地控制和配置组织资源，达到资源利用和效益最大化目的。

(5) 内部风险管理。资产托管部通过稽核监察、风险评估等方式加强内部风险管理，定期或不定期地对业务运作状况进行检查、监控，指导业务部门进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施，排查风险隐患。

(6) 数据安全控制。资产托管部通过业务操作区相对独立、数据和传真加密、数据传输线路的冗余备份、监控设施的运用和保障等措施来保障数据安全。

(7) 应急准备与响应。资产托管业务建立专门的灾难恢复中心，制定了基于数据、应用、操作、环境四个层面的完备的灾难恢复方案，并组织员工定期演练。为使演练更加接近实战，资产托管部不断提高演练标准，从最初的按照预订时间演练发展到现在的“随机演练”。从演练结果看，资产托管部完全有能力在发生灾难的情况下两个小时内恢复业务。

## 5、资产托管部内部风险控制情况

(1) 资产托管部内部设置专职稽核监察部门，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，全面贯彻落实全程监控思想，确保资产托管业务健康、稳定地发展。

(2) 完善组织结构，实施全员风险管理。完善的风险管理体系需要从上至下每个员工的共同参与，只有这样，风险控制制度和措施才会全面、有效。资产托管部实施全员风险管理，将风险控制责任落实到具体业务部门和业务岗位，每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责，通过建立纵向双人制、横向多部门制的内部组织结构，形成不同部门、不同岗位相互制衡的组织结构。

(3) 建立健全规章制度。资产托管部十分重视内控制度的建设，一贯

坚持把风险防范和控制的理念和方法融入岗位职责、制度建设和工作流程中。经过多年努力,资产托管部已经建立了一整套内部风险控制制度,包括:岗位职责、业务操作流程、稽核监察制度、信息披露制度等,覆盖所有部门和岗位,渗透各项业务过程,形成各个业务环节之间的相互制约机制。

(4) 内部风险控制始终是托管部工作重点之一,保持与业务发展同等地位。资产托管业务是商业银行新兴的中间业务,资产托管部从成立之日起就特别强调规范运作,一直将建立一个系统、高效的风险防范和控制体系作为工作重点。随着市场环境的变化和托管业务的快速发展,新问题、新情况不断出现,资产托管部始终将风险管理放在与业务发展同等重要的位置,视风险防范和控制为托管业务生存和发展的生命线。

#### (五) 基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《基金法》、基金合同、托管协议和有关基金法规的规定,基金托管人对基金的投资范围和投资对象、基金投融资比例、基金投资禁止行为、基金参与银行间债券市场、基金资产净值的计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查,其中对基金的投资比例的监督和核查自基金合同生效之后六个月开始。

基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、基金合同、基金托管协议或有关基金法律法规规定的行为,应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正,基金管理人收到通知后应及时核对,并以书面形式对基金托管人发出回函确认。在限期内,基金托管人有权随时对通知事项进行复查,督促基金管理人改正。基金管理人未能在限期内纠正的,基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为,应立即报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正。

## 五、相关服务机构

### (一) 销售机构

#### 1、场外直销机构

名称：财通基金管理有限公司

住所：上海市虹口区吴淞路 619 号 505 室

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 43/45 楼

法定代表人：吴林惠

电话：021-2053 7888

传真：021-6888 8169

联系人：何亚玲

客户服务电话：4008 209 888

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

#### 2、场外代销机构

##### (1) 北京创金启富基金销售有限公司

注册地址：北京市西城区白纸坊东街 2 号院 6 号楼 712 室

办公地址：北京市西城区白纸坊东街 2 号院 6 号楼 712 室

法定代表人：梁蓉

客服电话：010-66154828

公司网址：[www.5irich.com](http://www.5irich.com)

##### (2) 北京度小满基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区西北旺东路 10 号院西区 4 号楼 1 层 103 室

办公地址：北京市海淀区西北旺东路 10 号院西区 4 号楼（度小满金融总部）1 层

法定代表人：盛超

客服电话：95055-4

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

(3) 北京广源达信基金销售有限公司

注册地址：北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座六层 605 室

办公地址：北京市朝阳区望京东园四区 13 号楼浦项中心 B 座 19 层

法定代表人：齐剑辉

客服电话：4006236060

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

(4) 北京虹点基金销售有限公司

注册住所：北京市朝阳区东三环北路 17 号 10 层 1015 室

办公地址：北京市朝阳区东三环北路 17 号 10 层 1015 室

法定代表人：何静

客服电话：400-618-0707

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

(5) 北京汇成基金销售有限公司

注册地址：北京市西城区宣武门外大街甲 1 号 4 层 401-2

办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲 1 号环球财讯中信大厦 D 座 4 层 401

法定代表人：王伟刚

客服电话：400-619-9059

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

(6) 北京钱景基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村东路 18 号 1 号楼 11 层 B-1108

办公地址：北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012

法定代表人：王利刚

客服电话：010-59422766

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

(7) 北京雪球基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区创远路 34 号院 6 号楼 15 层 1501 室

办公地址：北京市朝阳区创远路 34 号院融新科技中心 C 座 17 层

法定代表人：李楠

客服电话：400-159-9288

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

(8) 北京增财基金销售有限公司

注册地址：北京市西城区德胜门外大街 83 号 4 层 407

办公地址：北京市西城区德胜门外大街 83 号 4 层 407

法定代表人：刘浩

客服电话：010-67000988

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

(9) 北京展恒基金销售股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安苑路 11 号西楼 6 层 604、607

办公地址：北京市朝阳区安苑路 11 号西楼 6 层 604、607

法定代表人：闫振杰

联系电话：010-59601399

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

(10) 北京中植基金销售有限公司

注册地址：北京市北京经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室

办公地址：北京朝阳区大望路金地中心 B 座 21 层、29 层

法定代表人：武建华

客服电话：400-8180-888

公司网址：www.zzfund.com

(11) 财咨道信息技术有限公司

注册地址：辽宁省沈阳市浑南区白塔二南街 18-2 号 B 座 601

办公地址：辽宁省沈阳市浑南区白塔二南街 18-2 号 B 座 601

法定代表人：朱荣晖

客服电话：400-003-5811

公司网址：www.jinjiwo.com

(12) 大连网金基金销售有限公司

注册地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号诺德大厦 2 层 202 室

办公地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号诺德大厦 2 层 202 室

法定代表人：樊怀东

客服电话：4000-899-100

公司网址：www.yibaijin.com

(13) 东方财富证券股份有限公司

注册地址：西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城 10 栋楼

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号金座东方财富大厦

法定代表人：戴彦

客服电话：95357

公司网址：www.18.cn

(14) 方德保险代理有限公司

注册地址：北京市东城区崇文门外 16 号 1 幢 8 层 802

办公地址：北京市东城区崇文门外 16 号 1 幢 8 层 802



法定代表人：邢耀

客服电话：010-64068617

公司网址：www.fdsure.com

(15) 凤凰金信（海口）基金销售有限公司

注册地址：海南省海口市滨海大道 32 号复兴城互联网创新创业园 E 区  
4 层

办公地址：北京市朝阳区建国路 93 号万达广场 8 号楼 7 层 701

法定代表人：张旭

客服电话：400-810-5919

公司网址：www.fengfd.com

(16) 海银基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 8 号 402 室

办公地址：上海市浦东新区银城中路 8 号 4 楼

法定代表人：巩巧丽

客服电话：400-808-1016

公司网址：www.fundhaiyin.com

(17) 和讯信息科技有限公司

注册地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号 1002 室

办公地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号 10 层

法定代表人：章知方

客服电话：010-85650688

公司网址：www.hexun.com

(18) 济安财富（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区太阳宫中路 16 号院 1 号楼 10 层 1005

办公地址：北京市朝阳区太阳宫中路 16 号院 1 号楼 3 层 307

法定代表人：杨健

客服电话：400-673-7010

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

(19) 嘉实财富管理有限公司

注册地址：海南省三亚市天涯区凤凰岛 1 号楼 7 层 710 号

办公地址：海南省三亚市天涯区凤凰岛 1 号楼 7 层 710 号

法定代表人：张峰

客服电话：4000218850

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

(20) 京东肯特瑞基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区西三旗建材城中路 12 号 17 号平房 157

办公地址：北京市通州区亦庄经济技术开发区科创十一街 18 号院京东集团总部 A 座 17 层

法定代表人：李骏

客服电话：400-098-8560

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

(21) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路 969 号 3 幢 5 层 599 室

办公地址：浙江省杭州市西湖区西溪路 556 号蚂蚁元空间

法定代表人：王珺

客服电话：95188-8

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

## (22) 民商基金销售(上海)有限公司

注册地址: 上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区(东座) 6 楼 A31 室

办公地址: 上海市浦东新区张杨路 707 号生命人寿大厦 32 楼

法定代表人: 贲惠琴

客服电话: 021-50206003

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

## (23) 诺亚正行基金销售有限公司

注册地址: 上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

办公地址: 上海市杨浦区长阳路 1687 号 2 号楼

法定代表人: 汪静波

客服电话: 400-821-5399

公司网址: [www.noah-fund.com](http://www.noah-fund.com)

## (24) 乾道基金销售有限公司

注册地址: 北京市西城区德胜门外大街 13 号院 1 号楼 1302

办公地址: 北京市西城区德胜门外大街 13 号院 1 号楼 1302

法定代表人: 董云巍

客服电话: 400-0888-080

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

## (25) 厦门市鑫鼎盛控股有限公司

注册地址: 厦门市思明区鹭江道 2 号 1501-1502 室

办公地址: 厦门市思明区鹭江道 2 号 1501-1502 室

法定代表人: 林劲

客服电话: 400-6533-789

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

(26) 上海大智慧基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 428 号 1 号楼 1102 单元

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 428 号 1 号楼 1102 单元

法定代表人：张俊

客服电话：021-20292031

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

(27) 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区东大名路 501 号 6211 单元

办公地址：上海市浦东新区潍坊新村街道张杨路 500 号华润时代广场商务楼 10、11、12 和 14 楼

法定代表人：陶怡

客服电话：400-700-9665

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

(28) 上海汇付基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区九江路 769 号 1807-3 室

办公地址：上海市黄浦区九江路 769 号 1807-3 室

法定代表人：金佶

客服电话：021-34013999

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

(29) 上海基煜基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区广东路 500 号 30 层 3001 单元

办公地址：上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 1503 室

法定代表人：王翔

客服电话：400-820-5369

公司网址：www.jiyufund.com.cn

(30) 上海凯石财富基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区西藏南路 765 号 602-115 室

办公地址：上海市黄浦区延安东路 1 号凯石大厦

法定代表人：陈继武

客服电话：4006-433-389

公司网址：www.vstonewealth.com

(31) 上海利得基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区临港新片区海基六路 70 弄 1 号 208-36 室

办公地址：上海市虹口区东大名路 1098 号浦江国际金融广场 53 层

法定代表人：李兴春

客服电话：400-032-5885

公司网址：www.leadbank.com.cn

(32) 上海联泰基金销售有限公司

注册地址：上海市普陀区兰溪路 900 弄 15 号 526 室

办公地址：上海市虹口区临潼路 188 号

法定代表人：尹彬彬

客服电话：400-118-1188

公司网址：www.66liantai.com

(33) 上海陆金所基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区源深路 1088 号 7 层（实际楼层 6 层）

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区源深路 1088 号 7 层

法定代表人：陈祎彬

客服电话：400-821-9031

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

（34）上海攀赢基金销售有限公司

注册地址：上海市闸北区广中西路 1207 号 306 室

办公地址：上海市浦东新区银城路 116 号大华银行大厦 7 楼

法定代表人：郑新林

客服电话：021-68889082

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

（35）上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号东方财富大厦

法定代表人：其实

客服电话：95021

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

（36）上海万得基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

办公地址：上海市浦东新区浦明路 1500 号万得大厦

法定代表人：简梦雯

客服电话：400-799-1888

公司网址：[www.520fund.com.cn](http://www.520fund.com.cn)

（37）上海有鱼基金销售有限公司

注册地址：上海自由贸易试验区浦东大道 2123 号 3 层 3E-2655 室

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区浦东大道 2123 号 3 层 3E-2655 室

法定代表人：周锋

客服电话：021-61265457

公司网址：www.youyufund.com

（38）上海云湾基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路 27 号、明月路 1257 号 1 幢 1 层 103-1、103-2 办公区

办公地址：上海市浦东新区新金桥路 27 号 1 号楼

法定代表人：冯轶明

客服电话：400-820-1515

公司网址：www.zhengtongfunds.com

（39）上海长量基金销售有限公司

注册地址：浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区东方路 1267 号陆家嘴金融服务广场二期 11 层

法定代表人：张跃伟

客服电话：400-820-2899

公司网址：www.erichfund.com

（40）上海中正达广基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙兰路 277 号 1 号楼 1203、1204 室

办公地址：上海市徐汇区龙兰路 277 号 1 号楼 1203、1204 室

法定代表人：黄欣

客服电话：400-6767-523

公司网址：www.zhongzhengfund.com

(41) 深圳富济基金销售有限公司

注册地址: 深圳市福田区福田街道岗厦社区福华三路 88 号财富大厦 28E

办公地址: 深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路 3088 号中洲大厦  
3203A 单元

法定代表人: 祝中村

客服电话: 0755-83999907

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

(42) 深圳市前海排排网基金销售有限责任公司

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

办公地址: 深圳市福田区新洲南路 2008 号新洲同创汇 3 层 D303 号

法定代表人: 杨柳

客服电话: 400-666-7388

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

(43) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址: 深圳市福田区梅林街道梅都社区中康路 136 号深圳新一代产业园 2 栋 3401

办公地址: 北京市丰台丽泽商务区平安幸福中心 b 座 7 层

法定代表人: 张斌

客服电话: 400-166-1188-2

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

(44) 深圳新华信通基金销售有限公司

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



办公地址：深圳市福田区深南大道 2003 号华嵘大厦 710、711 室

法定代表人：戴媛

客服电话：400-000-5767

公司网址：www.xintongfund.com

(45) 深圳众禄基金销售股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区笋岗街道笋西社区梨园路 8 号 HALO 广场一期四层 12-13 室

办公地址：深圳市罗湖区笋岗街道笋西社区梨园路 8 号 HALO 广场一期四层 12-13 室

法定代表人：薛峰

客服电话：4006-788-887

公司网址：www.zlfund.cn

(46) 泰信财富基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国路乙 118 号 10 层 1206

