

东方红睿泽三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金上市交

易公告书

基金管理人：上海东方证券资产管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

注册登记机构：中国证券登记结算有限责任公司

上市地点：上海证券交易所

上市时间：2018年10月17日

公告日期：2018年10月12日

目录

一、重要声明与提示	2
二、基金概览	2
三、基金的募集与上市交易	3
四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人	5
五、基金主要当事人简介	6
六、基金合同摘要	10
七、基金财务状况	10
八、基金投资组合	11
九、重大事件揭示	14
十、基金管理人承诺	14
十一、基金托管人承诺	15
十二、备查文件目录	15
附件：基金合同内容摘要	17

一、重要声明与提示

东方红睿泽三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)上市交易公告书(以下简称“本公告”)依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号<上市交易公告书的内容与格式>》和《上海证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制,本基金管理人上海东方证券资产管理有限公司的董事会及董事保证本公告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,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。

本基金托管人招商银行股份有限公司保证本公告中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性,承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、上海证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见,均不表明对本基金的任何保证。

本公告书第七节“基金财务状况”未经审计。

凡本公告未涉及的有关内容,请投资者详细查阅刊登在2018年1月16日《中国证券报》和《上海证券报》以及上海东方证券资产管理有限公司网站(www.dfham.com)上的《东方红睿泽三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》和其他相关公告。

二、基金概览

1、基金名称：东方红睿泽三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金。

2、基金类型：混合型。

3、基金运作方式：契约型。

本基金以定期开放方式运作，即采用封闭运作和开放运作交替循环的方式。

本基金的第一个封闭期的起始之日为基金合同生效日，结束之日为基金合同生效日所对应的第三年年度对日前的倒数第一日。第二个封闭期的起始之日为第一个开放期结束之日次日，结束之日为第二个封闭期起始之日所对应的第三年年度对日前的倒数第一日，依此类推。年度对日指某一特定日期在后续日历年份中的对应日期，如该对应日期为非工作日，则顺延至下一个工作日，若该日历年份中不存在对应日期的，则顺延至该月最后一日的下一工作日。本基金在封闭期内不办理申购与赎回业务，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。

本基金自封闭期结束之日的下一个工作日起进入开放期（即每个开放期首日为每个封闭期起始之日的第三年年度对日，包括该工作日），期间可以办理申购、赎回或其他业务。本基金每个开放期原则上不少于 5 个工作日且最长不超过 20 个工作日，开放期的具体时间由基金管理人在上一个封闭期结束前公告说明。如在开放期内发生不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放或需依据《基金合同》暂停申购或赎回等业务的，基金管理人有权合理调整申购或赎回等业务的办理期间并予以公告。

4、基金存续期限：不定期。

5、基金份额总额：截至 2018 年 10 月 10 日，本基金的份额总额为 7,105,789,899.82 份。

6、本基金基金份额参考净值：0.8622 元（截至 2018 年 10 月 10 日）。

7、本次上市交易的基金份额简称及代码：东证睿泽，代码：501054。

8、本基金本次上市交易的基金份额总额：1,227,650,600.00 份（截至 2018 年 10 月 10 日）

9、上市交易的证券交易所：上海证券交易所

10、上市交易日期：2018 年 10 月 17 日

11、基金管理人：上海东方证券资产管理有限公司

12、基金托管人：招商银行股份有限公司

13、本次上市交易的基金份额登记机构：中国证券登记结算有限责任公司

三、基金的募集与上市交易

（一）本基金上市前募集情况

1、本基金发售申请的核准机构和核准文号：中国证监会证监许可【2017】2252 号

2、基金运作方式：契约型

3、发售日期：2018 年 1 月 23 日

4、发售面值：1.00 元人民币

5、发售方式：通过场内、场外两种方式公开发售

6、发售机构：

（1）场内发售机构

具有基金销售业务资格、并经上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的、可通过上海证券交易所交易系统办理本基金销售业务的上海交易所会员单位。

（2）场外发售机构

1) 直销机构：上海东方证券资产管理有限公司直销中心和上海东方证券资产管理有限公司网上交易系统。

2) 代销机构：东方证券股份有限公司、上海银行股份有限公司、上海天天基金销售有限公司、珠海盈米财富管理有限公司、北京肯特瑞财富投资管理有限公司、上海好买基金销售有限公司、嘉实财富管理有限公司、诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司、北京展恒基金销售有限公司、深圳众禄金融控股股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、招商银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、兴业银行股份有限公司、平安银行股份有限公司、光大银行股份有限公司、中国银行股份有限公司。

7、验资机构名称：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)。

8、募集资金总额及入账情况：

本基金募集的有效认购户数为 760,981 户，净认购金额为人民币 7,105,521,668.09 元，认购款项在基金验资确认日前产生的利息共计人民币 324,237.93 元。

上述资金中，场内首次发行募集基金为人民币 1,227,650,600.00 元，场外首次发行募集基金为人民币 5,877,871,068.09 元，于 2018 年 1 月 26 日划至在招商银行股份有限公司上海分行营业部开立的东方红睿泽三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金托管专户。

按照每份基金份额初始面值 1.00 元计算，本次募集期的募集资金及其利息结转的份额共计 7,105,789,899.82 份，已全部计入基金份额持有人基金账户，归基金份额持有人所有。

9、基金备案情况

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等相关法律法规以及《东方红睿泽三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金募集结果符合备案条件，本基金管理人已向中国证监会办理完毕基金备案手续，并于 2018 年 1 月 31 日获中国证监会书面确认，本基金合同自该日起正式生效。基金合同生效之日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

10、基金合同生效日：2018 年 1 月 31 日。

11、本基金总份额 7,105,789,899.82 份。

(二) 本基金份额上市交易的主要内容

1、基金上市交易的核准机构和核准文号：上海证券交易所自律监管决定书[2018]132 号

2、上市交易日期：2018 年 10 月 17 日

3、上市交易的证券交易所：上海证券交易所

4、基金简称：东方红睿泽三年定开混合

场内简称：东证睿泽

5、交易代码：501054

6、本次上市交易份额：1,227,650,600.00 份(截至 2018 年 10 月 10 日)

