

易米低碳经济股票型发起式  
证券投资基金  
招募说明书

基金管理人：易米基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

二〇二三年一月

## 重要提示

1、易米低碳经济股票型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）经 2022 年 9 月 26 日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可〔2022〕2296 号文准予募集注册。

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

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；因基金价格可升可跌，亦不保证基金份额持有人能全数取回其原本投资。

3、本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资人在投资本基金前，需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，对投资本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资人根据所持有份额享受基金的收益，但同时也需承担相应的投资风险。投资本基金可能遇到的风险包括：因受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响而引起的市场风险；基金管理人在基金管理运作过程中产生的基金管理风险；流动性风险；本基金的特有风险；投资港股通标的股票的特定风险；投资可转换债券和可交换债券的特定风险；投资资产支持证券的特定风险；投资股指期货的特定风险；投资国债期货的特定风险；投资股票期权的特定风险；参与融资业务的特定风险；投资流通受限证券的特定风险；投资存托凭证的特定风险；基金管理人职责终止风险；本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险；投资本基金的其他风险等。

本基金基金合同生效之日起三年后的对应日（该对应日如为非工作日，则自动顺延至下一个工作日），如基金资产规模低于 2 亿元时，基金合同自动终止，届时投资者将面临基金资产变现及其清算等带来的不确定性风险。

本基金采用证券公司交易结算模式，即本基金将通过基金管理人选定的证

券经纪商进行场内交易，并由选定的证券经纪商作为结算参与人代理本基金进行结算。

投资有风险，投资人在认购（或申购）本基金前应认真阅读本基金的招募说明书、基金合同、基金产品资料概要等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，自主作出投资决策，自行承担投资风险。基金的过往业绩并不代表未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或者超过基金份额总数的 50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或者超过前述 50% 比例的除外。基金管理人固有资金、基金管理人高级管理人员及基金经理等人员出资认购的基金份额达到或超过基金总份额 50% 的，不受上述限制。法律法规、监管机构另有规定的，从其规定。

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招募说明书“侧袋机制”等有关章节的规定。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，并不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。

本基金的投资范围包括存托凭证，可能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。

4、自基金合同生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书，并登载在规定网站上。

## 目 录

重要提示 .....	1
第一部分 绪言 .....	1
第二部分 释义 .....	2
第三部分 基金管理人 .....	9
第四部分 基金托管人 .....	17
第五部分 相关服务机构 .....	20
第六部分 基金的募集 .....	28
第七部分 基金合同的生效 .....	34
第八部分 基金份额的申购与赎回 .....	36
第九部分 基金的投资 .....	51
第十部分 基金的财产 .....	62
第十一部分 基金资产的估值 .....	63
第十二部分 基金的收益与分配 .....	70
第十三部分 基金费用与税收 .....	72
第十四部分 基金的会计与审计 .....	75
第十五部分 基金的信息披露 .....	76
第十六部分 侧袋机制 .....	85
第十七部分 风险揭示 .....	90
第十八部分 基金合同的变更、终止与基金财产清算 .....	103
第十九部分 基金合同摘要 .....	105
第二十部分 托管协议摘要 .....	135
第二十一部分 对基金份额持有人的服务 .....	153
第二十二部分 其他应披露事项 .....	155
第二十三部分 招募说明书的存放及查阅方式 .....	156
第二十四部分 备查文件 .....	157

## 第一部分 绪言

《易米低碳经济股票型发起式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法》（以下简称“《证券法》”）、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）、《公开募集证券投资基金侧袋机制指引（试行）》（以下简称“《侧袋机制指引》”）和其他有关法律法规的规定以及《易米低碳经济股票型发起式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。本招募说明书由基金管理人解释。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，或对本招募说明书做出任何解释或者说明。

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

## 第二部分 释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

- 1、基金或本基金：指易米低碳经济股票型发起式证券投资基金
- 2、基金管理人：指易米基金管理有限公司
- 3、基金托管人：指兴业银行股份有限公司
- 4、证券、期货经纪商：指为本基金提供证券、期货经纪服务的证券公司、期货公司
- 5、基金合同或《基金合同》：指《易米低碳经济股票型发起式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
- 6、托管协议或《托管协议》：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《易米低碳经济股票型发起式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
- 7、招募说明书、《招募说明书》或本招募说明书：指《易米低碳经济股票型发起式证券投资基金招募说明书》及其更新
- 8、基金产品资料概要：指《易米低碳经济股票型发起式证券投资基金基金产品资料概要》及其更新
- 9、基金份额发售公告：指《易米低碳经济股票型发起式证券投资基金基金份额发售公告》
- 10、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
- 11、《证券法》：指 1998 年 12 月 29 日第九届全国人民代表大会常务委员会第六次会议通过，经 2004 年 8 月 28 日第十届全国人民代表大会常务委员会第十一次会议《关于修改〈中华人民共和国证券法〉的决定》第一次修正，2005 年 10 月 27 日第十届全国人民代表大会常务委员会第十八次会议第一次修订，2013 年 6 月 29 日第十二届全国人民代表大会常务委员会第三次会议《关于修改〈中华人民共和国文物保护法〉等十二部法律的决定》第二次修正，2014 年 8 月 31 日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十次会议《关于修改〈中华人

民共和国保险法》等五部法律的决定》第三次修正，2019年12月28日第十三届全国人民代表大会常务委员会第十五次会议第二次修订的《中华人民共和国证券法》及颁布机关对其不时做出的修订

12、《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，经2012年12月28日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自2013年6月1日起实施，并经2015年4月24日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修正的《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

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

14、《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，并经2020年3月20日中国证监会《关于修改部分证券期货规章的决定》修改的《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

15、《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

16、《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

17、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

18、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行保险监督管理委员会

19、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

20、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

21、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

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

23、投资人、投资者：指个人投资者、机构投资者、合格境外投资者、发起资金提供方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

24、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者

25、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

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

27、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

28、登记机构：指办理登记业务的机构。基金的登记机构为易米基金管理有限公司或接受易米基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构，本基金的登记机构为易米基金管理有限公司

29、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

30、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

31、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

32、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

33、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

34、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

35、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所的正常交易日

36、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

37、T+n日：指自T日起第n个工作日（不包含T日），n为自然数

38、开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日（若本基金参与港股通交易且该工作日为非港股通交易日时，则基金管理人可根据实际情况决定本基金是否开放申购、赎回及转换业务，具体以届时提前发布的公告为准）

39、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

40、《业务规则》：指《易米基金管理有限公司开放式基金业务规则》（包括其不时修订），是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金登记方面的业务规则，由基金管理人和投资人共同遵守

41、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

42、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

43、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

44、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、某一基金的全部或部分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

45、转托管：指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更

所持基金份额销售机构的操作

46、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

47、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%

48、元：指人民币元

49、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

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

51、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

52、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

53、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

54、基金份额类别：指根据认购/申购费用、赎回费用、销售服务费用收取方式的不同将本基金基金份额分为不同的类别，各基金份额类别分别设置代码，并分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值

55、A类基金份额：指在投资者认购/申购时收取认购/申购费，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额

56、C类基金份额：指在投资者认购/申购时不收取认购/申购费，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额

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

58、发起式基金：指符合中国证监会有关规定，由基金管理人、基金管理人股东、基金管理人高级管理人员或基金经理等人员承诺认购一定金额并持有一定期限的证券投资基金

59、发起资金：指用于认购发起式基金且来源于基金管理人股东资金、基金管理人固有资金、基金管理人高级管理人员或基金经理（指基金管理人员中依法具有基金经理资格者，包括但不限于本基金的基金经理，同时也可以包括基金经理之外公司投研人员，下同）等人员的资金。发起资金认购本基金的金额不低于 1000 万元，且发起资金认购的基金份额持有期限不低于三年

