

东方睿鑫热点挖掘灵活配置混合型证券投资基金  
招募说明书（更新）  
（2022 年第 1 号）

基金管理人：东方基金管理股份有限公司

基金托管人：广发证券股份有限公司

## 重要提示

东方睿鑫热点挖掘灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）根据2015年1月23日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予东方睿鑫热点挖掘灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2015]120号）和《关于东方睿鑫热点挖掘灵活配置混合型证券投资基金募集时间安排的确认函》（机构部函[2015]569号）核准募集。本基金基金合同于2015年4月15日正式生效。

东方基金管理股份有限公司（以下简称“本基金管理人”）保证《东方睿鑫热点挖掘灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》（以下简称“招募说明书”或“本招募说明书”）的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

投资有风险，投资人认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书和基金产品资料概要。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，但不保证投资本基金一定盈利，也不保证最低收益。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，请认真阅读本招募说明书和《东方睿鑫热点挖掘灵活配置混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，获得基金投资收益，亦承担基金投资中出现的各类风险。投资本基金可能遇到的风险包括：证券市场整体环境引发的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、大量赎回或暴跌导致的流动性风险、基金投资过程中产生的操作风险、因交收违约和投资债券引发的信用风险、基金投资对象与投资策略引致的特有风险等等。

本基金对固定收益类资产的投资中将中小企业私募债券纳入到投资范围当中，

中小企业私募债券，是根据相关法律法规由非上市的中小企业以非公开方式发行的债券。该类债券不能公开交易，可通过上海证券交易所固定收益证券综合电子平台或深圳证券交易所综合协议交易平台进行交易。一般情况下，中小企业私募债券的交易不活跃，潜在流动性风险较大；并且，当发债主体信用质量恶化时，受市场流动性限制，本基金可能无法卖出所持有的中小企业私募债券，从而可能给基金净值带来损失。

本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他可投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与中国存托凭证发行机制相关的风险。

本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等风险水平的投资品种。

当本基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，基金管理人履行相应程序后，可以启用侧袋机制，具体详见基金合同和本招募说明书“侧袋机制”等有关章节。侧袋机制实施期间，基金管理人将对基金简称进行特殊标识，且 not 办理侧袋账户的申购赎回。请基金份额持有人仔细阅读相关内容并关注本基金启用侧袋机制时的特定风险。

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

根据中国证监会 2017 年 10 月 1 日起施行的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》的要求，经与相关基金托管人协商一致，并报监管部门备案后，本基金管理人对旗下部分基金的基金合同及托管协议进行了修订，修订后的基金合同及托管协议自 2018 年 3 月 31 日起生效，具体情况请参阅本基金管理人于 2018 年 3 月 31 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及本基金管理人网站上发布的公告。

根据中国证监会 2019 年 9 月 1 日起施行的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的要求，经与相关基金托管人协商一致，本基金管理人对旗下部分基金的基金合同及托管协议进行了修订，报监管部门备案并按规定在指定媒介上公告。

根据中国证监会 2018 年 6 月 6 日颁布并实施的《存托凭证发行与交易管理办法（试行）》的要求，经与相关基金托管人协商一致，本基金管理人对旗下部分

基金的基金合同及托管协议进行了修订,报监管部门备案并按规定在指定媒介上公告。

根据中国证监会2020年7月10日颁布、同年8月1日实施的《公开募集证券投资基金侧袋机制指引(试行)》的要求,经与相关基金托管人协商一致,本基金管理人对旗下部分基金的基金合同及托管协议进行了修订,报监管部门备案并按规定在指定媒介上公告。

有关财务数据和净值表现截止日为2022年3月31日(财务数据未经审计),如无其他特别说明,本招募说明书其他所载内容截止日为2022年4月15日。

## 目 录

|                               |     |
|-------------------------------|-----|
| 第一部分绪言 .....                  | 1   |
| 第二部分释义 .....                  | 2   |
| 第三部分基金管理人 .....               | 7   |
| 第四部分基金托管人 .....               | 22  |
| 第五部分相关服务机构 .....              | 25  |
| 第六部分基金的募集与基金合同生效 .....        | 56  |
| 第七部分基金份额的申购与赎回 .....          | 57  |
| 第八部分基金的投资 .....               | 67  |
| 第九部分基金的业绩 .....               | 82  |
| 第十部分基金的财产 .....               | 84  |
| 第十一部分基金资产估值 .....             | 85  |
| 第十二部分基金收益与分配 .....            | 90  |
| 第十三部分基金的费用与税收 .....           | 92  |
| 第十四部分基金的会计与审计 .....           | 95  |
| 第十五部分基金的信息披露 .....            | 96  |
| 第十六部分侧袋机制 .....               | 103 |
| 第十七部分风险揭示 .....               | 107 |
| 第十八部分基金合同的变更、终止与基金财产的清算 ..... | 110 |
| 第十九部分基金合同的内容摘要 .....          | 112 |
| 第二十部分基金托管协议的内容摘要 .....        | 128 |
| 第二十一部分对基金份额持有人的服务 .....       | 142 |
| 第二十二部分其他应披露事项 .....           | 144 |
| 第二十三部分招募说明书存放及查阅方式 .....      | 148 |
| 第二十四部分备查文件 .....              | 149 |

## 第一部分 绪 言

《东方睿鑫热点挖掘灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》(以下简称“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》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《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》”)及其他有关规定以及《东方睿鑫热点挖掘灵活配置混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)编写。

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

本招募说明书根据本基金的基金合同编写,并经中国证监会注册。基金合同是约定基金合同当事人之间基本权利义务的法律文件,其他与本基金相关的涉及基金合同当事人之间权利义务关系的任何文件或表述,均以基金合同为准。基金合同的当事人包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人。基金投资者自依基金合同取得本基金基金份额,即成为基金份额持有人和基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受。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为必要条件。基金合同当事人按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

本招募说明书约定的基金产品资料概要编制、披露与更新要求,自《信息披露办法》实施之日起一年后开始执行。

## 第二部分 释 义

在《东方睿鑫热点挖掘灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》中，除非文意另有所指，下列词语具有如下含义：

- 1、基金或本基金：指东方睿鑫热点挖掘灵活配置混合型证券投资基金
- 2、基金管理人：指东方基金管理股份有限公司
- 3、基金托管人：指广发证券股份有限公司
- 4、基金合同：指《东方睿鑫热点挖掘灵活配置混合型证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充
- 5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《东方睿鑫热点挖掘灵活配置混合型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
- 6、招募说明书或本招募说明书：指《东方睿鑫热点挖掘灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》及其更新
- 7、基金产品资料概要：指《东方睿鑫热点挖掘灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要》及其更新
- 8、基金份额发售公告：指《东方睿鑫热点挖掘灵活配置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2003年10月28日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，并经2012年12月28日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自2013年6月1日起实施的《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2013年3月15日颁布、同年6月1日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 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《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、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

17、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

18、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

19、合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》及相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者

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

21、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

22、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

23、销售机构：指东方基金管理股份有限公司以及符合《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协议，办理基金销售业务的机构

24、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

25、登记机构：指办理登记业务的机构。基金的登记机构为东方基金管理股份有限公司或接受东方基金管理股份有限公司委托代为办理登记业务的机构

26、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

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

28、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

29、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

30、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

31、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

32、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

33、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

34、T+n日：指自T日起第n个工作日（不包含T日）

35、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

36、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

37、《业务规则》：指《东方基金管理股份有限公司公开募集开放式证券投资基金登记业务规则》，是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金登记方面的业务规则，由基金管理人 and 投资人共同遵守

38、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

39、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

40、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

41、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

42、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

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

44、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%

45、元：指人民币元

46、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

47、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

48、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

49、基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

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

51、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

52、销售服务费：指从基金资产中计提的，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

53、基金份额类别：指本基金根据认购/申购费用、赎回费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取前端认购/申购费用、赎回时收取赎回费用的，称为 A 类基金份额；在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用、赎回时收取赎回费用，且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

54、指定媒介：指中国证监会指定的用以进行信息披露的全国性报刊（以下简称“指定报刊”）及指定互联网网站（以下简称“指定网站”，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

55、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

56、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

57、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

## 第三部分 基金管理人

### 一、基金管理人基本情况

名称：东方基金管理股份有限公司

住所：北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层

办公地址：北京市丰台区金泽路 161 号院 1 号楼远洋锐中心 26 层

邮政编码：100073

法定代表人：崔伟

成立时间：2004 年 6 月 11 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：叁亿叁仟叁佰叁拾叁万元人民币

营业期限：2004 年 6 月 11 日至长期

经营范围：基金募集；基金销售；资产管理；从事境外证券投资管理业务；

中国证监会许可的其他业务

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2004]80 号

统一社会信用代码：911100007635106822

联系人：李景岩

电话：010-66295888

股权结构：

| 股东名称                 | 认购股份数（万股） | 持股比例   |
|----------------------|-----------|--------|
| 东北证券股份有限公司           | 19200     | 57.60% |
| 河北国控资本管理有限公司         | 8100      | 24.30% |
| 渤海国际信托股份有限公司         | 2700      | 8.10%  |
| 天津汇智长行企业管理咨询中心（有限合伙） | 1170      | 3.51%  |
| 天津汇远长行企业管理咨询中心（有限合伙） | 1123      | 3.37%  |
| 天津汇聚长行企业管理咨询中心（有限合伙） | 1040      | 3.12%  |
| 合计                   | 33333     | 100%   |

内部组织结构：

股东会是公司的最高权力机构，下设董事会和监事会，董事会下设合规与风险控制委员会、薪酬与考核委员会；公司组织管理实行董事会领导下的总经理负责制，下设战略发展委员会、风险控制委员会、投资决策委员会、产品委员会、IT治理委员会、估值委员会、反洗钱工作组和权益投资部、权益研究部、固定收益投资部、固定收益研究部、量化投资部、绝对收益部、资产配置部、专户投资部、专户业务一部、专户业务二部、专户业务三部、市场部、渠道管理部、产品开发部、电子商务部、机构业务一部、战略客户部、财富管理部、董事会办公室、运营部、交易部、信息技术部、财务部、人力资源部、综合管理部、风险管理部、合规法务部、监察稽核部及北京分公司、上海分公司、广州分公司、成都分公司、海口分公司；公司设督察长，分管风险管理部、合规法务部、监察稽核部，负责组织指导公司的风险管理、合规管理和监察稽核工作。

## 二、基金管理人主要人员情况

### (一) 董事会成员

崔伟先生，董事长，兼任东北证券股份有限公司副董事长、中国证券投资基金业协会第二届监事、东方汇智资产管理有限公司董事长，经济学博士。曾任中国人民银行副主任科员、主任科员、副处级秘书，中国证监会党组秘书、秘书处副处长、处长，中国人民银行东莞中心支行副行长、党委委员，中国人民银行汕头中心支行行长、党委书记兼国家外汇管理局汕头中心支局局长，中国证监会海南监管局副局长兼党委委员、局长兼党委书记，中国证监会协调部副主任兼中国证监会投资者教育办公室召集人、中国证券投资基金业协会第一届理事。

何俊岩先生，董事，硕士，高级会计师、中国注册会计师、中国注册资产评估师，吉林省五一劳动奖章获得者。历任吉林省五金矿产进出口公司计划财务部财务科长，东北证券有限责任公司计划财务部总经理、客户资产管理总部总经理，福建凤竹纺织科技股份有限公司财务总监，东北证券有限责任公司财务总监，东北证券股份有限公司副总裁、常务副总裁，东证融达投资有限公司董事，东证融通投资管理有限公司董事，东方基金管理有限责任公司监事会主席；现任东北证券股份有限公司副董事长、总裁、党委副书记，兼任吉林省第十二届政协委员，吉林省人民政府决策咨询委员会第五届委员，长春市第十六届人大代表，东证融达投资有限公司董事长。

李雪飞先生，董事，硕士。曾任吉林建设开发集团公司党委文书，吉林省国

际信托投资公司职员，华泰证券股份有限公司长春同志街营业部交易部经理、总经理助理，东北证券股份有限公司长春自由大路证券营业部总经理、长春同志街第三证券营业部总经理、营销管理部总经理、客户服务部总经理、机构业务部总经理、总裁助理、经纪业务发展与管理委员会副主任、金融产品部总经理、职工监事、东证融达投资有限公司董事；现任东北证券股份有限公司副总裁、经纪业务发展与管理委员会主任、党委委员，兼任中国证券业协会投资者服务与保护委员会委员，上海证券交易所第五届理事会市场交易管理委员会副主任委员，长春市南关区第十八届、第十九届人民代表大会代表，吉林省资本市场发展促进会副会长、秘书长，东证融汇证券资产管理有限公司副董事长，渤海期货股份有限公司董事长。

王真女士，董事，工商管理硕士。曾任沧州日报社记者，燕赵都市报社经济新闻部主任，河北青年报社副总编辑，河北建设投资集团有限公司集团办公室副主任，河北省国有资产控股运营有限公司战略投资部部长；现任河北国控资本管理有限公司党委书记、董事长，兼任河北省国有资产控股运营有限公司总裁助理、资本运营总监。

董丁丁先生，董事，北京大学金融学硕士，中共党员。历任海南航空股份有限公司飞行计划员、机组资源管理员、海航集团财务有限公司金融服务部信贷信息助理、信贷信息主管、公司业务经理、客户经理、总经理助理，资金信贷部副总经理、总经理。现任渤海国际信托股份有限公司财务总监。

雷小玲女士，独立董事，北京大学 EMBA，中国注册会计师。历任贵阳市财经学校会计专业教师，贵州省财经学院会计学系教师，海南会计师事务所注册会计师，证监会发行部发行审核委员，亚太中汇会计师事务所有限公司副主任会计师。现任中审众环会计师事务所海南分所所长，兼任海南省注册会计师协会专业技术咨询委员会主任委员。

陈守东先生，独立董事，经济学博士。历任通化煤矿学院教师，吉林大学数学系教师，吉林大学经济管理学院副教授，吉林大学商学院教授、博士生导师；现任吉林大学数量经济研究中心教授、博士生导师，兼任东方集团股份有限公司独立董事，吉林舒兰农村商业银行股份有限公司（非上市公司）独立董事，吉林瑞科汉斯电气股份有限公司独立董事，长春一汽富维汽车零部件股份有限公司独立董事，中国金融学年会常务理事，吉林省现场统计学会副理事长，吉林省法学会金

融法学会副会长及金融法律专家团专家。

刘峰先生，独立董事，大学本科。历任湖北省黄石市律师事务所副主任，海南方圆律师事务所主任；现任上海市锦天城律师事务所高级合伙人，兼任三角轮胎股份有限公司独立董事，北京百普赛斯生物科技股份有限公司独立董事，中华全国律师协会律师发展战略研究委员会副主任，金融证券委员会委员，曾被国家食品药品监督管理总局聘为首批餐饮服务食品安全法律组专家。

刘鸿鹏先生，总经理兼首席信息官，公司董事，吉林大学行政管理硕士。曾任新华证券股份有限公司长春同志街营业部总经理、东北证券股份有限公司杭州营业部总经理、营销管理总部副总经理、总经理。2011年5月加盟本基金管理人，历任总经理助理兼市场总监、市场部总经理，公司副总经理。

## （二）监事会成员

赵振兵先生，监事会主席，本科，高级经济师。历任河北华联商厦团委副书记、总经理助理、副总经理，河北省商贸集团经营二公司副总经理，河北省工贸资产经营有限公司改革发展处副处长，河北省国有资产控股运营有限公司团委书记、企业管理部副部长、资产运营部部长、副总裁；现任河北省国有资产控股运营有限公司总裁、党委副书记、副董事长。

周鑫先生，监事，硕士研究生。曾任职北京时代博讯高科技有限公司、太平洋证券有限责任公司、北京航天辰光精密仪器有限公司等机构；现任东方基金管理股份有限公司综合管理部总经理兼人力资源部总经理。

王丹丹女士，监事，硕士研究生。曾任职银瑞信基金管理有限公司、英大基金管理有限公司；现任东方基金管理股份有限公司产品开发部总经理兼运营部总经理。

## （三）高级管理人员

崔伟先生，董事长，简历请参见董事介绍。

刘鸿鹏先生，总经理兼首席信息官，简历请参见董事介绍。

秦熠群先生，副总经理，兼任东方汇智资产管理有限公司董事，中央财经大学经济学博士。曾任中央财经大学经济学院副院长、学校分部副主任。2011年7月加盟本基金管理人，历任董办主任、董秘、总经理助理，期间兼任人力资源部、综合管理部、风险管理部等部门总经理。

张科先生，副总经理，中国人民银行研究生部金融学博士。曾任甘肃银光化

学工业公司中学教师，深圳发展银行蛇口支行会计、信贷业务员，深圳发展银行上海分行资金部部门负责人，平安银行北京分行副行长、资深销售总监；2019年12月加盟本基金管理人，曾任特别助理。

杨贵宾先生，副总经理、固定收益投资总监，公募投资决策委员会副主任委员，东方双债添利债券型证券投资基金基金经理，东方多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理，东方可转债债券型证券投资基金基金经理，东方兴润债券型证券投资基金基金经理，西安交通大学经济学博士。曾任富国基金管理有限公司固定收益研究员、基金经理，上海海通证券资产管理有限公司投资主办、固定收益投资总监、公司总经理助理，2019年9月加盟本基金管理人，曾任总经理助理、固定收益投资总监。

关洪波先生，副总经理、市场总监，吉林大学工商管理硕士。曾任新华证券有限责任公司长春安达街营业部副总经理，东北证券有限责任公司南京中山北路营业部总经理，东北证券股份有限公司松原营业部总经理、长春建设街营业部总经理、运营管理部总经理。2017年11月加盟本基金管理人，曾任总经理助理、市场总监。

许文波先生，副总经理、权益投资总监，公募投资决策委员会副主任委员，东方精选混合型开放式证券投资基金基金经理、东方强化收益债券型证券投资基金基金经理、东方龙混合型开放式证券投资基金基金经理、东方欣利混合型证券投资基金基金经理、东方欣益一年持有期偏债混合型证券投资基金基金经理，吉林大学工商管理硕士。曾任新华证券有限责任公司投资顾问部分析师；东北证券股份有限公司资产管理分公司投资管理部投资经理、部门经理；德邦基金管理有限公司基金经理、投资研究部总经理。2018年4月加盟本基金管理人，曾任公司总经理助理、权益投资总监，东方双债添利债券型证券投资基金基金经理、东方价值挖掘灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方中国红利混合型证券投资基金基金经理。

李景岩先生，督察长，硕士研究生，中国注册会计师。曾任东北证券股份有限公司延吉证券营业部财务经理、北京管理总部财务经理。2004年6月加盟本基金管理人，曾任财务主管，财务部经理，财务负责人，综合管理部经理兼人力资源部经理、总经理助理。