7、基金资产净值的披露：每个交易日的次日公布本基金的基金份额净值，并在上交所行情发布系统揭示。

8、未上市交易份额的流通规定：未上市交易的托管在场外的份额，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下将其转托管至上海证券交易所场内后即可上市流通。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

(一) 持有人户数

截至 2018 年 10 月 10 日，本基金份额持有人户数为 760,981 户，其中场内基金份额持有人户数为 133,969 户，场外基金份额持有人户数为 627,012 户，场内基金份额持有人平均每户持有的本基金场内基金份额 9163.69 份。

(二) 持有人结构

截至 2018 年 10 月 10 日，本基金份额持有人结构如下：

机构投资者持有的本基金基金份额 1,071,327.97 份，占比 0.02%；个人投资者持有的本基金基金份额 7,104,718,571.85 份，占比 99.98%。

其中，场内基金份额持有人结构如下：

场内机构投资者持有的场内本基金基金份额 739,293.00 份，占比 0.01%；场内个人投资者持有的场内本基金基金份额 1,226,911,307.00 份，占比 17.27%。

场外基金份额持有人结构如下：

场外机构投资者持有的场外本基金基金份额 332,034.97 份，占比 0.005%；场外个人投资者持有的场外本基金基金份额 5,877,807,264.85 份，占比 82.72%。

(三) 截至 2018 年 10 月 10 日，本基金份额场内前十名持有人情况

本基金份额场内持有人中，持有人最多持有 9,852.00 份基金，占场内基金总份额的 0.0008%，持有该份额的人数共计 118,880 人。

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人

1、基本情况

名称：上海东方证券资产管理有限公司

法定代表人：潘鑫军

总经理：任莉

成立日期：2010 年 7 月 28 日

注册地址：上海市中山南路 318 号 31 层

注册资本：3 亿元人民币

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监许可[2010]518 号

开展公开募集证券投资基金业务批准文号：证监许可[2013]1131 号

经营范围：证券资产管理业务；公开募集证券投资基金管理业务

电话：(021) 63325888

传真：(021) 63326981

信息披露联系人：吴比

股东情况：东方证券股份有限公司持有公司 100% 的股权。

公司前身是东方证券股份有限公司客户资产管理业务总部，2010 年 7 月 28 日经中国证券监督管理委员会《关于核准东方证券股份有限公司设立证券资产管理子公司的批复》（证监许可[2010]518 号）批准，由东方证券股份有限公司出资 3 亿元，在原东方证券股份有限公司客户资产管理业务总部的基础上正式成立，是国内首家获批设立的券商系资产管理公司。

2、经营概况

公司具体经营管理由总经理负责，公司根据经营运作需要设置公募权益投资部、私募权益投资部、量化投资部、权益研究部、公募固定收益投资部、私募固定收益投资部、固定收益研究部、交易部、渠道发展部、机构业务部、结构与另类融资部、产品部、市场部、运营部、合规与风险管理部、综合管理部等 16 个职能部门。

3、人员情况

截至 2018 年 9 月 30 日，公司共有员工 225 人。

4、基金管理业务情况

本基金管理公司目前管理 34 只基金。

5、本基金基金经理

周云先生，出生于 1982 年，清华大学生物学博士。自 2008 年起开始从事证券行业工作，历任东方证券股份有限公司资产管理业务总部研究员，上海东方证券资产管理有限公司研究部高级研究员、投资主办人，权益研究部高级研究员、投资主办人，现任公募权益投资部副总经理、基金经理。2015 年 9 月起担任东方红京东大数据灵活配置混合型证券投资基金和东方红新动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016 年 6 月至 2018 年 8 月担任东方红睿满沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017 年 4 月起任东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理。2018 年 1 月起任东方红睿泽三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

孙伟先生，出生于 1983 年，北京大学金融学硕士。自 2010 年起开始从事证券行业工作，历任东方证券股份有限公司资产管理业务总部研究员，上海东方证券资产管理有限公司研究部高级研究员、权益研究部高级研究员，现任公募权益投资部基金经理。2016 年 1 月至 2017 年 4 月担任东方红新动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017 年 1 月起担任东方红睿满沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2018 年 2 月起任东方红睿泽三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

（二）基金托管人

1、基本情况

名称：招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）

设立日期：1987年4月8日

注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

注册资本：252.20亿元

法定代表人：李建红

行长：田惠宇

资产托管业务批准文号：证监基金字[2002]83号

电话：0755—83199084

传真：0755—83195201

资产托管部信息披露负责人：张燕

2、主要人员情况

李建红先生，董事长、非执行董事，2014年7月起担任董事、董事长。英国东伦敦大学工商管理硕士、吉林大学经济管理专业硕士，高级经济师。招商局集团有限公司董事长，兼任招商局国际有限公司董事会主席、招商局能源运输股份有限公司董事长、中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司董事长、招商局华建公路投资有限公司董事长和招商局资本投资有限责任公司董事长。曾任中国远洋运输（集团）总公司总裁助理、总经济师、副总裁，招商局集团有限公司董事、总裁。

田惠宇先生，行长、执行董事，2013年5月起担任行长、执行董事。美国哥伦比亚大学公共管理硕士学位，高级经济师。曾于2003年7月至2013年5月历任上海银行副行长、中国建设银行上海市分行副行长、深圳市分行行长、中国建设银行零售业务总监兼北京市分行行长。

王良先生，副行长，货币银行学硕士，高级经济师。1991年至1995年，在中国科技国际信托投资公司工作；1995年6月至2001年10月，历任招商银行北京分行展览路支行、东三环支行行长助理、副行长、行长、北京分行风险控制部总经理；2001年10月至2006年3月，历任北京分行行长助理、副行长；2006年3月至2008年6月，任北京分行党委书记、副行长（主持工作）；2008年6月至2012年6月，任北京分行行长、党委书记；2012年6月至2013年11月，任招商银行总行行长助理兼北京分行行长、党委书记；2013年11月至2014年12月，任招商银行总行行长助理；2015年1月起担任副行长；2016年11月起兼任董事会秘书。