办公地址：北京市朝阳区建国路乙 118 号京汇大厦 1206

法定代表人：彭浩

客服电话：400-004-8821

公司网址：www.taixincf.com

(47) 腾安基金销售（深圳）有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室

办公地址：深圳市南山区海天二路 33 号腾讯滨海大厦 15 楼

法定代表人：杨峻

客服电话：95788

公司网址：www.txfund.com

(48) 万家财富基金销售(天津)有限公司

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

办公地址: 北京市东城区朝阳门北大街 9 号泓晟国际中心 18 层

法定代表人: 戴晓云

客服电话: 010-59013842

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

(49) 武汉市伯嘉基金销售有限公司

注册地址: 武汉市江汉区台北一路 17-19 号环亚大厦 B 座 601 室

办公地址: 武汉市江岸区建设大道 700 号武汉香格里拉中心 20 楼 2002  
室

法定代表人: 江翔

客服电话: 400-027-9899

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

(50) 一路财富(北京)基金销售有限公司

注册地址: 北京市海淀区宝盛南路 1 号院 20 号楼 9 层 101-14

办公地址: 北京市海淀区奥北科技园-国泰大厦 9 层

法定代表人: 吴雪秀

客服电话: 400-001-1566

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

(51) 宜信普泽(北京)基金销售有限公司

注册地址: 北京市朝阳区建国路 118 号招商局大厦 2405、06 室

办公地址: 北京市朝阳区建国路 118 号招商局大厦 24F

法定代表人: 胡雄征

客服电话: 400-6099-200

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

(52) 奕丰基金销售有限公司

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

办公地址：深圳市南山区海德三道航天科技广场A座17楼1704室

法定代表人：TEOWEEHOWE

客服电话：400-684-0500

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

(53) 浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：杭州市文二西路1号903室

办公地址：浙江省杭州市余杭区同顺街18号同花顺大楼

法定代表人：吴强

客服电话：952555

公司网址：[www.5ifund.com](http://www.5ifund.com)

(54) 中证金牛（北京）投资咨询有限公司

注册地址：北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室

办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲1号环球财讯中心A座5层

法定代表人：吴志坚

客服电话：400-890-9998

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

(55) 珠海盈米基金销售有限公司

注册地址：珠海市横琴新区环岛东路3000号2719室

办公地址：广州市海珠区阅江中路688号保利国际广场北塔33层

法定代表人：肖雯

客服电话：020-89629066

公司网址：www.yingmi.cn

(56) 中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市复兴门内大街 55 号

办公地址：北京市复兴门内大街 55 号

法定代表人：陈四清

客服电话：95588

公司网址：www.icbc.com.cn

(57) 中国光大银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心

办公地址：北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心

法定代表人：李晓鹏

客服电话：95595

公司网址：www.cebbank.com

(58) 中国民生银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：高迎欣

客服电话：95568

公司网址：www.cmbc.com.cn

(59) 交通银行股份有限公司

注册地址：上海市银城中路 188 号

办公地址：上海市银城中路 188 号

法定代表人：任德奇

客服电话：95559

公司网站：[www.bankcomm.com](http://www.bankcomm.com)

(60) 上海银行股份有限公司

注册地址：上海市银城中路 168 号

办公地址：上海市银城中路 168 号

法定代表人：金煜

客服电话：95594

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

(61) 宁波银行股份有限公司

注册地址：中国浙江省宁波市鄞州区宁东路 345 号

办公地址：中国浙江省宁波市鄞州区宁东路 345 号

法定代表人：陆华裕

客服电话：95574

公司网站：[www.nbc.com.cn](http://www.nbc.com.cn)

(62) 广发银行股份有限公司

注册地址：广州市越秀区东风东路 713 号

办公地址：广州市越秀区东风东路 713 号

法定代表人：王凯

客服电话：400-830-8003

公司网站：[www.cgbchina.com.cn](http://www.cgbchina.com.cn)

(63) 平安银行股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号

办公地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号

法定代表人：谢永林

客服电话：95511-3

公司网址：[www.bank.pingan.com](http://www.bank.pingan.com)

(64) 财通证券股份有限公司

注册地址：浙江省杭州市西湖区天目山路 198 号财通双冠大厦西楼

办公地址：浙江省杭州市西湖区天目山路 198 号财通双冠大厦西楼

法定代表人：章启诚

客服电话：95336

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

(65) 信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人：祝瑞敏

客服电话：95321

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

(66) 国新证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区车公庄大街 4 号 2 幢 1 层 A2112 室

办公地址：北京市朝阳区朝阳门北大街 18 号中国人保寿险大厦 17 层

法定代表人：张海文

客服电话：95390

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

(67) 山西证券股份有限公司

注册地址：山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

办公地址：太原市府西街 69 号山西国际贸易中心 A 座 26—30 层

法定代表人：王怡里

客服电话：95573 或 0351-95573

公司网站：[www.i618.com.cn](http://www.i618.com.cn)

## (68) 中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市丰台区西营街 8 号院 1 号楼 7 至 18 层 101

办公地址：北京市丰台区西营街 8 号院 1 号楼青海金融大厦

法定代表人：陈亮

客服电话：4008-888-8888、95551

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

## (69) 申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人：杨玉成

客服电话：95523

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

## (70) 光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闸路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闸路 1508 号

法定代表人：刘秋明

客服电话：95525

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

## (71) 兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 268 号

办公地址：福州市湖东路 268 号证券大厦；上海市浦东新区长柳路 36 号兴业证券大厦

法定代表人：杨华辉

客服电话：95562

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

(72) 湘财证券股份有限公司

注册地址：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼

办公地址：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼

法定代表人：高振营

客服电话：95351

公司网址：www.xcsc.com

(73) 华福证券有限责任公司

注册地址：福建省福州市鼓楼区鼓屏路 27 号 1#楼 3 层、4 层、5 层

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1088 号招商银行大厦 18 层

法定代表人：苏军良

客服电话：95547

公司网址：www.hfzq.com.cn

(74) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号

办公地址：上海市静安区南京西路 768 号国泰君安大厦

法定代表人：贺青

客服电话：400-8888-666/95521

公司网址：www.gtja.com

(75) 中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座

办公地址：北京市朝阳区亮马桥 48 号中信证券大厦

法定代表人：张佑君

客服电话：95548



公司网址：[www.cs.ecitic.com](http://www.cs.ecitic.com)

(76) 国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 16 层至 26 层

办公地址：深圳市福田区福华一路 125 号国信金融大厦

法定代表人：张纳沙

客服电话：95536

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

(77) 招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道福华一路 111 号

办公地址：深圳市福田区福田街道福华一路 111 号招商证券大厦

法定代表人：霍达

客服电话：95565/0755-95565

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

(78) 上海证券有限责任公司

注册地址：上海市黄浦区四川中路 213 号 7 楼

办公地址：上海市黄浦区四川中路 213 号 7 楼

法定代表人：何伟

客服电话：4008-918-918

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

(79) 安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

办公地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 楼

法定代表人：黄炎勋

客服电话：95517

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

(80) 东海证券股份有限公司

注册地址：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18 层

办公地址：上海浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦

法定代表人：钱俊文

客服电话：95531；400-888-8588

公司网址：[mall.longone.com.cn](http://mall.longone.com.cn)

(81) 爱建证券有限责任公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1600 号 1 幢 32 楼

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1600 号 1 幢 32 楼

法定代表人：祝健

客服电话：4001-962-502

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

(82) 长城证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区福田街道金田路 2026 号能源大厦南塔楼  
10-19 层

办公地址：广东省深圳市福田区福田街道金田路 2026 号能源大厦南塔楼  
10-19 层

法定代表人：张巍

客服电话：400-666-6888/9551

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

(83) 国海证券股份有限公司

注册地址：广西桂林市辅星路 13 号

办公地址：广西南宁市滨湖路 46 号国海大厦

法定代表人：何春梅

客服电话：0771-95563

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

(84) 中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：山东省青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001

办公地址：青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座 5 层

法定代表人：陈佳春

客服电话：95548

网址：[sd.citics.com](http://sd.citics.com)

(85) 粤开证券股份有限公司

注册地址：广州市黄埔区科学大道 60 号开发区控股中心 19、21、22、  
23 层

办公地址：广州市黄埔区科学大道 60 号开发区控股中心 19、21、22、  
23 层

法定代表人：严亦斌

客服电话：95564

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

(86) 海通证券股份有限公司

注册地址：上海市广东路 689 号

办公地址：上海市广东路 689 号

法定代表人：周杰

客服电话：95553、4008888001

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

(87) 德邦证券股份有限公司

注册地址：上海市曹杨路 510 号南半幢 9 楼

办公地址：上海市浦东新区福山路 500 号城建国际中心 29 楼

法定代表人：武晓春

客服电话：400-888-8128 或 021-68639618

公司网站：www.tebon.com.cn

(88) 长江证券股份有限公司

注册地址：湖北省武汉市江汉区淮海路 88 号

办公地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：金才玖

客服电话：95579/400-888-8999

公司网址：www.95579.com

(89) 平安证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路 5033 号平安金融中心 22 层-25 层

办公地址：深圳市福田区益田路 5033 号平安金融中心 22 层-25 层

法定代表人：何之江

客服电话：95511 转 8

公司网址：stock.pingan.com

(90) 国金证券股份有限公司

注册地址：四川省成都市青羊区东城根上街 95 号

办公地址：上海市浦东新区芳甸路 1088 号紫竹国际大厦

法定代表人：冉云

客服电话：95310

公司网址：www.gjq.com.cn

(91) 西南证券股份有限公司

注册地址：重庆市江北区桥北苑 8 号

办公地址：重庆市江北区桥北苑 8 号西南证券大厦

法定代表人：吴坚

客服电话：95355

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

(92) 中国中金财富证券有限公司

注册地址：深圳市南山区粤海街道海珠社区科苑南路 2666 号中国华润大厦 L4601-L4608

办公地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋 4 层、18-21 层

法人代表：高涛

客服电话：95532/4006008008

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

(93) 华鑫证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区香蜜湖街道东海社区深南大道 7888 号东海国际中心一期 A 栋 2301A

办公地址：深圳市福田区香蜜湖街道东海社区深南大道 7888 号东海国际中心一期 A 栋 2301A

法定代表人：俞洋

客服电话：95323

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

(94) 东北证券股份有限公司

注册地址：吉林省长春市生态大街 6666 号

办公地址：吉林省长春市生态大街 6666 号

法定代表人：李福春

客服电话：95360

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

(95) 华安证券股份有限公司

注册地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

办公地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

法定代表人：章宏韬

客服电话：95318

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

(96) 恒泰证券股份有限公司

注册地址：内蒙古自治区呼和浩特市新城区海拉尔东街满世尚都办公商业综合楼

办公地址：内蒙古自治区呼和浩特市新城区海拉尔东街满世尚都办公商业综合楼

法定代表人：祝艳辉

客服电话：956088

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

(97) 中泰证券股份有限公司

注册地址：山东省济南市经七路 86 号

办公地址：山东省济南市经七路 86 号

法定代表人：王洪

客服电话：95538

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

(98) 中信证券华南股份有限公司

注册地址：广州市天河区临江大道 395 号 901 室（部位：自编 01 号）1001 室（部位：自编 01 号）

办公地址：广州市天河区临江大道 395 号合利天德广场 T1 楼 10 层

法定代表人：陈可可

客服电话：95548

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

(99) 华龙证券股份有限公司

注册地址：兰州市城关区东岗西路 638 号兰州财富中心 21 楼

办公地址：兰州市城关区东岗西路 638 号兰州财富中心

法定代表人：祁建邦

客服电话：95368，400-6898888

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

(100) 大同证券有限责任公司

注册地址：大同市城区迎宾街 15 号桐城中央 21 层

办公地址：太原市长治路 111 号山西世贸中心 A 座 12、13 层

法定代表人：董祥

客服电话：4007-121212

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

(101) 中银国际证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39F

办公地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39F

法定代表人：宁敏

客服电话：400-620-8888

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

(102) 东莞证券股份有限公司

注册地址：广东省东莞市莞城区可园南路一号

办公地址：广东省东莞市莞城区可园南路一号

法定代表人：陈照星

客服电话：95328

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

(103) 中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市东城区朝阳门内大街 2 号 B 座 9 层 03 单元 918

法定代表人：王常青

客服电话：95587/4008-888-108

公司网址：www.csc108.com

（104）华泰证券股份有限公司

注册地址：南京市江东中路 228 号

办公地址：南京市江东中路 228 号

法定代表人：张伟

客服电话：95597

公司网址：www.htsc.com.cn

（105）方正证券股份有限公司

注册地址：长沙市天心区湘江中路二段 36 号华远华中心 4、5 号楼

3701-3717

办公地址：湖南省长沙市天心区湘江中路二段 36 号华远国际中心 37 层

法定代表人：施华

客服电话：95571

公司网址：www.foundersc.com

（106）中信期货有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室/14 层

办公地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室/14 层

法定代表人：张皓

客服电话：400-990-8826

公司网站：www.citicsf.com



## (107) 中国国际金融股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27/28 层

办公地址：北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27/28 层

法定代表人：沈如军

客服电话：400-910-1166

公司网址：www.cicc.com.cn

## (108) 开源证券股份有限公司

注册地址：陕西省西安市高新区锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层

办公地址：陕西省西安市高新区锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层

法定代表人：李刚

客服电话：95325

公司网址：www.kysec.cn

## (109) 世纪证券有限责任公司

注册地址：深圳市前海深港合作区南山街道桂湾五路 128 号前海深港基金小镇对冲基金中心 406

办公地址：广东省深圳市福田区福田街道金田路 2026 号能源大厦北塔 23-25 层

法定代表人：李剑锋

客服电话：956019

公司网址：www.csc.com.cn

## (110) 联储证券有限责任公司

注册地址：山东省青岛市崂山区香港东路 195 号 8 号楼 15 层

办公地址：山东省青岛市崂山区苗岭路 15 号金融中心大厦 15 层

法人代表：吕春卫

客服电话：956006

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

(111) 中山证券有限责任公司

注册地址：深圳市南山区创业路 1777 号海信南方大厦 21、22 层

办公地址：深圳市南山区创业路 1777 号海信南方大厦 21、22 层

法定代表人：李永湖

客服电话：95329

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

(112) 弘业期货股份有限公司

注册地址：南京市建邺区江东中路 399 号 3 幢

办公地址：南京市中华路 50 号弘业大厦

法定代表人：周剑秋

客服电话：400-8281288

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

(113) 长江期货股份有限公司

注册地址：武汉市武昌区中北路 9 号长城汇 T2 号写字楼第 27、28 层

办公地址：武汉市武昌区中北路 9 号长城汇 T2 号写字楼第 27、28 层

法定代表人：潘山

客服电话：95579/027-85861133

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

(114) 第一创业证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼

办公地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼

法定代表人：刘学民

客服电话：95358

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

## (115) 申万宏源西部证券有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号世纪商贸广场 45 层

法定代表人：王献军

客服电话：95523/400-889-5523

公司网址：www.swhysc.com

## (116) 国盛证券有限责任公司

注册地址：江西省南昌市新建区子实路 1589 号

办公地址：江西省南昌市红谷滩新区凤凰中大道 1115 号北京银行南昌分行营业大楼

法定代表人：徐丽峰

客服电话：956080

公司网址：www.gszq.com

## (117) 国元证券股份有限公司

注册地址：安徽省合肥市梅山路 18 号

办公地址：安徽省合肥市梅山路 18 号安徽国际金融中心 A 座国元证券

法定代表人：沈和付

客服电话：95578

公司网址：www.gyzq.com.cn

## (118) 阳光人寿保险股份有限公司

注册地址：海南省三亚市迎宾路 360-1 号三亚阳光金融广场 16 层

办公地址：北京市朝阳区光华路阳光金融中心 4、5、6、7 层

法定代表人：李科

客服电话：95510

公司官网：[life.sinosig.com](http://life.sinosig.com)