60、发起资金提供方：指以发起资金认购本基金且承诺以发起资金认购的基金份额持有期限不少于三年的基金管理人股东、基金管理人、基金管理人高级管理人员或基金经理等人员

61、销售服务费：指从基金财产中计提的，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

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

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

64、内地与香港股票市场交易互联互通机制：指上海证券交易所、深圳证券交易所分别和香港联合交易所有限公司（以下简称香港联合交易所）建立技术连接，使内地和香港投资者可以通过当地证券公司或经纪商买卖规定范围内的对方交易所上市的股票。内地与香港股票市场交易互联互通机制包括沪港股票市场交易互联互通机制（以下简称沪港通）和深港股票市场交易互联互通机制（以下简称深港通）

65、港股通：指内地投资者委托内地证券公司，经由上海证券交易所、深

圳证券交易所在香港设立的证券交易服务公司，向香港联合交易所进行申报（买卖盘传递），买卖沪港通、深港通规定范围内的香港联合交易所上市的股票

66、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

67、特定资产：指为实施侧袋机制而在基金投资组合中分离至侧袋账户的资产，包括：（1）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；（2）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；（3）其他资产价值存在重大不确定性的资产

68、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

以上释义中涉及法律法规、业务规则的内容，法律法规、业务规则修订后，如适用本基金，相关内容以修订后法律法规、业务规则为准。

### 第三部分 基金管理人

#### 一、基金管理人概况

名称：易米基金管理有限公司

注册地址：上海市虹口区保定路 450 号 9 幢 320 室

办公地址：上海市浦东新区杨高南路 759 号 29 层 02 单元

法定代表人：李毅

成立时间：2017 年 5 月 24 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监许可〔2020〕1577 号

注册资本：13,000 万元人民币

组织形式：有限责任公司

存续期间：持续经营

电话：4006-046-899

股权结构：

股东	认缴出资额 万元	出资比例
李毅	4550.00	35%
董涛	2795.00	21.5%
郭之英	1365.00	10.5%
杨旭蔚	1365.00	10.5%
陈华晨	648.70	4.99%
刘鹏宇	643.50	4.95%
白洁	643.50	4.95%
上海易米满怀企业管理合伙企业（有限合伙）	640.90	4.93%
刘珠宝	348.40	2.68%
合计	13,000	100%

#### 二、主要人员情况

##### 1、董事会成员

郭之英，董事长，硕士。曾任汇丰晋信基金管理有限公司渠道部高级经理，富国基金管理有限公司渠道部高级经理，大成基金管理有限公司福州分公司总

经理、上海分公司总经理助理。现任易米基金管理有限公司董事长。

李毅，董事，硕士。曾任中国信息信托投资公司人事审计监察，中国国际期货经纪有限公司客户经理，中国证券监督管理委员会办公厅、规划委办公室主任科员，中国证券监督管理委员会基金监管部副处长，汇丰晋信基金管理有限公司总经理助理、副总经理。现任易米基金管理有限公司总经理、代任首席信息官。

陈凡，独立董事，学士。现任易米基金管理有限公司独立董事，上海锦天城（福州）律师事务所律师。

李欢丽，独立董事，硕士。现任易米基金管理有限公司独立董事，广东金融学院金融学教授。

肖珉，独立董事，博士。现任易米基金管理有限公司独立董事，厦门大学管理学院财务学系教授。

## 2、职工监事

贺文奇，监事，硕士。曾任国泰基金产品经理助理、渠道销售，后加入磐厚投资，协助组建磐厚蔚然，加入磐厚蔚然后历任投资经理、资本市场部总监。现任易米基金管理有限公司指数投资部总监、产品开发部总经理、基金经理。

## 3、经营管理层人员

李毅，总经理，硕士。相关介绍见董事会成员部分内容。

程伟庆先生，副总经理，博士。曾任中信证券研究部首席分析师兼策略研究团队负责人、中信证券交易与衍生品部投资经理兼研究团队负责人、中信证券资管部投资经理兼长期股权投资组负责人。现任易米基金有限公司副总经理、基金经理。

董涛，副总经理，硕士。曾任中国光大银行股份有限公司深圳分行业务部副经理，新恒基投资管理有限公司投资部总经理，宝盈基金管理有限公司市场部主管，汇丰晋信基金管理有限公司代销业务总监，深圳市纳盈资产管理有限公司总经理。现任易米基金管理有限公司副总经理、资产管理部负责人。

杨旭蔚，副总经理，硕士。曾任财通证券股份有限公司办公室主任助理，国泰基金管理有限公司战略规划专员、机构理财部副总监、产品规划部总监兼财富管理中心产品规划总监、量化投资小组副组长兼黄金ETF基金经理，上海

磐厚投资管理有限公司总经理，磐厚蔚然（上海）资产管理有限公司执行董事、总经理。现任易米基金管理有限公司副总经理。

#### 4、督察长

安萍，督察长，硕士。曾任上海司法审计事务所审计员，渣打银行上海分行现金管理中心主管，国泰基金管理有限公司监察稽核部副总监、人力资源部总监，华泰柏瑞基金管理有限公司法律监察部总监。

#### 5、本基金基金经理

程伟庆先生，北京大学博士，23年证券从业经验。曾任中信证券研究部首席分析师兼策略研究团队负责人、中信证券交易与衍生品部投资经理兼研究团队负责人、中信证券资管部投资经理兼长期股权投资组负责人。现任易米基金管理有限公司副总经理、基金经理。

#### 6、投资决策委员会成员：

李毅，总经理，硕士。相关介绍见董事会成员部分内容。

程伟庆，副总经理，博士。相关介绍见经营管理层人员部分内容。

董涛，副总经理，硕士。相关介绍见经营管理层人员部分内容。

杨旭蔚，副总经理，硕士。相关介绍见经营管理层人员部分内容。

王磊，基金经理，硕士。曾任华泰证券股份有限公司投资银行部项目经理、国金证券股份有限公司研究所行业研究员、太平洋资产管理有限责任公司研究部高级研究员、权益投资部投资副总裁、凯石基金管理有限公司研究副总监、基金经理。现任易米基金管理有限公司研究部总监、基金经理。

包丽华，基金经理，硕士。曾任兴业证券股份有限公司研究员，兴证证券资产管理有限公司资深投资经理，先锋期货有限公司资产管理部副总经理兼投资经理，嘉实基金管理有限公司权益投资部基金经理。现任易米基金管理有限公司基金经理。

俞科进，基金经理，硕士。曾任中国人保寿险股份有限公司员工，长江证券股份有限公司研究所金工分析师，中邮创业基金管理股份有限公司历任金融工程研究员、量化投资部副总经理、基金经理，上海集元资产管理有限公司合规风控负责人，现任易米基金管理有限公司多策略投资部总监、基金经理兼投资经理。

李秋实，拟任基金经理，硕士。曾任中银国际证券股份有限公司债券交易员。现拟任易米基金管理有限公司基金经理。

7、上述人员之间不存在近亲属关系。

### 三、基金管理人的职责

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

2、办理基金备案手续；

3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；

4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

6、编制季度、中期和年度基金报告；

7、计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回价格；

8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；

9、按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

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

12、有关法律法规、中国证监会规定和基金合同约定的其他职责。

### 四、基金管理人的承诺

1、基金管理人承诺不从事违反《证券法》的行为，并承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反《证券法》行为的发生；

2、基金管理人承诺不从事违反《基金法》的行为，并承诺建立健全内部风险控制制度，采取有效措施，防止下列行为的发生：

(1) 将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；

(2) 不公平地对待管理的不同基金财产；

(3) 利用基金财产或职务之便为基金份额持有人以外的人牟取利益；

(4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；



(5) 侵占、挪用基金财产；

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

(7) 玩忽职守，不按照规定履行职责；

(8) 法律、行政法规和中国证监会禁止的其他行为。

3、基金管理人承诺严格遵守基金合同，并承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反基金合同的行为发生；