姜然女士，招商银行资产托管部总经理，大学本科毕业，具有基金托管人高级管理人员任职资格。先后供职于中国农业银行黑龙江省分行，华商银行，中国农业银行深圳市分行，从事信贷管理、托管工作。2002年9月加盟招商银行至今，历任招商银行总行资产托管部经理、高级经理、总经理助理等职。是国内首家推出的网上托管银行的主要设计、开发者之一，具有20余年银行信贷及托管专业从业经验。在托管产品创新、服务流程优化、市场营销及客户关系管理等领域具有深入的研究和丰富的实务经验。

3、基金托管业务经营情况

截至2018年3月31日，招商银行股份有限公司累计托管364只开放式基金。

（三）基金验资机构

名称：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

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

办公地址：上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场二座普华永道中心11楼

执行事务合伙人：李丹

经办注册会计师：薛竞、陈熹

电话：021-23238888

传真：021-23238800

联系人：乐美昊

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件

七、基金财务状况

上海证券交易所在本基金募集期间未收取任何费用，其他各基金销售机构根据本基金招募说明书设定的费率收取认购费。

本基金募集结束后至上市交易公告书公告前未发生重要财务事项。

本基金 2018 年 10 月 10 日资产负债表如下：

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

资 产 本期末 2018 年 10 月 10 日

资 产：

银行存款 278,447,195.56

结算备付金 73,640,212.61

存出保证金 602,719.35

交易性金融资产 4,677,023,213.58

其中：股票投资 4,677,023,213.58

债券投资

资产支持证券投资

基金投资

衍生金融资产

买入返售金融资产

应收证券清算款 1,100,088,098.36

应收利息 310,481.82

应收股利 2,887,859.90

应收申购款

其他资产 20.00

资产合计：6,132,999,801.18

负债和所有者权益

负债：

短期借款

交易性金融负债

衍生金融负债

卖出回购金融资产款

应付证券清算款 147.86

应付赎回款

应付管理人报酬 2,612,578.89

应付托管费 435,429.81

应付销售服务费

应付交易费用 2,953,017.87

应付税费

应付利息

应付利润

其他负债 244,691.48
负债合计 6,245,865.91
所有者权益：
实收基金 7,105,789,899.82
未分配利润 -979,035,964.55
所有者权益合计 6,126,753,935.27
负债与持有人权益总计： 6,132,999,801.18

八、基金投资组合

截至 2018 年 10 月 10 日，本基金的投资组合如下：

(一) 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号 项目 金额（元） 占基金总资产的比例（%）

1 权益投资 4,677,023,213.58
76.26%
其中：股票 4,677,023,213.58 76.26%
2 固定收益投资
其中：债券
资产支持证券
3 金融衍生品投资
4 买入返售金融资产
其中：买断式回购的买入返售金融资产
5 银行存款和结算备付金合计 352,087,408.17 5.74%
6 其他资产 1,103,889,179.43 18.00%
7 合计 6,132,999,801.18 100.00%

(二) 报告期末按行业分类的股票投资组合

1、报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码 行业类别 公允价值（元） 占基金资产净值比例（%）

A 农、林、牧、渔业
B 采矿业 115,042,119.74 1.88%
C 制造业 3,164,416,981.30 51.65%
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业
E 建筑业 106,029.00 0.00%
F 批发和零售业
G 交通运输、仓储和邮政业
H 住宿和餐饮业
I 信息传输、软件和信息技术服务业
J 金融业 132,622,354.77 2.16%
K 房地产业 388,701,902.25 6.34%
L 租赁和商务服务业 202,939,226.52 3.31%
M 科学研究和技术服务业

N 水利、环境和公共设施管理业
O 居民服务、修理和其他服务业
P 教育
Q 卫生和社会工作
R 文化、体育和娱乐业
S 综合
合计 4,003,828,613.58 65.35%

2、报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组

行业类别 公允价值（元） 占基金资产净值比例（%）

能源

原材料 112,614,160.00 1.84%

工业 17,776,000.00 0.29%

非日常生活消费品 255,034,200.00 4.16%

日常消费品 152,615,600.00 2.49%

医疗保健

金融 10,080,000.00 0.16%

信息技术 66,530,000.00 1.09%

电信业务

公用事业

房地产 58,544,640.00 0.96%

合计 673,194,600.00 10.99%

（三）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 600887 伊利股份 22,718,437.00 566,825,003.15 9.25%

2 300124 汇川技术 10,192,986.00 264,354,479.70 4.31%

3 002475 立讯精密 16,200,586.00 242,198,760.70 3.95%

4 600600 青岛啤酒 6,149,973.00 207,192,590.37 3.38%

5 000333 美的集团 4,960,852.00 200,418,420.80 3.27%

6 600031 三一重工 23,327,892.00 199,686,755.52 3.26%

7 000002 万科A 8,227,619.00 178,950,713.25 2.92%

8 600048 保利地产 15,000,000.00 170,250,000.00 2.78%

9 002027 分众传媒 21,901,716.00 165,409,247.52 2.70%

10 600183 生益科技 14,132,947.00 135,393,632.26 2.21%

（四）报告期末按债券品种分类的债券投资组合

截至 2018 年 10 月 10 日，本基金未持有债券。

（五）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

截至 2018 年 10 月 10 日，本基金未持有债券。

（六）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

截至 2018 年 10 月 10 日，本基金未持有资产支持证券。

(七) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细
截至 2018 年 10 月 10 日, 本基金未持有权证。

(八) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
截至 2018 年 10 月 10 日, 本基金未进行股指期货投资。

(九) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
截至 2018 年 10 月 10 日, 本基金未进行国债期货投资。