郝丽琨女士，财务负责人，吉林大学社会学硕士，中国注册会计师，国际注

册内审师。曾任吉林省物资贸易大厦财务部会计、吉林省证券交易中心财务部会计、东北证券股份有限公司财务部高级项目经理、稽核审计部副总经理，2010年2月加盟本公司，任财务负责人。

(四) 本基金基金经理

| 姓名          | 任职日期                             | 简历                                                                                                                                                                                                                               |
|-------------|----------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 张玉坤<br>(先生) | 2016年8月16日至今                     | 清华大学化学工程与技术硕士，11年证券从业经历，曾任北京市凌怡科技公司炼化业务咨询顾问，2011年5月加盟本基金管理人，曾任研究部研究员，权益投资部研究员、投资经理、东方岳灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方价值挖掘灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方区域发展混合型证券投资基金基金经理，现任东方睿鑫热点挖掘灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方支柱产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方周期优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。 |
| 呼振翼<br>(先生) | 自2015年4月15日至2015年8月20日担任本基金基金经理。 |                                                                                                                                                                                                                                  |
| 薛子微<br>(先生) | 自2015年6月25日至2018年1月23日担任本基金基金经理。 |                                                                                                                                                                                                                                  |

(五) 公募投资决策委员会成员

刘鸿鹏先生，总经理兼首席信息官，公募投资决策委员会主任委员，简历请参见董事介绍。

杨贵宾先生，公司副总经理、固定收益投资总监、公募投资决策委员会副主任委员。简历请参见高级管理人员介绍。

许文波先生，公司副总经理、权益投资总监、公募投资决策委员会副主任委员，简历请参见高级管理人员介绍。

蒋茜先生，公司总经理助理、权益投资副总监，公募投资决策委员会委员。清华大学工商管理硕士，12年证券从业经历。曾任 GCW Consulting 高级分析师、中信证券高级经理、天安财产保险股份有限公司研究总监、渤海人寿保险股份有限公司投资总监。2017年5月加盟本基金管理人，曾任权益投资部总经理、研究

部总经理，东方支柱产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方精选混合型开放式证券投资基金基金经理、东方互联网嘉混合型证券投资基金基金经理、东方人工智能主题混合型证券投资基金基金经理，现任东方主题精选混合型证券投资基金基金经理、东方创新科技混合型证券投资基金基金经理、东方鑫享价值成长一年持有期混合型证券投资基金基金经理。

李瑞先生，权益投资部总经理、公募投资决策委员会委员。中国人民大学金融学硕士，11年证券从业经历。2011年7月加盟本基金管理人，曾任绝对收益部副总经理、权益投资部研究员，东方精选混合型开放式证券投资基金基金经理助理、东方安心收益保本混合型证券投资基金（于2019年8月2日起转型为东方成长回报平衡混合型证券投资基金）基金经理、东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金（于2018年6月21日起转型为东方新能源汽车主题混合型证券投资基金）基金经理、东方成长回报平衡混合型证券投资基金基金经理、东方新策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方惠新灵活配置混合型证券投资基金基金经理，现任东方新能源汽车主题混合型证券投资基金基金经理、东方汽车产业趋势混合型证券投资基金基金经理。

王然女士，权益研究部总经理，公募投资决策委员会委员。北京交通大学产业经济学硕士，14年证券从业经历。曾任益民基金交通运输、纺织服装、轻工制造行业研究员。2010年4月加盟本基金管理人，曾任权益研究部副总经理，权益投资部交通运输、纺织服装、商业零售行业研究员，东方策略成长股票型开放式证券投资基金（于2015年8月7日转型为东方策略成长混合型开放式证券投资基金）基金经理助理、东方策略成长股票型开放式证券投资基金（于2015年8月7日转型为东方策略成长混合型开放式证券投资基金）基金经理、东方赢家保本混合型证券投资基金基金经理、东方保本混合型开放式证券投资基金（于2017年5月11日转型为东方成长收益平衡混合型证券投资基金）基金经理、东方荣家保本混合型证券投资基金基金经理、东方民丰回报赢安定期开放混合型证券投资基金（于2017年9月13日起转型为东方民丰回报赢安混合型证券投资基金）基金经理、东方成长收益平衡混合型证券投资基金（于2018年1月17日转型为东方成长收益灵活配置混合型证券投资基金）基金经理、东方大健康混合型证券投资基金基金经理、东方成长收益灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方价值挖掘灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方合家保本混合型证券投资基金基

金经理、东方民丰回报赢安混合型证券投资基金基金经理、东方盛世灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方新思路灵活配置混合型证券投资基金基金经理,现任东方策略成长混合型开放式证券投资基金基金经理、东方新兴成长混合型证券投资基金基金经理、东方城镇消费主题混合型证券投资基金基金经理、东方品质消费一年持有期混合型证券投资基金基金经理。

吴萍萍女士,固定收益投资部总经理,公募投资决策委员会委员。中国人民大学应用经济学硕士,11年证券从业经历。曾任安信证券投资组资金交易员、民生加银基金管理有限公司专户投资经理。2015年11月加盟本基金管理人,曾任固定收益投资部副总经理,东方稳健回报债券型证券投资基金基金经理助理、东方添益债券型证券投资基金基金经理助理、东方利群混合型发起式证券投资基金基金经理助理、东方强化收益债券型证券投资基金基金经理助理、东方添益债券型证券投资基金基金经理、东方安心收益保本混合型证券投资基金(于2019年8月2日起转型为东方成长回报平衡混合型证券投资基金)基金经理、东方稳健回报债券型证券投资基金基金经理、东方成长回报平衡混合型证券投资基金基金经理、东方臻悦纯债债券型证券投资基金基金经理、东方合家保本混合型证券投资基金基金经理、东方卓行18个月定期开放债券型证券投资基金基金经理、东方臻选纯债债券型证券投资基金基金经理、东方臻萃3个月定期开放纯债债券型证券投资基金基金经理、东方永泰纯债1年定期开放债券型证券投资基金基金经理、东方永悦18个月定期开放纯债债券型证券投资基金基金经理、东方臻享纯债债券型证券投资基金基金经理,现任东方永兴18个月定期开放债券型证券投资基金基金经理、东方添益债券型证券投资基金基金经理、东方金账簿货币市场证券投资基金基金经理、东方中债1-5年政策性金融债指数证券投资基金基金经理、东方恒瑞短债债券型证券投资基金基金经理。

刘长俊先生,固定收益研究部副总经理,公募投资决策委员会委员。上海财经大学金融学硕士,11年投资从业经历。曾任平安银行股份有限公司投资经理、德邦基金管理有限责任公司固定收益研究员、基金经理。2019年7月加盟本基金管理人,现任东方稳健回报债券型证券投资基金基金经理、东方卓行18个月定期开放债券型证券投资基金基金经理、东方臻慧纯债债券型证券投资基金基金经理、东方恒瑞短债债券型证券投资基金基金经理、东方中债1-5年政策性金融债指数证券投资基金基金经理。

(六) 上述人员之间均不存在近亲属关系。

### 三、基金管理人职责

#### (一) 基金管理人的权利

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

- 1、依法募集资金；
- 2、自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
- 3、依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- 4、销售基金份额；
- 5、按照规定召集基金份额持有人大会；
- 6、依据《基金合同》及有关法律、法规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- 7、在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- 8、选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；
- 9、担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；
- 10、依据《基金合同》及有关法律、法规规定决定基金收益的分配方案；
- 11、在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；
- 12、依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- 13、在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资、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、期货经纪机构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、转换和非交易过户等的业务规则；

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。

## (二) 基金管理人的义务

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

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

2、办理基金备案手续；

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

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

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

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

7、依法接受基金托管人的监督；

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

9、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

10、编制季度报告、中期报告和年度报告；

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

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

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

14、按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

25、执行生效的基金份额持有人大会的决议；

26、建立并保存基金份额持有人名册；

27、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

#### 四、基金管理人的承诺

(一) 本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。

(二) 本基金管理人承诺严格遵守《中华人民共和国证券法》、《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、利用基金财产或者职务之便为基金份额持有人以外的第三人牟取利益;
- 4、向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失;
- 5、侵占、挪用基金财产;
- 6、泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动;
- 7、玩忽职守, 不按照规定履行职责;
- 8、法律、行政法规和中国证监会禁止的其他行为。

(三) 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利益;
- 4、在向中国证监会报送的资料中弄虚作假;
- 5、拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管;
- 6、玩忽职守、滥用职权, 不按照规定履行职责;
- 7、违反现行有效的有关法律法规、《基金合同》和中国证监会的有关规定, 泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密, 尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息, 或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动;
- 8、违反证券交易所业务规则, 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、其他法律法规以及中国证监会禁止的行为。

#### (四) 基金经理承诺

- 1、依照有关法律法规和《基金合同》的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；
- 2、不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，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
- 4、不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

#### 五、基金管理人的内部控制制度

##### (一) 内部控制的原则

- 1、健全性原则：内部控制应当包括公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员，并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个环节。
- 2、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，维护内部控制制度的有效执行。
- 3、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，基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离。
- 4、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。
- 5、成本效益原则：公司运用科学化的经营管理方法降低运作成本，提高经济效益，以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

##### (二) 内部控制的主要内容

###### 1、控制环境

(1)控制环境构成公司内部控制的基礎，环境控制包括管理思想、经营理念、控制文化、公司治理结构、组织结构和员工道德素质等内容。

(2)管理层通过定期学习、讨论、检讨内控制度，组织内控设计并以身作则、积极执行，牢固树立诚实信用和内控优先的思想，自觉形成风险管理观念；通过营造公司内控文化氛围，增进员工风险防范意识，使其贯穿于公司各部分、岗位和业务环节。

(3)董事会负责公司内部控制基本制度的制定和内控工作的评估审查，对公司建立有效的内部控制系统承担最终责任；同时，通过充分发挥独立董事和监事

会的监督职能,避免不正当关联交易、利益输送和内部人控制现象的发生,建立健全符合现代企业制度要求的法人治理结构。

(4) 建立决策科学、运营规范、管理高效的运行机制,包括民主透明的决策程序和管理议事规则,高效严谨的业务执行系统,以及健全有效的内部监督和反馈系统。

(5) 建立科学的聘用、培训、轮岗、考评、晋升、淘汰等人事管理制度,严格制定单位业绩和个人工作表现挂钩的薪酬制度,确保公司职员具备和保持正直、诚实、公正、廉洁的品质与应有的专业能力。

## 2、风险评估

公司定期评估公司风险状况,范围包括所有能对经营目标产生负面影响的内部和外部因素,评估这些因素对公司总体经营目标产生影响的程度及可能性,并将评估报告报公司董事会及高级管理人员。

## 3、组织体系

内部控制组织体系包括三个层次:

第一层次:董事会层面对公司经营管理过程中的风险控制工作的指导;

公司董事会通过其下设的合规与风险控制委员会、督察长对公司和基金的合法合规性进行监督。

合规与风险控制委员会代表董事会在董事会授权范围内对公司和基金运作的合法合规性及风险控制状况进行评估,并督促经理层、督察长落实或改进。

督察长根据法律法规的规定,监督检查基金和公司运作的合法合规及公司内部风险控制情况,行使法律法规及中国证监会和公司章程规定的职权。

第二层次:公司管理层对经营风险进行预防和控制的组织主要是总经理办公会、风险控制委员会和风险与监察稽核部门;

(1) 总经理办公会为公司经营重大事项之决策机构,并负责公司层面风险管理工作。

(2) 风险控制委员会是公司基金投资及资产管理的最高风险控制机构。风险控制委员会的主要职权是拟定基金投资风险控制的基本制度和标准,划分和量化市场风险,并进行基金投资组合的风险评估和业绩评价。

(3) 风险与监察稽核部门,负责对公司、基金运作和资产管理的合法合规性、内部控制制度的有效性及公司日常风险和基金投资的绩效评价进行风险管理、监

察、稽核。

第三层次：各职能部门对各自业务的自我检查和控制。

公司各业务部门作为公司内部风险控制的具体实施单位，在公司各项基本管理制度的基础上，根据具体情况制订和执行本部门的业务管理办法和操作流程，对各自业务中潜在风险进行自我检查和控制。

#### 4、制度体系

制度是内部控制的指引和规范，制度缜密是内部控制体系的基础。

(1) 内部控制制度包括内部管理控制制度、业务控制制度、会计核算控制制度、信息披露制度、监察稽核制度等。

(2) 内部管理控制制度包括授权管理制度、人力资源及业绩考核制度、行政管理制度、员工行为规范、纪律程序。

(3) 业务控制制度包括投资管理制度、风险控制制度、资料档案管理制度、技术保障制度和危机处理制度。

#### 5、信息与沟通

建立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。

#### (三) 基金管理人关于内部控制制度的声明

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

2、上述关于内部控制制度的披露真实、准确；

3、基金管理人承诺将根据市场环境的变化及基金管理人不断发展完善内部控制制度。

## 第四部分基金托管人

### (一) 基金托管人情况

#### 1、基本情况

名称：广发证券股份有限公司（简称：广发证券）

住所：广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街2号618室

办公地址：广州市天河区马场路26号广发证券大厦34楼

法定代表人：林传辉

成立时间：1994年1月21日

基金托管资格批文及文号：证监许可【2014】510号

注册资本：人民币7,621,087,664元

存续期间：长期

联系人：崔瑞娟

联系电话：020-66338888

广发证券是国内首批综合类证券公司，先后于2010年和2015年分别在深圳证券交易所及香港联合交易所有限公司主板上市（股票代码：000776.SZ，1776.HK）。截至2021年12月31日，公司共设立证券营业部284家。

广发证券具备完整的业务体系、科学均衡的业务结构，综合金融服务能力行业领先，主要经营指标连续多年稳居中国十大券商行列，是中国资本市场最具影响力的证券公司之一。截至2021年12月31日，集团总资产5,358.55亿元，归属于上市公司股东的所有者权益为1,066.25亿元，2021年营业收入为342.50亿元，营业利润为150.25亿元，归属于上市公司股东的净利润为108.54亿元。

#### 2、主要人员情况

刘洋先生现任广发证券资产托管部总经理。曾就职于大成基金管理有限公司、招商银行股份有限公司、浦银安盛基金管理有限公司、上海银行股份有限公司、美国道富银行。刘洋先生于2000年7月获得北京大学理学学士，并于2003年7月获得北京大学经济学硕士学位。

广发证券资产托管部主要人员均具备多年基金、证券、银行等金融机构从业经历或会计师事务所审计经验，从业经验丰富，具备基金从业资格，熟悉基金托

管工作。资产托管部员工学历均在本科以上,专业背景涵盖了金融、法律、会计、统计、计算机等领域,是一支诚实勤勉、积极进取的专业团队。

### 3、基金托管业务经营情况

广发证券于2014年5月取得中国证监会核准证券投资基金托管资格。广发证券严格履行基金托管人的各项职责,不断加强风险管理和内部控制,确保基金资产的完整性和独立性,切实维护基金份额持有人的合法权益,提供高质量的基金托管服务。截至2022年3月31日,广发证券托管的公开募集证券投资基金共39只。

#### (二) 基金托管人的风险管理原则和内部控制制度

公司开展基金托管业务遵循以下风险管理原则:

1、合规性原则。保持风险管理政策与监管部门要求相一致,并把监管规定作为业务开展和风险管理应遵从的最基本要求。

2、全面性原则。资产托管业务风险管理应涵盖可能出现的所有风险类型,应渗透到决策、执行、监督、反馈等各个环节,风险控制应落实到业务涉及的所有岗位、所有环节,包含事前风险控制、事中风险监控、事后风险报告和处理。

3、制衡性原则。资产托管业务各级业务部门和岗位的设置应当权责分明、相互制约,建立不同部门、不同岗位之间的制衡体系。

4、独立性原则。公司的风险控制相关部门,包括合规与法律事务部、风险管理部、稽核部等,均应保持高度的独立性,各自从独立的风险控制角度出发,对资产托管业务的风险进行管理。

5、持续性原则。公司对资产托管业务开展持续的风险管理工作,根据实际情况动态调整风控措施和风控手段,并通过顺畅的风险报告和传导机制,及时有效地处理各种风险事项,确保风险管理政策和措施的贯彻实施。

广发证券根据相关法律法规和公司制度的相关要求,制定了完善的内部控制制度,具体包括《广发证券资产托管业务管理办法》、《广发证券公募基金投资监督管理规定》、《广发证券资产托管业务信息披露管理规定》、《广发证券资产托管业务资金清算管理规定》、《广发证券资产托管业务账户管理规定》、《广发证券资产托管业务基金估值核算管理规定》、《广发证券资产托管部从业人员管理规定》、《广发证券资产托管业务应急管理规定的规定》、《广发证券资产托管部

业务信息保密与业务档案管理规定》、《广发证券股份有限公司资产托管业务公开募集证券投资基金风险准备金管理规定》等,囊括了基金托管业务的账户管理、估值核算、资金清算、投资监督、内部控制、风险管理、业务系统管理、保密和档案管理、应急处理、从业人员管理等全部业务环节。

### (三) 基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规以及基金合同、基金托管协议相关规定,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、信息披露等进行监督。

基金托管人发现基金管理人违反《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规或基金合同、基金托管协议相关规定的行为,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。

## 第五部分 相关服务机构

### 一、直销机构

#### 1、柜台交易

名称：东方基金管理股份有限公司直销中心

住所：北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层

法定代表人：崔伟

办公地址：北京市丰台区金泽路 161 号院 1 号楼远洋锐中心 26 层

联系人：王丹

电话：010—66295876

传真：010—66578690

网址：[www.orient-fund.com](http://www.orient-fund.com) 或 [www.df5888.com](http://www.df5888.com)

#### 2、电子交易

投资者可以通过本公司网上交易系统办理基金的申购、赎回等业务，具体业务办理情况及业务规则请登录本公司网站查询。

网址：[www.orient-fund.com](http://www.orient-fund.com) 或 [www.df5888.com](http://www.df5888.com)

### 二、其他销售机构

#### 1、中国工商银行股份有限公司

住所：中国北京复兴门内大街 55 号

办公地址：中国北京复兴门内大街 55 号

法定代表人：陈四清

联系人：陶仲伟

电话：010-66107900

传真：010-66107914

客服电话：95588

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

#### 2、招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：缪建民

联系人:季平伟

客户服务电话:95555

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

3、中国邮政储蓄银行股份有限公司

住所:北京市西城区金融大街3号

办公地址:北京市西城区金融大街3号

法定代表人:张金良

联系人员:李雪萍

客服电话:95580

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

4、东莞银行股份有限公司

住所:东莞市莞城区体育路21号东莞银行大厦

办公地址:东莞市莞城区体育路21号东莞银行大厦

法定代表人:廖玉林

联系人:陈幸

电话:0769-22119061

传真:0769-22117730

客服电话:4001196228(全国)、96228(广东省内)

网址: [www.dongguanbank.cn](http://www.dongguanbank.cn)