(119) 中国人寿保险(集团)公司

注册地址：北京市西城区金融大街17号

办公地址：北京市西城区金融大街17号

法定代表人：白涛

客服电话：95519

公司官网：[www.e-chinalife.com](http://www.e-chinalife.com)

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其它符合要求的机构代理销售本基金。

### 3、场内销售机构

本基金的场内销售机构为具有基金销售业务资格，且经上海证券交易所及其指定的登记结算机构认可的会员单位。

#### (二) 注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街17号

法定代表人：周明

电话：021-5887 2935

联系人：郑奕莉

#### (三) 出具法律意见书的律师事务所

名称：上海源泰律师事务所

住所：上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦14楼

负责人：廖海

电话：021-5115 0298

传真：021-5115 0398

联系人：刘佳

经办律师：刘佳、范佳斐

（四）审计基金财产的会计师事务所

名称：安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)

执行事务合伙人：毛鞍宁

住所：北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼（东三  
办公楼）16层

办公地址：上海市世纪大道100号环球金融中心50楼

邮政编码：200120

公司电话：（021）22288888

公司传真：（021）22280000

签章会计师：朱宝钦、骆文慧

业务联系人：朱宝钦

## 六、基金的募集

### (一) 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》、《信息披露办法》、《基金合同》及其他有关法律法规，并经中国证监会2015年12月29日证监许可[2015]3121号文准予注册募集。

### (二) 基金类型及基金存续期间

#### 1、基金类型：混合型

#### 2、基金运作方式：契约型

基金合同生效后，本基金设一个18个月的封闭期，起讫时间为基金合同生效之日至18个月后的对应日（若该日为非工作日，则为该日之前的最后一个工作日）止。在封闭期内，本基金不开放申购、赎回业务，但投资人可在本基金上市交易后通过上海证券交易所转让基金份额。封闭期届满后，本基金转换为上市开放式基金（LOF）。

#### 3、基金存续期间：不定期

#### 4、基金份额类别

本基金根据销售费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人申购时收取申购费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为A类基金份额；在投资人申购时不收取申购费用，而从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为C类基金份额。

本基金A类基金份额和C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算并公布基金份额净值，计算公式为：计算日某类别基金份额净值=计算日该类别基金份额的基金资产净值/计算日发售在外的该类别基金份额总数。

投资人可自行选择申购的基金份额类别。本基金不同基金份额类别之间

不得互相转换。投资者可通过场内、场外两种渠道申购与赎回A类基金份额；可通过场外渠道申购与赎回C类基金份额。本基金A类基金份额参与上市交易，C类基金份额不参与上市交易。

有关基金份额类别的具体设置、费率水平等由基金管理人确定，并在招募说明书及基金产品资料概要中列示。根据基金运作情况，在符合法律法规、基金合同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，基金管理人在履行适当程序后可以增加新的基金份额类别、或者停止现有基金份额类别的销售、或者调整基金份额分类办法及规则等，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。

### （三）基金份额面值

本基金基金份额发售面值为人民币1元。

### （四）募集期及募集结果

本基金募集期为自2016年2月18日至2016年3月4日，现募集工作已顺利结束。经会计师事务所验资，按照每份基金份额面值人民币1.000元计算，基金募集期共募集4,646,865,157.19份基金份额（其中包括利息转份额1,648,477.27份），本次募集的有效认购总户数为45,767户。

## 七、基金合同的生效

根据有关规定，本基金满足基金合同生效条件，基金合同已于 2016 年 3 月 9 日正式生效。自基金合同生效之日起，本基金管理人开始正式管理本基金。

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

法律法规或监管机构另有规定时，从其规定。



## 八、基金份额的上市交易

### （一）基金份额的上市

基金合同生效后,在本基金符合法律法规和上海证券交易所规定的上市条件的情况下,基金管理人将根据有关规定申请基金份额上市交易。A类基金份额可上市交易;C类基金份额不上市交易。如无特别说明,本部分约定仅适用于本基金A类基金份额。

#### 1、上市交易的地点

上海证券交易所。

#### 2、上市交易的时间

基金合同生效后三个月内开始在上海证券交易所上市交易。

#### 3、基金上市条件

基金合同生效后,具备下列条件的,基金管理人可依据《上海证券交易所证券投资基金上市规则》,向上海证券交易所申请本基金份额上市:

- (1) 基金募集金额不低于 2 亿元人民币;
- (2) 基金份额持有人不少于 1,000 人;
- (3) 《上海证券交易所证券投资基金上市规则》规定的其他条件。

#### 4、上市交易公告

基金上市前,基金管理人应与上海证券交易所签订上市协议书。基金获准在上海证券交易所上市的,基金管理人应在基金上市日前至少 3 个工作日发布基金上市交易公告书。

### （二）上市交易的规则

本基金基金份额在上海证券交易所的上市交易需遵循《上海证券交易所证券投资基金上市规则》、《上海证券交易所交易规则》等有关规定。

### （三）上市交易的费用

基金份额上市交易的费用按照上海证券交易所有关规定办理。

### （四）上市交易的停复牌和终止上市

上市基金份额的停复牌和终止上市按照《基金法》相关规定和上海证券交易所的相关规定执行。具体情况见基金管理人届时相关公告。

(五) 相关法律法规、中国证监会及上海证券交易所对基金上市交易的规则等相关规定内容进行调整的,基金合同相应予以修改,且此项修改无须召开基金份额持有人大会审议。

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

本基金 A 类基金份额已于 2016 年 6 月 6 日开始在上海证券交易所上市交易。

## 九、基金份额的申购与赎回

### （一）基金份额的封闭期

基金合同生效后，本基金设一个 18 个月的封闭期，起讫时间为基金合同生效之日至 18 个月后的对应日（若该日为非工作日，则为该日之前的最后一个工作日）止。在封闭期内，本基金不开放申购、赎回业务，但投资人可在本基金上市交易后通过上海证券交易所转让基金份额。封闭期届满后，本基金转换为上市开放式基金（LOF）。

举例：假设本基金成立日为 2015 年 11 月 18 日，那么 18 个月后的对应日为 2017 年 5 月 18 日，假设 2017 年 5 月 18 日为工作日，则本基金的封闭期为 2015 年 11 月 18 日至 2017 年 5 月 18 日。

### （二）申购和赎回场所

本基金基金合同生效后，投资者可通过场内、场外两种方式对 A 类基金份额进行申购与赎回，可通过场外方式申购与赎回 C 类基金份额。

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。其中，场外申购和赎回场所为基金管理人的直销网点及基金场外非直销销售机构的销售网点；场内申购和赎回场所为具有基金销售业务资格，且经上海证券交易所及其指定的登记结算机构认可的会员单位。

### （三）申购和赎回的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

本基金转为上市开放式基金（LOF）后，投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

基金合同生效后，若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更

或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

## 2、申购与赎回的开始时间

本基金的申购、赎回自转换为上市开放式基金（LOF）之日起不超过30天开始办理，基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告申购与赎回的开始时间。

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

本基金A类基金份额已于2017年9月11日开始办理日常申购业务，于2017年9月11日开始办理日常赎回业务。

### （四）申购与赎回的原则

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

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；

4、基金份额持有人在赎回基金份额时，除指定赎回外，遵循“先进先出”原则，即登记确认日期在前的基金份额先赎回，登记确认日期在后的基金份额后赎回，以确定所使用的赎回费率；

5、投资者通过上海证券交易所交易系统办理本基金的场内申购、赎回时，需遵守上海证券交易所和登记结算机构的相关业务规则。若相关法律法规、中国证监会、上海证券交易所或登记结算机构对申购、赎回业务等规则有新的规定，按新规定执行。

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。

## （五）申购与赎回的程序

### 1、申购和赎回的申请方式

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

### 2、申购和赎回的款项支付

投资人申购基金份额时，必须全额交付申购款项，投资人交付款项，申购成立，登记机构确认基金份额时，申购有效。

基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；登记机构确认赎回时，赎回生效。投资人赎回申请成功后，基金管理人将在 T+7 日(包括该日)内支付赎回款项。遇证券交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其它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，赎回款项顺延至下一个工作日划出。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。

### 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，投资人可在 T+2 日后(包括该日)到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功，则申购款项退还给投资人。

销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购、赎回的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资者应及时查询。若申购不成功或无效，则申购款项退还给投资人。

## （六）申购和赎回的数量限制

（1）投资人办理场外申购本基金 A 类基金份额或 C 类基金份额时，单

笔最低金额为 1000 元人民币（含申购费）。通过直销中心首次申购本基金 A 类基金份额或 C 类基金份额的最低金额为 5 万元人民币（含申购费），追加申购最低金额为 1,000 元人民币（含申购费）。已有认购本基金记录的投资人不受首次申购最低金额的限制，但受追加申购最低金额的限制。通过本公司网上交易系统办理基金场外申购业务的不受直销网点单笔申购最低金额的限制,申购最低金额为单笔 10 元（含申购费）。投资人场内申购的单笔申购最低金额为人民币 10 元（含申购费），超过 1,000 元的应为 1 元的整数倍（含申购费）。

投资人可多次申购，对单个投资人累计持有份额不设上限限制。法律法规、中国证监会另有规定的除外。

（2）基金份额持有人办理场外赎回时，每笔赎回申请的最低份额为 100 份基金份额；基金份额持有人办理场内赎回时，每笔赎回申请的最低份额为 100 份基金份额，同时赎回份额必须是整数份额。

（3）基金份额持有人可将其全部或部分基金份额赎回，但某笔交易类业务（如赎回、基金转换、转托管等）导致单个交易账户的基金份额余额少于 100 份时，余额部分基金份额必须一同赎回。

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

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

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

### （七）申购费用和赎回费用

1、本基金 A 类基金份额在申购时收取基金申购费用；C 类基金份额不收取申购费用。本基金 A 类基金份额的申购费用由 A 类基金份额的投资人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用。

2、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。赎回费中扣除应归基金资产的部分后，其余用于支付登记费和其他必要的手续费。其中，对持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5% 的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产。

#### 3、本基金 A 类基金份额的申购费用

本基金 A 类基金份额的场外申购费率如下：

单笔申购金额 (M)	申购费率
M < 100 万	1.50%
100 万 ≤ M < 300 万	1.00%
300 万 ≤ M < 500 万	0.50%
M ≥ 500 万	每笔 1000 元

（注：M：申购金额；单位：元）

本基金 A 类基金份额的场内申购费率由基金场内代销机构参照场外申购费率执行。

#### 4、赎回费用

本基金 A 类基金份额的场外/场内赎回费率如下：

持有期	赎回费率
持有期 < 7 日	1.50%
7 日 ≤ 持有期 < 30 日	0.75%
30 日 ≤ 持有期 < 365 日	0.50%
365 日 ≤ 持有期 < 730 日	0.25%

持有期≥730 日	0
-----------	---

本基金 C 类基金份额的赎回费率如下：

持有期	赎回费率
持有期<7 日	1.50%
7 日≤持有期<30 日	0.5%
持有期≥30 日	0

（注：赎回份额的持有期限，自基金合同生效日（含）或申购申请确认日（含）起开始计算。）

赎回费用由基金赎回人承担，对份额存续时间小于 30 个自然日的，赎回费用全部归基金财产，对份额存续时间小于 3 个自然月的，赎回费用的 75% 归基金财产，对份额存续时间小于 6 个自然月的，赎回费用的 50% 归基金财产，对份额存续时间大于等于 6 个自然月的，赎回费用的 25% 归基金财产，其余用于支付市场推广、注册登记费和其他必要的手续费。

5、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。

6、当本基金各类基金份额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。

#### （八）申购份额与赎回金额的计算

##### 1、本基金申购份额的计算：

申购的有效份额为净申购金额除以当日的该类基金份额净值，有效份额单位为份，其中：

##### （1）A 类基金份额申购份额的计算如下：

当申购费用适用比例费率时，申购份数的计算方法如下：

净申购金额 = 申购金额 / (1 + 申购费率)

申购费用 = 申购金额 - 净申购金额



申购份额=净申购金额/T日A类基金份额净值

当申购费用为固定金额时，申购份数的计算方法如下：

申购费用=固定金额

净认购金额=申购金额-申购费用

申购份数=净申购金额/T日A类基金份额净值

(2) C类基金份额申购份数的计算如下：

申购份额=申购金额/T日C类基金份额净值

申购费以四舍五入方式保留到小数点后两位。通过场外进行申购的，份额计算结果按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产享有或承担；通过场内方式进行申购的，份额计算结果采用截尾法保留至整数位，不足1份部分对应的申购资金将返还给投资人。

例一：某投资人通过场外投资5,000元申购本基金A类基金份额，对应费率为1.5%，假设申购当日A类基金份额净值为1.128元，则其可得到的申购份额为：

净申购金额=5,000/(1+1.5%)=4,926.11元

申购费用=5,000-4,926.11=73.89元

申购份数=4,926.11/1.128=4,367.12份

即：该投资人通过场外投资5,000元申购本基金A类基金份额，假设申购当日A类基金份额净值为1.128元，则可得到4,367.12份A类基金份额。

例二：某投资人通过场内投资10,000元申购本基金A类基金份额，对应费率为1.5%，假设申购当日A类基金份额净值为1.025元，则其申购费用、可得到的份额及返还的资金余额为：

净申购金额=10,000/(1+1.5%)=9,852.22元

申购费用=10,000-9,852.22=147.78元

申购份额=9,852.22/1.025=9611.92份

因场内申购份额保留至整数，故投资人所得为9,611份A类基金份额，整数位后小数部分的申购份额对应的资金返还给投资人。具体计算公式为：

实际净申购金额=9,611×1.025=9,851.28元

退款金额=9852.22-9851.28=0.94 元

即：该投资人投资 10,000 元从场内申购本基金 A 类基金份额，假设当日 A 类基金份额净值为 1.025 元，则其可得到 A 类基金份额 9,611 份，退款 0.94 元。