(十) 投资组合报告附注

1、本基金持有的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查, 或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2、基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

3、其他资产构成

序号 名称 金额(元)

1 存出保证金 602,719.35

2 应收证券清算款 1,100,088,098.36

3 应收股利 2,887,859.9

4 应收利息 310,481.82

5 应收申购款

6 其他应收款 20.00

7 待摊费用

8 其他

9 合计 1,103,889,179.43

4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

截至 2018 年 10 月 10 日, 本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号 股票代码 股票名称 流通受限部分的公允价值 占基金资产净值比例(%) 流通受限情况说明

1 000333 美的集团 200,418,420.80 3.27% 临时停牌

2 300124 汇川技术 179,900,000.00 2.94% 流通受限

3 002027 分众传媒 163,080,000.00 2.66% 流通受限

九、重大事件揭示

本基金管理人于 2018 年 3 月 8 日发布公告, 同意陈光明同志自 2018 年 3 月 7 日起辞去公司董事长职务, 由潘鑫军同志担任公司董事长职务; 于 2018 年 5 月 11 日发布公告, 林鹏同志自 2018 年 5 月 10 日起任职公司副总经理职务; 于 2018 年 7 月 21 日发布公告, 唐涵颖同志自 2018 年 7 月 20 日起离任公司督察长职务, 由任莉同志代为履行公司督察长职务; 于 2018 年 8 月 29 日发布公告, 公司法定代表人变更为潘鑫军同志。

十、基金管理人承诺

本基金管理人就本基金上市交易之后履行管理人职责做出承诺:

(一) 严格遵守《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及其他法律法规、基金合同的规定, 以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

(二) 真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件, 披露所有对基金份额持有人有重大

影响的信息，并接受中国证监会、上海证券交易所的监督管理。

(三) 在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后，将及时予以公开澄清。

十一、基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺：

(一) 严格遵守《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及本基金基金合同、托管协议的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则托管基金资产。

(二) 根据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及本基金基金合同、托管协议的规定，对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金份额净值计算进行监督和核查。如发现基金管理人违反《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及本基金基金合同、托管协议的规定，将及时通知基金管理人纠正；基金管理人未能在限期内纠正的，基金托管人将及时向中国证监会报告。

十二、备查文件目录

以下备查文件存放于基金管理人和基金托管人的办公场所，投资者可在办公时间免费查阅。

- (一) 中国证监会核准基金募集的文件
- (二) 《东方红睿泽三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- (三) 《东方红睿泽三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
- (四) 《东方红睿泽三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- (五) 法律意见书
- (六) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (七) 基金托管人业务资格批件、营业执照

上海东方证券资产管理有限公司

2018年10月12日

附件：基金合同内容摘要

(一) 基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

1、基金管理人简况

名称：上海东方证券资产管理有限公司

住所：上海市黄浦区中山南路318号31层

法定代表人：陈光明

设立日期：2010年7月28日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监许可字[2010]518号

开展公开募集证券投资基金管理业务批准文号：证监许可[2013]1131号

组织形式：有限责任公司

注册资本：3亿元人民币

存续期限：持续经营

联系电话：(021) 63325888

联系人：廉迪

2、基金管理人的权利与义务

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

1) 依法募集资金；

- 2) 自《基金合同》生效之日起,根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产;
- 3) 依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用;
- 4) 销售基金份额;
- 5) 按照规定召集基金份额持有人大会;
- 6) 依据《基金合同》及有关法律的规定监督基金托管人,如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律的规定,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人的利益;
- 7) 在基金托管人更换时,提名新的基金托管人;
- 8) 选择、委托、更换基金代销机构,对基金代销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》及有关法律的规定决定基金收益的分配方案;
- 11) 在《基金合同》约定的范围内,拒绝或暂停受理申购与赎回申请;
- 12) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利,为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利;
- 13) 在法律法规允许的前提下,为基金的利益依法为基金进行融资;
- 14) 以基金管理人的名义,代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为;
- 15) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券、期货经纪商或其他为基金提供服务的外部机构;
- 16) 在符合有关法律、法规的前提下,制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换等的业务规则;
- 17) 法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

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

- 1) 依法募集资金,办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜;
- 2) 办理基金备案手续;
- 3) 自《基金合同》生效之日起,以诚实信用、勤勉尽责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资产净值,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、半年度和年度基金报告;
- 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 15 年以上;
- 17) 确保需要向基金投资人提供的各项文件或资料在规定时间内发出,并且保证投资人能够按照《基金合同》规定的时间和方式,随时查阅到与基金有关的公开资料,并在支付合理成本的条件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；但因第三方责任导致基金财产或基金份额持有人利益受到损失，而基金管理人首先承担了责任的情况下，基金管理人有权向第三方追偿；
- 23) 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；
- 24) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人；
- 25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- 26) 建立并保存基金份额持有人名册；
- 27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

3、基金托管人简况

名称：招商银行股份有限公司

住所：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

邮政编码：518040

法定代表人：李建红

成立时间：1987 年 4 月 8 日

批准设立机关和批准设立文号：中国人民银行银复字（1986）175 号文、银复（1987）86 号文

基金托管业务批准文号：证监基金字[2002]83 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币 252.20 亿元

存续期间：持续经营

4、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收入；
 - 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人的利益；
 - 4) 根据相关市场规则，为基金开设证券、期货结算账户等投资所需账户，为基金办理证券交易资金清算；
 - 5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；
 - 6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；
 - 7) 法律法规、《基金合同》及中国证监会规定的其他权利。
- (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、证券账户和期货结算账户等投资所需账户，按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
 - 7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；
 - 8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、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、半年度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 15 年以上；
 - 12) 保存基金份额持有人名册；
 - 13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
 - 14) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；
 - 15) 按照《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。

5、基金份额持有人

基金投资人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，基金投资人自依据《基金合同》取得基金份额，即成为本基金份额持有人和《基金合同》的当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为《基金合同》当事人并不以在《基金合同》上书面签章或签字为必要条件。同一类别的每份基金份额具有同等的合法权益。