5、吉林银行股份有限公司

住所:吉林省长春市东南湖大路1817号

办公地址:吉林省长春市东南湖大路1817号

法定代表人:陈宇龙

联系人:孟明

电话:0431-84992680

传真:0431-84992649

客服电话:400-88-96666(全国)、96666(吉林省)

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

6、晋商银行股份有限公司

住所:山西省太原市小店区长风街59号

办公地址：山西省太原市小店区长风街 59 号

法人代表：郝强

联系人：董嘉文

电话：0351-6819505

传真：0351-6819898

客户服务电话：95105588

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

#### 7、青岛银行股份有限公司

住所：青岛市崂山区秦岭路 6 号 3 号楼

办公地址：青岛市崂山区秦岭路 6 号 3 号楼

法定代表人：郭少泉

联系人：陈界交

电话：0532-68629956

传真：0532-68629939

客户服务电话：96588(青岛)；400-66-96588(全国)

网址：<http://www.qdccb.com>

#### 8、宁波银行股份有限公司

住所：浙江省宁波市鄞州区宁东路 345 号

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 210 号 19 楼

法人代表：陆华裕

联系人：马艺玮

电话：021-23262715

客服电话：95574

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

#### 9、长江证券股份有限公司

住所：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

办公地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：李新华

联系人：奚博宇

电话：027-65799999

传真: 027-85481900

客服电话: 95579 或 4008-888-999

网址: [www.95579.com](http://www.95579.com)

#### 10、东北证券股份有限公司

住所: 长春市生态大街 6666 号

办公地址: 长春市生态大街 6666 号

法定代表人: 李福春

联系人: 安岩岩

电话: 0431-85096517

传真: 0431-85096795

客服电话: 95360

网址: [www.nesc.cn](http://www.nesc.cn)

#### 11、东海证券股份有限公司

注册地址: 江苏省常州延陵西路 23 号投资广场 18 层

办公地址: 上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦

法定代表人: 钱俊文

电话: 021-20333333

传真: 021-50498825

联系人: 王一彦

客服电话: 95531 或 400-8888-588

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

#### 12、东莞证券股份有限公司

住所: 广东省东莞市莞城区可园南路一号金源中心 30 楼

办公地址: 广东省东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼

法定代表人: 陈照星

联系人: 孙旭

电话: 0769-22119348

客服电话: 961130 (省内直拨, 省外请加拨区号 0769)

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

#### 13、光大证券股份有限公司

住所：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号 3 楼

法定代表人：刘秋明

联系人：戴巧燕

电话：021-22169999

传真：021-22169134

客服电话：95525

网址：www.ebscn.com

#### 14、广发证券股份有限公司

住所：广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街 2 号 618 室

办公地址：广州市天河北路大都会广场 5、18、19、36、38、41、42、43、

44 楼

法定代表人：林传辉

联系人：黄岚

电话：020-87555888

传真：020-87555305

客服电话：95575

网址：www.gf.com.cn

#### 15、海通证券股份有限公司

住所：上海市淮海中路 98 号

办公地址：上海市黄浦区广东路 689 号

法定代表人：周杰

联系人：凌方睿

电话：021-23219454

传真：021-23219100

客服电话：021-95553、400-8888-001 或拨打各城市营业网点咨询电话

网址：www.htsec.com

#### 16、华安证券股份有限公司

住所：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 号财智中心 B1 座

法定代表人：章宏韬

联系人：范超

电话：0551-65161666

传真：0551-5161600

客服电话：95318

网址：www.hazq.com

17、华鑫证券有限责任公司

住所：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01（b）单元

办公地址：深圳市福田区莲花街道福中社区深南大道 2008 号中国凤凰大厦 1 栋 20C-1 房

法定代表人：俞洋

联系人：杨莉娟

电话：021-54967552

传真：021-54967293

客服电话：021-32109999；029-68918888；4001099918

网址：www.cfsc.com.cn

18、江海证券有限公司

住所：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

办公地址：哈尔滨市松北区创新三路 833 号

法定代表人：赵洪波

联系人：王金娇

电话：0451-87765732

传真：0451-82337279

客户服务热线：400-666-2288

网址：www.jhzq.com.cn

19、粤开证券股份有限公司

住所：惠州市江北东江三路 55 号广播电视新闻中心西面一层大堂和三、四层

办公地址：深圳市福田区深南中路 2002 号中广核大厦北楼 10 层

法定代表人：严亦斌

联系人: 彭莲

电话: 0755-83331195

客服电话: 95564

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

20、中泰证券股份有限公司

住所: 济南市市中区经七路 86 号

办公地址: 山东省济南市市中区经七路 86 号

法定代表人: 李峰

联系人: 李明娟

电话: 021-20315290

传真: 021-20315125

客服电话: 95538

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

21、上海证券有限责任公司

住所: 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 号久事商务大厦 7 楼

法定代表人: 何伟

联系人: 邵珍珍

电话: 021-53686888

传真: 021-53686100, 021-53686200

客服电话: 021-962518

网址: [www.962518.com](http://www.962518.com)

21、山西证券股份有限公司

住所: 山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

办公地址: 山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

法定代表人: 王怡里

联系人: 郭熠

电话: 0351-8686659

传真: 0351-8686619

客服电话: 400-666-1618

网址: [www.i618.com.cn](http://www.i618.com.cn)

### 23、申万宏源证券有限公司

住所: 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

联系人: 余洁

电话: 021-33388214

传真: 021-33388224

客服电话: 95523 或 4008895523

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

### 24、申万宏源西部证券有限公司

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

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

法定代表人: 王献军

联系人: 梁丽

电话: 0991-2307105

传真: 0991-2301927

客服电话: 95523 或 4008895523

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

### 25、五矿证券有限公司

住所: 深圳市福田区金田路 4028 号荣超经贸中心办公楼 47 层 01 单元

办公地址: 深圳市南山区滨海大道与后海滨路交汇处滨海大道 3165 号五矿金融大厦(18-25 层)

法定代表人: 黄海洲

联系人: 戴佳璐

电话: 0755-23375492

客服电话: 40018-40028

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

## 26、招商证券股份有限公司

住所：深圳市福田区福田街道福华一路 111 号

办公地址：深圳市福田区福华一路 111 号招商证券大厦 23 楼

法定代表人：霍达

联系人：黄婵君

电话：0755-82943666

传真：0755-829734343

客服电话：95565、4008888111

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

## 27、中国银河证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 35 号 2-6 层

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：陈共炎

联系人：辛国政

电话：010-80928123

传真：010-80928123

客服电话：400-888-8888

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

## 28、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：吴小静

联系人：罗艺琳

电话：0755-82943755

传真：0755-82960582

客服电话：95329

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

## 29、中信建投证券股份有限公司

住所：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：王常青

联系人：权唐

电话：010-85130588

传真：010-65182261

客服电话：400-8888-108

网址：www.csc108.com

30、中信证券（山东）有限责任公司

住所：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：冯恩星

联系人：刘晓明

电话：0531—89606165

传真：0532-85022605

客服电话：95548

网址：www.zxwt.com.cn

31、中信证券股份有限公司

住所：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路 48 号中信证券大厦

法定代表人：张佑君

联系人：郑慧

电话：010-6083 8888

传真：010-6083 6029

客服电话：95548

网址：www.cs.ecitic.com

32、中信期货有限公司

住所：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层

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

法定代表人：张皓

联系人: 刘宏莹

电话: 010-60833754

传真: 0755-83201097

客服电话: 400-990-8826

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

33、中国国际金融股份有限公司

住所: 北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27层及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层及28层

法定代表人: 沈如军

联系人: 杨涵宇

电话: 010-65051166

传真: 010-85679203

客服电话: 400-910-1166

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

34、平安证券股份有限公司

住所: 深圳市福田区福田街道益田路5023号平安金融中心B座第22-25层

办公地址: 深圳市福田区福田街道益田路5023号平安金融中心B座第22-25

层

法定代表人: 何之江

联系人: 王阳

电话: 021-38632136

传真: 021-58991896

客服电话: 95511-8

网址: [stock.pingan.com](http://stock.pingan.com)

35、东兴证券股份有限公司

住所: 北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12、15层

办公地址: 北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12、15层

法定代表人: 魏庆华

联系人: 付梦雪

电话: 010-66559079

传真: 010-66555147

客服电话: 95309

网址: [www.dxzq.net](http://www.dxzq.net)

36、国金证券股份有限公司

住所: 四川省成都市东城根上街 95 号

办公地址: 四川省成都市东城根上街 95 号

法定代表人: 冉云

联系人: 刘婧漪

电话: 028-86690057

传真: 028-86690126

客服电话: 95310

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

37、华龙证券股份有限公司

住所: 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 19 楼

法定代表人: 祁建邦

联系人: 范坤

电话: 0931-4890208

传真: 0931-4890628

客户服务电话: 95368

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

38、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: 北京市朝阳区朝阳门外大街乙 12 号院 1 号昆泰国际大厦 12 层

法定代表人: 李科

客户服务电话: 95510

网址: <http://fund.sinosig.com/>

39、中国中金财富证券有限公司

住所: 深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18-21 层及第 04 层 01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23 单元

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 栋第 18-21 层及第 04 层 01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23 单元

法定代表人：高涛

客户服务热线：95532、400-600-8008

网站：[www.china-invs.cn](http://www.china-invs.cn)

40、大连网金基金销售有限公司

住所：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

法人代表：樊怀东

联系人：于秀

电话：0411-39027810

传真：0411-39027835

客户服务热线：4000-899-100

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

41、中信证券华南股份有限公司

住所：广州市天河区珠江西路 5 号 501 房

办公地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 5 层

法人代表：胡伏云

联系人：宋丽雪

客服电话：95548

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

42、中国人寿保险股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 16 号

办公地址：北京市西城区金融大街 16 号

法定代表人：王滨

客服电话：95519

网址：[www.e-chinalife.com](http://www.e-chinalife.com)

43、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

法定代表人：彭浩

客服电话: 400-004-8821

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

44、深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址: 深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#

办公地址: 北京市西城区宣武门外大街10号庄胜广场中央办公楼东翼7层727室

法定代表人: 杨懿

联系人: 张燕

电话: 010-58325388-1588

传真: 010-58325282

客服电话: 400-166-1188

网址: [8.jrj.com.cn](http://8.jrj.com.cn)

45、江苏汇林保大基金销售有限公司

注册地址: 南京市高淳区经济开发区古檀大道47号

办公地址: 南京市鼓楼区中山北路2号绿地紫峰大厦2005室

法定代表人: 吴言林

联系人: 孙平

电话: 13564999938

客服电话: 025-66046166

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

46、喜鹊财富基金销售有限公司

注册地址: 西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦1513室

办公地址: 西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦1513室

法定代表人: 陈皓

联系人: 张萌

电话: 18600730680

客服电话: 400-6997-719

网址: [www.xiquefund.com](http://www.xiquefund.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 层

法定代表人: 刘明军

联系人: 吴建国

电话: 0755-86013388-65061

客服电话: 95017

网址: www.txfund.com

48、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

法定代表人: 葛新

联系人: 宋刚

电话: 010-59403028

传真: 010-59403027

客服电话: 95055-4

网址: www.baiyingfund.com

49、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: 上海市杨浦区昆明路 508 号北美广场 B 座 12 楼

法定代表人: 汪静波

联系人: 李娟

联系电话: 021-38509735

传真: 021-38509777

客服电话: 400-821-5399

网址: www.noah-fund.com

50、深圳众禄基金销售股份有限公司

注册地址: 深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

办公地址: 深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼

法定代表人: 薛峰

联系人: 童彩平

电话: 0755-33227950

传真: 0755-33227951

客服电话: 400 678 8887

网址: [www.zlfund.cn](http://www.zlfund.cn) 及 [www.jjmmw.com](http://www.jjmmw.com)

51、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 号金座东方财富大厦

法定代表人: 其实

联系人: 施悦

电话: 021-54509977-8151

传真: 021-64385308

客服电话: 400 1818 188

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

52、上海好买基金销售有限公司

注册地址: 上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室

办公地址: 上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903~906 室

法定代表人: 杨文斌

联系人: 张茹

电话: 021-20613999

传真: 021-68596916

客服电话: 400 700 9665

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

53、蚂蚁(杭州)基金销售有限公司

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

办公地址: 浙江省杭州市西湖区西溪路 556 号

法定代表人: 王珺

联系人: 韩爱彬

客服电话: 95188-8

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

54、上海长量基金销售有限公司

注册地址: 上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层

法定代表人：张跃伟

联系人：单丙烨

电话：021-20691832

传真：021-20691861

客服电话：400 820 2899

网址：www.erichfund.com

55、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：浙江省杭州市翠柏路 7 号杭州电子商务产业园 2 号楼 2 楼

法定代表人：凌顺平

联系人：刘晓倩

电话：0571-88911818

传真：0571-88910240

客服电话：4008-773-772

网址：www.5ifund.com

56、北京展恒基金销售股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区华严北里 2 号民建大厦 6 层

办公地址：北京市朝阳区华严北里 2 号民建大厦 6 层

法定代表人：闫振杰

联系人：宋丽冉

电话：010-62020088

传真：010-62020355

客服电话：400 888 6661

网址：www.myfund.com

57、上海利得基金销售有限公司

注册地址：上海宝山区蕴川路 5475 号 1033 室

办公地址：上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼

法定代表人：李兴春

联系人：赵沛然

电话: 021-50583533

传真: 021-50583633

客服电话: 400-921-7755

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

58、天津市润泽基金销售有限公司

注册地址: 天津市和平区南京路181号世纪都会1606-1607

办公地址: 天津市和平区南京路181号世纪都会1606-1607

法定代表人: 王正宇

联系人: 孟媛媛

电话: 18920017760

传真: 022-23297867

客服电话: 400-706-6880

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

59、嘉实财富管理有限公司

注册地址: 上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心办公楼二期46层  
4609-10单元

办公地址: 北京市朝阳区建国路91号金地中心A座6层

法定代表人: 赵学军

联系人: 余永键

电话: 010-85097570

传真: 010-85097308

客服电话: 400-021-8850

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

60、乾道基金销售有限公司

注册地址: 北京市海淀区东北旺村南1号楼7层7117室

办公地址: 北京市西城区德外大街合生财富广场1302室

法定代表人: 王兴吉

联系人: 高雪超

电话: 010-62062880

传真: 010-82057741

客服电话：400-088-8080

网址：www.qiandaojr.com

61、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

联系人：张海洋

客服电话：010-66154828

网址：www.5irich.com

62、宜信普泽(北京)基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区光华路7号楼20层20A1、20A2单元

办公地址：北京市朝阳区光华路7号楼20层20A1、20A2单元

法定代表人：才殿阳

联系人：魏晨

电话：010-58664558

客服电话：400-6099-200

网址：www.yixinfund.com

63、南京苏宁基金销售有限公司

注册地址：南京市玄武区苏宁大道1-5号

办公地址：南京市玄武区徐庄软件园苏宁大道1号

法定代表人：王峰

联系人：张云飞

电话：13016933367

客服电话：025-66996699

网址：www.snjijin.com

64、北京增财基金销售有限公司

注册地址：北京市西城区南礼士路66号1号楼12层1208号

办公地址：北京市西城区南礼士路66号1号楼12层1208号

法定代表人：罗细安

联系人：史丽丽

电话: 010-67000988

传真: 010-67000988

客服电话: 400-001-8811

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

#### 65、通华财富(上海)基金销售有限公司

注册地址: 上海市浦东新区金沪路 55 号通华科技大厦 10 层

办公地址: 上海市浦东新区金沪路 55 号通华科技大厦 10 层

法定代表人: 沈丹义

联系人: 陶律然

客服电话: 400-101-9301

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

#### 66、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 A 座 28 层

法定代表人: 武建华

联系人: 丛瑞丰

联系电话: 010-59313555

客服电话: 400-8180-888

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

#### 67、北京汇成基金销售有限公司

注册地址: 北京市海淀区中关村大街 11 号 A 座 1108

办公地址: 北京市西城区宣武门外大街甲 1 号环球财讯中心 D 座 406

法定代表人: 王伟刚

联系人: 丁向坤

电话: 010-56282140

传真: 010-62680827

客服电话: 400-619-9059

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

#### 68、一路财富(北京)基金销售有限公司

注册地址: 北京市西城区阜成门外大街 2 号 1 幢 A2208 室

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

联系人: 吕晓歌

电话: 010-88312877

传真: 010- 88312099

客服电话: 400-001-1566

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

#### 69、北京钱景基金销售有限公司

注册地址: 北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012

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: 赵荣春

联系人: 申泽灏

电话: 010-57418813

传真: 010-57569671

客服电话: 400 678 5095

网址: [www.niuji.net](http://www.niuji.net)

#### 70、海银基金销售有限公司

注册地址: 上海市浦东新区东方路 1217 号 16 楼 B 单元

办公地址: 上海市浦东新区东方路 1217 号 6 楼

法定代表人: 刘惠

联系人: 毛林

电话: 021-80133597

传真: 021-80133413

客服电话: 400-808-1016

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

#### 71、济安财富(北京)基金销售有限公司

注册地址: 北京市朝阳区东三环中路 7 号 4 号楼 40 层 4601 室

办公地址: 北京市朝阳区东三环中路 7 号北京财富中心 A 座 46 层

联系人: 李海燕

电话: 010-65309516

传真: 010-65330699

客服电话: 400-673-7010

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

## 72、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11楼

法定代表人: 黄祎

联系人: 张戈

电话: 021-50712782

客服电话: 400-799-1888

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

## 73、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: 北京市朝阳区来广营中街甲1号朝来高科技产业园5号楼

法定代表人: 程刚

联系人: 张旭

电话: 010-58160168

传真: 010-58160181

客服电话: 400-810-5919

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

## 74、上海联泰基金销售有限公司

注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区富特北路277号3层310室

办公地址: 上海市长宁区福泉北路518号8号楼3层

法定代表人: 燕斌

联系人: 陈东

电话: 021-52822063

传真: 021-52975270

客服电话: 4000-466-788

网址: [www.66zichan.com](http://www.66zichan.com)

## 75、上海汇付金融服务有限公司

注册地址：上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼

办公地址：上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼

法定代表人：金佶

联系人：陈云卉

电话：021-33323999-5611

传真：021-33323837

客服电话：400-820-2819

网址：www.chinapnr.com

#### 76、上海基煜基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 1503 室

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

联系人：李鑫

电话：021-65370077

传真：021-55085991

客服电话：400-820-5369

网址：www.jiyufund.com.cn

#### 77、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 4 楼

法定代表人：陈继武

联系人：葛佳蕊

联系电话：021-63333389

传真：021-63332523

客服电话：4000178000

网址：www.lingxianfund.com

#### 78、上海中正达广基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙腾大道 2815 号 302 室

办公地址：上海市徐汇区龙腾大道 2815 号 302 室

法定代表人：黄欣

联系人: 戴珉微

电话: 021-33768132

传真: 021-33768132\*802

客服电话: 400-6767-523

网址: [www.zzwealth.cn](http://www.zzwealth.cn)