4、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；

5、基金管理人承诺不从事其他法规规定禁止从事的行为。

#### 五、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、代表人、受雇人或任何其他第三人牟取不当利益；

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

4、不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

#### 六、基金管理人的内部控制制度

##### 1、内部控制的原则

(1) 健全性原则：内部控制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，维护内控制度的有效执行。

(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，公司基金资产、自有资产、其他资产的运作分离。

(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。

## 2、内部控制的主要内容

### (1) 控制环境

公司完善法人治理结构，充分发挥独立董事和监事职能，严禁不正当关联交易、利益输送和内部人控制现象的发生，保护投资者利益和公司合法权益。

公司管理层贯彻内控优先的风险管理理念，培养全体员工的风险防范意识，营造一个浓厚的内控文化氛围，确保全体员工及时了解国家法律法规和公司规章制度，使风险意识贯穿到公司各个部门、各个岗位和各个环节。公司全体员工必须忠于职守勤勉尽责，严格遵守国家法律法规和公司各项规章制度。

公司的组织结构体现职责明确、相互制约的原则，各部门有明确的授权分工，操作相互独立。公司建立决策科学、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。

公司建立有效的人力资源管理制度，健全激励约束机制，确保公司人员具备与岗位要求相适应的职业操守和专业胜任能力。

### (2) 风险评估

公司建立科学严密的风险评估体系，对公司内外部风险进行识别、评估和分析，及时防范和化解风险。

风险评估是根据风险发生的可能性及其可能引起的后果，来评估风险水平的高低。风险评估既有定量的度量指针，也有定性的分析手段；

定量的方法是指设计有关风险指针，按其发生的可能性与后果的严重程度计算相应的风险值，确定相应的风险水平；

定性的分析是把风险水平划分为若干级别，每一种风险按其发生的可能性与后果的严重程度分别计入不同的风险等级。投资组合风险采用定量分析方法，通过投资组合风险管理系统进行评估；其它风险，一般采用定性分析方法，通过风险定位机制进行评估；

风险定位机制是通过对公司业务和流程风险点的分析，评估风险的大小和等级，并制定相应风险管理措施，形成风险定位图，并定期生成风险管理报告

的风险管理方法：

各部门根据公司风险评估标准制定、修改本部门内控制度，报送公司监察稽核部。监察稽核部对各部门提交的内部控制制度进行评估，出具独立的评估报告提交总经理及督察长，由总经理责成相关部门实施。风险管理委员会负责评估公司内、外部风险，评价公司的基本管理制度以及提出改进方案，报公司董事会。

### （3）内控机制

公司依据自身经营特点设立顺序递进、权责统一、严密有效的三道监控防线：

建立以各岗位目标责任制为基础的第一道监控防线。各岗位、各管理和业务流程均制定详实的操作流程和明确的岗位职责，各岗位人员上岗前必须声明已知悉并承诺遵守，在授权范围内承担各自职责；

建立相关部门、相关岗位之间相互监督制衡的第二道监控防线。公司建立重要业务处理凭据传递和信息沟通制度，相关部门和岗位之间相互监督制衡；

建立以督察长和监察稽核部对各岗位、各部门、各机构、各项业务全面实施监督反馈的第三道监控防线。督察长、监察稽核部独立于其它部门和业务活动，并对内部控制制度的执行情况实行严格的检查和监督。

### （4）信息与沟通

公司制定管理和业务报告制度。维护信息沟通渠道的畅通，建立清晰的报告系统。公司各报告线路如下：

执行体系报告路线是各业务人员向部门负责人报告；部门负责人向分管副总经理，例如：分管投资的副总经理，分管营运的副总经理、分管市场的副总经理向总经理报告。总经理向董事会报告；

监督体系报告路径为：公司员工、各部门主管向监察稽核部报告，监察稽核部向督察长报告；

督察长向董事会报告。董事会、监事向股东会报告。

### （5）监督与内部稽核

公司建立有效的内部监控制度，设置督察长和独立的监察稽核部，对公司内部控制制度的执行情况进行持续的监督，保证内部控制制度落实。公司定期

评价内部控制的有效性，根据市场环境、新的金融工具、新的技术应用和新的法律法规等情况，适时改进。

#### （6）风险管理

公司针对相关业务岗位分别建立分级授权制度和岗位分离制度，各业务部门必须在适当的授权基础上实行恰当的责任分离制度。

公司针对不同的业务岗位，建立岗位责任制度。在明确不同岗位的工作任务基础上，赋予各岗位相应的责任和职权，建立相互配合、相互制约、相互促进的工作关系。通过制定规范的岗位责任制度、严格的操作程序和合理的工作标准，大力推行各部门、各岗位的目标管理。

公司各部门应真实、全面地记载每一笔业务，建立健全各种信息资料的报送制度，确保各种信息资料的真实与完整。与此同时制定相应的保密制度，公司全体职工必须严格执行公司各项保密制度。

公司建立严密有效的风险管理系统，包括主要业务的风险评估和监测办法、重要部门的风险考核指标体系以及业务人员的道德风险防范等，必要时聘请外部专业机构提供风险评估和建议，通过严密的风险管理，及时发现风险、管理风险。

公司制订有效的紧急应变制度，设定紧急情况处理程序。当业务操作发生失误或遭遇突发情况时，应急处理措施要及时到位，并按预定功能发挥作用，以确保公司的整体经营不会受到影响。

### 3、基金管理人关于内部控制的声明

（1）本公司确知建立、实施和维持内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任。

（2）上述关于内部控制的披露真实、准确。

（3）本公司承诺将根据市场环境变化及公司的发展不断完善内部控制制度。

## 第四部分 基金托管人

### 一、基金托管人概况

本基金托管人为兴业银行股份有限公司，基本信息如下：

名称：兴业银行股份有限公司（以下简称“兴业银行”）

注册地址：福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦

办公地址：上海市银城路 167 号

邮政编码：200120

法定代表人：吕家进

成立日期：1988 年 8 月 22 日

批准设立机关和批准设立文号：中国人民银行总行，银复[1988]347 号

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基金字[2005]74 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：207.74 亿元人民币

存续期间：持续经营

### 二、托管业务部门设置及员工情况

兴业银行股份有限公司总行设资产托管部，下设综合管理处、基金证券业务处、信托保险业务处、理财私募业务处、产品管理处、稽核监察处、投资监督管理处、运行管理处等处室，共有员工 100 余人，业务岗位人员均具有基金从业资格。

### 三、基金托管业务经营情况

兴业银行股份有限公司于 2005 年 4 月 26 日取得基金托管资格。基金托管业务批准文号：证监基金字[2005]74 号。截至 2022 年 9 月 30 日，兴业银行共托管证券投资基金 617 只，托管基金的基金资产净值合计 24055.27 亿元，基金份额合计 23181.41 亿份。

### 四、基金托管人的内部控制制度

#### （一）内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金资产的

安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

## （二）内部控制组织结构

兴业银行基金托管业务内部控制组织架构由总行内部控制委员会、总行风险管理部门、总行审计部、总行资产托管部、总行运营管理部及分行托管运营机构共同组成。各级内部控制组织依照本行相关制度对本行托管业务风险管理和内部控制实施管理。

## （三）内部控制原则

1、全面性原则：内部控制贯穿资产托管业务的全过程，覆盖各项业务和产品，以及从事资产托管业务的各机构和从业人员；

2、重要性原则：内部控制应当在全面控制的基础上，关注重要业务事项和高风险领域；

3、独立性原则：开展托管业务的部门和岗位的设置应权责分明、相对独立、相互制衡；

4、审慎性原则：内控与风险管理必须以防范风险，保证托管资产的安全与完整为出发点，“内控优先”，“制度优先”，审慎发展资产托管业务；

5、制衡性原则：内部控制应当在治理结构、机构设置及权责分配、业务流程等方面形成相互制约、相互监督，同时兼顾运营效率；

6、适应性原则：内部控制体系应同所处的环境相适应，以合理的成本实现内控目标，内部制度的制订应当具有前瞻性，并应当根据国家政策、法律及经营管理的需要，适时进行相应修改和完善；内部控制存在的问题应当能够得到及时反馈和纠正；