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

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

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

- 1) 认真阅读并遵守《基金合同》、招募说明书等信息披露文件；
- 2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；
- 3) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；
- 4) 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) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
- 8) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- 9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(二) 基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

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

本基金份额持有人大会不设日常机构。

1、召开事由

(1) 当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

- 1) 终止《基金合同》；
- 2) 更换基金管理人；
- 3) 更换基金托管人；
- 4) 转换基金运作方式；
- 5) 调整基金管理人、基金托管人的报酬标准，根据法律法规和中国证监会要求调整该等报酬的除外；
- 6) 变更基金类别；
- 7) 本基金与其他基金的合并；
- 8) 变更基金投资目标、范围或策略，法律法规和中国证监会另有规定的除外；
- 9) 终止基金上市，但因基金不再具备上市条件而被上海证券交易所终止上市的除外；
- 10) 变更基金份额持有人大会程序；
- 11) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- 12) 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；
- 13) 对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；
- 14) 法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

(2) 在不违反法律法规和基金合同的约定的前提下，以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

- 1) 法律法规要求增加的基金费用的收取；
- 2) 在对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下调整本基金的申购费率、调低赎回费率、变更收费方式；
- 3) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；
- 4) 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生重大变化；
- 5) 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情形。

2、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六十日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

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

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

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

3、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 天，在指定媒介公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

- 1) 会议召开的时间、地点、方式和会议形式；
- 2) 会议拟审议的事项、议事程序和表决形式；
- 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) 授权委托书的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、授权方式、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及投票方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、表决意见提交的截止时间和收取方式。

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

4、基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式等法律法规或监管机构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书委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或基金托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

- 1) 亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托书符合法律法规、《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，有效的基金份额不小于本基金在权

益登记日基金总份额的 50%（含 50%）。

参加基金份额持有人大会的持有人的基金份额低于 50%的，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）基金份额的持有人参加，方可召开。

（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召集人通知载明的方式在表决截止日以前提交至召集人指定的地址或系统。通讯开会应以召集人通知载明的方式进行表决。

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》规定公布会议通知后，在表决截止日前公布 2 次相关提示性公告；
- 2) 召集人按基金合同规定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取表决意见的，不影响表决效力；
- 3) 本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的 50%（含 50%）；

基金份额持有人持有的基金份额低于 50%的，召集人可以在原公告的表决截止日的三个月以后、六个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）基金份额的持有人出具表决意见，方视为有效。

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

（3）在法律法规和监管机关允许的情况下，本基金的基金份额持有人可采用网络、电话、短信等其他非书面方式授权其代理人出席基金份额持有人大会；在会议召开方式上，本基金亦可采用网络、电话、短信等其他非现场方式或者以非现场方式与现场方式结合的方式召开基金份额持有人大会，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。

5、议事内容与程序

（1）议事内容及提案权

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

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

（2）议事程序

1) 现场开会

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

6、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，提交符合会议通知中规定的确认投资人身份文件的表决视为有效出席的投资人，符合会议通知规定的表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

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

7、计票

(1) 现场开会

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

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

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

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

(2) 通讯开会

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

8、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决定的事项自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 个工作日内在指定媒介公告。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。

9、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) 基金收益分配原则、执行方式

1、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。

2、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未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

3、基金收益分配原则

本基金收益分配应遵循下列原则：

- (1) 本基金的每份基金份额享有同等分配权；
- (2) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满3个月则可不进行收益分配；
- (3) 本基金收益分配方式仅现金分红一种方式；
- (4) 基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；
- (5) 法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

4、收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截至基金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。

5、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个工作日内在指定媒介公告并报中国证监会备案。

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。

6、基金收益分配中发生的费用

收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。

场内基金份额收益分配时发生的费用，遵循上海证券交易所和登记机构的相关规定。

(四) 与基金财产管理、运作有关费用的提取、支付方式与比例

1、基金费用的种类

- (1) 基金管理人的管理费；
- (2) 基金托管人的托管费；
- (3) 《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- (4) 《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- (5) 基金份额持有人大会费用；
- (6) 基金的证券、期货交易费用；
- (7) 基金的银行汇划费用；
- (8) 基金上市初费和上市年费；
- (9) 证券、期货账户开户费和账户维护费；
- (10) 投资港股通标的股票的相关费用；
- (11) 按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

2、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1.5%的年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式，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、公休日等，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 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式，于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述基金费用的种类中第 (3) — (11) 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

3、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，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用；
- (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。

4、费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率。

调整基金管理费率、基金托管费率，须召开基金份额持有人大会审议。基金管理人调整管理费、托管费，需于调整实施前书面告知基金托管人。

基金管理人必须于新的费率实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

5、基金税收

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

(五) 基金资产的投资方向和投资限制

1、投资目标

本基金在严格控制投资组合风险的前提下，追求资产净值的长期稳健增值

2、投资范围

本基金的投资范围为国内依法发行的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、港股通标的股票、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债、央行票据、中期票据、中小企业私募债、证券公司发行的短期公司债券、短期融资券等）、债券回购、同业存单等货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

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。

本基金的投资比例为：

开放期内，股票资产投资比例为基金资产的 0%—95%（其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0%-50%），封闭期内，股票资产投资比例为基金资产的 0%—100%（其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%）。

开放期每个交易日日终，在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持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%，在封闭期内，本基金不受上述 5% 的限制，封闭期内每个交易日日终在扣除股指期货、国债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，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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

3、投资策略

本基金在中国经济发展进入新常态，从总量增长转向结构调整，从短期增长转到长期可持续发展，同时人口面临内部结构老化和空间分布失衡等众多挑战的大背景下，将贯彻长期价值投资的理念，发挥在封闭期封闭运作的优势，抓住供给侧改革的机遇，配合“一带一路”的发展战略，布局与中国经济转型、产业升级、人口转变等密切相关的发展领域，挖掘重点行业中的优势个股，自下而上精选具有核心竞争优势的企业，分享转型期中国经济增长的成果，在控制风险前提下，追求基金资产的长期稳健增值。