79、北京虹点基金销售有限公司

注册地址: 北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙房2层222单元

办公地址: 北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙房2层222单元

法定代表人: 胡伟

联系人: 牛亚楠

电话: 010-65951887

传真: 010-65951887

客服电话: 400-618-0707

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

80、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金田路3088号中洲大厦3203A单元

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: 刘鹏宇

联系人: 刘勇

电话: 0755-83999907-8814

传真: 0755-83999926

客服电话: 0755-83999907

网址: [www.jinqianwo.cn](http://www.jinqianwo.cn)

81、武汉市伯嘉基金销售有限公司

注册地址: 湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际SOHO城(一期)第7栋23层1号、4号

办公地址: 湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际SOHO城(一期)第7栋23层1号、4号

法定代表人：陶捷

联系人：孔繁

电话：027-87006003\*8020

传真：027-87006010

客服电话：400-027-9899

网址：www.buyfunds.cn

82、上海陆金所基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

法定代表人：郭坚

联系人：宁博宇

电话：021-20665952

传真：021-22066653

客服电话：400-821-9031

网址：www.lufunds.com

83、珠海盈米基金销售有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼 B1201-1203

法定代表人：肖雯

联系人：李孟军

电话：020-89629012

传真：020-89629011

客服电话：020-89629066

网址：www.yingmi.cn

84、和耕传承基金销售有限公司

注册地址：河南自贸试验区郑州片区（郑东）东风南路东康宁街北 6 号楼 5 楼 503

办公地址：河南自贸试验区郑州片区（郑东）东风南路东康宁街北 6 号楼 5 楼 503

法定代表人：温丽燕

联系人：胡静华

电话：18638787099

客服电话：4000555671

网址：www.hgccpb.com

85、奕丰基金销售有限公司

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

办公地址：深圳市南山区海德三道航天科技广场A座17楼1704室

法定代表人：TEO WEE HOWE

联系人：叶健

电话：0755-89460507

传真：0755-21674453

客服电话：400-684-0500

网址：www.ifastps.com.cn

86、中证金牛（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室

办公地址：北京市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：钱昊旻

联系人：沈晨

电话：010-59336544

客服电话：4008-909-998

网址：www.jnlc.com

87、上海爱建基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区西藏中路336号1806-13室

办公地址：上海市浦东新区民生路1299号丁香国际大厦西塔19层02/03室

法定代表人：马金

联系人：黄子珈

电话：021-60608989

客服电话：021-60608989

网址：www.ajwm.com.cn

88、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15层

法定代表人:王苏宁

联系人:隋斌

传真:010-89189566

客服电话:95118

网址: fund.jd.com

89、中民财富基金销售(上海)有限公司

注册地址:上海市黄浦区中山南路100号7层05单元

办公地址:上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼27层

法定代表人:弭洪军

联系人:黄鹏

电话:18521506916

客服电话:400-876-5716

网址: www.cmiwm.com

90、北京雪球基金销售有限公司

注册地址:北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507

办公地址:北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507

法定代表人:钟斐斐

联系人:侯芳芳

电话:010-61840688

客服电话:400-159-9288

网址: danjuanapp.com

91、深圳前海凯恩斯基金销售有限公司

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6019号金润大厦23A

法定代表人:高锋

联系人: 李勇

电话: 0755-83655588

传真: 0755-83655518

客服电话: 400-804-8688

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

#### 92、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

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

联系人: 林丽/刘文婷

联系电话: 0755-82779746/18122062924

客服电话: 400-666-7388

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

#### 93、深圳前海财厚基金销售有限公司

注册地址: 深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室

办公地址: 广东省深圳市南山区高新南十道 深圳湾科技生态园三区11栋A座3608室

法定代表人: 杨艳平

联系人: 莫婉

电话: 13923830997

客服电话: 400-1286-800

网址: [www.caiho.cn](http://www.caiho.cn)

#### 94、上海华夏财富投资管理有限公司

注册地址: 上海市虹口区东大名路687号1幢2楼268室

办公地址: 北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层

法定代表人: 毛淮平

联系人: 仲秋玥

电话: 010-88066632

传真: 010-63136184

客服电话: 400-817-5666

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

95、东方财富证券股份有限公司

注册地址: 西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城 10 栋楼

办公地址: 上海市徐汇区宛平南路 88 号东方财富大厦

法定代表人: 戴彦

联系人: 付佳

电话: 021-23586603

客服电话: 95357

网址: [www.18.cn](http://www.18.cn)

96、玄元保险代理有限公司

注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区张杨路 707 号 1105 室

办公地址: 中国(上海)自由贸易试验区张杨路 707 号 1105 室

法定代表人: 马永谕

联系人: 卢亚博

电话: 137-5252-8013

客服电话: 400-080-8208

网址: [www.licaimofang.cn](http://www.licaimofang.cn)

97、方德保险代理有限公司

注册地址: 北京市东城区东直门南大街 3 号楼 7 层 711

办公地址: 北京市朝阳区门外大街 18 号丰联广场 A 座 1009

法定代表人: 邢耀

联系人: 胡明哲

电话: 15810201340

传真: 028-62825388

客服电话: 010-64068617

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

98、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

联系人: 庞文静

电话: 13918960890

传真: 024-82280606

客服电话: 400-003-5811

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

### 三、登记机构

名称: 东方基金管理股份有限公司

住所: 北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层

办公地址: 北京市丰台区金泽路 161 号院 1 号楼远洋锐中心 26 层

法定代表人: 崔伟

联系人: 肖向辉

电话: 010-66295871

传真: 010-66578680

网址: [www.orient-fund.com](http://www.orient-fund.com) 或 [www.df5888.com](http://www.df5888.com)

### 四、出具法律意见书的律师事务所

名称: 上海市通力律师事务所

住所: 上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址: 上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人: 俞卫锋

联系人: 孙睿

电话: 021-31358666

传真: 021-31358600

经办律师: 黎明、孙睿

### 五、审计基金财产的会计师事务所

名称: 立信会计师事务所(特殊普通合伙)

住所: 上海市南京东路 61 号 4 楼

办公地址: 北京市海淀区西四环中路 16 号院 7 号楼 10 层

法定代表人: 朱建弟

联系人: 朱锦梅

电话: 010-68286868

传真：010-88210608

经办注册会计师：朱锦梅、高慧丽

## 第六部分 基金的募集与基金合同生效

一、本基金根据 2015 年 1 月 23 日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予东方睿鑫热点挖掘灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2015]120 号）和《关于东方睿鑫热点挖掘灵活配置混合型证券投资基金募集时间安排的确认函》（机构部函[2015]569 号）核准，并按照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定进行募集。

二、本基金类型：混合型

本基金存续期间：不定期

三、本基金募集期为：2015 年 3 月 23 日至 2015 年 4 月 10 日

募集份额为：907,395,829.96 份

有效户数：13,950 户

四、本基金根据《关于东方睿鑫热点挖掘灵活配置混合型证券投资基金备案确认的函》（基金部函[2015]991 号）的批准，于 2015 年 4 月 15 日基金合同生效。

本基金合同生效后，连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续六十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。

法律法规另有规定时，从其规定。

## 第七部分 基金份额的申购与赎回

### 一、申购和赎回场所

1、本基金管理人的直销机构为直销中心以及电子交易平台。

2、经本基金管理人委托,具有销售开放式基金资格的商业银行或其他机构的营业网点即其他销售机构销售网点。目前其他销售机构的名称、住所等信息请详见本招募说明书“第五部分 相关服务机构”中“二、其他销售机构”。本基金管理人可根据情况增减基金其他销售机构,并在基金管理人网站公示。

3、投资者可通过本基金直销机构或指定的其他销售机构按照规定的方式进行申购或赎回。

### 二、申购和赎回的开放日及时间

#### (一) 开放日及开放时间

投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回,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》的有关规定在指定媒介上公告。

#### (二) 申购、赎回开始日及业务办理时间

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

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

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

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

### 三、申购与赎回的原则

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

(二) “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；

(三) 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；

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

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

#### 四、申购与赎回的程序

##### (一) 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。

##### (二) 申购和赎回申请的确认

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

因投资人怠于履行该项查询等各项义务，致使其相关权益受损的，基金管理人、基金托管人、基金销售机构不承担由此造成的损失或不利后果。

基金销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构已经接收到申购、赎回申请。申购、赎回的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资人应及时查询。

##### (三) 申购和赎回的款项支付

本基金仅对申购 A 类基金份额的投资人收取申购费用，不对申购 C 类基金份额的投资人收取申购费用。

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

基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；登记机构确认赎回时，赎回生效。

投资人赎回申请成功后，基金管理人将在 T+7 日(包括该日)内支付赎回款

项。在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。

## 五、申购和赎回的数量限制

(一) 投资者每次最低申购金额为 1.00 元（含申购费），每次定期定额最低申购金额为 1.00 元，具体办理要求以销售机构的交易细则为准，但不得低于基金管理人规定的最低限额。

(二) 基金份额持有人在销售机构赎回时，每次赎回申请不得低于 1.00 份基金份额。基金份额持有人赎回时或赎回后在销售机构保留的基金份额余额不足 1.00 份的，在赎回时需一次全部赎回。

(三) 基金管理人可以规定单个投资人累计持有的基金份额上限，具体规定请参见更新的招募说明书。

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

(五) 基金管理人可以根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整上述规定的数量或比例限制。但基金管理人必须在调整前依照有关规定在指定媒介上公告。

## 六、申购费用和赎回费用

### (一) 申购费用

本基金仅对 A 类基金份额收取申购费用，不对 C 类基金份额收取申购费用。

本基金 A 类基金份额的申购费用由申购 A 类基金份额的投资人承担，不列入基金资产，申购费用于本基金的市场推广、销售、登记等。投资者选择红利再投资转基金份额时不收取申购费用。

本基金 A 类基金份额的申购费率如下：

| 申购金额（M，含申购费）                    | 费率       |
|---------------------------------|----------|
| $M < 50$ 万                      | 1.20%    |
| $50 \text{ 万} \leq M < 100$ 万   | 1.00%    |
| $100 \text{ 万} \leq M < 1000$ 万 | 0.80%    |
| $M \geq 1000$ 万                 | 1000 元/笔 |

### (二) 赎回费用

赎回费用由基金赎回人承担，对 A 类基金份额和 C 类基金份额同时收取，赎

回费率如下:

| 基金类别 | 费 率                                   |       |           |
|------|---------------------------------------|-------|-----------|
| A 类  | $Y < 7$ 日                             | 1.50% | 全额计入基金资产  |
|      | $7 \text{ 日} \leq Y < 30$ 日           | 0.75% |           |
|      | $30 \text{ 日} \leq Y < 90$ 日          | 0.50% | 75%计入基金资产 |
|      | $90 \text{ 日} \leq Y < 180$ 日         | 0.50% | 50%计入基金资产 |
|      | $180 \text{ 日} \leq Y < 365$ 日        | 0.50% | 25%计入基金资产 |
|      | $365 \text{ 日} \leq Y < 730$ 日        | 0.25% |           |
|      | $Y \geq 730$ 日                        | 0%    | --        |
| C 类  | 持有期限 $< 7$ 天                          | 1.50% | 全额计入基金资产  |
|      | $7 \text{ 天} \leq \text{持有期限} < 30$ 天 | 0.50% |           |
|      | 持有期限 $\geq 30$ 天                      | 0%    | --        |

(三) 基金管理人可以根据基金合同的相关约定调整费率或收费方式, 基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

(四) 基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划, 针对特定交易方式(如网上交易、电话交易等)等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间, 按相关监管部门要求履行相关手续后基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

## 七、申购份额与赎回金额的计算

(一) 基金申购份额的计算:

1、A 类基金份额申购份额的计算方式

当申购费用适用比例费率时:

申购费用 = 申购金额  $\times$  申购费率 / (1 + 申购费率)

净申购金额 = 申购金额 - 申购费用

申购份额 = 净申购金额 / 申购当日 A 类基金份额的基金份额净值

当申购费用适用固定金额时:

申购费用 = 固定金额

净申购金额 = 申购金额 - 申购费用

申购份额 = 净申购金额 / 申购当日 A 类基金份额的基金份额净值

例 4: 某投资者投资 186,245 元申购本基金 A 类基金份额, 对应费率为 1.20%, 假设申购当日 A 类基金份额的基金份额净值为 1.0325 元, 则其可得到的申购份额为:

$$\text{申购费用} = 186,245 \times 1.20\% / (1 + 1.20\%) = 2,208.43 \text{ 元}$$

$$\text{净申购金额} = 186,245 - 2,208.43 = 184,036.57 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 184,036.57 / 1.0325 = 178,243.65 \text{ 份}$$

例 5: 某投资者投资 1000 万元申购本基金 A 类基金份额, 申购费用为 1000 元, 假设申购当日 A 类基金份额的基金份额净值为 1.0325 元, 则其可得到的申购份额为:

$$\text{申购费用} = 1,000 \text{ 元}$$

$$\text{净申购金额} = 10,000,000.00 - 1,000 = 9,999,000.00 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 9,999,000 / 1.0325 = 9,684,261.50 \text{ 份}$$

## 2、C 类基金份额申购份额的计算方式

$$\text{申购份额} = \text{申购金额} / \text{申购当日 C 类基金份额的基金份额净值}$$

例 6: 某投资者投资 186,537 元申购本基金 C 类基金份额, 假设申购当日 C 类基金份额的基金份额净值为 1.0264 元, 则其可得到的申购份额为:

$$\text{申购费用} = 0 \text{ 元}$$

$$\text{净申购金额} = 186,537 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 186,537 / 1.0264 = 181,739.08 \text{ 份}$$

上述计算中, 涉及基金份额、费用的计算结果均保留到小数点后两位, 小数点后两位以后的部分舍弃, 舍弃部分归入基金财产。

## (二) 基金赎回金额的计算

赎回金额的计算方法如下:

$$\text{赎回费用} = \text{赎回份数} \times \text{T 日 A 类/C 类基金份额的基金份额净值} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{净赎回金额} = \text{赎回份数} \times \text{T 日 A 类/C 类基金份额的基金份额净值} - \text{赎回费用}$$

例 7: 假定某投资者在 T 日赎回 1,537,989 份 A 类基金份额, 持有期限 168 天, 对应赎回费率为 0.50%, 该日 A 类基金份额的基金份额净值为 1.0679 元, 则其获得的赎回金额计算如下:

$$\text{赎回费用} = 1,537,989 \times 1.0679 \times 0.50\% = 8,212.09 \text{ 元}$$

$$\text{净赎回金额} = 1,537,989 \times 1.0679 - 8,212.09 = 1,634,206.36 \text{ 元}$$

例 8: 假定某投资者在 T 日赎回 168,506 份 C 类基金份额, 持有期限 26 天, 对应赎回费率为 0.50%, 该日 C 类基金份额的基金份额净值为 1.0681 元, 则其获得的赎回金额计算如下:

$$\text{赎回费用} = 168,506 \times 1.0681 \times 0.50\% = 899.90 \text{ 元}$$

$$\text{净赎回金额} = 168,506 \times 1.0681 - 899.90 = 179,081.36 \text{ 元}$$

上述计算中, 涉及赎回费用的计算结果保留到小数点后 2 位, 小数点后 2 位以后的部分舍去, 舍去部分归入基金财产, 涉及赎回金额的计算结果保留到小数点后 2 位, 小数点后第 3 位四舍五入。

### (三) 基金份额净值的计算

基金份额净值 = 基金资产净值总额 / 当日发行在外的基金份额总数

本基金 T 日的基金份额净值在当天收市后计算, 并在 T+1 日内公告。遇特殊情况, 经中国证监会同意, 可以适当延迟计算或公告。本基金基金份额净值的计算, 保留到小数点后 4 位, 小数点后第 5 位四舍五入, 由此产生的误差损失由基金财产承担, 产生的收益归基金财产所有。

## 八、拒绝或暂停申购的情形及处理方式

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:

(一) 因不可抗力导致基金无法正常运作。

(二) 发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时, 基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。

(三) 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。

(四) 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。

(五) 基金资产规模过大, 使基金管理人无法找到合适的投资品种, 或其他可能对基金业绩产生负面影响, 或出现其它损害现有基金份额持有人利益的情形。

(六) 接受某一投资者申购申请后导致其持有基金份额达到或超过基金总份额 50% 的。

(七) 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暂停接受基金申购申请的措施。

(八) 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第(一)、(二)、(三)、(五)、(七)、(八)项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受申购申请时,基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝,被拒绝的申购款项将退还给投资人。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。

## 九、暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式

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:

(一) 因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。

(二) 发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时,基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。

(三) 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。

(四) 连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

(五) 出现继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时,可暂停接受投资人的赎回申请。

(六) 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赎回申请的措施。

(七) 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项时,基金管理人应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(四)项所述情形,按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时,基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

## 十、巨额赎回的情形及处理方式

(一) 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。

## (二) 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者的全部赎回申请时，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、在出现巨额赎回且单个基金份额持有人当日的赎回申请超过上一开放日基金总份额20%以上的情形时，对于该基金份额持有人当日申请赎回的超过上一开放日基金总份额20%以上的基金份额，基金管理人有权全部自动进行延期办理；对于该基金份额持有人未超过上述比例的部分，基金管理人可以根据前段“1、全额赎回”或“2、部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。但是，如该基金份额持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理部分的赎回申请将被撤销。

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

## (三) 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个交易日内通知基金份额持有人,说明有关处理方法,并按规定在指定媒介上刊登公告。

### 十一、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

(一)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指定媒介上刊登暂停公告。

(二)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个开放日各类基金份额的基金份额净值。

(三)如果发生暂停的时间超过1日但少于2周(含2周),暂停结束基金重新开放申购或赎回时,基金管理人依照法律法规的规定在指定媒介刊登基金重新开放申购或赎回的公告,并公布最近1个工作日各类基金份额的基金份额净值。

(四)如果发生暂停的时间超过2周,暂停期间,基金管理人可根据需要刊登暂停公告。暂停结束基金重新开放申购或赎回时,基金管理人应按规定在指定媒介刊登基金重新开放申购或赎回的公告,并在重新开放申购或赎回日公告最近1个工作日各类基金份额的基金份额净值。

### 十二、基金转换

为方便基金份额持有人,本公司已在部分销售机构开通本基金和旗下各只基金的基金转换业务。基金转换的数额限制、转换费率等具体规定以基金管理人对外发布的公告为准。

### 十三、基金份额的转让

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

### 十四、基金的非交易过户

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

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

### **十六、定期定额投资计划**

为方便投资者或基金份额持有人，本基金已在部分销售机构开通定期定额投资业务，具体内容详见基金管理人和其他销售机构有关基金定期定额投资的公告。未来在各项技术条件和准备完备的情况下，将在其它销售渠道酌情增加本基金的定期定额投资业务。