例三：某投资人通过场外投资 2,000 元申购本基金 C 类基金份额，假设申购当日 C 类基金份额净值为 1.128 元，则其可得到的申购份额为：

申购份额=2,000/1.128=1,773.05 份

即：该投资人投资 2,000 元场外申购本基金 C 类基金份额，假设申购当日 C 类基金份额净值为 1.128 元，则可得到 1,773.05 份 C 类基金份额。

## 2、本基金赎回金额的计算：

场内赎回和场外赎回计算方法相同。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日该类基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元，计算公式：

赎回总金额=赎回份额×T 日该类基金份额净值

赎回费用=赎回总金额×赎回费率

净赎回金额=赎回总金额-赎回费用

上述计算结果均按四舍五入，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

例：某基金份额持有人持有本基金 10,000 份 A 类基金份额一年后(未满 2 年)决定赎回，对应的赎回费率为 0.25%，假设赎回当日 A 类基金份额净值是 1.148 元，则可得到的净赎回金额为：

赎回总金额=10,000×1.148=11,480 元

赎回费用=11,480×0.25%=28.70 元

净赎回金额=11,480-28.70=11,451.30 元

即：该基金份额持有人持有 10,000 份本基金 A 类基金份额一年后(未满 2 年)赎回，假设赎回当日本基金 A 类基金份额净值是 1.148 元，则可得到的净赎回金额为 11,451.30 元。

## 3、本基金各类基金份额净值的计算：

本基金各类基金份额净值的计算，均保留到小数点后3位，小数点后第4位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T日的各类基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

#### （九）拒绝或暂停申购的情形

本基金转为开放式运作以后，发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

- 1、因不可抗力导致基金无法正常运作。
- 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接收投资人的申购申请。当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金申购赎回申请的措施。
- 3、证券、期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
- 4、基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。
- 5、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%，或者变相规避50%集中度的情形时。
- 6、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人利益的情形。
- 7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

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

#### (十) 暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

本基金转为开放式运作以后,发生下列情形时,基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项:

1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时,基金管理人可暂停接收投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时,经与基金托管人协商确认后,基金管理人应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金申购赎回申请的措施。

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

4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

5、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第1、2、3、5情形时,基金管理人应按规定报中国证监会备案,已确认的赎回申请,基金管理人应足额支付;如暂时不能足额支付,应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人,未支付部分可延期支付。若出现上述第4项所述情形,按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时,基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

#### (十一) 巨额赎回的情形及处理方式

##### 1、巨额赎回的认定

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

## 2、巨额赎回的处理方式

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

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

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

(3) 当基金出现巨额赎回时,在单个基金份额持有人赎回申请超过前一估值日基金总份额 20%的情形下,基金管理人认为支付该基金份额持有人的全部赎回申请有困难或者因支付该基金份额持有人的全部赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时,可以对该单个基金份额持有人超出前一估值日基金总份额 20%的赎回申请实施延期办理。对于未能赎回部分,投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回,具体按上述(2)方式处理。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理,无优先权并以下一开放日的各类基金份额净值为基础计算赎回金额,以此类推,直到全部赎回为止。而对该单个基金份额持有人前一估值日基金总份额 20%以内(含 20%)的赎回申请与其他投资者的赎回申请按上述(1)、(2)方式处理,具体见相关公告。

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

### 3、巨额赎回的公告

当发生上述延期赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个工作日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在指定媒介上刊登公告。

4、场内巨额赎回的处理方式按照上海证券交易所及登记机构的有关规定办理。

## (十二) 暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

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

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

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

## (十三) 基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换业务，基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及基金合同的规定制定并公告，并提前告知基金托管人与相关机构。

本基金已于 2018 年 5 月 21 日开通了 A 类基金份额转换业务，基金转换的数额限制、转换费率等具体规定见基金管理人发布的相关公告。

#### （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、符合法律法规的其它非交易过户。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资人。

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

#### （十五）基金的转托管

##### 1、基金份额的注册登记

本基金的 A 类基金份额采用分系统登记的原则。场外认购、申购或通过跨系统转托管从场内转入的 A 类基金份额登记在注册登记系统基金份额持有人开放式基金账户下，场内认购、申购、上市交易买入或通过跨系统转托管从场外转入的 A 类基金份额登记在证券登记结算系统基金份额持有人的上海证券账户下。场外申购的 C 类基金份额登记在登记结算系统基金份额持有人开放式基金账户下。

2、基金份额持有人可办理已持有同类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。本基金 A 类基金份额的转托管包括系统内转托管和跨系统转托管。除经基金管理人另行公告，C 类基金份额持有人不能办理跨系统转登记。

##### 3、系统内转托管

（1）基金份额持有人可将其持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间进行系统内转托管或在证券登记结算系统内不同会员单

位之间进行转指定。

(2) 基金份额登记在注册登记系统的基金份额持有人在变更办理赎回业务的销售机构(网点)时,须办理已持有基金份额的系统内转托管。

(3) 基金份额登记在证券登记结算系统的基金份额持有人在变更办理基金份额上市交易或场内赎回业务的会员单位时,须办理已持有基金份额转指定。

#### 4、跨系统转托管

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

(2) 本基金跨系统转托管的具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司及上海证券交易所的相关规定办理。

#### (十六) 基金的冻结和解冻

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。

#### (十七) 实施侧袋机制期间本基金的申购与赎回

本基金实施侧袋机制的,本基金的申购和赎回安排详见招募说明书“侧袋机制”部分的规定。



## 十、基金的投资

### （一）投资目标

本基金将灵活运用多种投资策略,充分挖掘和利用市场中潜在的投资机会,力争为基金份额持有人创造超越业绩比较基准的投资回报。

### （二）投资范围

本基金的投资范围为国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证)、权证、债券、中期票据、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

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

基金的投资组合比例为:股票资产(含存托凭证)比例为基金资产的30%~95%;债券、中期票据、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具等固定收益品种的比例为基金资产的0%~70%;在封闭期内,每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金;转换为上市开放式基金(LOF)后,每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

### （三）投资策略

#### 1、资产配置策略

本基金综合分析国内外政治经济环境、经济基本面状况、宏观政策变化、金融市场形势等多方面因素,通过对货币市场、债券市场和股票市场的整体

估值状况比较分析，对各主要投资品种市场的未来发展趋势进行研判，根据判断结果进行资产配置及组合的构建，确定基金在股票、债券、货币市场工具等资产类别上的投资比例，并随着各类资产风险收益特征的相对变化，适时动态调整各资产类别的投资比例，在控制投资组合整体风险基础上力争提高收益。

本基金进行综合分析的各项指标和因素主要包括：基本面分析方面主要包括国民生产总值、居民消费价格指数、工业增加值、失业率水平、固定资产投资总量、发电量等宏观经济统计数据；政策面分析方面主要包括存款准备金率、存贷款利率、再贴现率、公开市场操作等各项货币政策，财政支出总量、转移支付水平以及税收政策等财政政策；金融市场分析方面主要包括市场投资者参与度、市场资金供求变化、市场估值水平等。

## 2、股票投资策略

本基金在价值投资理念的基础上，建立成长策略、主题策略、定向增发策略以及动量策略等多策略体系，并根据市场环境的变化进行针对性运用。具体投资过程中，本基金通过自下而上的成长股策略，对上市公司进行基本面研究，精选股票；通过自上而下的主题策略，研究行业轮动与市场热点，精选行业；通过动量策略进行股票操作层面的动态调整，捕捉市场动量效应驱动的投资机会；通过定向增发策略把握上市公司定向增发事件关联的投资机会，选择基本面和安全边际双优的定增企业。通过以上多种策略的综合应用，本基金建立基金投资组合，并根据宏观经济状况、公司基本面变化等因素进行动态调整。

### （1）成长策略

本基金对成长型公司的投资以新兴产业、处于周期性景气上升阶段的拐点行业以及持续增长的传统产业为重点，并精选其中行业代表性高、潜在成长性好、估值具有吸引力的个股进行投资。对于新兴产业，在对产业结构演变趋势进行深入研究和分析的基础上，准确把握新兴产业的发展方向，重点投资体现行业发展方向、拥有核心技术、创新意识领先并已经形成明确盈利模式的公司；对于拐点产业，依据对行业景气变化趋势的研究，结合投资增长率等辅助判断指标，提前发现景气度进入上升周期的行业，重点投资拐点行业中景气敏感度高的公司；对于传统产业，主要关注产业增长的持续性、企业的竞争优势、发展战略以及潜在发展空间，重点投资具有清晰商业模式、

增长具有可持续性和不可复制性的公司。

## (2) 主题策略

本基金通过对经济发展过程中的制度性、结构性或周期性趋势的研究和分析，深入挖掘潜在的投资主题，并选择那些受惠于投资主题的公司进行投资。首先，从经济体制变革、产业结构调整、技术发展创新等多个角度出发，分析经济结构、产业结构或企业商业运作模式变化的根本性趋势以及导致上述根本性变化的关键性驱动因素，从而前瞻性地发掘经济发展过程中的投资主题；其次，通过对投资主题的全面分析和评估，明确投资主题所对应的主题行业或主题板块，从而确定受惠于相关主题的公司，依据企业对投资主题的敏感程度、反应速度以及获益水平等指标，精选个股；再次，通过紧密跟踪经济发展趋势及其内在驱动因素的变化，不断地挖掘和研究新的投资主题，并对主题投资方向做出适时调整，从而准确把握新旧投资主题的转换时机，充分分享不同投资主题兴起所带来的投资机遇。

## (3) 定向增发策略

定向增发是指上市公司向特定投资者（包括大股东、机构投资者、自然人等）非公开发行股票的方式。本基金将对进行非公开发行的上市公司进行基本面分析，结合市场未来走势进行判断，从战略角度评估参与定向增发的预期中签情况、预期损益和风险水平，积极参与风险较低的定向增发项目。在定向增发股票锁定期结束后，本基金将根据对股票内在投资价值和成长性的判断，结合股票市场环境的分析，选择适当的时机卖出。

## (4) 动量策略

动量策略是指市场在一定时期内可呈现“强者恒强”的特征，通过买入过去一段时期的强势股可以获得超越市场平均水平的收益。本基金将综合分析各股票的市场价格动量特征，分析指标包括各股票的阶段累计收益率、换手率、市场交易活跃度、波动率，选择动量特征明显和价格趋势强劲的个股纳入投资组合，作为本基金的辅助投资策略。

## 3、存托凭证投资策略

本基金将根据投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。

## 4、固定收益类资产投资策略

固定收益投资在保证资产流动性的基础上，采取利率预期策略、信用风

险管理和时机策略相结合的积极性投资方法，力求在控制各类风险的基础上获取稳定的收益。

### （1）利率预期与久期控制策略

本基金密切跟踪最新发布的宏观经济数据和金融运行数据，分析宏观经济运行的可能情景，预测财政政策、货币政策等政府宏观经济政策取向，分析金融市场资金供求状况变化趋势，在此基础上预测市场利率水平变动趋势，以及收益率曲线变化趋势。在预期市场利率水平将上升时，降低组合的久期；预期市场利率将下降时，提高组合的久期。并根据收益率曲线变化情况制定相应的债券组合期限结构策略，如子弹型组合、哑铃型组合或者阶梯型组合等。

### （2）个券选择策略

个券选择层面，对各信用品种进行详细的财务分析和非财务分析后，进行个券选择。财务分析方面，以企业财务报表为依据，对企业规模、资产负债结构、偿债能力和盈利能力四方面进行评分；非财务分析方面（包括管理能力、市场地位和发展前景等指标）则主要采取实地调研和电话会议等形式实施。

### （3）时机策略

i.价值分析策略。根据当日收益率曲线和债券特性，建立债券的估值模型，对当日无交易的债券计算理论价值，买进价格低于价值的债券；相反，卖出价格高于价值的债券。

ii.骑乘策略。当收益率曲线比较陡峭时，也即相邻期限利差较大时，可以买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券，也即收益率水平处于相对高位的债券，随着持有期限的延长，债券的剩余期限将会缩短，从而此时债券的收益率水平将会较投资期初有所下降，通过债券的收益率的下滑，进而获得资本利得收益。

iii.息差策略。利用回购利率低于债券收益率的情形，通过正回购将所获得资金投资于债券以获取超额收益。

iv.利差策略。对两个期限相近的债券的利差进行分析，对利差水平的未来走势做出判断，从而进行相应的债券置换。当预期利差水平缩小时，买入收益率高的债券同时卖出收益率低的债券，通过两债券利差的缩小获得投资收益；当预期利差水平扩大时，买入收益率低的债券同时卖出收益率高的债

券，通过两债券利差的扩大获得投资收益。

#### 5、权证投资策略

本基金将在严格控制风险的前提下进行权证投资。权证投资将以价值分析为基础，在采用数量化模型分析其合理定价的基础上，结合权证的溢价率、隐含波动率、到期日等指标，选择权证的买入和卖出时机，追求在风险可控的前提下实现稳健的超额收益。

#### 6、股指期货的投资策略

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

### （四）投资限制

#### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）股票资产（含存托凭证）比例为基金资产的 30%~95%；债券、中期票据、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具等固定收益品种的比例为基金资产的 0%~70%；

（2）在封闭期内，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；转换为上市开放式基金（LOF）后，每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

（3）本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；

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

- (5) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；
- (6) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；
- (7) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；
- (8) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；
- (9) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；
- (10) 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；
- (11) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；
- (12) 本基金应投资于信用级别评级为 **BBB** 以上(含 **BBB**)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；
- (13) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；
- (14) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；
- (15) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；
- (16) 本基金在封闭期内，任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值与有价证券之和，不得超过基金资产净值的 100%；转换为上市开放式基金(LOF)后，任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；其中，有价证券指股票、债券(不包含到期日在一年以内的政府债券)、权证、资产支持债券、买入返

售金融资产（不含质押式回购）等；

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

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

（19）本基金在封闭期内，基金总资产不得超过基金净资产的 200%，转换为上市开放式基金(LOF)后，基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

（20）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；

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

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

（23）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；

（24）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价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，除上述（2）、（12）、（22）、（23）点的情形外，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规另有规定的，从其规定。

本基金持有证券期间，如发生证券处于流通受限状态等非基金管理人原因导致基金投资比例不符合前述规定的，基金管理人应在上述情形消除后的 10 个交易日内调整完毕。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。期间,基金的投资范围、投资策略应当符合《基金合同》的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,则本基金投资不再受相关限制,但须提前公告,不需要经基金份额持有人审议。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或者活动:

- (1) 承销证券;
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保;
- (3) 从事承担无限责任的投资;
- (4) 买卖其他基金份额,但是中国证监会另有规定的除外;
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资;
- (6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;
- (7) 依照法律法规有关规定,由中国证监会规定禁止的其他活动。