基于本基金每满三年开放一次，除开放期外封闭运作的特点，基金管理人在临近开放期和开放期内将重点关注基金资产的流动性和变现能力，分散投资，做好流动性管理以应对开放期投资人的赎回需求。

(1) 资产配置

本基金为三年定期开放的产品，可发挥在封闭期内封闭运作，聚焦于与中国经济发展趋势相符的标的资产，立足于长期价值投资的理念，通过定性与定量研究相结合的方法，确定投资组合中权益类资产和其他资产的配置比例。

本基金通过动态跟踪海内外主要经济体的 GDP、CPI、利率等宏观经济指标，以及估值水平、盈利预期、流动性、投资人心态等市场指标，预测未来市场变动趋势。本基金通过全面评估上述各种关键指标的变动趋势，对股票、债券等大类资产的风险和收益特征进行预测。根据上述定性和定量指标的分析结果，运用资产配置优化模型，在目标收益条件下，追求风险最小化目标，最终确定大类资产投资权重，实现资产合理配置。

(2) 股票组合的构建

本基金对国内股票及港股通标的股票主要遵循“自下而上”的个股投资策略，利用基金管理人投研团队的资源，对企业内在价值进行深入细致的分析，并进一步挖掘出价格低估、质地优秀、未来预期成长性良好，符合转型期中国经济发展趋势的上市公司股票进行投资。

1) 中国经济发展的趋势

① 供给侧改革

供给侧改革的主要任务包括“三去一降一补”，在进一步巩固去库存和去产能成果的基础上，未来政策中心将放在去杠杆、降成本和补短板。这将有利于企业的资源整合和优化，增加发展的可持续性，降低企业尤其是制造业的成本。中西部基础设施建设，科技创新、高新技术发展等也会是未来的重点领域，在 PPP 模式不断深化下，会有越来越多的企业分享到国家基础设施建设带来的红利。

同时，正蓬勃发展的“互联网+”将成为供给侧改革的一把利器。互联网能扩大有效供给，提升供给能力，还能够促进供给侧与需求侧的高效耦合和精准对接，加快推动消费升级。通过互联网，企业获得消费者的信息过程变得扁平而快速。所有消费者都触手可及，消费者的行为、偏好的数据可以更容易被捕捉、获取和分析。这一切，都将转换为生产力，指导供给侧随之变化，提供符合消费者个性化需求的产品和服务。此外，地方国企混改，一带一路，农村土地改革等都将催生出一大片具有良好发展潜力的投资领域。

② 人口转变

人口转变涉及人口的空间再分布和人口的结构变化，前者主要是人口城镇化，后者则关注人口老龄化。城镇化不是简单将农村人口变成城镇人口，提高城镇化率，而是走新型城镇化路线，这和中国经济转型，结构转变密切相关。同时在财政金融体系、土地制度、户籍制度、人口政策、要素价格、人力资本等多方面的市场化改革也是政策关注的重点。

未来的城镇化图景一定有别于过去，核心是人的城镇化。它应该着眼农村和中小城镇，实现城乡基础设施

一体和公共服务均等化，进城人口的市民化，促进经济社会发展，实现共同富裕。以新型工业化作为动力，实现制造业和服务业升级，投入资本的回报率逐步提升，人力资本在收入分配中的占比提升，消费和服务业占 GDP 的比重提高，资源和环境更加友好。新型城镇化将带动消费和服务产业大发展，尽管增长速度的绝对值未必比得上过去，但增长将更有质量和更加可持续。

人口老龄化一方面将对我国经济增长在劳动力供给方面的可持续性形成挑战，考验传统经济模式的转型效率，另一方面也迫使很多企业寻求生产要素的优化配置，变被动为主动。同时对于医疗服务业、养老产业的蓬勃发展有着巨大影响。若能把握好第二次人口红利的契机，将能促进相关产业发展，带来更多的投资机会。

③资源环境转型

全球气候变暖带来的挑战对资源使用、环境保护提出了更高的要求。我国政府也提出要建设资源节约型、环境友好型社会。这将会淘汰不少生产效率低下、资源消耗巨大、环境污染严重的企业，甚至影响相关产业的发展。未来国家在新能源产业、节能环保行业和高科技发展方面都将花费更多的精力，这将带动一系列上下游相关行业的发展。同样，也将对传统产业的行业集中度产生影响，从而改变企业的投资价值。

2) 行业配置策略

在行业配置层面，本基金倾向于一些符合转型期中国经济发展趋势的行业或子行业，比如由人口老龄化驱动的医疗行业、具有品牌优势的消费品行业、可以替代人工的自动化行业等。具体分析时，基金管理人会跟踪各行业整体的收入增速、利润增速、毛利率变动幅度、ROIC 变动情况，依此来判断各行业的景气度，再根据行业整体的估值情况，市场的预期，目前机构配置的比例来综合考虑各行业在组合中的配置比例。

3) 股票投资选择

针对个股，每个报告期基金管理人都会根据公开信息和一些假设推理初筛一批重点研究标的，围绕这些公司，基金管理人的股票研究团队将展开深入的调研，除了上市公司外，基金管理人还会调研竞争对手，产业链的上下游，以此来验证基金管理人的推理是否正确。对于个股是否纳入到组合，基金管理人会重点关注 3 个方面：公司素质、公司的成长空间及未来公司盈利增速、目前的估值。其中公司素质是基金管理人最看重的因素，包括公司商业模式的独特性、进入壁垒、行业地位、公司管理层的品格和能力等方面；对于具有优秀基因的公司，如果成长性和估值匹配的话，基金管理人将其纳入投资组合；否则将会放在股票库中，保持持续跟踪。

4) 港股投资策略

本基金将通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场，不使用合格境内机构投资者(QDII)境外投资额度进行境外投资。本基金将重点关注：