### **十七、基金份额的冻结和解冻**

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

### **十八、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本招募说明书“侧袋机制”章节的规定或基金管理人届时发布的相关公告。

## 第八部分 基金的投资

### 一、投资目标

深度挖掘我国经济发展过程中不断涌现的具备较高投资价值的证券,在严格控制基金投资风险的前提下,充分分享我国经济发展带来的投资收益。

### 二、投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证)、债券(含中小企业私募债券)、货币市场工具、权证、资产支持证券、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:股票资产占基金资产的比例为0%-95%;权证、股指期货及其他金融工具的投资比例按照法律法规或监管机构的规定执行;本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例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。投资于本基金定义的热点证券的比例不低于非现金基金资产的80%。

### 三、投资策略

本基金充分把握我国经济发展过程中不断出现的热点投资机会,在严控投资风险的基础上,结合类别资产配置、热点证券配置,提高基金的投资收益。

#### 1、“热点”定义

根据我国经济发展特点和我国证券市场中长期发展趋势,本基金将热点证券细分为下述四大类别:

##### (1) 政策热点证券

我国经济运行发展过程中,随着经济结构的持续优化和经济短期发展目标的不调整,符合阶段性调整政策的行业和公司会受政策利好获得快速发展的机会,使公司的整体盈利能力提高,此类公司所发行的证券也会因此获得市场关注成为

投资热点。

本基金主要基于我国宏观经济运行环境和相关产业政策、发展计划等重要文件的颁布和实施情况,挖掘受益于政策推出的相关行业和公司。参考申银万国的行业分类,本类证券所属行业包括但不限于公用事业、交通运输、国防军工等。

## (2) 证券市场热点证券

随着我国证券市场的快速发展,证券市场本身机制的完善也会产生相应的热点证券,此类证券受益于证券市场机制的完善、证券市场逐步放开、投资标的的推出、交易模式多样化、流动性提高等利好因素,成为受市场关注的证券。

本基金分析我国证券市场发展路径、经济金融环境特点并参考国外较成熟证券市场发展模式,挖掘未来可能受益于我国证券市场发展而受到市场关注的证券。同时,银行和非银金融等行业也会成为直接受益于我国证券市场发展的行业。

## (3) 科学技术热点证券

科技作为第一生产力,原有科学技术的更新、新科学技术的涌现、国际和国内前沿科学技术的发展均会给国家带来新一轮的经济增长点,并使相关行业和公司具备更好的发展前景,提高盈利能力。此类公司发行的证券会因投资者对公司未来盈利能力和公司发展前景的良好预期更具投资价值。

参考申银万国的行业分类,本类证券所属行业包括但不限于计算机、传媒、通信、医药生物、汽车、电气设备等。

## (4) 其它热点证券

日常生活中的突发事件也会对某些行业或公司产生短期和中长期利好,使投资者对公司的短期和中长期盈利能力、投资价值产生乐观预期。符合上述条件的股票和债券,即为本基金定义的热点证券。

参考申银万国的行业分类,本类证券所属行业包括但不限于化工、采掘、有色金属、商业贸易等。

伴随着我国经济的不断发展,资本市场会涌现新的热点类别,本基金在审慎投资、严控投资风险的基础上,将不断挖掘新的具有投资价值的热点证券。

## 2、类别资产配置策略

本基金通过各类数据分析对我国宏观经济运行、资本市场运行情况等形成判断,结合国家政策走向、国内外经济环境变化等研究各类别资产的当期、中短期

和中长期风险收益水平,在符合相关投资比例限制的前提下,进行类别资产的配置和动态调整。

### 3、股票投资策略

本基金通过定量分析和定性分析相结合的方式选择具有较高投资价值的股票。定量分析主要依据上市公布的相关数据等,通过对主营业务收入增长率、净利润等相关指标的分析对公司的成长能力、盈利能力、未来发展潜力、股票估值水平等形成判断。

#### (1) 成长能力分析

本基金认为,企业以往的成长性能够在一定程度上反映企业未来的增长潜力,因此,本基金利用主营业务收入增长率、净利润增长率、经营性现金流量增长率指标来考量公司的历史成长性,作为判断公司未来成长性的依据。

主营业务收入增长率是考察公司成长性最重要的指标,主营业务收入的增长所隐含的往往是企业市场份额的扩大,体现公司未来盈利潜力的提高,盈利稳定性的加大,公司未来持续成长能力的提升。本基金主要考察上市公司最新报告期的主营业务收入与上年同期的比较,并与同行业相比较。

净利润是一个企业经营的最终成果,是衡量企业经营效益的主要指标,净利润的增长反映的是公司的盈利能力和盈利增长情况。本基金主要考察上市公司最新报告期的净利润与上年同期的比较,并与同行业相比较。

经营性现金流量反映的是公司的营运能力,体现了公司的偿债能力和抗风险能力。本基金主要考察上市公司最新报告期的经营性现金流量与上年同期的比较,并与同行业相比较。

#### (2) 盈利能力分析

本基金利用总资产报酬率、净资产收益率、盈利现金比率(经营现金净流量/净利润)指标来考量公司的盈利能力和质量。

总资产报酬率是反映企业资产综合利用效果的核心指标,也是衡量企业总资产盈利能力的重要指标;净资产收益率反映企业利用股东资本盈利的效率,净资产收益率较高且保持增长的公司,能为股东带来较高回报。本基金考察上市公司过去两年的总资产报酬率和净资产收益率,并与同行业平均水平进行比较。

盈利现金比率,即经营现金净流量与净利润的比值,反映公司本期经营活动

产生的现金净流量与净利润之间的比率关系。该比率越大，一般说明公司盈利质量就越高。本基金考察上市公司过去两年的盈利现金比率，并与同行业平均水平进行比较。

此外，本基金还将关注上市公司盈利的构成、盈利的主要来源等，全面分析其盈利能力和质量。

### (3) 未来增长潜力分析

公司未来盈利增长的预期决定股票价格的变化。因此，在关注上市公司历史成长性的同时，本基金尤其关注其未来盈利的增长潜力。本基金将对上市公司未来一至三年的主营业务收入增长率、净利润增长率进行预测，并对其可能性进行判断。

### (4) 估值水平分析

本基金将根据上市公司所处的行业，采用市盈率、市净率等估值指标，对上市公司股票价值进行动态评估，分析该公司的股价是否处于合理的估值区间，以规避股票价值被过分高估所隐含的投资风险。

定性分析主要考察公司的资源配置、技术创新力、品牌竞争力、受国家政策影响程度等。

本基金综合上述条件筛选具有投资价值的个股，构建股票组合。

### (5) 存托凭证投资策略

本基金在深入研究的基础上，综合考虑预期收益、风险、流动性等因素，进行存托凭证的投资。

## 4、债券投资策略

本基金通过动态调整债券的投资比例，在一定程度上规避股票市场的投资风险，获得相对稳定的投资收益。结合市场利率趋势及信用环境变化情况等，综合判断各类券种的风险收益水平，构造债券的投资组合。在实际的投资运作中，本基金将运用久期调整策略、收益率曲线策略、类属券种配置策略、期限结构策略等多种策略，获取债券市场的长期稳定收益。

## 5、中小企业私募债券投资策略

在控制信用风险的基础上，本基金对中小企业私募债券投资，主要通过期限和品种的分散投资控制流动性风险。以买入持有到期为主要策略，审慎投资。

针对内嵌转股选择权的中小企业私募债券,本基金通过深入的基本面分析及定性定量研究,自下而上精选个债,在控制风险的前提下,谋求内嵌转股权潜在的增强收益。

基金投资中小企业私募债券,基金管理人将根据审慎原则,制订严格的投资决策流程、风险控制制度和信用风险、流动性风险处置预案,并经董事会批准,以防范信用风险、流动性风险等各种风险。

#### 6、权证投资策略

本基金在进行权证投资时,将通过对权证标的证券基本面的研究,并结合权证定价模型,深入分析标的资产价格及其市场隐含波动率的变化,寻求其合理定价水平。全面考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征,谨慎投资,追求较稳定的当期收益。

#### 7、资产支持证券投资策略

本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略,在严格遵守法律法规和基金合同基础上,通过信用研究和流动性管理,选择经风险调整后相对价值较高的品种进行投资,以期获得长期稳定收益。

#### 8、股指期货投资策略

本基金进行股指期货的投资以套期保值为主要目的,本基金投资于流动性好、交易活跃的股指期货合约,通过对股票市场和股指期货市场短期和中长期趋势的研究,结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平,与现货资产进行匹配,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

### 四、投资管理流程

研究、决策、组合构建、交易、风险监控、评估和组合调整的有机配合共同构成了本基金的投资管理流程。严格的投资管理流程可以保证投资理念的正确执行,避免重大风险的发生。

#### (一) 研究

本基金的投资研究主要依托于公司整体的研究平台,采用自上而下和自下而上相结合的方式。通过对全球宏观经济形势、中国经济发展趋势、货币政策和财政政策执行情况进行分析,深入研究行业景气状况、市场合理估值水平,预测利

率变化趋势；深入研究其合理的投资价值；据此提出大类资产配置、行业配置、个股配置的投资建议。

## （二）资产配置决策

投资决策委员会依据上述研究报告，对基金的投资方向、资产配置比例等提出指导性意见。

基金经理基于研究员的投资建议，根据自己对未来一段时期内证券市场走势的基本判断，对基金资产的投资，制定月度资产配置和行业配置计划，并报投资决策委员会审批，审批通过，方可按计划执行。

## （三）组合构建

大类资产配置比例范围确定后，基金经理参考研究员的个股投资建议，结合自身的研究判断，决定具体的投资品种并决定买卖时机，其中重大单项投资决定需经投资总监或投资决策委员会审批。

### 1、交易执行

中央交易室负责具体的交易执行，依据基金经理的指令，制定交易策略，统一执行证券投资组合计划，进行具体品种的交易。

### 2、风险监控

本基金管理人各相关业务部门对投资组合计划的执行过程进行监控，定期向风险控制委员会汇报。风险控制委员会根据风险监控情况，责令投资不规范的基金经理进行检讨，并及时调整。

### 3、风险绩效评估

风险管理部定期对基金的投资进行风险绩效评估，并提供相关报告，使投资决策委员会和基金经理能够更加清楚组合承担的风险水平以及是否符合既定的投资策略，并了解组合是否实现了投资预期、组合收益的来源及投资策略成功与否。基金经理可以据以检讨投资策略，进而调整投资组合。

### 4、组合调整

基金经理将依据宏观经济状况、证券市场和上市公司的发展变化，以及组合风险与绩效的评估结果，对投资组合进行动态调整，使之不断得到优化。

基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下，有权根据环境变化和实际需要对上述投资管理流程进行调整。

## 五、投资限制

### (一) 禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

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

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，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按调整后的规定执行。

### (二) 投资组合限制

本基金的投资组合将遵循以下限制：

1、本基金股票投资占基金资产的比例为 0%-95%，其中，投资于本基金定义的热点证券的资产不低于非现金基金资产的 80%；

2、本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、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%；本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

15、本基金参与股指期货交易后，需遵守下列投资比例限制：

（1）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%；

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

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

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

（5）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%；

16、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%；

17、本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

18、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%;

19、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、基金规模变动等本基金管理人之外的因素致使本基金不符合前述比例限制的,本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;

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

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。

除第2、12、19、20项外,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,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,本基金的投资范围、投资策略应符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或调整上述限制,如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制或按调整后的规定执行。

## 六、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 $\times$ 70%+中证全债指数收益率 $\times$ 30%

本基金选择中证全债指数收益率作为债券投资部分的业绩比较基准。中证全债指数样本具有广泛的市场代表性,涵盖主要交易市场(银行间市场、交易所市场等)、不同发行主体(政府、企业等)和期限(长期、中期、短期等),是中

国目前最权威，应用也最广的指数。中证全债指数的构成品种基本覆盖了本基金的债券投资标的，反映债券全市场的整体价格和投资回报情况。

本基金选择沪深300指数收益率作为股票投资部分的业绩比较基准。沪深300指数样本覆盖了沪深市场60%左右的市值，具有良好的市场代表性和可投资性。

若今后法律法规发生变化，或未来市场发生变化导致此业绩比较基准不再适用或有更加适合的业绩比较基准，基金管理人有权根据市场发展状况及本基金的投资范围和投资策略，调整本基金的业绩比较基准。业绩比较基准的变更须经基金管理人和基金托管人协商一致并及时公告，无需召开基金份额持有人大会。

## 七、风险收益特征

本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等风险水平的投资品种。

## 八、基金管理人代表基金行使股东权利及债权人权利的处理原则及方法

(一) 基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东及债权人权利，保护基金份额持有人的利益；

(二) 不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；

(三) 有利于基金财产的安全与增值；

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

## 九、基金的融资融券

本基金可以按照国家的有关规定进行融资、融券。

## 十、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，无需召开基金份额持有人大会审议。

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本招募说明书“侧袋机制”章节

的规定。

## 十一、基金管理人和基金经理承诺

详情请见“第三部分 基金管理人”中的基金管理人的承诺部分。

## 十二、投资组合报告

本基金管理人的董事会及董事保证本投资组合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。

基金托管人根据本基金合同规定，已复核了本投资组合报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至 2022 年 3 月 31 日（财务数据未经审计）。

### 1、报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额（元）          | 占基金总资产的比例(%) |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 148,039,228.76 | 73.70        |
|    | 其中：股票             | 148,039,228.76 | 73.70        |
| 2  | 基金投资              | —              | —            |
| 3  | 固定收益投资            | 10,104,441.09  | 5.03         |
|    | 其中：债券             | 10,104,441.09  | 5.03         |
|    | 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      | 21,141,211.19  | 10.53        |
| 8  | 其他资产              | 21,570,256.89  | 10.74        |
| 9  | 合计                | 200,855,137.93 | 100.00       |

### 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

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           | 17,938,200.00  | 9.50         |
| C  | 制造业           | 128,037,742.04 | 67.83        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和 | —              | —            |

|   |                 |                |       |
|---|-----------------|----------------|-------|
|   | 供应业             |                |       |
| E | 建筑业             | -              | -     |
| F | 批发和零售业          | 15,786.72      | 0.01  |
| 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 | 2,047,500.00   | 1.08  |
| J | 金融业             | -              | -     |
| K | 房地产业            | -              | -     |
| L | 租赁和商务服务业        | -              | -     |
| M | 科学研究和技术服务业      | -              | -     |
| N | 水利、环境和公共设施管理业   | -              | -     |
| O | 居民服务、修理和其他服务业   | -              | -     |
| P | 教育              | -              | -     |
| Q | 卫生和社会工作         | -              | -     |
| R | 文化、体育和娱乐业       | -              | -     |
| S | 综合              | -              | -     |
|   | 合计              | 148,039,228.76 | 78.43 |

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  | 300037 | 新宙邦  | 118,000   | 9,622,900.00 | 5.10         |
| 2  | 603799 | 华友钴业 | 96,000    | 9,388,800.00 | 4.97         |
| 3  | 603501 | 韦尔股份 | 48,000    | 9,283,200.00 | 4.92         |
| 4  | 600362 | 江西铜业 | 480,000   | 9,254,400.00 | 4.90         |
| 5  | 601899 | 紫金矿业 | 810,000   | 9,185,400.00 | 4.87         |
| 6  | 603993 | 洛阳钼业 | 1,680,000 | 8,752,800.00 | 4.64         |
| 7  | 002493 | 荣盛石化 | 540,782   | 7,733,182.60 | 4.10         |
| 8  | 688396 | 华润微  | 138,000   | 7,558,260.00 | 4.00         |
| 9  | 601233 | 桐昆股份 | 420,000   | 7,341,600.00 | 3.89         |
| 10 | 300699 | 光威复材 | 108,000   | 6,367,680.00 | 3.37         |

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种      | 公允价值(元)       | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|---------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 10,104,441.09 | 5.35         |
| 2  | 央行票据      | -             | -            |
| 3  | 金融债券      | -             | -            |
|    | 其中：政策性金融债 | -             | -            |
| 4  | 企业债券      | -             | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | -             | -            |
| 6  | 中期票据      | -             | -            |

|    |           |               |      |
|----|-----------|---------------|------|
| 7  | 可转债（可交换债） | -             | -    |
| 8  | 同业存单      | -             | -    |
| 9  | 其他        | -             | -    |
| 10 | 合计        | 10,104,441.09 | 5.35 |

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称     | 数量（张）  | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|--------|--------------|--------------|
| 1  | 019664 | 21 国债 16 | 60,000 | 6,059,564.38 | 3.21         |
| 2  | 019658 | 21 国债 10 | 30,000 | 3,040,689.04 | 1.61         |
| 3  | 019666 | 22 国债 01 | 10,000 | 1,004,187.67 | 0.53         |
| 4  | -      | -        | -      | -            | -            |
| 5  | -      | -        | -      | -            | -            |

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

11、投资组合报告附注

(1) 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

本基金所持有的韦尔股份（603501）因存在如下违规行为而收到处罚：

公司于 2019 年 1 月 17 日完成深圳市芯能投资有限公司（以下简称“芯能投资”）、深圳市芯力投资有限公司（以下简称“芯力投资”）100%股权的收购，收购价款合计 16.87 亿元。其中，芯能投资、芯力投资主要资产分别为其持有的北京豪威科技有限公司 6.31%股权、4.24%股权。2019 年 7 月，公司与兴业银行签

订借款合同,借款金额为10亿元,借款期限为2019年7月5日至2024年7月4日,借款用途为用于支付(或置换)芯能投资和芯力投资100%股权的股权并购款。公司以持有的芯能投资、芯力投资100%股权及芯能投资、芯力投资持有的北京豪威科技有限公司10.55%股权提供质押担保。上述质押资产的账面值约占最近一期经审计总资产37%。公司对于上述资产质押情况未及时在临时公告中披露,直至2020年4月10日才在2019年年度报告中披露。上述行为违反了《上市公司信息披露管理办法》(证监会令第40号)第二条第一款、第三十条第二款第十五项的规定。根据《上市公司信息披露管理办法》第五十九条的规定,中国证监会上海监管局于2021年5月1日决定对公司采取出具警示函的监管措施。公司公告以上内容不会对公司本年度经营业绩产生重大负面影响。

本基金决策依据及投资程序:

①研究员对宏观经济、证券市场、行业和公司的发展变化进行深入而有效的研究,形成有关的各类报告,为本基金的投资管理提供决策依据。

②投资决策委员会定期召开会议,讨论本报告期内本基金投资的前十名股票中,没有投资超出基金合同规定范围形成本基金的资产配置比例指导意见。

③基金经理根据投资决策委员会的决议,参考上述报告,并结合自身的分析判断,形成基金投资计划,主要包括行业配置和投资组合管理。

④交易部依据基金经理的指令,制定交易策略,统一进行具体品种的交易;基金经理必须遵守投资组合决定权和交易下单权严格分离的规定。

⑤投资决策委员会根据市场变化对投资组合计划提出市场风险防范措施,监察稽核部、风险管理部对投资组合计划的执行过程进行日常监督和量化风险控制。

本基金投资韦尔股份主要基于以下原因:公司是国内CIS芯片行业龙头,受益于汽车、安防等行业需求的快速增长,经营业绩持续提升。公司通过加大模拟、射频功率自研,外延并购synapticsTDDI团队及深圳吉迪思,同时与北京极感科技成立合资公司极豪科技切入屏下指纹,初步形成“显示触控驱动+屏下指纹+外围模拟+射频+功率”的平台雏形,成功打开第二增长曲线。