7、成本效益原则：内部控制应当权衡实施成本与预期效益，以适当的成本实现有效控制。

## （四）内部控制制度及措施

1、制度建设：建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度。

2、建立健全的组织管理结构：前后台分离，不同部门、岗位相互牵制。

3、风险识别与评估：稽核监察处指导业务处室进行风险识别、评估，制定

并实施风险控制措施。

4、相对独立的业务操作空间：业务操作区相对独立，实施门禁管理和音像监控。

5、人员管理：进行定期的业务与职业道德培训，使员工树立风险防范与控制理念，并签订承诺书。

6、应急预案：制定完备的《应急预案》，并组织员工定期演练；建立异地灾备中心，保证业务不中断。

#### 五、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

基金托管人负有对基金管理人的投资运作行使监督权的职责。根据《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定，托管人对基金的投资对象和范围、投资组合比例、投资限制、费用的计提和支付方式、基金会计核算、基金资产估值和基金净值的计算、收益分配、申购赎回以及其他有关基金投资和运作的事项，对基金管理人进行业务监督、核查。

基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法律法规规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金托管人发出回函。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。基金管理人违反基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。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，并将纠正结果报告中国证监会。

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

基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、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，并及时向中国证监会报告。

## 第五部分 相关服务机构

### 一、销售机构

#### 1、直销机构

本基金直销机构为基金管理人直销柜台。

名称：易米基金管理有限公司

注册地址：上海市虹口区保定路450号9幢320室

办公地址：上海市浦东新区杨高南路759号29层02单元

法定代表人：李毅

客户服务电话：4006-046-899

联系人：袁维

联系电话：021-60857160

传真：021-60857110

#### 2、其他销售机构

##### （1）国泰君安证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路618号

法定代表人：贺青

客服电话：95521

网址：<http://www.gtja.com/>

##### （2）中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座

法定代表人：张佑君

客服电话：95548

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

##### （3）中信证券华南股份有限公司

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

法定代表人：胡伏云

客服电话：95548

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



(4) 中信证券山东有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001

法定代表人：陈佳春

客服电话：95548

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

(5) 中信期货有限公司

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

法定代表人：张皓

客服电话：400-990-8826

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

(6) 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

法定代表人：其实

客服电话：95021

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

(7) 珠海盈米基金销售有限公司

注册地址：珠海市横琴新区环岛东路3000号2719室

法定代表人：肖雯

客服电话：020-89629066

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

(8) 上海基煜基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区广东路500号30层3001单元

法定代表人：王翔

客服电话：400-820-5369

网站：[www.jigoutong.com](http://www.jigoutong.com)

(9) 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区东大名路501号6211单元

法定代表人：杨文斌

客服电话：400-700-9665

网站：www.howbuy.com

(10) 北京汇成基金销售有限公司

注册地址：北京市西城区宣武门外大街甲1号4层401-2

法定代表人：王伟刚

客服电话：400-619-9059

网址：www.hcfunds.com

(11) 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

法定代表人：王珺

客服电话：955188

网址：www.fund123.cn

(12) 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

法定代表人：吴强

客服电话：952555

网址：www.5ifund.com

(13) 通华财富（上海）基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区同丰路667弄107号201室

法定代表人：沈丹义

客服电话：400-101-9301

网址：www.tonghuafund.com

(14) 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

法定代表人：朱荣晖

客服电话：400-003-5811

网址：www.linlongtougou.com

(15) 上海利得基金销售有限公司

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

室

法定代表人：李兴春

客服电话：400-032-5885

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

(16) 上海联泰基金销售有限公司

注册地址：上海市普陀区兰溪路900弄15号526室

法定代表人：尹彬彬

客服电话：400-118-1188

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

(17) 京东肯特瑞基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区知春路76号（写字楼）1号楼4层1-7-2

法定代表人：邹保威

客服电话：4000988511

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

(18) 众惠基金销售有限公司

注册地址：贵州省贵阳市观山湖区长岭北路贵阳国际金融中心二期商务区第C4栋30层1号

法定代表人：李春蓉

客服电话：400-839-1818

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

(19) 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

法定代表人：汪静波

客服电话：400-821-5399

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

(20) 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

法定代表人：张跃伟

客服电话：400-820-2899

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

(21) 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：40000488251

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

(22) 中国中金财富证券有限公司

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

法定代表人：高涛

客服电话：95532

网址：<http://www.ciccwm.com/>

(23) 深圳市前海排排网基金销售有限责任公司

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

法定代表人：杨柳

客服电话：400-666-7388

网址：<http://www.ppwfund.com/>

(24) 安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道福华一路119号安信金融大厦

法定代表人：黄炎勋

客服电话：95517

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

(25) 和讯信息科技有限公司

注册地址：北京市朝阳区朝外大街22号1002室

法定代表人：章知方

客服电话：4009200022

网址：<http://licaike.hexun.com>

(26) 上海云湾基金销售有限公司

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

法定代表人：冯轶明

客服电话：4008201515

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

(27) 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

法定代表人：马永谔

客服电话：400-080-8208

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

(28) 上海攀赢基金销售有限公司

注册地址：上海市闸北区广中西路1207号306室

法定代表人：郑新林

客服电话：021-68889082

网址：[www.pytz.cn](http://www.pytz.cn)

(29) 深圳众禄基金销售股份有限公司

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

法定代表人：薛峰

客服电话：4006-788-887

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

(30) 上海大智慧基金销售有限公司

注册地址：中国(上海)自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102单元

法定代表人：张俊

客服电话：021-20292031

网址：<http://www.wg.com.cn>

(31) 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

法定代表人：戴彦

客服电话：95357

网址：www.18.cn

(32) 上海挖财基金销售有限公司

注册地址：中国(上海)自由贸易试验区杨高南路759号18层03单元

法定代表人：吕柳霞

客服电话：021-50810673

网址：www.wacaijjin.com

基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并在基金管理人网站进行公示。

## 二、登记机构

名称：易米基金管理有限公司

注册地址：上海市虹口区保定路450号9幢320室

办公地址：上海市浦东新区杨高南路759号29层02单元

法定代表人：李毅

联系人：伍军华

电话：021-60857130

## 三、出具法律意见书的律师事务所

名称：上海源泰律师事务所

住所：上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦14楼

办公地址：上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦14楼

负责人：廖海

经办律师：刘佳、黄丽华

联系电话：021-51150298

传真：021-51150398

联系人：黄丽华

## 四、审计基金财产的会计师事务所

机构名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：上海市自贸试验区陆家嘴环路1318号星展银行大厦507单元

01室

办公地址：中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼

执行事务合伙人：李丹

经办注册会计师：薛竞、陈轶杰

联系人：陈轶杰

联系电话：021-23238888

传真：021-23238800

## 第六部分 基金的募集

### 一、基金募集的依据

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》、基金合同及有关法律法规募集，并经中国证监会 2022 年 9 月 26 日证监许可（2022）2296 号文件准予募集注册。

### 二、基金类型

股票型证券投资基金

### 三、基金运作方式

契约型开放式

### 四、基金存续期间

不定期

基金合同生效之日起三年后的对应日（该对应日如为非工作日，则自动顺延至下一个工作日），若基金资产净值低于 2 亿元，基金合同自动终止，且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续基金合同期限。法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定。