- ①A 股稀缺性行业和个股，包括优质中资公司（如国内互联网及软件企业、国内部分消费行业领导品牌等）、A 股缺乏投资标的的行业（如博彩）；
- ②具有持续领先优势或核心竞争力的企业，这类企业应具有良好成长性或为市场龙头；
- ③符合内地政策和投资逻辑的主题性行业个股；
- ④与 A 股同类公司相比具有估值优势的公司。

5) 参与定向增发投资策略

基金管理人将通过实地调研深入了解发行人的行业背景、市场地位、产销规模、核心技术、股东和管理层情况、持续经营与盈利能力等各方面的信息；对定向增发价格的合理性做出判断，并结合上市公司大股东参与定向增发的情况，在进行全面和深入研究的基础上做出投资决定，在控制风险的基础上力求获取较高的收益。

(3) 权证投资策略

本基金将权证作为有效控制基金投资组合风险、提高投资组合收益的辅助工具。管理人将根据权证对应公司基本面情况确定权证的合理价值，在发现权证价值低估或者权证能有效对冲正股波动风险时买入。

(4) 债券投资策略

本基金的债券投资品种主要有国债、企业债等中国证监会认可的，具有良好流动性的金融工具。债券投资

主要用于提高非股票资产的收益率，基金管理人将坚持价值投资的理念，严格控制风险，追求合理的回报。在债券投资方面，基金管理人将以宏观形势及利率分析为基础，依据国家经济发展规划量化核心基准参照指标和辅助参考指标，结合货币政策、财政政策的实施情况，以及国际金融市场基准利率水平及变化情况，预测未来基准利率水平变化趋势与幅度，进行定量评价。

（5）中小企业私募债券投资策略

由于中小企业私募债票面利率较高、信用风险较大、二级市场流动性较差。本基金将运用基本面研究，结合公司财务分析方法对债券发行人信用风险进行分析和度量，选择风险与收益相匹配的更优品种进行投资。在进行投资时，将采取分散投资、锁定收益策略。在遴选债券时，将只投资有担保或者国有控股企业发行的中小企业私募债，以降低信用风险。

（6）证券公司短期公司债券投资策略

本基金证券公司短期公司债券的投资策略主要从分析证券行业整体情况、证券公司基本面情况入手，包括整个证券行业的发展现状，发展趋势，具体证券公司的经营情况、资产负债情况、现金流情况，从而分析证券公司短期公司债券的违约风险及合理的利差水平，对证券公司短期公司债券进行独立、客观的价值评估。

（7）资产支持证券投资策略

本基金资产支持证券的投资配置策略主要从信用风险、流动性、收益率几方面来考虑，采用自下而上的项目精选策略，以资产支持证券的优先级或次优先级为投资标的，精选违约或逾期风险可控、收益率较高的资产支持证券项目。根据不同资产支持证券的基础资产采取适度分散的地区配置策略和行业配置策略，在有效分散风险的前提下为投资人谋求较高的投资组合回报率。资产支持证券的信用风险分析采取内外结合的方法，以基金管理人的内部信用风险评估为主，并结合外部信用评级机构的分析报告，最终得出对每个资产支持证券项目的总体风险判断。另外，鉴于资产支持证券的流动性较差，本基金更倾向于久期较短的品种，即使持有到期压力也不会太大。

（8）股指期货投资策略

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，以回避市场风险。故股指期货空头的合约价值主要与股票组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理股指期货合约数量，以萃取相应股票组合的超额收益。

（9）国债期货投资策略

本基金投资国债期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，以回避市场风险。故国债期货空头的合约价值主要与债券组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理国债期货合约数量，以萃取相应债券组合的超额收益。

4、投资限制

（1）投资组合限制

本基金的投资组合将遵循以下限制：

- 1) 在封闭期内，本基金投资组合中股票资产投资比例为基金资产的 0%—100%（其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0%-50%），在开放期内，本基金投资组合中股票资产投资比例为基金资产的 0%—95%（其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0%-50%）；
- 2) 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；
- 3) 在开放期内，本基金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，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，在封闭期内，本基金不受上述 5% 的限制，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，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；
- 4) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值（同一家公司在境内和香港同时上市的 A+H 股合计计算）不超过基金资产净值的 10%；

- 5) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券, 不超过该证券的 10%;
- 6) 本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票, 不得超过该上市公司可流通股票的 15%; 本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票, 不得超过该上市公司可流通股票的 30%;
- 7) 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%;
- 8) 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%;
- 9) 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%;
- 10) 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%;
- 11) 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%;
- 12) 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%;
- 13) 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%;
- 14) 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;
- 15) 本基金在封闭期内总资产不得超过基金净资产的 200%, 在开放期内, 本基金总资产不得超过基金净资产的 140%;
- 16) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%; 债券回购最长期限为 1 年, 债券回购到期后不得展期;
- 17) 本基金参与股指期货交易, 应当遵守下列要求:
 - i. 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%。
 - ii. 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%。
 - iii. 基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值, 合计(轧差计算)应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定。
 - iv. 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%。
- 18) 本基金参与国债期货交易, 应当遵守下列要求:
 - i. 基金在任何交易日日终, 持有的买入国债期货合约价值, 不得超过基金资产净值的 15%。
 - ii. 在开放期内, 任何交易日日终, 持有的买入国债期货和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%。
在封闭期内, 任何交易日日终, 持有的买入国债期货和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 100%。
其中, 有价证券指股票、债券(不含到期日在一年以内的政府债券)、权证、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等。
 - iii. 基金在任何交易日日终, 持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%。
 - iv. 基金所持有的债券(不含到期日在一年以内的政府债券)市值和买入、卖出国债期货合约价值, 合计(轧差计算)应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定。
 - v. 基金在任何交易日内交易(不包括平仓)的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 30%。
- 19) 本基金持有单只中小企业私募债券, 其市值不得超过本基金资产净值的 10%; 本基金投资中小企业私募债券的剩余期限, 不得超过本基金封闭期的剩余期限;
- 20) 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;
- 21) 在开放期内, 本基金主动投资于流动性受限资产的市场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前款所规定