除上述情况外,本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未发现存在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、处罚的情况。

(2) 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

(3) 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额(元)         |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | 176,704.97    |
| 2  | 应收证券清算款 | -             |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | -             |
| 5  | 应收申购款   | 21,393,551.92 |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 其他      | -             |
| 8  | 合计      | 21,570,256.89 |

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## 第九部分 基金的业绩

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) 基金的净值表现

本报告期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

#### 东方睿鑫热点挖掘 A 类

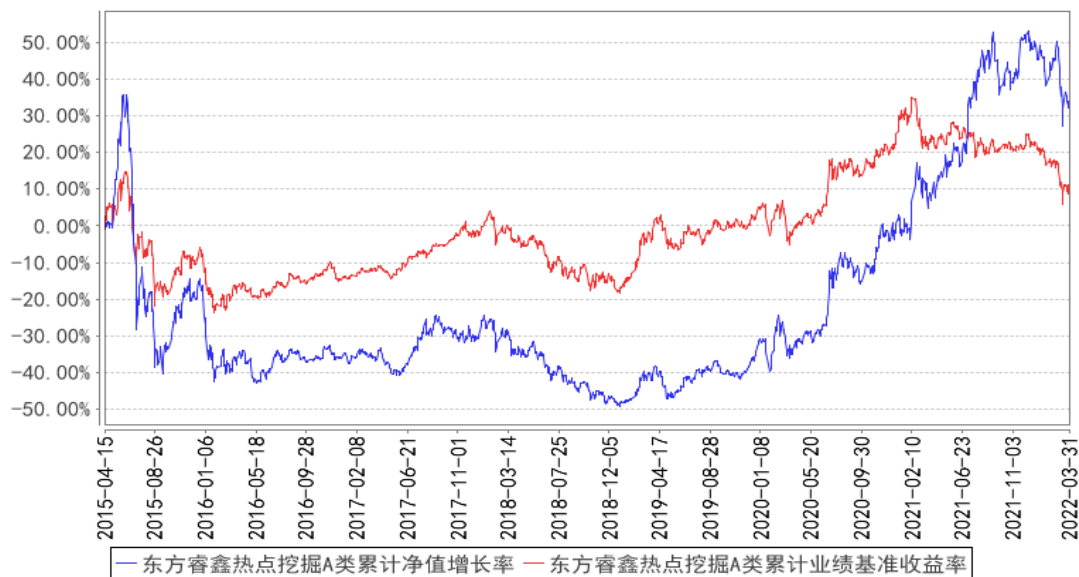
| 阶段                    | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③     | ②—④   |
|-----------------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|-------|
| 2015.04.15-2015.12.31 | -18.39%  | 2.94%       | -8.23%     | 1.89%         | -10.16% | 1.05% |
| 2016.01.01-2016.12.31 | -21.76%  | 1.70%       | -7.02%     | 0.98%         | -14.74% | 0.72% |
| 2017.01.01-2017.12.31 | 12.01%   | 1.06%       | 14.79%     | 0.45%         | -2.78%  | 0.61% |
| 2018.01.01-2018.12.31 | -28.09%  | 1.36%       | -15.97%    | 0.93%         | -12.12% | 0.43% |
| 2019.01.01-2019.12.31 | 30.33%   | 1.07%       | 26.39%     | 0.87%         | 3.94%   | 0.20% |
| 2020.01.01-2020.12.31 | 49.68%   | 1.62%       | 20.09%     | 1.00%         | 29.59%  | 0.62% |
| 2021.01.01-2021.12.31 | 49.56%   | 1.45%       | -1.72%     | 0.82%         | 51.28%  | 0.63% |
| 2022.01.01-2022.03.31 | -12.14%  | 1.50%       | -10.08%    | 1.02%         | -2.06%  | 0.48% |

#### 东方睿鑫热点挖掘 C 类

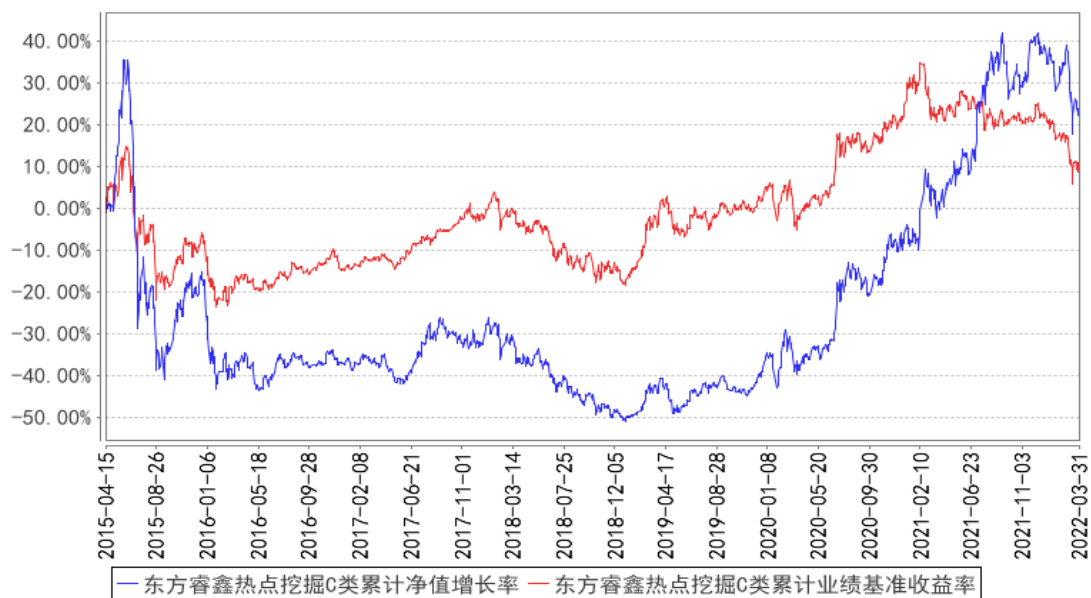
| 阶段                    | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③     | ②—④   |
|-----------------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|-------|
| 2015.04.15-2015.12.31 | -19.26%  | 2.94%       | -8.23%     | 1.89%         | -11.03% | 1.05% |
| 2016.01.01-2016.12.31 | -22.42%  | 1.70%       | -7.02%     | 0.98%         | -15.40% | 0.72% |
| 2017.01.01-2017.12.31 | 11.02%   | 1.06%       | 14.79%     | 0.45%         | -3.77%  | 0.61% |
| 2018.01.01-2018.12.31 | -28.70%  | 1.36%       | -15.97%    | 0.93%         | -12.73% | 0.43% |
| 2019.01.01-2019.12.31 | 27.45%   | 1.07%       | 26.39%     | 0.87%         | 1.06%   | 0.20% |
| 2020.01.01-2020.12.31 | 48.47%   | 1.62%       | 20.09%     | 1.00%         | 28.38%  | 0.62% |
| 2021.01.01-2021.12.31 | 48.36%   | 1.45%       | -1.72%     | 0.82%         | 50.08%  | 0.63% |
| 2022.01.01-2022.03.31 | -12.31%  | 1.50%       | -10.08%    | 1.02%         | -2.23%  | 0.48% |

## (二) 本基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

东方睿鑫热点挖掘A类累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



东方睿鑫热点挖掘C类累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



## 第十部分 基金的财产

### 一、基金资产总值

基金资产总值是指购买的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、期货账户以及投资所需的其他专用账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

### 四、基金财产的保管和处分

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

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

## 第十一部分 基金资产估值

### 一、估值目的

基金资产的估值目的是客观、准确地反映基金相关金融资产的公允价值，并为基金份额提供计价依据。

### 二、估值日

本基金的估值日为相关的证券交易所的正常营业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。

### 三、估值对象

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

### 四、估值方法

本基金按以下方式进行估值：

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

2、交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，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，按最近交易日的收盘价估值。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，确定公允价格；

3、交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券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，按最近交易日债券收盘价减去债券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，确定公允价格；

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。

(二) 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。

(三) 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，采用估值技术确定公允价值。

(四) 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。

(五) 基金所持有的中小企业私募债券，按成本估值。国家有最新规定的，按其规定进行估值。

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

(七) 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。

(八) 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。

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

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

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会

计问题,如经相关各方在平等基础上充分讨论后,仍无法达成一致的意见,按照基金管理人对基金净值的计算结果对外予以公布。

## 五、估值程序

(一) 基金份额净值是按照每个工作日闭市后,基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算,精确到0.0001元,小数点后第5位四舍五入。国家另有规定的,从其规定。

基金管理人于每个工作日计算基金资产净值及各类基金份额的基金份额净值,并按规定公告。

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

## 六、估值错误的处理

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

基金合同的当事人应按照以下约定处理:

### (一) 估值错误类型

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

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

### (二) 估值错误处理原则

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

估值错误责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认,确保估值错误已得到更正。

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

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

4、估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

### (三) 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。

### (四) 基金份额净值估值错误处理的方法如下:

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

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

3、前述内容如法律法规或监管机关另有规定的,从其规定处理。

## 七、暂停估值的情形

(一)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;

(二)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;

(三)当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上的,基金管理人经与基金托管人协商一致的;

(四)中国证监会和基金合同认定的其它情形。

## 八、基金净值的确认

基金资产净值和各类基金份额的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的基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人,由基金管理人对基金净值予以公布。

## 九、特殊情形的处理

(一)基金管理人或基金托管人按估值方法的第(八)项进行估值时,所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

(二)由于不可抗力原因,或由于证券/期货交易所、登记结算公司发送的数据错误等,基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查,但是未能发现该错误的,由此造成的基金资产估值错误,基金管理人、基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

## 十、实施侧袋机制期间的基金资产估值

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

## 第十二部分 基金收益与分配

### 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孰低数。

### 三、基金收益分配原则

(一) 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同一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;选择采取红利再投资形式的,分红资金将按红利发放日的基金份额净值转成相应类别的基金份额,红利再投资的份额免收申购费。如投资者在不同销售机构选择的分红方式不同,则登记机构将以投资者最后一次选择的分红方式为准;

(二) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值,即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;

(三) 同一类别内每一基金份额享有同等分配权;

(四) 分红权益登记日申请申购的基金份额不享受当次分红,分红权益登记日申请赎回的基金份额享受当次分红;

(五) 法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

本基金每次收益分配比例详见届时基金管理人发布的公告。

### 四、收益分配方案

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

### 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日内在指定媒介公告。

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

## 六、基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足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同一类别的基金份额。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，详见本招募说明书“侧袋机制”章节的规定。

## 第十三部分 基金的费用与税收

### 一、基金费用的种类

- (一) 基金管理人的管理费;
- (二) 基金托管人的托管费;
- (三) C类基金份额的销售服务费;
- (四) 《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;
- (五) 《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;
- (六) 基金份额持有人大会费用;
- (七) 基金的证券/期货交易费用;
- (八) 基金的银行汇划费用;
- (九) 基金的开户费用、账户维护费用;
- (十) 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、上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定, 法律法规另有规定时从其规定。

### 三、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### (一) 基金管理人的管理费

本基金的管理费每日按前一日基金资产净值的 1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下:

$$H=E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算, 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五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。

#### (二) 基金托管人的托管费

本基金的托管费每日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,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五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。

### (三) C类基金份额的销售服务费

本基金仅对C类基金份额收取销售服务费。

本基金C类基金份额的销售服务费每日按前一日C类基金资产净值的0.80%年费率计提。销售服务费的计算方法如下:

$$H=E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

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类基金份额销售服务费每日计提,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,经基金托管人复核后于次月前五个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人,由基金管理人代付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

销售服务费主要用于本基金持续销售以及基金份额持有人服务等各项费用。

上述“一、基金费用的种类中第(四)至(十)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。

## 四、不列入基金费用的项目

(一)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;

(二)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;

(三)基金合同生效前的相关费用;

(四)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。

## 五、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,详见本招募说明书“侧袋机制”章节的规定。

## 六、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。

## 第十四部分 基金的会计与审计

### 一、基金会计政策

(一) 基金管理人为本基金的基金会计责任方;

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

(三) 基金核算以人民币为记账本位币,以人民币元为记账单位;

(四) 会计制度执行国家有关会计制度;

(五) 本基金独立建账、独立核算;

(六) 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;

(七) 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

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

(二) 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。

(三) 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日内在指定媒介公告。

## 第十五部分 基金的信息披露

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

### 二、信息披露义务人

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

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

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内,将应予披露的基金信息通过中国证监会的指定媒介披露,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:

- (一) 虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏;
- (二) 对证券投资业绩进行预测;
- (三) 违规承诺收益或者承担损失;
- (四) 诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构;
- (五) 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;
- (六) 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:

- (一) 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,并登载在指定网站上,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和基金产品资料概要。

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。

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

## (二) 基金份额发售公告

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

## (三) 《基金合同》生效公告

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

## (四) 基金净值信息

《基金合同》生效后,在开始办理基金份额申购或者赎回前,基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和各类基金份额的基金份额净值。

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

份额的基金份额净值和基金份额累计净值。

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

#### (五) 基金份额申购、赎回价格

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

#### (六) 基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告

基金管理人应当在每年结束之日起3个月内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载在指定网站上，并将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计。

基金管理人应当在上半年结束之日起2个月内，编制完成基金中期报告，将中期报告登载在指定网站上，并将中期报告提示性公告登载在指定报刊上。

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

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

本基金持续运作过程中，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。

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

#### (七) 临时报告

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

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

- 1、基金份额持有人大会的召开及决定的事项；

- 2、《基金合同》终止、基金清算;
- 3、转换基金运作方式、基金合并;
- 4、更换基金管理人、基金托管人;
- 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;
- 11、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;
- 12、涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼或仲裁;
- 13、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;
- 14、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;
- 15、基金收益分配事项;
- 16、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;
- 17、基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五;
- 18、基金改聘会计师事务所;
- 19、更换基金登记机构;
- 20、本基金开始办理申购、赎回;
- 21、本基金发生巨额赎回并延期办理;
- 22、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;

- 23、本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请;
- 24、调整基金份额类别的设置;
- 25、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;
- 26、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。

#### (八) 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。

#### (九) 基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项,应当依法报中国证监会备案,并予以公告。

#### (十) 清算报告

基金合同终止的,基金管理人应当依法组织基金财产清算小组对基金财产进行清算并作出清算报告。基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上,并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

#### (十一) 基金投资中小企业私募债券的信息披露

本基金投资中小企业私募债券后两个交易日内,基金管理人应在中国证监会指定媒介披露所投资中小企业私募债券的名称、数量、期限、收益率等信息,并在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书(更新)等文件中披露中小企业私募债券的投资情况。

#### (十二) 基金投资股指期货的信息披露

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。

#### (十三) 基金投资资产支持证券信息披露

基金管理人应在基金年报及中期报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细。

基金管理人应在基金季度报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持

证券市值占基金净资产的比例和报告期末按市值占基金净资产比例大小排序的前10名资产支持证券明细。

#### (十四) 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, 详见本招募说明书“侧袋机制”章节的规定。

#### (十五) 中国证监会规定的其他信息。

### 六、信息披露事务管理

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

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

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基金资产净值、各类基金份额的基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告、更新的招募说明书、基金产品资料概要、基金清算报告等相关基金信息进行复核、审查, 并向基金管理人进行书面或者电子确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定报刊中选择披露信息的报刊, 单只基金只需选择一家报刊。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及自律规则的相关规定。前述自主披露如产生信息披露费用, 该费用不得从基金财产中列支。

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,供社会公众查阅、复制。

## 第十六部分 侧袋机制

### 一、侧袋机制的实施条件和实施程序

当本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,无需召开基金份额持有人大会审议。基金管理人应当在启用侧袋机制当日报中国证监会及基金管理人所在地中国证监会派出机构备案。

### 二、侧袋机制实施期间的基金运作安排

#### (一) 基金份额的申购与赎回

##### 1、侧袋账户

侧袋机制实施期间,基金管理人不得办理侧袋账户的申购、赎回和转换。基金份额持有人申请申购、赎回或转换侧袋账户基金份额的,该申购、赎回或转换申请将被拒绝。

##### 2、主袋账户

基金管理人将依法保障主袋账户份额持有人享有基金合同约定的赎回权利,并根据主袋账户运作情况合理确定申购事项,具体事项届时将由基金管理人在相关公告中规定。

3、对于启用侧袋机制当日收到的赎回申请,基金管理人仅办理主袋账户的赎回申请并支付赎回款项。在启用侧袋机制当日收到的申购申请,视为投资者对侧袋机制启用后的主袋账户提交的申购申请。

#### (二) 基金份额的登记

侧袋机制实施期间,基金管理人应对侧袋账户份额实行独立管理,主袋账户沿用原基金代码,侧袋账户使用独立的基金代码。侧袋账户份额的名称应以“基金简称+侧袋标识 S+侧袋账户建立日期”格式设定,同时主袋账户份额的名称增加大写字母 M 标识作为后缀。本基金所有侧袋账户注销后,应取消主袋账户份额名称中的 M 标识。

启用侧袋机制当日,基金管理人和基金服务机构应以基金份额持有人的原有账户份额为基础,确认相应侧袋账户持有人名册和份额。

侧袋账户资产完全清算后,基金管理人应注销侧袋账户。

### (三) 基金的投资及业绩

侧袋机制实施期间, 本基金的各项投资运作指标和基金业绩指标应当以主袋账户资产为基准。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。

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, 但因资产流动性受限等中国证监会规定的情形除外。

侧袋机制实施期间, 基金管理人、基金服务机构在计算基金业绩相关指标时仅考虑主袋账户资产, 分割侧袋账户资产导致的基金净资产减少在计算基金业绩相关指标时按投资损失处理。

### (四) 基金的估值

侧袋机制启用当日, 基金管理人以完成日终估值后的基金净资产为基数对主袋账户和侧袋账户的资产进行分割, 与特定资产可明确对应的资产类科目余额、除应交税费外的负债类科目余额一并纳入侧袋账户。基金管理人应将特定资产作为一个整体, 不能仅分割其公允价值无法确定的部分。

侧袋机制实施期间, 基金管理人应对侧袋账户单独设置账套, 实行独立核算。如果本基金同时存在多个侧袋账户, 不同侧袋账户应分开进行核算。侧袋账户的会计核算应符合《企业会计准则》的相关要求。

### (五) 基金的费用

侧袋机制实施期间, 侧袋账户资产不收取管理费。因启用侧袋机制产生的咨询、审计费用等由基金管理人承担。

本基金实施侧袋机制的, 基金管理人可以将与侧袋账户有关的费用从侧袋账户中列支, 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, 管理费以外的其他费用详见基金管理人届时发布的相关公告。