### 五、募集方式及场所

通过各销售机构的基金销售网点（包括基金管理人的直销柜台、网上直销系统及其他销售机构的销售网点等）公开发售，各销售机构的具体名单见基金份额发售公告和基金管理人网站公示。除法律法规另有规定外，任何与基金份额发售有关的当事人不得提前发售基金份额。

### 六、募集期限

自基金份额发售之日起最长不得超过 3 个月，具体发售时间见基金份额发售公告。如果在此期间未达到本招募说明书中“第七部分基金合同的生效”中的“一、基金备案的条件”的规定，基金可在募集期限内继续销售，直到达到基金备案条件。基金管理人也可根据基金销售情况在募集期限内适当延长或缩短基金发售时间，并及时公告。

### 七、募集对象

符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、



合格境外投资者、发起资金提供方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。

#### 八、基金的最低募集份额总额

本基金的最低募集份额总额为 1000 万份，最低募集金额为 1000 万元人民币，其中发起资金提供方认购基金的金额不少于 1000 万元人民币。

发起资金提供方承诺持有发起资金认购的基金份额的期限自基金合同生效日起不少于 3 年。认购份额的高级管理人员或基金经理等人员在上述期限内离职的，其持有期限的承诺不受影响（基金合同生效不满三年提前终止的情况除外）。

本基金发起资金的认购情况见基金管理人届时发布的公告。

#### 九、基金份额类别

本基金根据认购费用、申购费用、销售服务费用、赎回费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资者认购/申购时不收取认购/申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。

本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值和基金份额累计净值。

投资人可自行选择认购/申购的基金份额类别。

有关基金份额类别的具体设置、费率水平等由基金管理人确定，并在《招募说明书》中公告。根据基金销售 and 实际运作情况，基金管理人在不违反法律法规、《基金合同》以及不对基金份额持有人权益产生实质性不利影响的情况下，经与基金托管人协商一致，在履行适当程序后，可以增加、减少或调整基金份额类别、调整现有基金份额类别的设置规则和分类方法、或者在法律法规和基金合同规定的范围内变更基金份额类别的申购费率、调低赎回费率、调低销售服务费率或变更收费方式、或者停止基金份额类别的销售等，此项调整无需召开基金份额持有人大会，但基金管理人需履行适当程序并及时公告。

#### 十、基金的面值、认购费用、募集期利息的处理方式及认购份额的计算

1、本基金基金份额发售面值为人民币 1.00 元。

## 2、认购费用

本基金 A 类基金份额在认购时收取认购费用；C 类基金份额不收取认购费用。

本基金 A 类基金份额的认购费率如下：

认购金额（含认购费）	认购费率
认购金额 < 100 万元	1.20%
100 万元 ≤ 认购金额 < 200 万元	0.80%
200 万元 ≤ 认购金额 < 500 万元	0.50%
500 万元 ≤ 认购金额	1000 元/笔

本基金 A 类基金份额的基金认购费用由认购 A 类基金份额的投资人承担，不列入基金财产，主要用于基金的市场推广、销售、登记等募集期间发生的各项费用。

投资者多次认购 A 类基金份额的，须按每笔认购所对应的费率档次分别计算。

在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，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，定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金认购费率并另行公告。

## 3、募集期利息的处理方式

有效认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有，其中利息转份额的具体数额以登记机构的记录为准。

## 4、基金认购份额的计算

本基金认购采用“金额认购，份额确认”的方式。认购份额的计算保留到小数点后 2 位，小数点 2 位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

(1) A 类基金份额的认购份额计算方法为：

① 认购费用适用比例费率时：

净认购金额 = 认购金额 / (1 + 认购费率)

认购费用 = 认购金额 - 净认购金额

认购份额 = (净认购金额 + 认购资金利息) / 基金份额发售面值

② 认购费用适用固定金额时：

认购费用 = 固定金额

净认购金额 = 认购金额 - 认购费用

认购份额 = (净认购金额 + 认购资金利息) / 基金份额发售面值

例：某投资人投资 5,000.00 元认购本基金 A 类基金份额，认购期间利息为 2.00 元，则其可得到的 A 类基金份额计算如下：

净认购金额 = 5,000.00 / (1 + 1.20%) = 4,940.71 元

认购费用 = 5,000.00 - 4,940.71 = 59.29 元

认购份额 = (4,940.71 + 2.00) / 1.00 = 4,942.71 份

即投资人投资 5,000.00 元认购本基金 A 类基金份额，假设认购期间利息为 2.00 元，可得到 4,942.71 份本基金 A 类基金份额。

(2) C 类基金份额的认购份额计算方法为：

认购份额 = (认购金额 + 认购资金利息) / 基金份额发售面值

例：某投资人投资 5,000.00 元认购本基金 C 类基金份额，认购期间利息为 2.00 元，则其可得到的 C 类基金份额计算如下：

认购份额 = (5,000.00 + 2.00) / 1.00 = 5,002.00 份

即投资人投资 5,000.00 元认购本基金 C 类基金份额，假设认购期间利息为 2.00 元，可得到 5,002.00 份基金 C 类基金份额。

## 十一、投资者对基金份额的认购

1、认购时间安排：本基金向个人投资者、机构投资者、合格境外投资者、发起资金提供方同时发售，具体发售时间由基金管理人根据相关法律法规及本基金基金合同，在基金份额发售公告中确定并披露。

2、投资人认购应提交的文件和办理的手续：详见基金份额发售公告及销售机构相关业务规则。

3、认购申请的确认：基金销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购申请的确认以登记机构的

确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利，否则，由此产生的投资人的任何损失由投资人自行承担。

投资者认购前，应认真阅读基金管理人及其他销售机构的业务规则，一旦选择在某销售机构提出认购申请，即视为投资者已完全阅读、理解并认可该销售机构的业务规则，并接受该规则的约束。

4、认购原则和认购限额：认购以金额申请。投资人认购基金份额时，需按销售机构规定的方式全额缴付认购款项。基金管理人直销柜台每个基金交易账户首次认购金额不得低于1万元人民币（含认购费），单笔追加认购最低金额为1万元人民币（含认购费）。其他销售机构及基金管理人网上直销系统每个基金交易账户每次认购金额不得低于1元人民币（含认购费），其他销售机构另有规定最低单笔认购金额高于1元人民币的（含认购费），从其规定。

募集期内，基金管理人可设置单个投资人的累计认购金额限制，具体见基金管理人届时发布的相关公告。

5、如果本基金单个投资人累计认购的基金份额数达到或者超过基金总份额的50%，基金管理人有权拒绝该投资人的全部或部分认购申请。基金管理人接受某笔或者某些认购申请有可能导致投资者变相规避前述50%比例要求的，基金管理人有权拒绝该等全部或者部分认购申请。基金管理人使用固有资金、公司高级管理人员及基金经理等人员出资认购的基金份额达到或者超过基金总份额50%的，不受上述限制。投资人认购的基金份额数以基金合同生效后登记机构的确认为准。

6、投资人在基金募集期内可以多次认购基金份额，A类基金份额的认购费用按照单笔认购金额分别计算。认购申请一经受理不得撤销。

7、发起资金的认购：本基金发起资金认购的金额不少于1000万元人民币，且发起资金认购的基金份额持有期限自基金合同生效日起不少于3年（基金合同生效不满三年提前终止的情况除外）。认购份额的高级管理人员或基金经理等人员在上述期限内离职的，其持有期限的承诺不受影响。本基金发起资金的认购情况见基金管理人届时发布的公告。

## 十二、募集资金

基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人

不得动用。基金募集期间的信息披露费、会计师费、审计费、律师费以及其他费用，不得从基金财产中列支。

## 第七部分 基金合同的生效

### 一、基金备案的条件

本基金自基金份额发售之日起3个月内，发起资金提供方认购基金的金额不少于1000万元人民币，且承诺持有期限自基金合同生效日起不少于3年的，基金募集期届满或基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售，并在10日内聘请法定验资机构验资，验资报告需对发起资金提供方及其持有份额进行专门说明，自收到验资报告之日起10日内，向中国证监会办理基金备案手续。