运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券,或者从事其他重大关联交易的,应当遵循基金份额持有人利益优先的原则,防范利益冲突,符合国务院证券监督管理机构的规定,并履行信息披露义务。

## (五) 业绩比较基准

本基金业绩比较基准:沪深 300 指数收益率  $\times 55\%$  + 上证国债指数收益率  $\times 45\%$

本基金选择该业绩基准,是基于以下因素:

- (1) 沪深 300 指数和上证国债指数编制方法合理、透明;
- (2) 沪深 300 指数和上证国债指数编制和发布有一定的历史,有较高的知名度和市场影响力;
- (3) 具有市场覆盖率,不易被操纵;



(4) 本基金的股票、债券和现金比例，选用该业绩比较基准能够真实反映本基金的风险收益特征。

沪深 300 指数由中证指数有限公司编制和计算。中证指数有限公司将采取一切必要措施以确保指数的精确性。关于指数值和成分股名单的所有知识产权归属中证指数有限公司。

上证国债指数由上海证券交易所委托中证指数有限公司管理。上证指数的所有权归属上海证券交易所。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的股票指数时，本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告，而无需召开基金份额持有人大会。

#### (六) 风险收益特征

本基金是混合型证券投资基金，其预期收益和风险水平高于债券型基金产品和货币市场基金、低于股票型基金产品，属于中高风险、中高收益的基金产品。

#### (七) 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。

#### (八) 基金投资组合报告

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

责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年4月21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。

本报告中财务资料未经审计，本投资组合报告所载数据截至2023年3月31日。

### 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	189,188,352.78	92.31
	其中：股票	189,188,352.78	92.31
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资		
	其中：债券		
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	11,454,170.47	5.59
8	其他资产	4,311,311.25	2.10
9	合计	204,953,834.50	100.00

### 2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	12,174,462.00	6.00

B	采矿业		-
C	制造业	170,423,167.49	83.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	368,222.80	0.18
E	建筑业	22,340.56	0.01-
F	批发和零售业	38,234.16	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	5,515,100.88	2.72
H	住宿和餐饮业		
I	信息传输、软件和信息技术服务业	218,523.00	0.11
J	金融业	102,150.00	0.05
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	16,357.89	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	202,634.00	0.10
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	107,160.00	0.05
S	综合	-	-
	合计	189,188,352.78	93.24

2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
 本基金本报告期末未持有通过港股通机制投资的港股。

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	603369	今世缘	269,500.00	17,477,075.00	8.61
2	000568	泸州老窖	67,500.00	17,198,325.00	8.48
3	603225	新凤鸣	1,502,450.0 0	16,301,582.50	8.03
4	002271	东方雨虹	478,800.00	16,030,224.00	7.90
5	600872	中炬高新	426,100.00	15,808,310.00	7.79
6	603737	三棵树	105,000.00	12,223,050.00	6.02
7	603477	巨星农牧	401,400.00	12,174,462.00	6.00
8	603983	丸美股份	316,700.00	12,082,105.00	5.95
9	002567	唐人神	1,050,600.0 0	8,572,896.00	4.22
10	600079	人福医药	304,874.00	8,164,525.72	4.02

#### 4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

## 9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

## 9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

## 10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 10.1 本期国债期货投资政策

本基金暂不投资国债期货。

### 10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

### 10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

## 11 投资组合报告附注

11.1 报告期内，本基金投资的前十名证券的人福医药（证券代码：600079.SH）发行主体人福医药集团股份有限公司及其控股股东武汉当代科技产业集团股份有限公司、实际控制人艾路明在信息披露、规范运作等方面，有关责任人在职责履行方面因存在多项违规行为受到纪律处分。除上述情况外，本基金投资的其他证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

本基金投资上述标的的投资决策程序为：

- （一）投资决策委员会确定产品的基本投资逻辑；
- （二）投资研究体系中的研究平台是一个共享平台，为投资决策全流程提供研究支持；
- （三）基金经理/投资经理拟订所管理产品的投资计划与方案；

(四) 风险管理部对各投资组合的投资计划进行风险评价, 并向投资决策委员会提交评估报告;

(五) 投资决策委员会审议基金经理/投资经理提交的议案, 并形成决议;

(六) 根据决议, 基金经理/投资经理对计划方案进行具体实施;

(七) 集中交易部按有关交易规则执行基金经理/投资经理下达的交易指令, 并将有关信息进行反馈;

(八) 基金经理/投资经理定期汇报投资组合的运作成效;

(九) 风险管理部定期为投资决策委员会、投资总监、基金经理/投资经理出具绩效与风险评估报告。

11.2 报告期内, 本基金投资的前十名股票中, 没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

### 11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	119,079.70
2	应收证券清算款	4,120,601.27
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	71,630.28
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	4,311,311.25

### 11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有的处于转股期的可转换债券。

### 11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，本报告中涉及比例计算的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## 十一、基金的业绩

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

### (一) 基金净值表现

基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

财通多策略升级混合(LOF)A净值表现

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2017年9月9日-2017年12月31日	-3.18%	0.72%	3.04%	0.40%	-6.22%	0.32%
2018年1月1日-2018年12月31日	-22.03%	1.48%	-12.22%	0.74%	-9.81%	0.74%
2019年1月1日-2019年12月31日	23.91%	1.05%	21.32%	0.69%	2.59%	0.36%
2020年1月1日-2020年12月31日	23.46%	1.83%	16.76%	0.78%	6.70%	1.05%
2021年1月1日-2021年12月31日	-0.18%	1.35%	-0.66%	0.65%	0.48%	0.70%
2022年1月1日-2022年12月31日	-0.62%	2.03%	-10.69%	0.71%	10.07%	1.32%
2023年1月1日-2023年3月31日	5.82%	1.05%	2.91%	0.47%	2.91%	0.58%
自基金合同生效起至今(2017年9月9日-20	21.23%	1.53%	16.99%	0.69%	4.24%	0.84%



23年3月31日)						
-----------	--	--	--	--	--	--

## 财通多策略升级混合(LOF)C净值表现

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2022年3月3日-2022年12月31日	-2.79%	2.04%	-7.24%	0.73%	4.45%	1.31%
2023年1月1日-2023年3月31日	5.66%	1.05%	2.91%	0.47%	2.75%	0.58%
自基金合同生效起至今(2022年3月3日-2023年3月31日)	2.71%	1.86%	-4.54%	0.68%	7.25%	1.18%

注：(1)上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

(2)本基金业绩比较基准为：沪深300指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%；

(3)本基金自2022年3月3日起增设收取销售服务费的C类份额，原份额变更为A类份额。

(二) 自基金合同转型以来A类基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

财通多策略升级混合(LOF)A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



财通多策略升级混合(LOF)C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注：(1)本基金合同生效日为2016年3月9日，转型日期为2017年9月9日；

(2)本基金建仓期为基金合同生效起6个月，截至建仓期末及本报告期末，本基金的资产配置符合基金契约的相关要求；

(3)本基金自2017年9月8日起根据中国证券投资基金业协会《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）>的通知》（中基协发〔2017〕6号）确定的估值方法对持有的流通受限股票进行调整；

(4)本基金自2022年3月3日起增设收取销售服务费的C类份额，原份额变更为A类份额。

## 十二、基金的财产

### （一）基金资产总值

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

### （二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### （三）基金财产的账户

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

### （四）基金财产的保管和处分

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

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

## 十三、基金资产估值

### （一）估值日

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

### （二）估值对象

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

### （三）估值方法

#### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

（1）交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，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，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）交易所上市实行净价交易的债券按估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值；

（3）交易所上市未实行净价交易的债券按估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价减去估值全价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；

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

#### 2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

（1）送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所

挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

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

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

### 3、金融衍生品的估值

（1）评估金融衍生品价值时，应当采用市场公认或者合理的估值方法确定公允价值；

（2）股指期货合约一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值；

4、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用第三方估值机构提供的价格数据估值。同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

5、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。

6、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。

7、当本基金各类基金份额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。

8、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見，按照基金管理人對基金淨值的計算結果對外予以公布。

#### （四）估值程序

1、各類基金份額淨值是按照每個工作日閉市後，該類基金資產淨值除以當日該類基金份額的餘額數量計算，精確到 0.001 元，小數點後第 4 位四舍五入。國家另有規定的，從其規定。

每個工作日計算基金資產淨值及各類基金份額淨值，並按規定公告。

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

#### （五）估值錯誤的處理

基金管理人和基金託管人將採取必要、適當、合理的措施確保基金資產估值的準確性、及時性。當任一類基金份額淨值小數點後 3 位以內(含第 3 位)發生估值錯誤時，視為該類基金份額淨值錯誤。

基金合同的當事人應按照以下約定處理：

##### 1、估值錯誤類型

本基金運作過程中，如果由於基金管理人或基金託管人、或登記機構、或銷售機構、或投資人自身的過錯造成估值錯誤，導致其他當事人遭受損失的，過錯的責任人應當對由於該估值錯誤遭受損失當事人(“受損方”)的直接損失按下述“估值錯誤處理原則”給予賠償，承擔賠償責任。

上述估值錯誤的主要類型包括但不限於：資料申報差錯、數據傳輸差錯、數據計算差錯、系統故障差錯、下達指令差錯等。

##### 2、估值錯誤處理原則

(1) 估值錯誤已發生，但尚未給當事人造成損失時，估值錯誤責任方

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

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

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

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

### 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

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



#### 4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

(1) 任一类基金份额净值计算出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

(2) 错误偏差达到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。

(3) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

#### (六) 暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

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

4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

#### (七) 基金净值的确认

基金资产净值和各类基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的基金资产净值和各类基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对外公布。

#### (八) 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。

## 十四、基金的收益与分配

### （一）基金利润的构成

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

### （二）基金可供分配利润

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

### （三）基金收益分配原则

- 1、在封闭期内，本基金不进行收益分配；
- 2、转换为上市开放式基金（LOF）后，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 25%；
- 3、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金份额持有人可对 A 类和 C 类基金份额分别选择不同的分红方式；同一投资人持有的同一类别的基金份额只能选择一种分红方式，如投资人在不同销售机构选择的分红方式不同，则基金份额登记机构将以投资人最后一次选择的分红方式为准；
- 4、基金收益分配后任一类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的任一类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；
- 5、本基金各基金份额类别在费用收取上不同，其对应的可分配收益可能有所不同。同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### （四）收益分配方案

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

#### （五）收益分配方案的确定、公告与实施

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

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

#### （六）基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足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。

## 十五、基金费用与税收

### (一) 基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、从C类基金份额的基金财产中计提的销售服务费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券、期货交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、基金的上市初费和月费；
- 10、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

### (二) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.2%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.2\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

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

#### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.2% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

### 3、销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.4%。

本基金 C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值的 0.4% 的年费率计提，销售服务费计算方法如下：

$$H = E \times 0.4\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

C 类基金份额基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人支付给销售机构。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

4、上述“（一）基金费用的种类”中第 4—10 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，详见招募说明书“侧袋机制”部分的规定。

#### （五）基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## 十六、基金的会计与审计

### (一) 基金会计政策

- 1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；
- 2、基金的会计年度为公历年度的 1 月 1 日至 12 月 31 日；基金首次募集的会计年度按如下原则：如果《基金合同》生效少于 2 个月，可以并入下一个会计年度；
- 3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
- 4、会计制度执行国家有关会计制度；
- 5、本基金独立建账、独立核算；
- 6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；
- 7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

### (二) 基金的年度审计

- 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的符合《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。

## 十七、基金的信息披露

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

### (二) 信息披露义务人

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

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

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过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、恭维性或推荐性文字；



## 6、中国证监会禁止的其他行为。

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

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

### (五) 公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

#### 1、基金招募说明书、基金产品资料概要、《基金合同》、基金托管协议

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

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

基金产品资料概要是基金招募说明书的摘要文件，用于向投资者提供简明的基金概要信息。基金管理人应当依照法律法规和中国证监会的规定编制、披露与更新基金产品资料概要。

基金合同生效后，基金招募说明书、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，更新基金招募说明书和基金产品资料概要，并登载在规定网站上，其中基金产品资料概要还应当登载在基金销售机构网站或营业网点；除重大变更事项之外，基金招募说明书、基金产品资料概要其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书、基金产品资料概要。

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

## 2、基金份额发售公告

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

## 3、《基金合同》生效公告

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

## 4、基金份额上市交易公告书

基金份额获准在证券交易所上市交易的，基金管理人应当在基金份额上市交易 3 个工作日前，将基金份额上市交易公告书登载在规定媒介上。

## 5、基金净值信息

本基金的《基金合同》生效后，在基金份额开始上市交易前，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各类基金份额累计净值。

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

基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在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各类基金份额累计净值。

## 6、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者营业网点查阅或者复制前述信息资料。

## 7、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十五个工作日内，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。

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

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

## 8、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、变更基金管理人的实际控制人；

(8) 基金募集期延长；

(9) 基金管理人高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；

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

(11) 涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼或仲裁；

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

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

(14) 基金收益分配事项；

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

(16) 任一类基金份额净值计价错误达该类基金份额净值百分之零点五；

(17) 本基金开始办理申购、赎回；

(18) 本基金发生巨额赎回并延期办理；

(19) 本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；

(20) 本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；

(21) 基金份额暂停上市、恢复上市或终止上市；

(22) 发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大

事项时；

(23) 基金管理人采用摆动定价机制进行估值；

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

#### 9、澄清公告

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

#### 10、基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报国务院证券监督管理机构备案，并予以公告。

#### 11、清算报告

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。

#### 12、投资股指期货信息披露

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

#### 13、实施侧袋机制期间的信息披露

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

#### 14、中国证监会规定的其他信息。

基金管理人应在基金投资非公开发行股票后两个交易日内，在中国证监会规定媒介披露所投资非公开发行股票的名称、数量、总成本、账面价值，

以及总成本和账面价值占基金资产净值的比例、锁定期等信息。

#### （六）信息披露事务管理

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

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

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

基金管理人、基金托管人应当在规定报刊中选择一家披露信息的报刊。

基金管理人、基金托管人应当向中国证监会基金电子披露网站报送拟披露的基金信息，并保证相关报送信息的真实、准确、完整、及时。

为强化投资者保护，提升信息披露服务质量，基金管理人应当自中国证监会规定之日起，按照中国证监会规定向投资者及时提供对其投资决策有重大影响的信息。

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

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

#### （七）信息披露文件的存放与查阅

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

（八）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、出现导致基金管理人不能出售或评估基金资产的紧急事故的情况；
- 4、法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的情况。

## 十八、侧袋机制

### （一）侧袋机制的实施条件

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

基金管理人应当在启用侧袋机制后及时发布临时公告，并在五个工作日内聘请侧袋机制启用日发表意见且符合《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。