的比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

22) 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。

法律法规或监管部门取消或调整上述限制，如适用于本基金，则在履行适当程序后，本基金投资不再受相关限制或按照调整后的规定执行，基金管理人及时根据《信息披露办法》规定在指定媒介公告。

除 3)、14)、20)、21) 条外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

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

(2) 禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，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，但法律法规或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；
- 6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- 7) 法律、行政法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

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

(3) 关联交易原则

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，或者从事重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

5、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率 × 60% + 恒生指数收益率 × 20% + 中国债券总指数收益率 × 20%。

其中，沪深 300 指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权，由中证指数有限公司开发的中国 A 股市场指数，它的样本选自沪深两个证券市场，覆盖了大部分流通市值，其成份股票为中国 A 股市场中代表性强、流动性高的股票，能够反映 A 股市场总体发展趋势。

恒生指数是由恒生指数服务有限公司编制，以香港股票市场中的 50 家上市股票为成份股样本，以其发行量为权数的加权平均股价指数，是反映香港股市价幅趋势最有影响的一种股价指数。

中国债券总指数是由中央国债登记结算有限责任公司于 2001 年 12 月 31 日推出的债券指数。它是中国债券市场趋势的表征，也是债券组合投资管理业绩评估的有效工具。中国债券总指数为掌握我国债券市场价格总水平、波动幅度和变动趋势，测算债券投资回报率水平，判断债券供求动向提供了很好的依据。

本基金业绩比较基准沪深 300 指数收益率 × 60% + 恒生指数收益率 × 20% + 中国债券总指数收益率 × 20% 目前能够忠实地反映本基金的风险收益特征。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时，本基金可以变更业绩比较基准，但应与基金托管人协商一致，在履行适当程序后报中国证监会备案，并在中国证监会指定的媒介上及时公告，无需召开基金份额持有人大会。

6、风险收益特征

本基金是一只混合型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。

本基金除了投资 A 股外，还可根据法律法规规定投资香港联合交易所上市的股票。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

（六）基金资产净值的计算方法和公告方式

1、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的资产净值。

2、估值方法

以下估值方法中所指的固定收益品种，是指在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所及中国证监会认可的其他交易场所上市交易或挂牌转让的国债、中央银行债、政策性银行债、短期融资券、中期票据、企业债、公司债、商业银行金融债、可转换债券、中小企业私募债、证券公司发行的短期公司债券、资产支持证券、同业存单等品种。

（1）证券交易所上市的有价证券的估值

1) 交易所上市的权益类证券（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且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值；

2) 交易所上市实行净价交易的固定收益品种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，具体估值机构由基金管理人与基金托管人另行协商约定；

3) 交易所上市交易的可转换债券按估值日收盘价减去收盘价中所含的应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日收盘价减去收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值；

交易所上市实行全价交易的债券（可转债除外），选取第三方估值机构提供的估值全价减去估值全价中所含的债券（税后）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权益类证券，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) 对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为计量日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表计量日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认计量日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，则应采用估值技术确定其公允价值；

4) 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）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，以第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值；对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，按成本估值。

(4) 证券公司发行的短期公司债券，根据发行所处场所，同银行间债券估值方式即依据第三方估值机构公布的收益率曲线及估值价格估值，若无第三方估值机构估值价格的，按成本估值。

(5) 中小企业私募债采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(6) 同一债券或股票同时在两个或两个以上市场交易的，按债券或股票所处的市场分别估值。

(7) 投资证券衍生品的估值方法

1) 股指期货合约，一般以估值日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。

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

(8) 存款的估值方法

持有的银行定期存款或通知存款以本金列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入。

(9) 汇率

本基金外币资产价值计算中，涉及外币对人民币汇率的，应当以基金估值日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价为准。估值时先根据外币行情价格折算成保留两位小数的人民币估值价，再根据持仓量计算出市值。

(10) 税收

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

(11) 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。

(12) 当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以对本基金采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性，并需履行相关信息披露义务。

(13) 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《基金法》，基金管理人计算并公告基金资产净值，基金托管人复核、审查基金管理人计算的基金资产净值。基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致意见的，按照基金管理人计算的基金资产净值的结果对外予以公布。

3、基金资产净值、基金份额净值

本基金的《基金合同》生效后，在基金份额开始上市交易前，基金管理人应至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值；基金管理人应在开放期前最后一个工作日的次日，披露开放期前最后一个工作日的基金份额净值和基金份额累计净值。

在基金份额上市交易后或在开放期内，基金管理人应当通过基金管理人网站、上市的证券交易所、基金销售机构以及其他媒介，在每个交易日的次日披露基金份额净值、基金份额累计净值。

若本基金终止上市并转型为非上市基金，在封闭期内，基金管理人应至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值；在开放期内，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额销售机构以及其他媒介，披露开放日基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和份额累计净值登载在指定媒介上。

(七) 基金合同的变更、终止与基金财产的清算

1、《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生效后方可执行，基金管理人应在决议生效后 2 个工作日内在指定媒介公告。

2、《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。

3、基金财产的清算

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

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

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

(4) 基金财产清算程序：

- 1) 基金合同终止情形出现后，发布基金财产清算公告；
- 2) 《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；
- 3) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- 4) 对基金财产进行估值和变现；
- 5) 制作清算报告；
- 6) 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；
- 7) 将清算报告报中国证监会备案并公告；
- 8) 对基金剩余财产进行分配。

(5) 基金财产清算的期限为 6 个月。

4、清算费用

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

5、基金财产清算剩余资产的分配

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

6、基金财产清算的公告

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

7、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

(八) 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，

应提交上海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，仲裁地点为上海市，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，除非仲裁裁决另有决定，仲裁费由败诉方承担。

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

《基金合同》适用中华人民共和国法律并从其解释。

（九）基金合同存放地和投资人取得合同的方式

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