基金募集达到基金备案条件的，自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起，《基金合同》生效；否则《基金合同》不生效。基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对《基金合同》生效事宜予以公告。基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。

### 二、基金合同不能生效时募集资金的处理方式

如果募集期限届满，未满足基金备案条件，基金管理人应当承担下列责任：

- 1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；
- 2、在基金募集期限届满后30日内退还投资人已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息；
- 3、如基金募集失败，基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和销售机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。

### 三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

基金合同生效之日起三年后的对应日（该对应日如为非工作日，则自动顺延至下一个工作日），若基金资产净值低于2亿元人民币的，基金合同自动终止，且不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。若届时法律法规或中国证监会规定发生变化，上述终止规定被取消、更改或补充时，则本基金可以参照届时有有效的法律法规或中国证监会规定执行。

基金合同生效三年后继续存续的，基金存续期内，连续20个工作日出现基

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

法律法规或中国证监会或基金合同另有规定时，从其规定。

## 第八部分 基金份额的申购与赎回

### 一、申购和赎回场所

#### 1、直销机构

名称：易米基金管理有限公司

注册地址：上海市虹口区保定路450号9幢320室

办公地址：上海市浦东新区杨高南路759号29层02单元

法定代表人：李毅

客户服务电话：4006-046-899

联系人：袁维

联系电话：021-60857160

传真：021-60857110

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

投资者可以通过基金管理人办理开户、本基金的认购、申购、赎回等业务，具体交易细则届时请参阅基金管理人网站及相关公告。

#### 2、除基金管理人之外的其他销售机构

本基金除基金管理人之外的其他销售机构参见基金份额发售公告或拨打基金管理人客户服务电话进行咨询。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并在基金管理人网站进行公示。

投资人应当通过上述销售机构的营业场所或按上述销售机构提供的其他方式办理基金的申购或赎回。若基金管理人或其他销售机构开通电话、传真或网上交易等交易方式，投资人可以通过上述方式进行申购与赎回。具体参见各销售机构的相关业务规则。

### 二、申购和赎回的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所的正常交易日的交易时间（若本基金参与港股通交易且该工作日为非港股通交易日时，则基金管理人可根据实际情况决定本基金是否开放申购、赎回及转换业务，具体以届时提前发布的公告为



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

## 2、申购、赎回开始日及业务办理时间

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

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相关公告中规定。

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》的有关规定在规定媒介上公告申购与赎回的开始时间。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、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该类基金份额申购、赎回的价格。

## 三、申购与赎回的原则

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

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销，但申请经登记机构受理的不得撤销；

4、基金份额持有人赎回时，基金管理人按“先进先出”原则，对该持有人账户在该销售机构的基金份额进行处理，即登记确认日期在前的基金份额先赎回，登记确认日期在后的基金份额后赎回，以确定被赎回基金份额的持有期限和所适用的赎回费率；

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

6、基金管理人有权决定基金份额持有人持有本基金的最高限额和本基金的总规模限额，但应最迟在新的限额实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告；

7、投资者办理申购、赎回等业务时应提交的文件和办理手续、办理时间、处理规则等在遵守基金合同和招募说明书规定的前提下，以各销售机构的具体规定为准。

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

#### 四、申购与赎回的数额限制

1、基金管理人直销柜台每个基金交易账户首次最低申购金额为1万元人民币（含申购费），追加单笔申购最低金额为1万元人民币（含申购费）。已有认购本基金记录的投资人不受首次申购最低金额的限制，但受追加申购最低金额的限制；其他销售机构及基金管理人网上直销系统每个基金交易账户单笔申购最低金额为1元人民币（含申购费），其他销售机构另有规定最低单笔申购金额高于1元人民币的（含申购费），从其规定。基金投资人当期分配的基金收益转购基金份额时，不受最低申购金额的限制。

2、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0.01份基金份额，如果销售机构另有规定最低单笔赎回份额高于0.01份，从其规定；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0.01份的，在赎回时需一次全部赎回。

3、基金管理人可以规定基金总规模上限、单日累计申购金额/净申购金额上限、单个账户单日累计申购金额/净申购金额上限、单笔申购金额上限，具体规定请参见更新的招募说明书或相关公告。

4、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或相关公告。但若本基金单一投资人累计申购的基金份额数达到或者超过基金总份额的50%，基金管理人有权对该投资人的申购申请进行限制。基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致投资人变相规避前述50%比例要求的，基金管理人有权拒绝该等全部或者部分申购申请。

5、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。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。具体见基金管理人相关公告。

6、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额、赎回份额、投资人每个基金交易账户的最低基金份额余额、单个投资人累计持有的基金份额上限、基金总规模上限等数量限制。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

## 五、申购与赎回的程序

### 1、申购和赎回的申请方式

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

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

### 2、申购和赎回的款项支付

投资人申购基金份额时，必须在规定时间内全额交付申购款项，投资人在规定时间内全额交付申购款项，申购申请成立；基金份额登记机构确认基金份额时，申购申请生效。若申购资金在规定时间内未全额到账则申购申请不成立，申购款项本金将退回投资人账户，基金管理人、基金托管人和销售机构等不承担由此产生的利息等任何损失。

基金份额持有人在提交赎回申请时须持有足够的基金份额余额，否则所提交的赎回申请不成立。当基金份额持有人持有足够的基金份额余额，基金份额持有人递交赎回申请，赎回申请成立；基金份额登记机构确认赎回时，赎回申请生效。

基金份额持有人赎回申请生效后，基金管理人将在 T+7 日（包括该日）内支付赎回款项。遇证券/期货交易所、交易市场或外汇市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障、港股通交易系统或港股通资金交收规则限

制或其他非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程时，赎回款项顺延至上述情形消失的下一个工作日划出。基金管理人、基金托管人和销售机构等不承担由此顺延造成的损失或不利后果。在发生巨额赎回或基金合同载明的其他暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。

### 3、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日（T日），在正常情况下，本基金登记机构在T+1日内（包括该日）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。若申购不成立或无效，则申购款项本金退还给投资人。

基金销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购、赎回申请的确认以基金登记机构的确认结果为准。对于申购、赎回申请的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利。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。

### 4、如未来法律法规或监管机构对上述内容另有规定，从其规定。

基金管理人可以在法律法规允许的范围内，依法对上述申购和赎回申请的业务办理规则或确认时间等进行调整，并必须在调整实施日前按照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

## 六、申购费和赎回费

### 1、申购费率

本基金A类基金份额在申购时收取基金申购费用，投资者可以多次申购本基金，申购费率按每笔申购申请单独计算。C类基金份额不收取基金申购费用。

本基金A类基金份额的申购费率如下：

申购金额（含申购费）	申购费率
申购金额 < 100 万元	1.50%
100 万元 ≤ 申购金额 < 200 万元	1.00%

200 万元 ≤ 申购金额 < 500 万元	0.80%
500 万元 ≤ 申购金额	1000 元/笔

本基金 A 类基金份额的申购费用应在投资人申购 A 类基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用。

## 2、赎回费率

### (1) 本基金 A 类基金份额的赎回费

本基金 A 类基金份额的赎回费率按照持有时间递减，即相关基金份额持有时间越长，所适用的赎回费率越低。

本基金 A 类基金份额的赎回费率如下：

持有时间	赎回费率
持有时间 < 7 日	1.50%
7 日 ≤ 持有时间 < 30 日	0.75%
30 日 ≤ 持有时间 < 180 日	0.50%
180 日 ≤ 持有时间	0.00%