### （二）实施侧袋机制期间基金份额的申购与赎回

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

2、实施侧袋机制期间，基金管理人不得办理侧袋账户份额的申购、赎回和转换；同时，基金管理人按照基金合同和招募说明书的约定办理主袋账户份额的赎回，并根据主袋账户运作情况确定是否暂停申购。

3、除基金管理人应按照主袋账户的份额净值办理主袋账户份额的申购和赎回外，本招募说明书“基金份额的申购与赎回”部分的申购、赎回规定适用于主袋账户份额。巨额赎回按照单个开放日内主袋账户份额净赎回申请超过前一开放日主袋账户总份额的10%认定。

### （三）实施侧袋机制期间的基金投资

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



账户资产。

基金管理人原则上应当在侧袋机制启用后 20 个交易日内完成对主袋账户投资组合的调整，因资产流动性受限等中国证监会规定的情形除外。

基金管理人不得在侧袋账户中进行除特定资产处置变现以外的其他投资操作。

#### （四）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。侧袋账户的会计核算应符合《企业会计准则》的相关要求。

#### （五）实施侧袋账户期间的基金费用

1、本基金实施侧袋机制的，管理费和托管费按主袋账户基金资产净值作为基数计提。

2、与侧袋账户有关的费用可从侧袋账户中列支，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。

3、侧袋账户计提托管费。侧袋账户的托管费按前一日侧袋账户资产净值的 0.2% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的侧袋账户托管费

E 为前一日的侧袋账户基金资产净值

侧袋账户托管费每日计提，逐日累计，待特定资产变现后由基金管理人与基金托管人核对一致后，基金管理人向基金托管人发送划款指令，基金托管人进行支付。

#### （六）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。

侧袋机制实施期间，无论侧袋账户资产是否全部完成变现，基金管理人都应当及时向侧袋账户全部份额持有人支付已变现部分对应的款项。若侧袋账户资产无法一次性完成处置变现，基金管理人在每次处置变现后均应按照相关法律法规要求及时发布临时公告。

侧袋账户资产全部完成变现并终止侧袋机制后，基金管理人应及时聘请符合《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。

### （七）侧袋机制的信息披露

#### 1、临时公告

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

#### 2、基金净值信息

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

#### 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侧袋账户相关信息，基金定期报告中的基金会计报表仅需针对主袋账户进行编制。会计师事务所对基金年度报告进行审计时，应对报告期内基金侧袋机制运行相关的会计核算和年度报告披露等发表审计意见。

## 十九、风险揭示

### （一）投资于本基金的风险

#### 1、市场风险

本基金为证券投资基金，证券市场的变化将影响到基金的业绩。因此，宏观和微观经济因素、国家政策、市场变动、行业与个股业绩的变化、投资人风险收益偏好和市场流动程度等影响证券市场的各种因素将影响到本基金业绩，从而产生市场风险，这种风险主要包括：

##### （1）经济周期风险

随着经济运行的周期性变化，国家经济、微观经济、行业及上市公司的盈利水平也可能呈周期性变化，从而影响到证券市场及行业的走势。

##### （2）政策风险

因国家的各项政策，如财政政策、货币政策、产业政策、地区发展政策等发生变化，导致证券市场波动而影响基金投资收益，产生风险。

##### （3）利率风险

由于利率发生变化和波动使得证券价格和证券利息产生波动，从而影响到基金业绩。

##### （4）信用风险

当证券发行人不能够实现发行时所做出的承诺，按时足额还本付息的时候，就会产生信用风险。信用风险主要来自于发行人和担保人。一般认为：国债的信用风险可以视为零，而其他债券的信用风险可根据专业机构的信用评级确定。当证券的信用等级发生变化时，可能会产生证券的价格变动，从而影响到基金资产。

##### （5）再投资风险

再投资获得的收益又被称作利息的利息，这一收益取决于再投资时的市场利率水平和再投资的策略。未来市场利率的变化可能会引起再投资收益的不确定性并可能影响到基金投资策略的顺利实施。

### （6）购买力风险

基金份额持有人收益将主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀因素而使其购买力下降。

### （7）上市公司经营风险

上市公司的经营状况受多种因素的影响，如经营决策、技术变革、新产品研发、竞争加剧等风险。如果基金所投资的上市公司基本面或发展前景产生变化，可能导致其股价的下跌，或者可分配利润的降低，使基金预期收益产生波动。虽然基金可以通过分散化投资来减少风险，但不能完全规避。

## 2、管理风险

（1）在基金管理运作中，基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的占有以及对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平。对信息的占有以及对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平。

（2）基金管理人和基金托管人的管理手段和管理技术等因素的变化也会影响基金收益水平。

## 3、估值风险

本基金采用的估值方法有可能不能充分反映和揭示利率风险，或经济环境发生重大变化时，在一定时期内可能高估或低估基金资产净值。基金管理人和基金托管人将共同协商，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，使调整后的基金资产净值更公允地反映基金资产价值，确保基金资产净值不会对基金份额持有人造成实质性的损害。

## 4、流动性风险

本基金转换为上市开放式基金（LOF）后，基金规模将随着基金投资者对基金份额的申购和赎回而不断波动。基金投资者的连续大量赎回可能使基金资产难以按照预先期望的价格变现，而导致基金的投资组合流动性不足；或者投资组合持有的证券由于外部环境影响或基本面发生重大变化而导致流动性降低，造成基金资产变现的损失，从而产生流动性风险。

侧袋机制是一种流动性风险管理工具，是将特定资产分离至专门的侧袋

账户进行处置清算，并以处置变现后的款项向基金份额持有人进行支付，目的在于有效隔离并化解风险。但基金启用侧袋机制后，侧袋账户份额将停止披露基金份额净值，并不得办理申购、赎回和转换，仅主袋账户份额正常开放赎回，因此启用侧袋机制时持有基金份额的持有人将在启用侧袋机制后同时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特定资产的真实价值及变化情况。

## 5、本基金特有风险

(1) 本基金为混合型基金，在投资管理中会至少维持 30% 的股票投资比例，不能完全规避市场下跌的风险和个股风险，在市场上涨时也不能保证基金净值能够完全跟随或超越市场涨幅。

(2) 在股票资产配置上，本基金主要运用成长、主题、定向增发、动量等多种策略精选个股，而市场整体并不全部符合本基金的选股标准。在特定的投资期间之内，本基金的收益率可能会与市场整体产生偏差。

(3) 本基金的投资范围包括股指期货，期货是一种复杂的投资工具，期货合约价值取决于基础资产价格变动等诸多因素，并且远期价格与即期价格不时背离，该等因素均无法为基金管理人准确判断，因此委托资产投资期

货可能由于基金管理人判断错误而导致损失，且基金管理人该种判断错误是不可克服和不可避免的。期货是一种高风险的投资工具，实行保证金交易制度具有杠杆性，高杠杆效应放大的价格波动风险；当出现不利行情时，股价指数微小的变动就可能会使委托资产遭受较大损失。期货采用保证金交易制度，实行每日无负债结算，对资金管理有较高要求；价格波动剧烈的时候会导致保证金不足，如果基金管理人未能及时追加保证金，委托资产持有的未平仓合约将可能在亏损的情况下被平仓，致使委托资产遭受损失。期货市场在运作中由于管理法规和机制不健全等原因，可能产生流动性风险、结算风险、交割风险等，该等风险都可能导致委托资产的损失。由于国家法律、法规、政策的变化、期货交易所交易规则的修改、紧急措施的出台等原因，委托资产持有的未平仓合约可能无法继续持有，委托资产可能因此而导致损失。“套期保值”交易同投机交易一样，同样面临价格波动引起的风险，“套期保值”同样会导致委托财产的损失。

(4) 基金经理主观判断错误的风险。

(5) 投资科创板股票的风险：

1) 流动性风险：

科创板股票交易实施更加严格的投资者适当性管理制度，投资者门槛高；随着后期上市企业的增加，部分股票可能面临交易不活跃、流动性差等风险；且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成交的风险。

2) 退市风险：

科创板退市制度较主板更为严格，退市时间短、退市速度快、退市情形多，且不再设置暂停上市、恢复上市和重新上市环节，上市公司退市风险更大，可能给基金净值带来不利影响。

3) 集中投资风险：

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

## (6) 投资存托凭证的风险

### 1) 存托凭证市场价格大幅波动的风险

存托凭证的交易框架中涉及发行人、存托人、托管人等多个法律主体，其交易结构及原理与股票相比更为复杂。存托凭证属于市场创新产品，中国境内资本市场尚无先例，其未来的交易活跃程度、价格决定机制、投资者关注度等均存在较大的不确定性。因此，存托凭证的交易价格可能存在大幅波动的风险。

### 2) 存托凭证持有人与境外基础证券持有人的权益存在差异可能引发的风险

存托凭证由存托人签发、以境外证券为基础在中国境内发行，代表境外基础证券权益。存托凭证持有人实际享有的权益与境外基础证券持有人的权益虽然基本相当，但并不能等同于直接持有境外基础证券。

### 3) 存托凭证存续期间的风险

存托凭证存续期间，存托凭证项目内容可能发生重大、实质变化，包括但不限于存托凭证与基础证券转换比例发生调整、红筹公司和存托人可能对存托协议作出修改、更换存托人、更换托管人、存托凭证主动退市等。部分变化可能仅以事先通知的方式，即对其投资者生效。存托凭证的投资者可能无法对此行使表决权。

存托凭证存续期间，对应的基础证券等财产可能出现被质押、挪用、司法冻结、强制执行等情形，存托凭证的投资者可能失去应有权利的风险。

### 4) 退市风险

存托凭证退市的，可能面临存托人无法根据存托协议的约定卖出基础证券，存托凭证无法转到境内其他市场进行公开交易或者转让，存托人无法继续按照存托协议的约定为投资者提供相应服务的风险。

### 5) 其他风险

存托凭证还存在其他风险，包括但不限于存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险；因地上市造成存托凭证价格差异以及波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；已在境外上市

的基础证券发行人，在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险；境内外法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险等。

#### （7）投资资产支持证券风险

1）与基础资产相关的风险。包括特定原始权益人破产风险、现金流预测风险等与基础资产相关的风险。

2）与资产支持证券相关的风险。包括资产支持证券的利率风险、资产支持证券的流动性风险、评级风险等与资产支持证券相关的风险。

3）其他风险。包括政策风险、发生不可抗力事件的风险、技术风险和操作风险。

### 6、其他风险

#### （1）技术风险

当计算机、通讯系统、交易网络等技术保障系统或信息网络支持出现异常情况，可能导致基金日常的申购赎回无法按正常时限完成、注册登记系统瘫痪、核算系统无法按正常时限显示产生净值、基金的投资交易指令无法及时传输等风险。

#### （2）大额申购/赎回风险

本基金转换为上市开放式基金（LOF）后，基金规模将随着投资人对基金单位的申购与赎回而不断变化，若是由于投资人的连续大量申购而导致基金管理人在短期内被迫持有大量现金；或由于投资人的连续大量赎回而导致基金管理人被迫抛售所持有的证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响。

#### （3）顺延或暂停赎回风险

本基金转换为上市开放式基金（LOF）后，因为市场剧烈波动或其他原因而连续出现巨额赎回，并导致基金管理人的现金支付出现困难，基金投资人在赎回基金单位时，可能会遇到部分顺延赎回或暂停赎回等风险。

#### （4）其他风险

战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金资产有遭受损失的风险，以及证券市场、基金管理人及基金代销机构可能因不可抗力无法正常工作，从而



产生影响基金的申购和赎回按正常时限完成的风险。

## 二十、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### （一）《基金合同》的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于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应当报中国证监会备案，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，《基金合同》应当终止：

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

### （三）基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金管理人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)聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- (6)将清算报告报中国证监会备案并公告。
- (7)对基金财产进行分配；

#### 5、基金财产清算的期限为6个月。

#### (四) 清算费用

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

#### (五) 基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按在基金合同终止事由发生时各类基金份额资产净值的比例确定剩余财产在各类基金份额中的分配比例，并在各类基金份额可分配的剩余财产范围内按各类别基金份额的基金份额持有人持有的该类基金份额比例进行分配。同一类别的基金份额持有人对基金财产清算后剩余资产具有同等的分配权。

#### (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。

(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不低于法律法规规定的最低期限。

## 二十一、基金合同的内容摘要

### 一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

#### (一) 基金份额持有人的权利与义务

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

同一类别每份基金份额具有同等的合法权益。

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

- (1) 分享基金财产收益；
- (2) 参与分配清算后的剩余基金财产；
- (3) 依法申请赎回其持有的基金份额；
- (4) 按照规定要求召开或者自行召集基金份额持有人大会；
- (5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- (6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- (7) 监督基金管理人的投资运作；
- (8) 对基金管理人、基金托管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

- (1) 认真阅读并遵守《基金合同》；
- (2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自行承担投资风

险；

(3) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；

(4) 缴纳基金认购、申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；

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

(6) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；

(7) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(8) 返还在基金交易过程中因各种原因获得的不当得利；

(9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## (二) 基金管理人的权利与义务

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

(1) 依法募集基金；

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

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

(4) 销售基金份额；

(5) 召集基金份额持有人大会；

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

(7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

(8) 选择、更换基金服务机构，对基金服务机构的相关行为进行监督和处理；

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

(10) 依据《基金合同》及有关法律规定决定基金收益的分配方案;

(11) 在《基金合同》约定的范围内,拒绝或暂停受理申购与赎回申请;

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

(13) 在法律法规允许的前提下,为基金的利益依法为基金进行融资融券;

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

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

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

(17) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

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

(2) 办理基金备案手续;

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

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

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

(6) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外,不得利用基金

财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

(7) 依法接受基金托管人的监督；

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

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(10) 编制季度、中期和年度基金报告；

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

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

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

(14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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

(16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料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内发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件；

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

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

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



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

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

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

(24) 基金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) 建立并保存基金份额持有人名册；

(27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

### (三) 基金托管人的权利与义务

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

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

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

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

(4) 根据相关市场规则，为基金开设证券账户、为基金办理证券交易资金清算。

(5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

(6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

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

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

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

(5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

(6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户，按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

(7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；

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

(9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

(10) 对基金财务会计报告、季度、中期和年度基金报告出具意见，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) 建立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监管机构，并通知基金管理人；
- (19) 因违反《基金合同》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- (20) 按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿；
- (21) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- (22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## 二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的同一类别每一基金份额拥有平等的投票权。