### (六) 基金的收益分配

侧袋机制实施期间, 在主袋账户份额满足基金合同收益分配条件的情形下, 基金管理人可对主袋账户份额进行收益分配。侧袋账户不进行收益分配。

### (七) 基金的信息披露

#### 1、基金净值信息

侧袋机制实施期间, 基金管理人应当暂停披露侧袋账户的基金净值信息。

#### 2、定期报告

侧袋机制实施期间,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。侧袋账户相关信息在定期报告中单独进行披露,包括但不限于:

(1) 侧袋账户的基金代码、基金名称、侧袋账户成立日期等基本信息;

(2) 侧袋账户的初始资产、初始负债;

(3) 特定资产的名称、代码、发行人等基本信息;

(4) 报告期内的特定资产处置进展情况、与处置特定资产相关的费用情况及其他与特定资产状况相关的信息;

(5) 可根据特定资产处置进展情况披露特定资产的可变现净值或净值参考区间,该净值或净值区间并不代表特定资产最终的变现价格,不作为基金管理人对特定资产最终变现价格的承诺;

(6) 可能对投资者利益存在重大影响的其他情况及相关风险提示。

### 3、临时报告

基金管理人在启用侧袋机制、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应及时发布临时公告。侧袋机制实施期间,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相关规定及时发布临时公告。

启用侧袋机制的临时公告内容应当包括启用原因及程序、特定资产流动性和估值情况、对投资者申购赎回的影响、风险提示等重要信息。

处置特定资产的临时公告内容应当包括特定资产处置价格和时间、向侧袋账户份额持有人支付的款项、相关费用发生情况等重要信息。

#### (八) 特定资产的处置清算

基金管理人将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款项。无论侧袋账户资产是否全部完成变现,基金管理人都将及时向侧袋账户份额持有人支付已变现部分对应的款项。

#### (九) 侧袋的审计

基金管理人应当在启用侧袋机制和终止侧袋机制后,及时聘请符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所进行审计并披露专项审计意见,具体如下:

基金管理人应当在启用侧袋机制时,就特定资产认定的相关事宜取得符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所的专业意见。

基金管理人应当在启用侧袋机制后五个工作日内,聘请于侧袋机制启用日发表意见的会计师事务所针对侧袋机制启用日本基金持有的特定资产情况出具专项审计意见,内容应包含侧袋账户的初始资产、份额、净资产等信息。

会计师事务所对基金年度报告进行审计时,应对报告期间基金侧袋机制运行相关的会计核算和年报披露,执行适当程序并发表审计意见。

当侧袋账户资产全部完成变现后,基金管理人应参照基金清算报告的相关要求,聘请符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所对侧袋账户进行审计并披露专项审计意见。

三、本部分关于侧袋机制的相关规定,凡是直接引用法律法规或监管规则的部分,如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的,基金管理人经与基金托管人协商一致并履行适当程序后,在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下,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。

## 第十七部分 风险揭示

一般来讲,预期投资收益越高,所伴随的预期风险越大。本基金属于混合型基金,其预期收益和风险水平低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金。本基金所面临的风险主要包括以下部分:

### 一、系统性风险:

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

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

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

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

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

### 二、非系统性风险:

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

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

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

### 三、流动性风险

流动性风险主要包括以下两个方面:一方面是指在市场或个股流动性不足的

情况下,基金管理人可能无法迅速、低成本地变现或调整基金投资组合的风险。另一方面是指本基金面临大量赎回而无法及时变现其资产而造成的风险。

#### 四、启用侧袋机制的风险

当本基金启用侧袋机制时,侧袋机制实施期间,侧袋账户份额将停止披露基金净值信息,并不得办理申购、赎回和转换,基金份额持有人可能面临无法及时获得侧袋账户对应部分的资金的流动性风险。基金管理人将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款项,但因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。

#### 五、运作风险

①管理风险:指在基金管理运作过程中,由于基金管理人的知识、经验、判断、决策等主观因素的限制而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而产生的风险,或者由于基金管理人内部控制不完善而导致基金财产损失的风险。

②交易风险:指在基金投资交易过程中由于各种原因造成的风险。

③运作风险:指由于运营系统、网络系统、计算机或交易软件等发生技术故障等突发情况而造成的风险,或者由于操作过程中的疏忽和错误而产生的风险。

④道德风险:指业务人员道德行为违规产生的风险,包括由内幕交易、违规操作、欺诈行为等原因造成的风险。

#### 六、本基金特有的风险

本基金为采用灵活配置策略的混合型基金,股票等权益类资产占基金资产的0%-95%,在资产配置上可能存在以下风险:本基金在灵活调整资产配置比例时,可能由于基金经理的预判与市场的实际表现存在较大差异,出现资产配置不合理的风险,从而对基金收益造成不利影响。

本基金对固定收益类资产的投资中将中小企业私募债券纳入到投资范围当中,中小企业私募债券,是根据相关法律法规由非上市的中小企业以非公开方式发行的债券。该类债券不能公开交易,可通过上海证券交易所固定收益证券综合电子平台或深圳证券交易所综合协议交易平台进行交易。一般情况下,中小企业私募债券的交易不活跃,潜在流动性风险较大;并且,当发债主体信用质量恶化时,

受市场流动性限制,本基金可能无法卖出所持有的中小企业私募债券,从而可能给基金净值带来损失。

本基金将股指期货纳入到投资范围中,股指期货采用保证金交易制度,由于保证金交易具有杠杆性,当出现不利行情时,微小的变动就可能会使投资人权益遭受较大损失。同时,股指期货采用每日无负债结算制度,如果没有在规定的时间内补足保证金,按规定将被强制平仓,可能给基金净值带来重大损失。

本基金的投资范围包括存托凭证,除与其他可投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外,本基金还将面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险,以及与中国存托凭证发行机制相关的风险,包括存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险;存托协议自动约束存托凭证持有人的风险;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;存托凭证退市的风险;因多地上市造成存托凭证价格差异以及受境外市场影响交易价格大幅波动的风险;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。

## 七、法律风险

指基金管理或运作过程中,违反国家法律、法规的规定,或者基金投资违反法规及基金合同有关规定的风险。

## 八、其他风险

战争、自然灾害等不可抗力因素的出现,将会严重影响证券市场的运行,可能导致基金资产的损失。

根据交易所就资金前端额度控制的相关要求,基金管理人(交易参与人)按照前一交易日日终的相关产品的合计资产总额作为每个交易日申报的最高额度,并与基金托管人(结算参与人)明确约定额度申报事项。由于交易所就资金前端额度控制的规定,从而可能存在影响本基金财产收益的风险。

## 第十八部分 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

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

(二) 关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自生效后执行, 自决议生效后两日内在指定媒介公告。

### 二、基金合同的终止

有下列情形之一的, 基金合同应当终止:

- (一) 基金份额持有人大会决定终止的;
- (二) 基金管理人、基金托管人职责终止, 在 6 个月内没有新的基金管理人、新的基金托管人承接的;
- (三) 《基金合同》约定的其他情形;
- (四) 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

(一) 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。

(二) 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、具有证券、期货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。

(三) 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。

(四) 基金财产清算程序:

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

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

6、将清算报告报中国证监会备案并公告;

7、对基金剩余财产进行分配。

(五) 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,按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

#### **六、基金财产清算的公告**

清算过程中的有关重大事项须及时公告;基金财产清算报告经具有证券、期货相关业务资格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 15 年以上。

## 第十九部分 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

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) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- (8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## (二) 基金管理人的权利与义务

### 1、基金管理人的权利

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

- (1) 依法募集资金；
- (2) 自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
- (3) 依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- (4) 销售基金份额；
- (5) 按照规定召集基金份额持有人大会；
- (6) 依据《基金合同》及有关法律、法规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- (7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- (8) 选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；
- (9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；
- (10) 依据《基金合同》及有关法律、法规规定决定基金收益的分配方案；
- (11) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；
- (12) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- (13) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资、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、期货经纪机构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、转换和非交易过户等的业务规则；
- (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、基金管理人的义务

(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办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

(2) 办理基金备案手续；

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

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

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

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

(7) 依法接受基金托管人的监督；

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

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(10) 编制季度报告、中期报告和年度报告；

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

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

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

(14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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

(16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相

关资料 15 年以上;

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

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

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

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

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

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

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

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

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议;

(26) 建立并保存基金份额持有人名册;

(27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

### (三) 基金托管人的权利与义务

#### 1、基金托管人的权利

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,为基金开设资金账户、证券账户、期货账户等投资所需账户,为基金办理证券、期货交易资金清算;

(5) 提议召开或召集基金份额持有人大会;

(6) 在基金管理人更换时,提名新的基金管理人;

(7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

## 2、基金托管人的义务

(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、期货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、基金份额净值、基金份额申购、赎回价格;

(9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项;

(10) 对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告出具意见,说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》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) 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,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。除法律法规另有规定或基金合同另有约定外,基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

### (一) 召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的,应当召开基金份额持有人大会:

(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) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准或销售服务费率,但法律法规要求提高该等报酬标准或销售服务费率的除外;

(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;

(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、销售服务费和其他应由基金承担的费用;

(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》规定的范围内且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、调低赎回费率或变更收费方式;

(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重大变化;

(6) 在不损害已有基金份额持有人权益的情况下增加、取消或调整基金份额类别设置;

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

(二) 会议召集人和召集方式

1、除法律法规规定或《基金合同》另有约定外,基金份额持有人大会由基金

管理人召集。

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。

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

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

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

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

### (三) 召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

- (1) 会议召开的时间、地点和会议形式；
- (2) 会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；
- (3) 有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；

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

(5) 会务常设联系人姓名及联系电话;

(6) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续;

(7) 召集人需要通知的其他事项。

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下,由会议召集人决定在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、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表决意见的计票进行监督的,不影响表决意见的计票效力。

#### (四) 基金份额持有人出席会议的方式

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

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

(2) 经核对,汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示,有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一(含二分之一)。若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一,召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内,就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效的基金份额应不少于本基金在

权益登记日基金总份额的三分之一(含三分之一)。

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式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二分之一(含二分之一);若本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一,召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内,就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一(含三分之一)以上基金份额的持有人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见;

(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,并与基金登记机构记录相符。

3、在会议召开方式上,本基金亦可采用其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开基金份额持有人大会,会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。

4、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亦可采用其他非书面方式授权其代理人出席基金份额持有人大会。

#### (五) 议事内容与程序

##### 1、议事内容及提案权

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

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

## 2、议事程序

### (1) 现场开会

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

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

### (2) 通讯开会

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

## (六) 表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议:

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

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

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时监督员及公证机关均认为有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认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 日内在指定媒介上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

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

#### （九）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、若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；

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。

侧袋机制实施期间，基金份额持有人大会审议事项涉及主袋账户和侧袋账户的，应分别由主袋账户、侧袋账户的基金份额持有人进行表决，同一主侧袋账户内的每份基金份额具有平等的表决权。表决事项未涉及侧袋账户的，侧袋账户份额无表决权。

侧袋机制实施期间，关于基金份额持有人大会的相关规定以本节特殊约定内容为准，本节没有规定的适用本部分的相关规定。

（十）本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规的部分，如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人提前公告后，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

#### （一）《基金合同》的终止

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。

#### （二）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、具有证券、期货相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

4、基金财产清算程序：

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

5、基金财产清算的期限为6个月。

(三) 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。

(四) 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。

(五) 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具有证券、期货相关业务资格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。

(六) 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。

## 四、争议解决方式

对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力。

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

《基金合同》受中国法律管辖。

## **五、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式**

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

## 第二十部分 基金托管协议的内容摘要

### 一、托管协议当事人

#### (一) 基金管理人

名称：东方基金管理股份有限公司

住所：北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层

办公地址：北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层

邮政编码：100033

法定代表人：崔伟

成立日期：2004 年 6 月 11 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2004]80 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：叁亿叁仟叁佰叁拾叁万元人民币

营业期限：2004 年 6 月 11 日至长期

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、从事境外证券投资管理业务和中国证监会许可的其他业务。

#### (二) 基金托管人

名称：广发证券股份有限公司（简称：广发证券）

住所：广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街 2 号 618 室

办公地址：广州市天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼

邮政编码：510075

法定代表人：孙树明

成立时间：1994 年 1 月 21 日

基金托管资格批准文号：证监许可[2014]510 号

注册资本：人民币 7,621,087,664 元

存续期间：长期

经营范围：证券经纪；证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问；证券承销与保荐；证券自营；融资融券；证券投资基金代销；证券投资基金托管；为期货公司提供中间介绍业务；代销金融产品；股票期权做市。（依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动。）

## 二、基金管理人与基金托管人之间的业务监督、核查

### (一) 基金托管人对基金管理人的业务监督、核查

1、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对基金投资范围、投资对象进行监督。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的,基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种池和交易对手库,以便基金托管人运用相关技术系统,对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督,对存在疑义的事项进行核查。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证)、债券(含中小企业私募债券)、货币市场工具、权证、资产支持证券、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。

本基金的配置比例为:股票资产占基金资产的比例为 0%-95%;权证、股指期货及其他金融工具的投资比例按照法律法规或监管机构的规定执行;本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例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。投资于本基金定义的热点证券的比例不低于非现金基金资产的 80%。

当法律法规的相关规定变更时,基金管理人在履行适当程序后可对上述资产配置比例进行适当调整。

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,对基金投资、融资、融券比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督:

(1) 本基金股票投资占基金资产的比例为 0%-95%,投资于本基金定义的热点证券的资产不低于非现金基金资产的 80%;

(2) 本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、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) 本基金与本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券,其市值不超过该证券的 10%;

(5) 本基金进入全国银行间同业市场的债券回购融入的资金余额不超过基金资产净值的 40%。本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年,债券回购到期后不得展期;

(6) 本基金参与股票发行申购,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;

(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 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%; 本基金与本基金管理人管理的其他基金持有的同一权证,不得超过该权证的 10%;

(8) 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的 10%; 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%; 本基金管理人管理的全部证券投资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%; 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%;

(9) 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;

(10) 本基金参与股指期货交易后,需遵守下列投资比例限制:

① 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%;

② 本基金在任何交易日日终,持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和不得超过基金资产净值的 95%,其中,有价证券指股票、债券(不含到期日在一年以内的政府债券)、权证、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等;

③ 本基金在任何交易日日终,持有的卖出期货合约价值不得超过本基金持有的股票总市值的 20%;

④ 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值,合计(轧差计算)应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定;

⑤ 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%;

(11) 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%;

(12) 本基金持有的同一中期票据的比例,不得超过该中期票据规模的 10%。经基金管理人和基金托管人协商,可对前述比例进行调整;

(13) 本基金持有的所有流通受限证券,其公允价值不得超过本基金资产净值的 20%,且不得超过本基金权益类资产规模的 50%;本基金对于非公开发行证券的投资总额的买入权限不得超过本基金资产净值的 10%,在单只品种上的买入权限不得超过本基金资产净值的 5%;经基金管理人和托管人协商,可对前述比例进行调整;

(14) 本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%;

(15) 本基金管理人管理的且由本基金托管人托管的全部开放式基金(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且由本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股票,不得超过该上市公司可流通股票的 30%;

(16) 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、基金规模变动等本基金管理人之外的因素致使本基金不符合前述比例限制的,本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;

(17) 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;

(18) 本基金不得违反基金合同中有关投资范围、投资策略、投资比例的规定;

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

(20) 法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的,从其规定。

除第(2)、(9)、(16)、(17)项外,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,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。法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的,从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内,本基金的投资范围、投资策略应符合基金合同的约定。法律法规或监管部门另有规定的,从其规定。

上述投资组合限制条款中,若属法律法规的强制性规定,则当法律法规或监管部门取消或调整上述限制,在履行适当程序后,本基金投资可不受上述规定限制或按调整后的规定执行。

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,对本托管协议第十五条第九款基金投资禁止行为进行监督。

4、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供经慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手名单,并约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金托管人监督基金管理人是否按事前提提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易。基金管理人可以每半年对银行间债券市场交易对手名单进行更新,如基金管理人根据市场情况需要临时调整银行间债券市场交易对手名单,应向基金托管人说明理由,在与交易对手发生交易前 3 个工作日内与基金托管人协商解决。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。基金管理人负责对交易对手的资信控制,按银行间债券市场的交易规则进行交易,基金托管人则根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督,但不承担交易对手不履行合同造成的损失。如基金托管人事后发现基金管理人没有按照事先约定的交易对手或交易方式进行交易时,基金托管人应及时提醒基金管理人,基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任。

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

基金投资银行定期存款的,基金管理人应根据法律法规的规定及基金合同的

约定选择存款银行。

本基金投资银行存款应符合如下规定：

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

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

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

基金托管人发现基金管理人在选择存款银行时有违反有关法律法规的规定及基金合同的约定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人在 10 个工作日内纠正。基金管理人未能在 10 个工作日内纠正的，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在 10 个工作日内纠正或拒绝结算。

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

如果基金管理人未经基金托管人的审核擅自将不实的业绩表现数据印制在宣传推介材料上，则基金托管人对此不承担任何责任，并将在发现后立即报告中国证监会。

7、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资流通受限证券进行监督。

(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) 流通受限证券与上文所述的流动性受限资产并不完全一致，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)在首次投资流通受限证券之前,基金管理人应当制定相关投资决策流程、风险控制制度、流动性风险控制预案等规章制度。基金管理人应当根据基金流动性的需要合理安排流通受限证券的投资比例,并在风险控制制度中明确具体比例,避免基金出现流动性风险。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,基金管理人应当将上述规章制度以及董事会批准上述规章制度的决议提交给基金托管人。

(4)在投资流通受限证券之前,基金管理人应至少提前一个交易日向基金托管人提供有关流通受限证券的相关信息,具体应当包括但不限于如下文件(如有):

拟发行数量、定价依据、监管机构的批准证明文件复印件、基金管理人与承销商签订的销售协议复印件、缴款通知书、基金拟认购的数量、价格、总成本、划款账号、划款金额、划款时间文件等。基金管理人应保证上述信息的真实、完整。

(5)基金托管人在监督基金管理人投资流通受限证券的过程中,如认为因市场出现剧烈变化导致基金管理人的具体投资行为可能对基金财产造成较大风险,基金托管人有权要求基金管理人对该风险的消除或防范措施进行补充和整改,并做出书面说明。否则,基金托管人经事先书面告知基金管理人,有权拒绝执行其有关指令。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。

(6)基金管理人应保证基金投资的流通受限证券登记存管在本基金名下,并确保基金托管人能够正常查询。因基金管理人原因产生的流通受限证券登记存管问题,造成基金财产的损失或基金托管人无法安全保管基金财产的责任与损失,由基金管理人承担。