A 类份额的赎回费用由赎回 A 类基金份额的基金份额持有人承担。对持续持有期少于 30 日的 A 类基金份额收取的赎回费，将全额计入基金财产；对持续持有期不少于 30 日但少于 90 日的 A 类基金份额收取的赎回费，将赎回费总额的 75% 计入基金财产；对持续持有期不少于 90 日但少于 180 日的 A 类基金份额收取的赎回费，将赎回费总额的 50% 计入基金财产；未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。

### (2) 本基金 C 类基金份额的赎回费

本基金 C 类基金份额的赎回费率按照持有时间递减，即相关基金份额持有时间越长，所适用的赎回费率越低。

本基金 C 类基金份额的赎回费率如下：

持有时间	赎回费率
持有时间 < 7 日	1.50%
7 日 ≤ 持有时间 < 30 日	0.50%
30 日 ≤ 持有时间	0.00%

C类份额的赎回费用由赎回C类基金份额的基金份额持有人承担。对持续持有期少于30日的C类基金份额收取的赎回费，将全额计入基金财产。

3、基金管理人可以根据相关法律法规或在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并在履行适当的程序后，最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

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

5、在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率、赎回费率或销售服务费率并另行公告。

## 七、基金申购份额和赎回金额的计算

### 1、申购份额的计算

申购本基金A类基金份额的申购费用采用前端收费模式（即申购A类基金份额时缴纳申购费）。申购C类基金份额时不收取申购费。

（1）A类基金份额申购份额的计算方式如下：

1) 申购费用适用比例费率时：

净申购金额 = 申购金额 / (1 + 申购费率)

申购费用 = 申购金额 - 净申购金额

申购份额 = 净申购金额 / 申购当日A类基金份额净值

2) 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类基金份额净值

（2）C类基金份额申购份额的计算方式如下：

申购份额 = 申购金额 / 申购当日C类基金份额净值

（3）上述计算结果按照四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的

收益或损失由基金财产承担。

例一：某投资人投资 5,000.00 元申购本基金 A 类基金份额，假设申购当日基金的 A 类基金份额净值为 1.0500 元，则可得到的 A 类基金份额为：

$$\text{净申购金额} = 5,000.00 / (1 + 1.50\%) = 4,926.11 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 5,000.00 - 4,926.11 = 73.89 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 4,926.11 / 1.0500 = 4,691.53 \text{ 份}$$

即：投资人投资 5,000.00 元申购本基金 A 类基金份额，假设申购当日基金的 A 类基金份额净值为 1.0500 元，则其可得到 4,691.53 份 A 类基金份额。

例二：某投资人投资 500 万元申购本基金 A 类基金份额，假设申购当日基金的 A 类基金份额净值为 1.0500 元，则可得到的 A 类基金份额为：

$$\text{申购费用} = 1,000.00 \text{ 元}$$

$$\text{净申购金额} = 5,000,000.00 - 1,000.00 = 4,999,000.00 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 4,999,000.00 / 1.0500 = 4,760,952.38 \text{ 份}$$

即：投资人投资 500 万元申购本基金 A 类基金份额，假设申购当日基金的 A 类基金份额净值为 1.0500 元，则其可得到 4,760,952.38 份 A 类基金份额。

例三：某投资人投资 5,000.00 元申购本基金的 C 类基金份额，假设申购当日 C 类基金份额净值为 1.0500 元，则可得到的 C 类基金份额为：

$$\text{申购份额} = 5,000.00 / 1.0500 = 4,761.90 \text{ 份}$$

即：投资人投资 5,000.00 元申购本基金的 C 类基金份额，假设申购当日 C 类基金份额净值为 1.0500 元，则其可得到 4,761.90 份 C 类基金份额。

## 2、赎回金额的计算

基金份额持有人在赎回本基金时缴纳赎回费，基金份额持有人的赎回金额为赎回总金额扣减赎回费用。赎回金额的计算方法如下：

$$\text{赎回总金额} = \text{赎回份额} \times \text{赎回当日该类基金份额净值}$$

$$\text{赎回费用} = \text{赎回总金额} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{赎回金额} = \text{赎回总金额} - \text{赎回费用}$$

上述计算结果按照四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

例一：某投资人赎回本基金 10,000 份 A 类基金份额，持有时间小于 7 日，

则适用赎回费率为 1.50%，假设赎回当日 A 类基金份额净值为 1.1480 元，则其可得净赎回金额为：

$$\text{赎回总金额} = 10,000 \times 1.1480 = 11,480.00 \text{ 元}$$

$$\text{赎回费用} = 11,480.00 \times 1.50\% = 172.20 \text{ 元}$$

$$\text{净赎回金额} = 11,480.00 - 172.20 = 11,307.80 \text{ 元}$$

即：投资人赎回本基金 10,000 份 A 类基金份额，假设赎回当日 A 类基金份额净值为 1.1480 元，持有时间小于 7 日，适用的赎回费率为 1.50%，则可得到的净赎回金额为 11,307.80 元。

例二：某投资人赎回本基金 10,000 份 C 类基金份额，假设持有时间大于 30 日，则赎回适用费率为 0%，假设赎回当日 C 类基金份额净值为 1.1480 元，则其可得净赎回金额为：

$$\text{赎回总金额} = 10,000 \times 1.1480 = 11,480.00 \text{ 元}$$

$$\text{赎回费用} = 11,480 \times 0 = 0.00 \text{ 元}$$

$$\text{赎回金额} = 11,480.00 - 0.00 = 11,480.00 \text{ 元}$$

即：投资人赎回本基金 10,000 份 C 类基金份额，假设赎回当日 C 类基金份额净值为 1.1480 元，持有时间大于 30 日，适用的赎回费率为 0%，则可得到的净赎回金额为 11,480.00 元。

### 3、基金份额净值的计算公式

计算日某类别基金份额净值 = 该计算日该类别基金份额的基金资产净值 / 该计算日该类别基金份额余额总数。

本基金各类基金份额净值的计算，均保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T 日的各类基金份额净值在当天收市后计算，并在不晚于 T+1 日公告。遇特殊情况，经履行适当程序，可以适当延迟计算或公告。

### 八、拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的全部或部分申购申请：

1、因不可抗力导致基金无法正常运作或者因不可抗力导致基金管理人无法接受投资人的申购申请；



- 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时；
- 3、证券、期货交易所、外汇市场交易时间非正常停市或者基金参与港股通交易且港股通临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；
- 4、基金管理人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或对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时；
- 5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或发生其他损害现有基金份额持有人利益的情形；
- 6、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金申购申请；
- 7、基金管理人接受某笔或者某些申购申请或基金转换入申请有可能导致单一投资者持有基金份额占本基金总份额的比例达到或者超过 50%，或者变相规避前述 50%比例要求的情形时；
- 8、本基金的资产组合中的重要部分发生暂停交易或其他重大事件，继续接受申购可能会影响或损害其他基金份额持有人利益时；
- 9、申购申请超过基金管理人设定的基金总规模、单日净申购比例上限、单一投资者单日或单笔申购金额上限、单一投资人累计持有份额上限的情形；
- 10、基金管理人、基金托管人、基金销售机构、证券经纪商、期货经纪商、基金销售支付结算机构或登记机构的异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系统、基金销售支付结算系统或基金会计系统无法正常运行；
- 11、基金管理人基于投资运作与风险控制的需要认为应当拒绝大额申购或暂停申购时；
- 12、参与港股通交易且港股通每日额度不足；
- 13、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述（第 4、7、9 项除外）暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在规定媒介上刊登暂停申购公告。发生上述第 7 项情形时，基金管理人可以采取比例确认等方式对该投资人的申购申请进行限制，基金管理人有权拒绝该等全部或者部分申购申请。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项本金将退还给投资人。在暂

停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

#### 九、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

- 1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项；
- 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时；
- 3、证券、期货交易所、外汇市场交易时间非正常停市或者基金参与港股通交易且港股通临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；
- 4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回；
- 5、发生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，基金管理人可暂停接受基金份额持有人的赎回申请；
- 6、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请；
- 7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形（第 4 项除外）之一且基金管理人决定暂停赎回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 4 项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