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

### (一) 召开事由

- 1、除法律法规，或基金合同，或中国证监会另有规定外，当出现或需

要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

- (1) 终止《基金合同》；
- (2) 更换基金管理人；
- (3) 更换基金托管人；
- (4) 转换基金运作方式，但不包括本基金结束封闭期转换为上市开放式基金（LOF）；
- (5) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准或提高销售服务费率；
- (6) 变更基金类别；
- (7) 本基金与其他基金的合并；
- (8) 变更基金投资目标、范围或策略；
- (9) 变更基金份额持有人大会程序；
- (10) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- (11) 单独或合计持有本基金总份额 10% 以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；
- (12) 对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；
- (13) 法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

2、以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

- (1) 调低基金管理费、基金托管费；
- (2) 法律法规要求增加的基金费用的收取；
- (3) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、赎回费率/调低销售服务费率或其他应由基金承担的费用；
- (4) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；
- (5) 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生变化；
- (6) 基金管理人、基金登记机构在法律法规规定或中国证监会许可的

范围内调整或修改《业务规则》，包括但不限于有关基金认购、申购、赎回、转换、基金交易、非交易过户、转托管等内容；

(7) 增加、取消或者调整基金份额类别设置、变更收费方式或者停止现有基金份额的销售及对基金份额分类办法及规则进行调整；

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

## (二) 会议召集人及召集方式

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

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集；

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

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

5、代表基金份额 10% 以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独

或合计代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

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

### （三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

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

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

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

### （四）基金份额持有人出席会议的方式

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

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

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

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

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

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

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

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

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

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

4、基金份额持有人授权他人代为出席会议并表决的,授权方式可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式,具体方式在会议通知中列明。

#### 5、重新召集基金份额持有人大会的条件

基金份额持有人大会应当有代表二分之一以上基金份额的持有人参加,方可召开。

参加基金份额持有人大会的持有人的基金份额低于上述规定比例的,召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内,就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上基金份额的持有人参加,方可召开。

### (五) 议事内容与程序

#### 1、议事内容及提案权

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

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。



## 2、议事程序

### (1) 现场开会

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

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

### (2) 通讯开会

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

## (六) 表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议:

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

2、特别决议,特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上(含三分之二)通过方可做出。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》、与其他基金合并

以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

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

### （七）计票

#### 1、现场开会

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

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

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

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

## 2、通讯开会

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

### （八）生效与公告

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

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

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

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

### （九）实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定

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

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

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

3、通讯开会的直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金

份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日相关基金份额的二分之一（含二分之一）；

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

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

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

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

同一主侧袋账户内的每份基金份额具有平等的表决权。

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

### 三、基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产的清算

#### （一）《基金合同》的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于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应当报中国证监会备案，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，《基金合同》应当终止：

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

## （三）基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金管理人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）聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- （6）将清算报告报中国证监会备案并公告。

(7) 对基金财产进行分配；

5、基金财产清算的期限为 6 个月。

#### (四) 清算费用

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

#### (五) 基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按在基金合同终止事由发生时各类基金份额资产净值的比例确定剩余财产在各类基金份额中的分配比例，并在各类基金份额可分配的剩余财产范围内按各类别基金份额的基金份额持有人持有的该类基金份额比例进行分配。同一类别的基金份额持有人对基金财产清算后剩余资产具有同等的分配权。

#### (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。

#### (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不低于法律法规规定的最低期限。

### 四、争议解决方式

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根

据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，仲裁费由败诉方承担。

《基金合同》受中国法律管辖。

## 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。

## 二十二、基金托管协议的内容摘要

### 一、托管协议的当事人

#### (一) 基金管理人

名称：财通基金管理有限公司

住所：上海市虹口区吴淞路 619 号 505 室

法定代表人：吴林惠

成立时间：2011 年 6 月 21 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监许可【2011】840 号

注册资本：贰亿元人民币

组织形式：有限责任公司

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。**【企业经营涉及行政许可的，凭许可证件经营】**

存续期间：持续经营

电话：021-2053 7888

传真：021-6888 8169

#### (二) 基金托管人

名称：中国工商银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 55 号（100032）

法定代表人：陈四清

电话：（010）66105799

传真：（010）66105798

联系人：蒋松云

成立时间：1984 年 1 月 1 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币 35,640,625.71 元



批准设立机关和设立文号：国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》（国发[1983]146号）

存续期间：持续经营

经营范围：办理人民币存款、贷款、同业拆借业务；国内外结算；办理票据承兑、贴现、转贴现、各类汇兑业务；代理资金清算；提供信用证服务及担保；代理销售业务；代理发行、代理承销、代理兑付政府债券；代收代付业务；代理证券投资基金清算业务（银证转账）；保险代理业务；代理政策性银行、外国政府和国际金融机构贷款业务；保管箱服务；发行金融债券；买卖政府债券、金融债券；证券投资基金、企业年金托管业务；企业年金受托管理服务；年金账户管理服务；开放式基金的注册登记、认购、申购和赎回业务；资信调查、咨询、见证业务；贷款承诺；企业、个人财务顾问服务；组织或参加银团贷款；外汇存款；外汇贷款；外币兑换；出口托收及进口代收；外汇票据承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；发行、代理发行、买卖或代理买卖股票以外的外币有价证券；自营、代客外汇买卖；外汇金融衍生业务；银行卡业务；电话银行、网上银行、手机银行业务；办理结汇、售汇业务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。

## 二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

### （一）基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权

1、基金托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定，对下述基金投资范围、投资对象进行监督。

本基金将投资于以下金融工具：

国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证）、权证、债券、中期票据、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

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

本基金不得投资于相关法律、法规、部门规章及《基金合同》禁止投资的投资工具。

2、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投融资比例进行监督：

(1) 按法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金的投资资产配置比例为：本基金股票（含存托凭证）投资占基金资产的比例为 30%–95%；债券、中期票据、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具等固定收益品种的投资占基金资产的比例为 0%–70%；在封闭期内，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；转换为上市开放式基金（LOF）后，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

因基金规模或市场变化等因素导致投资组合不符合上述规定的，基金管理人应在合理的期限内调整基金的投资组合，以符合上述比例限定。法律法规另有规定时，从其规定。

如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。

(2) 根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金投资组合遵循以下投资限制：

a、本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；

b、本基金管理人管理且由基金托管人托管的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；

c、本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

d、本基金管理人管理且由基金托管人托管的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

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

f、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%；

g、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%；

h、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%；

i、本基金管理人管理且由基金托管人托管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%；

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

k、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；

l、本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；

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

n、本基金在封闭期内，任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值与有价证券之和，不得超过基金资产净值的 100%；转换为上市开放式基金(LOF)后，任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；其中，有价证券指股票、债券(不包含到期日在一年以内的政府债券)、权证、资产支持债券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等；

o、本基金在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过

基金持有的股票总市值的 20%；

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

q、本基金在封闭期内，基金总资产不得超过基金净资产的 200%，转换为上市开放式基金（LOF）后，基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

r、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；

s、本基金管理人管理且由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%；本基金管理人管理且由基金托管人托管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%；

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

u、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；

《基金法》及其他有关法律法规或监管部门取消上述限制的，如适用于本基金，则本基金不受上述限制，但须提前公告，不需要经基金份额持有人审议。

### （3）法规允许的基金投资比例调整期限

因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价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，除上述 j、t、u 点的情形外，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规另有规定的，从其规定。

本基金持有证券期间，如发生证券处于流通受限状态等非基金管理人原因导致基金投资比例不符合前述规定的，基金管理人应在上述情形消除后的 10 个交易日内调整完毕。法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应在出现可预见资产规模大幅变动的情况下，至少提前 2 个工作日正式向基金托管人发函说明基金可能变动规模和公司应对措施，便于托管人实施交易监督。

(4) 本基金可以按照国家的有关规定进行融资融券。

除投资资产配置外，基金托管人对基金投资的监督和检查自《基金合同》生效之日起开始。

3、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投资禁止行为进行监督：

根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金禁止从事下列行为：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但中国证监会另有规定的除外；
- (5) 向基金管理人、基金托管人出资。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

4、基金托管人依据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。

(1) 基金托管人按以下方式对基金管理人参与银行间市场交易的交易对手资信风险控制措施进行监督。

基金管理人向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的银行间市场交易对手的名单，并按照审慎的风险控制原则在该名单中约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金托管人在收到名单后 2 个工作日内回函确认收到该名单。基金管理人应定期或不定期对银行间市场现券及回购交易对手的名单进行更新，名单中增加或减少银行间市场交易对手时须提前书面通知基金托管人，基金托管人于 2 个工作日内回函确认收到后，对名单进行更新。基金管理人收到基金托管人书面确认后，被确认调整的名单开始生效，新名单生效前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。

如果基金托管人发现基金管理人与不在名单内的银行间市场交易对手进行交易,应及时提醒基金管理人撤销交易,经提醒后基金管理人仍执行交易并造成基金资产损失的,基金托管人不承担责任,发生此种情形时,托管人有权报告中国证监会。

#### (2) 基金托管人对于基金管理人参与银行间市场交易的交易方式的控制

基金管理人在银行间市场进行现券买卖和回购交易时,需按交易对手名单中约定的该交易对手所适用的交易结算方式进行交易。如果基金托管人发现基金管理人没有按照事先约定的交易方式进行交易时,基金托管人应及时提醒基金管理人与交易对手重新确定交易方式,经提醒后仍未改正时造成基金资产损失的,基金托管人不承担责任。

(3)基金管理人参与银行间市场交易的核心交易对手为中国工商银行、中国银行、中国建设银行、中国农业银行和交通银行,基金管理人在通知基金托管人后,可以根据当时的市场情况调整核心交易对手名单。基金管理人有责任控制交易对手的资信风险,在与核心交易对手以外的交易对手进行交易时,由于交易对手资信风险引起的损失先由基金管理人承担,其后有权要求相关责任人进行赔偿。基金托管人的监督责任仅限于根据已提供的名单,审核交易对手是否在名单内列明。

#### 5、基金托管人对基金管理人选择存款银行进行监督。

本基金投资银行存款的信用风险主要包括存款银行的信用等级、存款银行的支付能力等涉及到存款银行选择方面的风险。本基金核心存款银行名单为中国工商银行、中国银行、中国建设银行、中国农业银行和交通银行,本基金投资除核心存款银行以外的银行存款出现由于存款银行信用风险而造成的损失时,先由基金管理人负责赔偿,之后有权要求相关责任人进行赔偿。基金管理人在通知基金托管人后,可以根据当时的市场情况对于核心存款银行名单进行调整。基金托管人的监督责任仅限于根据已提供的名单,审核核心存款银行是否在名单内列明。

#### 6、基金托管人对基金投资流通受限证券的监督

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

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

(3) 基金管理人应在基金首次投资流通受限证券前，向基金托管人提供经基金管理人董事会批准的有关基金投资流通受限证券的投资决策流程、风险控制制度。基金投资非公开发行股票，基金管理人还应提供基金管理人董事会批准的流动性风险处置预案。上述资料应包括但不限于基金投资流通受限证券的投资额度和投资比例控制情况。

上述规章制度须经基金管理人董事会批准。上述规章制度经董事会通过之后，基金管理人应至少于首次执行投资指令之前两个工作日将上述资料书面发至基金托管人，保证基金托管人有足够的时间进行审核。基金托管人应在收到上述资料后两个工作日内，以书面或其他双方认可的方式确认收到上述资料。

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

(5) 基金托管人应按照《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》规定，对基金管理人是否遵守法律法规进行监督，并审核基金管理人提供的有关书面信息。基金托管人认为上述资料可能导致基金出现风险的，有权要求基金管理人在投资流通受限证券前就该风险的消除或防范措施进行补充书面说明，并保留查看基金管理人风险管理部门就基金投

资流通受限证券出具的风险评估报告等备查资料的权利。否则，基金托管人有权拒绝执行有关指令。因拒绝执行该指令造成基金财产损失的，基金托管人不承担任何责任，并有权报告中国证监会。

如基金管理人和基金托管人无法达成一致，应及时上报中国证监会请求解决。如果基金托管人切实履行监督职责，则不承担任何责任。如果基金托管人没有切实履行监督职责，导致基金出现风险，基金托管人应承担连带责任。

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

(三) 基金托管人发现基金管理人的投资运作及其他运作违反《基金法》、《基金合同》、基金托管协议有关规定时，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到书面通知后应在下一个工作日及时核对，并以书面形式向基金托管人发出回函，就基金托管人的合理疑义进行解释或举证。

在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。基金托管人有义务要求基金管理人赔偿因其违反《基金合同》而致使投资者遭受的损失。

对于依据交易程序尚未成交的且基金托管人在交易前能够监控的投资指令，基金托管人发现该投资指令违反法律法规规定或者违反《基金合同》约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并向中国证监会报告。

对于必须于估值完成后方可获知的监控指标或依据交易程序已经成交的投资指令，基金托管人发现该投资指令违反法律法规或者违反《基金合同》约定的，应当立即通知基金管理人，并报告中国证监会。

基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查，必须在规定时间内答复基金托管人并改正，就基金托管人的合理疑义进行解释或举证，对



基金托管人按照法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的,基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

基金托管人发现基金管理人有关重大违规行为,应立即报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正。

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

### 三、基金管理人对基金托管人的业务核查

基金管理人对基金托管人履行托管职责情况进行核查,核查事项包括但不限于基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和各类基金份额净值、根据管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、无故未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、《基金合同》、本托管协议及其他有关规定时,基金管理人应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正,基金托管人收到通知后应及时核对确认并以书面形式向基金管理人发出回函。在限期内,基金管理人有权随时对通知事项进行复查,督促基金托管人改正,并予协助配合。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的,基金管理人应报告中国证监会。基金管理人有关义务要求基金托管人赔偿基金因此所遭受的损失。

基金管理人发现基金托管人有重大违规行为,应立即报告中国证监会和银行业监督管理机构,同时通知基金托管人限期纠正。

基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为,包括但不限于:提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性,在规定时间内答复基金管理人并改正。

基金托管人无正当理由,拒绝、阻挠基金管理人根据本协议规定行使监

督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍基金管理人进行有效监督，情节严重或经基金管理人提出警告仍不改正的，基金管理人应报告中国证监会。

#### 四、基金财产的保管

##### （一）基金财产保管的原则

- 1、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。
- 2、基金托管人应安全保管基金财产。未经基金管理人的正当指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。
- 3、基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户。
- 4、基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，与基金托管人的其他业务和其他基金的托管业务实行严格的分账管理，确保基金财产的完整与独立。
- 5、对于因基金认（申）购、基金投资过程中产生的应收财产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金托管人处的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失，基金托管人对此不承担责任。

##### （二）募集资金的验证

募集期内销售机构按销售与服务代理协议的约定，将认购资金划入基金管理人在具有托管资格的商业银行开设的财通基金管理有限公司基金认购专户。该账户由基金管理人开立并管理。基金募集期满，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，由基金管理人聘请符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所进行验资，出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的 2 名以上（含 2 名）中国注册会计师签字有效。验资完成，基金管理人应将募集的属于本基金财产的全部资金划入基金托管人为基金开立的资产托管专户中，基金托管人在收到资金当日出具确认文件。