(7)如果基金管理人未按照本协议的约定向基金托管人报送相关数据或者报送了虚假的数据,导致基金托管人不能履行托管人职责的,基金管理人应依法承担相应法律后果。除基金托管人未能依据法律法规、基金合同及本协议履行职责外,因投资流通受限证券产生的损失,基金托管人按照本协议履行监督职责后不承担上述损失。

8、基金管理人应在基金首次投资中期票据或中小企业私募债券前,与基金托管人签署相应的风险控制补充协议,并按照法律法规的规定和补充协议的约定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中期票据或中小企业私

募债券的投资管理制度。

9、基金托管人发现基金管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作中违反法律法规和基金合同的规定，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函，就基金托管人的疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人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依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当立即通知基金管理人，并报告中国证监会。

10、基金管理人应配合和协助基金托管人依照法律法规、基金合同和本托管协议对基金业务执行核查。对基金托管人发出的书面提示，基金管理人应在规定时间内答复并改正，或就基金托管人的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事项，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

11、基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的，基金托管人应报告中国证监会。

12、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，无需召开基金份额持有人大会审议。

侧袋机制实施期间，本基金的投资组合比例、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（包括但不限于对基金赎回的影响、信息披露、费用列支等）、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基金合同和招募说明书的规定。

基金托管人依照相关法律法规的规定以及基金合同和招募说明书的约定,对侧袋机制启用、特定资产处置和信息披露等方面进行复核和监督。

## (二) 基金管理人 对基金托管人的业务核查

1、基金管理人 对基金托管人履行托管职责情况进行核查,核查事项包括基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户、证券账户、期货账户等投资所需账户、复核基金管理人计算的基金资产净值、各类基金份额的基金份额净值、根据基金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。

2、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、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、基金合同、本协议及其他有关规定时,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在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金管理人发出回函,说明违规原因及纠正期限,并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内,基金管理人有权随时对通知事项进行复查,督促基金托管人改正。基金托管人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。

3、基金管理人发现基金托管人有重大违规行为,应及时报告中国证监会,同时通知基金托管人限期纠正,并将纠正结果报告中国证监会。基金托管人无正当理由,拒绝、阻挠对方根据本协议规定行使监督权,或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督,情节严重或经基金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。

## 三、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。未经基金管理人依据合法程序作出的合 法合规指令,基金托管人不得自行运用、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、证券账户、期货账户等投资所需账户。

4、基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户,确保基金财产的完整与独立。

5、基金托管人根据基金管理人的指令,按照基金合同和本协议的约定保管基金财产,如有特殊情况双方可另行协商解决。

6、对于因为基金投资产生的应收资产,应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人,到账日基金财产没有到达基金账户的,基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金财产造成损失的,基金托管人对此不承担任何责任。

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

## (二) 基金募集期间及募集资金的验资

1、基金募集期间的资金应存于基金管理人在具有托管资格的商业银行开设的基金认购专户。该账户由基金管理人开立并管理。

2、基金募集期满或基金停止募集时,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,基金管理人应将属于基金财产的全部资金划入基金托管人开立的基金托管资金账户,同时在规定时间内,聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验资,出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的2名或2名以上中国注册会计师签字方为有效。

3、若基金募集期限届满,未能达到基金合同生效的条件,由基金管理人按规定办理退款等事宜,基金托管人应提供充分协助。

## (三) 基金资金账户的开立和管理

1、基金托管人应负责本基金的资金账户的开设和管理。

2、基金托管人应以本基金的名义在具有基金托管资格的商业银行开设本基金的资金账户,并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。本基金的一切货币收支活动,包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益、收取申购款,均需通过本基金的资金账户进行。

3、基金托管资金账户的开立和使用,限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立任何其他银行账户;亦不得使用

基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

4、基金托管资金账户的开立和管理应符合相关法律法规的有关规定。

5、在符合法律法规规定的条件下,基金托管人可以通过基金托管人专用账户办理基金资产的支付。

#### (四) 基金证券账户的开立和管理

1、基金托管人在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司为基金开立基金托管人与基金联名的证券账户。

2、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或未经对方同意擅自转让基金的任何证券账户,亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

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

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

5、在本托管协议生效日之后,本基金被允许从事其他投资品种的投资业务,涉及相关账户的开设、使用的,按有关规定开设、使用并管理;若无相关规定,则基金托管人应当比照并遵守上述关于账户开设、使用的规定。

#### (五) 债券托管专户的开设和管理

基金合同生效后,基金托管人根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司的有关规定,以本基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司开立债券托管与结算账户,并代表本基金进行银行间市场债券的结算。基金管理人和基金托管人同时代表本基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议。

#### (六) 其他账户的开立和管理

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

2、法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的,从其规定办理。

#### (七) 基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的有关实物证券、银行定期存款存单等有价凭证由基金托管人

负责妥善保管, 保管凭证由基金托管人持有。有价凭证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有价凭证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由基金管理人、基金托管人保管。除协议另有规定外, 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。重大合同的保管期限为基金合同终止后 15 年, 法律法规另有规定的从其规定。

### 四、基金资产净值的计算和会计核算

#### (一) 基金资产净值的计算及复核程序

##### 1、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的净资产值。

基金份额净值是指基金资产净值除以基金份额总数后得到的基金份额的资产净值。基金份额净值的计算, 精确到 0.0001 元, 小数点后第五位四舍五入, 由此产生的误差计入基金财产。国家另有规定的, 从其规定。

基金管理人每工作日计算基金资产净值及各类基金份额的基金份额净值, 并按规定公告。

##### 2、复核程序

基金管理人每工作日对基金资产进行估值后, 将各类基金份额的基金份额净值结果发送给基金托管人, 经基金托管人复核无误后, 由基金管理人依据基金合同和相关法律法规的规定对外公布。

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

### 五、基金份额持有人名册的登记与保管

本基金的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、基金权益登记日、基金份额持有人大会

权益登记日、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至少应包括持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册由登记机构编制,由基金管理人审核并提交基金托管人保管。基金托管人有权要求基金管理人提供任意一个交易日或全部交易日的基金份额持有人名册,基金管理人应及时提供,不得拖延或拒绝提供。

基金管理人应及时向基金托管人提交基金份额持有人名册。每年6月30日和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后十个工作日内提交。

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

## 六、争议解决方式

因本协议产生或与之相关的争议,双方当事人应通过协商、调解解决,协商、调解不能解决的,任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会,仲裁地点为北京市,按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的,对当事人均有约束力。

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

本协议适用中华人民共和国法律并从其解释。

## 七、托管协议的变更与终止

### (一) 托管协议的变更程序

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

### (二) 基金托管协议终止的情形

- 1、基金合同终止;
- 2、基金托管人解散、依法被撤销、破产或由其他基金托管人接管基金资产;
- 3、基金管理人解散、依法被撤销、破产或由其他基金管理人接管基金管理权;

4、发生法律法规、中国证监会或基金合同规定的终止事项。

## 第二十一部分 对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务,并将随着业务的发展和客户需求的变化,积极增加或变更服务内容,努力提高服务品质,为客户提供专业、便捷、周到的全方位服务。主要服务内容如下:

### 一、开户确认

基金管理人为投资者提供开户网上查询确认服务,投资者可通过登陆基金管理人网站了解相关的开户信息。

### 二、资料发送

#### 1、基金投资人对账单

基金管理人为基金份额持有人提供电子对账单定期发送服务,并为有需要的投资者提供纸质对账单的寄送服务。

为保证基金份额持有人获得方便、快捷、私密性较强的对账单信息,基金管理人为基金份额持有人提供电子对账单发送服务。基金份额持有人在开户后可通过基金管理人网站、客服电话、客服邮箱留下本人的电子邮件地址及相关信息,基金管理人将定期为其发送电子对账单。

#### 2、其他资料

基金管理人将根据客户的定制要求和相应的客户类别,寄送基金管理人期刊及各类研究报告,动态地向客户提供时效性强的财经资讯。

### 三、呼叫中心服务

东方基金呼叫中心已经开通并能为客户提供安全高效的信息查询服务及人工咨询服务。客户可以通过自动语音系统进行交易信息查询、账户信息查询与修改以及基金信息的查询,在这过程中客户有任何需要帮助的地方,均可以转接人工或在语音信箱中留言;东方基金呼叫中心同时受理 E-Mail、传真等多样化咨询方式,为客户提供便捷多样的交流方式。

东方基金呼叫中心电话:010-66578578,400-628-5888(免长途通话费用)

东方基金呼叫中心传真:010-66578700

### 四、短信服务

若投资者准确完整的预留了手机号码(小灵通用户除外),可获得免费手机短信服务,包括交易短信、短信对账单、净值短信、产品信息、基金分红提示、

基金管理人最新公告等。未预留手机号码的投资者可拨打客服电话或登陆基金管理人网站添加后获得此项服务。若因网络、数据传输等原因导致短信内容有误,具体内容以公司信息为准。

## 五、网上交易业务

本基金已开通网上交易业务,个人投资者可通过基金管理人网上交易平台办理基金的开户、申购、赎回等各项业务,基金管理人在遵循法律法规的前提下开展网上交易申购费率优惠活动,个人投资者通过基金管理人网上交易平台办理基金申购业务时可享受申购费率优惠,详情可登陆基金管理人网站 [www.orient-fund.com](http://www.orient-fund.com) 或 [www.df5888.com](http://www.df5888.com) 查阅基金管理人旗下基金开通网上交易业务的公告。

为方便个人投资者或基金份额持有人,未来在各项技术条件和准备完备的情况下,本基金管理人将酌情丰富网上交易渠道。

## 六、网上查询服务

通过基金管理人网站,客户还可获得如下服务:

### 1、查询服务

所有东方开放式基金的持有人均可通过基金管理人网站实现基金交易查询、账户信息查询和基金信息查询。

客户可以利用基金管理人网站获取基金和基金管理人的各类信息,包括基金的法律文件、业绩报告及基金管理人最新动态等各类最新资料。

## 七、客户投诉受理服务

投资者可以通过东方基金呼叫中心(010-66578578 或 400-628-5888)、基金管理人网站([www.orient-fund.com](http://www.orient-fund.com) 或 [www.df5888.com](http://www.df5888.com))、电子邮件([services@orient-fund.com](mailto:services@orient-fund.com))、传真、信件等方式对我们的工作提出建议或意见。我们将用心倾听投资者的需求和意见,并按照《东方基金管理股份有限公司客户投诉业务处理制度》流程处理,在规定的时间内予以反馈。

## 八、投资顾问服务

基金管理人拥有一支具有金融专业技能与良好沟通技能的专业的理财顾问团队,分布于北京、上海等地区,致力于为客户提供优异的个性化理财服务。

九、如本招募说明书存在任何您/贵机构无法理解的内容,可通过上述方式联系本公司。请确保投资前,您/贵机构已经全面理解了本招募说明书。

## 第二十二部分 其他应披露事项

一、在本基金存续期内，本基金管理人的内部机构设置、职能划分可能会发生变化，职能也会相应地做出调整，但不会影响本基金的投资理念、投资目标、投资范围和投资运作。

二、基金管理人和基金份额持有人应遵守《东方基金管理股份有限公司公开募集开放式证券投资基金登记业务规则》等有关规定（包括本基金管理人对上述规则的任何修订和补充）。上述规则由本基金管理人制定，并由其解释与修改，但规则的修改若实质性地修改了基金合同，应召开基金份额持有人大会，对基金合同的修改达成决议。

三、本招募说明书将按中国证监会有关规定进行更新。招募说明书解释与基金合同不一致时，以基金合同为准。

四、从上次《招募说明书（更新）》截止日 2021 年 4 月 15 日，到本次《招募说明书（更新）》截止日 2022 年 4 月 15 日之间的信息披露事项如下：

| 公告名称                                              | 公告日期      |
|---------------------------------------------------|-----------|
| 2021 年一季度报告                                       | 2021-4-21 |
| 东方基金管理股份有限公司关于调整旗下部分基金投资范围、增加侧袋机制并相应修改法律文件的公告（四）  | 2021-4-28 |
| 东方睿鑫热点挖掘灵活配置混合型证券投资基金基金合同（2021 年 4 月修订）           | 2021-4-28 |
| 东方睿鑫热点挖掘灵活配置混合型证券投资基金托管协议（2021 年 4 月修订）           | 2021-4-28 |
| 东方睿鑫热点挖掘灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新                   | 2021-4-29 |
| 东方睿鑫热点挖掘灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新                      | 2021-4-29 |
| 关于增加上海爱建基金销售有限公司为旗下基金销售机构同时开通定投及转换业务并参与其费率优惠活动的公告 | 2021-5-13 |
| 东方睿鑫热点挖掘灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新                      | 2021-5-28 |
| 东方睿鑫热点挖掘灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新                   | 2021-5-28 |
| 关于旗下部分基金参与吉林银行基金申购及定投手续费率优惠活动的公告                  | 2021-5-28 |
| 关于旗下部分基金参与上海基煜基金销售有限公司费率优惠活动的公告                   | 2021-6-24 |

|                                                           |            |
|-----------------------------------------------------------|------------|
| 关于旗下部分基金参与珠海盈米基金销售有限公司费率优惠活动的公告                           | 2021-6-29  |
| 关于旗下部分基金参与北京汇成基金销售有限公司费率优惠活动的公告                           | 2021-6-29  |
| 关于增加中国人寿保险股份有限公司为旗下基金销售机构 同时开通定投及转换业务并参与其费率优惠活动的公告        | 2021-7-6   |
| 关于旗下部分基金参与招商银行股份有限公司申购费率优惠的公告                             | 2021-7-20  |
| 2021 年二季度报告                                               | 2021-7-21  |
| 关于旗下部分基金参与招商证券股份有限公司等六家销售机构申购费率优惠的公告                      | 2021-7-28  |
| 关于中国工商银行股份有限公司开通东方基金管理股份有限公司旗下开放式基金定投及转换业务的公告             | 2021-7-29  |
| 关于旗下部分基金参与喜鹊财富基金销售有限公司等两家销售机构申购费率优惠的公告                    | 2021-8-10  |
| 关于旗下部分基金参与中国工商银行股份有限公司 申购费率优惠的公告                          | 2021-8-21  |
| 2021 年中期报告                                                | 2021-8-26  |
| 关于旗下部分基金参与中国中金财富证券有限公司申购费率优惠的公告                           | 2021-9-3   |
| 关于旗下部分基金参与中国建设银行股份有限公司申购费率优惠的公告                           | 2021-9-4   |
| 东方基金管理股份有限公司关于调整旗下部分基金持有的停牌股票估值方法的提示性公告                   | 2021-9-8   |
| 关于增加上海万得基金销售有限公司为东方基金旗下部分开放式基金销售机构同时开通定投及转换业务并参与费率优惠活动的公告 | 2021-9-8   |
| 关于在海通证券股份有限公司开通旗下部分基金定投并参加其费率优惠活动的公告                      | 2021-9-16  |
| 关于旗下部分基金参与国金证券股份有限公司等四家销售机构申购费率优惠的公告                      | 2021-9-16  |
| 关于旗下部分基金参与海银基金销售有限公司费率优惠活动的公告                             | 2021-10-18 |
| 关于旗下部分基金参与腾安基金销售(深圳)有限公司费率优惠活动的公告                         | 2021-10-18 |
| 关于增加泰信财富基金销售有限公司为东方基金旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务并参与费率优惠活动的公告    | 2021-10-21 |
| 2021 年三季度报告                                               | 2021-10-26 |

|                                                                   |            |
|-------------------------------------------------------------------|------------|
| 关于旗下部分基金参与中信证券股份有限公司等四家销售机构申购费率优惠的公告                              | 2021-10-26 |
| 关于旗下部分基金参与腾安基金销售(深圳)有限公司赎回费率优惠活动的公告                               | 2021-11-1  |
| 关于旗下部分基金参与上海证券有限责任公司等四家销售机构申购费率优惠的公告                              | 2021-11-9  |
| 关于旗下部分基金参与蚂蚁(杭州)基金销售有限公司等7家销售机构申购费率优惠活动的公告                        | 2021-11-16 |
| 关于旗下部分基金参与浙江同花顺基金销售有限公司申购费率优惠活动的公告                                | 2021-11-18 |
| 关于增加上海陆金所基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告                        | 2021-11-19 |
| 东方基金管理股份有限公司关于办公地址变更的公告                                           | 2021-12-4  |
| 关于旗下部分基金参与中国邮政储蓄银行股份有限公司申购费率优惠的公告                                 | 2021-12-25 |
| 关于旗下部分基金参与北京雪球基金销售有限公司申购费率优惠活动的公告                                 | 2022-1-4   |
| 东方基金管理股份有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告                        | 2022-1-5   |
| 关于增加通华财富(上海)基金销售有限公司等3家机构为东方基金旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务并参与申购费率优惠活动的公告 | 2022-1-11  |
| 关于增加北京创金启富基金销售有限公司为东方基金旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务并参与申购费率优惠活动的公告        | 2022-1-13  |
| 东方基金管理股份有限公司关于开展直销电子交易系统基金申购费率优惠的公告                               | 2022-1-20  |
| 2021年四季度报告                                                        | 2022-1-21  |
| 东方基金管理股份有限公司基金行业高级管理人员变更公告                                        | 2022-2-12  |
| 关于增加北京中植基金销售有限公司为东方基金旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务并参与申购费率优惠活动的公告          | 2022-2-18  |
| 关于增加申万宏源西部证券有限公司为公司旗下部分基金销售机构同时开                                  | 2022-3-9   |

|                                                         |           |
|---------------------------------------------------------|-----------|
| 通定投及转换业务的公告                                             |           |
| 关于增加财咨道信息技术有限公司为东方基金旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务并参与申购费率优惠活动的公告 | 2022-3-10 |
| 2021 年年度报告                                              | 2022-3-25 |
| 关于旗下部分基金参与广发证券股份有限公司等两家机构申购费率优惠的公告                      | 2022-3-26 |
| 关于旗下部分基金参与京东肯特瑞基金销售有限公司申购费率优惠活动的公告                      | 2022-4-11 |
| 关于旗下部分基金参与东方财富证券股份有限公司申购费率优惠活动的公告                       | 2022-4-11 |
| 关于增加招商银行股份有限公司招赢通平台为旗下部分基金销售机构的公告                       | 2022-4-13 |
| 关于增加青岛银行股份有限公司为东方基金旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务并参与申购费率优惠活动的公告  | 2022-4-13 |

## 第二十三部分 招募说明书存放及查阅方式

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,供社会公众查阅、复制。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与公告的内容完全一致。

投资者还可以直接登录基金管理人的网站(www.orient-fund.com 或 www.df5888.com)查阅和下载招募说明书。

## 第二十四部分 备查文件

一、中国证监会准予东方睿鑫热点挖掘灵活配置混合型证券投资基金募集注册的文件

二、《东方睿鑫热点挖掘灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

三、《东方睿鑫热点挖掘灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

四、法律意见书

五、基金管理人业务资格批件和营业执照

六、基金托管人业务资格批件和营业执照

七、中国证监会要求的其他文件

东方基金管理股份有限公司

2022年5月