若基金募集期限届满，未能达到《基金合同》生效的条件，由基金管理

人按规定办理退款事宜。

### （三）基金的银行账户的开立和管理

基金托管人以基金托管人的名义在其营业机构开设资产托管专户，保管基金的银行存款。该账户的开设和管理由基金托管人承担。本基金的一切货币收支活动，均需通过基金托管人的资产托管专户进行。

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

资产托管专户的管理应符合《人民币银行结算账户管理办法》、《现金管理暂行条例》、《人民币利率管理规定》、《利率管理暂行规定》、《支付结算办法》以及银行业监督管理机构的其他规定。

### （四）基金证券账户与证券交易资金账户的开设和管理

基金托管人以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限公司上海分公司/深圳分公司开设证券账户。

基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司开立基金证券交易资金账户，用于证券清算。

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

### （五）债券托管账户的开立和管理

1、《基金合同》生效后，基金管理人负责以基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表基金进行交易；基金托管人负责以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司开设银行间债券市场债券托管自营账户，并由基金托管人负责基金的债券的后台匹配及资金的清算。

2、基金管理人和基金托管人应一起负责为基金对外签订全国银行间债券市场回购主协议，正本由基金托管人保管，基金管理人保存副本。

### （六）其他账户的开设和管理

在本托管协议订立日之后,本基金被允许从事符合法律法规规定和《基金合同》约定的其他投资品种的投资业务时,如果涉及相关账户的开设和使用,由基金管理人协助托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定,开立有关账户。该账户按有关规则使用并管理。

(七)基金财产投资的有关实物证券、银行定期存款存单等有价凭证的保管

基金财产投资的有关实物证券由基金托管人存放于基金托管人的保管库;其中实物证券也可存入中央国债登记结算有限责任公司或中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司、银行间市场清算所股份有限公司或票据营业中心的代保管库。实物证券的购买和转让,由基金托管人根据基金管理人的指令办理。属于基金托管人实际有效控制下的实物证券在基金托管人保管期间的损坏、灭失,由此产生的责任应由基金托管人承担。基金托管人对基金托管人以外机构实际有效控制或保管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

由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同的原件分别应由基金托管人、基金管理人保管。除本协议另有规定外,基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时,应保证基金一方持有两份以上的正本,以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人在合同签署后5个工作日内通过专人送达、挂号邮寄等安全方式将合同原件送达基金托管人处。合同原件应存放于基金管理人和基金托管人各自文件保管部门,不低于法律法规规定的最低期限。

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

## 五、基金资产净值计算与复核

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。各类基金份额净值是指计算日基金资产净值除以该计算日该类基金份额总份额后的数值。各类

基金份额净值的计算保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

基金管理人应每工作日对基金资产估值。估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算业务指引》及其他法律、法规的规定。基金资产净值和各类基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金资产净值和各类基金份额净值，并以双方认可的方式发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核后以双方认可的方式发送给基金管理人，由基金管理人对外公布。

根据《基金法》，基金管理人计算并公告基金净值，基金托管人复核、审查基金管理人计算的基金净值。因此，本基金的会计责任方是基金管理人，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見，按照基金管理人对外公布的结果处理。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。

## 六、基金份额持有人名册的登记与保管

基金管理人和基金托管人须分别妥善保管的基金份额持有人名册，包括《基金合同》生效日、《基金合同》终止日、基金份额持有人大会权利登记日、每年 6 月 30 日、12 月 31 日的基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容必须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的基金注册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按照目前相关规则分别保管基金份额持有人名册。保管方式可以采用电子或文档的形式。登记机构的保管期限自基金账户销户之日起不得少于 20 年。

基金管理人应当及时向基金托管人提交下列日期的基金份额持有人名册：《基金合同》生效日、《基金合同》终止日、基金份额持有人大会权利登记日、每年 6 月 30 日、每年 12 月 31 日的基金份额持有人名册。基金份额

持有人名册的内容必须包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。其中每年 12 月 31 日的基金份额持有人名册应于下月前十个工作日内提交；《基金合同》生效日、《基金合同》终止日等涉及到基金重要事项日期的基金份额持有人名册应于发生日后十个工作日内提交。

基金托管人以电子版形式妥善保管基金份额持有人名册，并定期刻成光盘备份，保存期限不低于法律法规规定的最低期限。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。

若基金管理人或基金托管人由于自身原因无法妥善保管基金份额持有人名册，应按有关法规规定各自承担相应的责任。

## 七、争议解决方式

相关各方当事人同意，因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议，除经友好协商可以解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点在北京，仲裁裁决是终局性的并对相关各方均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

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

本协议受中国法律管辖。

## 八、托管协议的修改与终止

### 1、托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议的内容进行变更。变更后的托管协议，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。

### 2、基金托管协议终止的情形

发生以下情况，本托管协议终止：

- (1) 《基金合同》终止；
- (2) 基金托管人解散、依法被撤销、破产或有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、破产或有其他基金管理人接管基金管理权；
- (4) 发生法律法规或《基金合同》规定的终止事项。

## 二十三、对基金份额持有人的服务

对基金份额持有人的服务主要由基金管理人及销售机构提供,以下是基金管理人提供的主要服务内容。基金管理人根据基金份额持有人的需要和市场的变化,有权在符合法律法规的前提下,增加和修改相关服务项目。如因系统、第三方或不可抗力等原因,导致下述服务无法提供,基金管理人不承担任何责任。

### (一) 持有人注册登记服务

基金管理人自行或委托登记机构为基金份额持有人提供登记服务。基金管理人将敦促基金登记机构配备安全、完善的电脑系统及通讯系统,准确、及时地为基金投资者办理基金账户、基金份额的登记、管理、托管与转托管;基金转换和非交易过户;基金份额持有人名册的管理;权益分配时红利的登记派发;基金交易份额的清算过户和基金交易资金的交收等服务。

### (二) 持有人通知服务及对账单服务

1、通知基金份额持有人的内容包括短信账单、电子对账单等服务。对于订制手机短信对账单的基金份额持有人,本公司将每月向账单期内有份额余额的基金份额持有人发送,方便基金份额持有人快速获得账户信息。对于订制电子对账单的基金份额持有人,本基金管理人将每月或每年通过E-MAIL向账单期内有交易或期末有余额的基金份额持有人发送上个月或年度基金交易对账单,以方便基金份额持有人快速获得交易信息,电子邮件地址及手机号码不详的、微信未绑定或取消关注的除外。

2、纸质账单服务:基金管理人将采取以电子账单为主的账单服务方式,但继续为有需求的基金份额持有人提供纸质账单服务,基金份额持有人可通过客户服务热线电话400-820-9888订制纸质账单。



### （三）在线服务

通过基金管理人网站（[www.ctfund.com](http://www.ctfund.com)）、微信公众号（可搜索“财通基金微管家”或“ctfund88”）或财通基金 APP 客户端，投资人可获得如下服务：

#### 1、查询服务

机构投资者通过基金管理人网站，个人投资者通过基金管理人网站、微信公众号或 APP 客户端，可享有基金交易查询、账户查询和相关基金信息查询等服务。

#### 2、网上交易服务

个人投资者可通过基金管理人网站、微信公众号或 APP 客户端办理开户、认购/申购、赎回及信息查询等业务。有关基金管理人电子直销具体规则请参见基金管理人网站相关公告和业务规则。

#### 3、信息资讯服务

基金份额持有人可以利用基金管理人网站等获取基金和基金管理人依法披露的各类信息，包括基金的法律文件、基金公告、定期报告和基金管理人最新动态等各类资料。

### （四）客户服务中心电话服务

客户服务中心提供 24 小时自动语音查询服务。基金份额持有人可进行基金账户余额、申购与赎回交易情况查询与基金产品等信息的查询。

客户服务中心提供每周五天，每天不少于 8 小时的人工热线咨询服务。基金份额持有人可通过客服热线电话：400-820-9888 享受业务咨询、信息查询、服务投诉、信息定制、对账单寄送地址资料修改等专项服务。

### （五）投资者投诉受理服务

基金份额持有人可以通过代销机构网点或基金管理人客服热线电话、信函及电子邮件等形式对基金管理人或销售网点所提供的服务进行投诉。

客服热线电话投诉、电子邮件投诉、信函投诉是主要投诉受理渠道，现

场投诉和意见簿投诉是补充投诉渠道，由各代销机构和基金管理人分别管理。

基金管理人客服热线电话：400-820-9888；客服邮箱：service@ctfund.com

（六）如本招募说明书存在任何您/贵机构无法理解的内容，请通过上述方式及时联系基金管理人。请确保投资前，您/贵机构已经全面理解本招募说明书，并同意全部内容。

## 二十四、其他应披露事项

以下信息披露事项已通过中国证监会规定媒介以及基金管理人的公司网站（www.ctfund.com）进行公开披露。

1. 2022年05月20日披露了《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加部分代销机构基金申购费率优惠活动的公告》；

2. 2022年05月27日披露了《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加宁波银行股份有限公司基金申购费率优惠活动的公告》；

3. 2022年06月15日披露了《关于上海尚善基金销售有限公司终止代理销售财通基金管理有限公司旗下基金的公告》；

4. 2022年06月15日披露了《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加国泰君安证券股份有限公司基金申购费率优惠活动的公告》；

5. 2022年06月25日披露了《财通多策略升级混合型证券投资基金(LOF)基金产品资料概要更新（2022年6月25日公告）》；

6. 2022年06月25日披露了《财通多策略升级混合型证券投资基金(LOF)更新招募说明书（2022年6月25日公告）》；

7. 2022年07月01日披露了《财通基金管理有限公司关于旗下基金2022年半年度资产净值的公告》；

8. 2022年07月06日披露了《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加北京度小满基金销售有限公司基金申购费率优惠活动的公告》；

9. 2022年07月13日披露了《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加华融证券股份有限公司基金申购费率优惠活动的公告》；

10. 2022年07月20日披露了《财通多策略升级混合型证券投资基金(LOF)2022年第二季度报告》；

11. 2022年07月29日披露了《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加上海中正达广基金销售有限公司基金申购费率优惠活动的公告》；

12. 2022年08月02日披露了《财通基金管理有限公司旗下公开募集

证券投资基金 2022 年风险评价结果的公告》；

13. 2022 年 08 月 03 日披露了《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加长城证券股份有限公司基金申购费率优惠活动的公告》；

14. 2022 年 08 月 05 日披露了《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加上海万得基金销售有限公司基金申购费率优惠活动的公告》；

15. 2022 年 08 月 27 日披露了《财通多策略升级混合型证券投资基金(LOF)2022 年中期报告》；

16. 2022 年 09 月 24 日披露了《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加上海攀赢基金销售有限公司基金申购费率优惠活动的公告》；

17. 2022 年 09 月 27 日披露了《财通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》；

18. 2022 年 09 月 30 日披露了《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加深圳市前海排排网基金销售有限责任公司基金申购费率优惠活动的公告》；

19. 2022 年 10 月 01 日披露了《财通基金管理有限公司关于旗下部分证券投资基金投资非公开发行的公告》；

20. 2022 年 10 月 18 日披露了《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加上海好买基金销售有限公司基金申购费率优惠活动的公告》；

21. 2022 年 10 月 21 日披露了《财通基金管理有限公司高级管理人员变更公告》；

22. 2022 年 10 月 25 日披露了《财通多策略升级混合型证券投资基金(LOF)2022 年第三季度报告》；

23. 2022 年 10 月 26 日披露了《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加玄元保险代理有限公司基金申购费率优惠活动的公告》；

24. 2022 年 11 月 10 日披露了《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加海通证券股份有限公司基金申购费率优惠活动的公告》；

25. 2022 年 12 月 16 日披露了《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加平安银行股份有限公司基金申购费率优惠活动的公告》；

26. 2022 年 12 月 16 日披露了《财通基金管理有限公司关于广州分公司经营场所及经营范围变更的公告》；

27. 2023 年 01 月 04 日披露了《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国工商银行“2023 倾心回馈”基金定期定额申购费率优惠活动的公告》；

28. 2023 年 01 月 04 日披露了《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国工商银行股份有限公司基金申购费率优惠活动的公告》；

29. 2023 年 01 月 18 日披露了《财通基金管理有限公司关于设立成都分公司的公告》；

30. 2023 年 01 月 20 日披露了《财通基金管理有限公司关于旗下部分证券投资基金投资非公开发行股票的公告》；

31. 2023 年 01 月 21 日披露了《财通多策略升级混合型证券投资基金(LOF)2022 年第四季度报告》；

32. 2023 年 02 月 04 日披露了《财通基金管理有限公司分支机构负责人任职公告》；

33. 2023 年 02 月 14 日披露了《财通基金管理有限公司关于旗下部分证券投资基金投资非公开发行股票的公告》；

34. 2023 年 03 月 22 日披露了《关于上海爱建基金销售有限公司终止代理销售财通基金管理有限公司旗下基金的公告》；

35. 2023 年 03 月 30 日披露了《财通多策略升级混合型证券投资基金(LOF)2022 年年度报告》；

36. 2023 年 04 月 06 日披露了《财通基金管理有限公司关于设立浙江分公司的公告》；

37. 2023 年 04 月 22 日披露了《财通多策略升级混合型证券投资基金(LOF)2023 年第 1 季度报告》；

38. 2023 年 04 月 27 日披露了《财通基金管理有限公司关于成都分公司经营范围变更的公告》；

39. 2023 年 05 月 05 日披露了《财通基金管理有限公司关于办公地址

变更的公告》；

40. 2023 年 05 月 20 日披露了《关于江西正融基金销售有限公司终止代理销售财通基金管理有限公司旗下基金的公告》。

## 二十五、招募说明书的存放及查阅方式

本基金招募说明书存放于基金管理人和基金托管人的办公场所、注册登记机构、基金销售机构、基金上市交易的证券交易所处，投资者可在营业时间免费查阅。基金投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得招募说明书的复印件。对投资者按上述方式所获得的文件及其复印件，基金管理人和基金托管人保证与所公告文本的内容完全一致。

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

## 二十六、备查文件

### (一) 备查文件目录

- 1、中国证监会准予财通多策略升级混合型证券投资基金募集注册的文件。
- 2、《财通多策略升级混合型证券投资基金基金合同》。
- 3、《财通多策略升级混合型证券投资基金托管协议》。
- 4、法律意见书。
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照。
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照。
- 7、中国证监会要求的其他文件。

### (二) 存放地点

备查文件存放于基金管理人和基金托管人的住所。

### (三) 查阅方式

投资者可到基金管理人和基金托管人的办公场所、营业场所及网站免费查阅备查文件。

财通基金管理有限公司

二〇二三年七月二十八日