#### 十、巨额赎回的情形及处理方式

##### 1、巨额赎回的认定

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

##### 2、巨额赎回的处理方式

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

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

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

(3) 若本基金发生巨额赎回且存在单个基金份额持有人超过上一开放日基金总份额 20%以上的赎回申请的情形下，基金管理人有权对于该基金份额持有人当日超过上一开放日基金总份额 20%以上部分的赎回申请进行延期办理，对于该基金份额持有人其余赎回申请部分，基金管理人有权根据前段“（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，则其当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。

(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，并应当在规定媒介上进行公告。

### 3、巨额赎回的公告

当发生上述巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式（包括但不限于短信、电子邮件或由基金销售机构

通知等方式) 在 3 个交易日内通知基金份额持有人, 说明有关处理方法, 并在 2 日内在规定媒介上刊登公告。

#### 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

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

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

3、如果发生暂停的时间超过 1 日, 基金管理人可以根据暂停申购或赎回的时间, 依照《信息披露办法》的有关规定, 最迟于重新开放申购或赎回日在规定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回的公告, 并公告最近 1 个工作日的各类基金份额净值; 也可以根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间, 届时不再另行发布重新开放的公告。

#### 十二、基金转换

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

#### 十三、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, 或者按照相关法律法规或国家有权机关要求的方式进行处理的行为。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, 或者按照相关法律法规或国家有权机关要求的方式进行处理。

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、法人或非法人组织。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。

#### 十四、基金的转托管

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

如果出现基金管理人、登记机构、办理转托管的销售机构因技术系统性能限制或其它合理原因，可以暂停该业务或者拒绝基金份额持有人的转托管申请。

#### 十五、定期定额投资计划

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

#### 十六、基金份额的冻结和解冻

基金登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻，以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。基金份额的冻结手续、冻结方式按照登记机构的相关规定办理。基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益按照我国法律法规、监管规章及国家有权机关的要求以及登记机构业务规定处理。基金份额被冻结部分产生的权益一并冻结，被冻结部分份额仍然参与收益分配与支付。法律法规或监管部门另有规定的除外。

#### 十七、基金份额的转让

在法律法规允许、条件具备且对基金份额持有人无实质性不利影响的前提下，履行相关程序后，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基金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，将提前在规定媒介公告相关的业务规则，基金份额持有人应根据基金管理人届时公告的业务规则办理基金份额转让业务。

#### 十八、其他业务

在相关法律法规允许的条件下，基金管理人在制定基金份额质押或其他相应业务规则并依照《信息披露办法》的有关规定进行公告后，可受理基金份额质押业务或其他基金业务。

十九、在不违反相关法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人可根据具体情况对上述申购和赎回以及相关业务的安排进行补充和调整并提前公告，无需召开基金份额持有人大会审议。

#### 二十、实施侧袋机制期间本基金的申购与赎回

本基金实施侧袋机制的，本基金的申购与赎回安排详见招募说明书“侧袋机制”章节的规定或基金管理人届时发布的相关公告。

## 第九部分 基金的投资

### 一、投资目标

本基金通过深度挖掘低碳经济主题相关的投资机会，集中投资于低碳经济主题相关的优质企业，在严格控制风险并保证流动性的前提下，力争获得基金的长期稳定增值。

### 二、投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括创业板及其他经中国证监会核准、注册上市的股票以及存托凭证）、沪港通允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票及包括深港通允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（简称“港股通标的股票”）、债券（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、地方政府债券、政府支持机构债券、政府支持债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、金融衍生品（包括股指期货、国债期货、股票期权）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）。

本基金将按照法律法规相关规定参与融资业务。

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（包括国内依法发行上市的股票、存托凭证及港股通标的股票）投资占基金资产的比例为 80%-95%，其中对港股通标的股票的投资比例不超过股票资产的 50%，投资于低碳经济主题相关上市公司股票的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或对投资比例要求有变更的，基金管理人在履行适当程序后，可以做出相应调整。

### 三、投资策略

#### 1、大类资产配置策略

本基金通过跟踪考量宏观经济变量及国家财政、税收、货币、汇率各项政策，判断经济周期当前所处的位置及未来发展方向，并通过监测重要行业的产能利用与经济景气轮动研究，调整股票资产和固定收益资产的配置比例。

#### 2、股票投资策略

##### (1) 低碳经济主题的界定

低碳经济是指在可持续发展理念指导下，通过技术创新、制度创新、产业转型、新能源开发等手段，尽可能地减少煤炭、石油等高碳能源消耗，减少温室气体排放，达到经济社会发展与生态环境保护“双赢”的一种经济发展模式。低碳经济以低能耗、低排放、低污染为特征，以应对碳基能源对气候变暖的影响为要求，以实现经济社会的可持续发展为目的。

本基金重点关注随着未来经济的发展、人口结构变化、环境与资源的制约以及国家政策目标和国际承诺的兑现带来的低碳经济主题相关的投资机会；以及其他各种有利于低碳经济发展的新产业、新技术、新商业模式带来的中长期的投资机会。

本基金认可的低碳经济主题包括：

1) 电力领域：包括光伏、风电、核电、水电、分布式发电、储能系统、特高压、智慧电网；

2) 工业领域：指在工业生产环节中，通过技术升级与工艺改造减少碳排放量，涉及钢铁、化工和机械设备行业。其中：钢铁行业主要关注绿色生产工艺改造，包括特种钢铁、电炉炼钢和氢能炼钢，实现钢铁生产脱碳；化工行业主要关注研发化工新材料和新技术，实现非化石能源对传统能源的替代，促进节能减排；机械设备行业主要关注两方面，一是新能源设备，主要满足下游新能源装机量需求，包括光伏设备、锂电设备、水电及风电设备、天然气设备及其核心零部件企业；二是新设备替代传统机械设备的转型，包括轨道交通设备、节油发动机和自动化设备；

3) 交通领域：包括新能源车及其核心零部件（动力电池、核心资源与材料）；



- 4) 新材料领域：包括新型环保材料；
- 5) 建筑领域：包括环保建材、装配式建筑；
- 6) 公共领域：主要投资领域为环保装备和污染处理，包括废水、废气、废渣、土壤污染的监测、处置设备与材料；
- 7) 农业领域：包括林业等提供负碳的领域；
- 8) 助力于实现低碳目标的相关技术领域：包括节能环保、碳监测、碳交易、碳金融、负碳技术以及高端智能制造技术。

## (2) 个股投资策略

本基金采取“自上而下”与“自下而上”相结合的分析方法进行股票投资。基金管理人在行业分析的基础上，选择治理结构完善、经营稳健、业绩优良、具有可持续增长前景或价值被低估的上市公司股票，以合理价格买入并进行中长期投资。本基金股票投资具体包括行业分析与配置、公司财务状况评价、价值评估及股票选择与组合优化等过程。

### 1) 行业分析与配置

本基金将根据各行业所处生命周期、产业竞争结构、近期发展趋势等数方面因素对各行业的相对盈利能力及投资吸引力进行评价，并根据行业综合评价结果确定股票资产中各行业的权重。

### 2) 公司财务状况评估

在对行业进行深入分析的基础上，对上市公司的基本财务状况进行评估。结合基本面分析、财务指标分析和定量模型分析，根据上市公司的财务情况进行筛选，剔除财务异常和经营不够稳健的股票，构建基本投资股票池。

### 3) 价值评估

基于对公司未来业绩发展的预测，采用现金流折现模型等方法评估公司股票的合理内在价值，同时结合股票的市场价格，挖掘具有持续增长能力或者价值被低估的公司，选择最具有投资吸引力的股票构建投资组合。

### 4) 股票选择与组合优化

综合定性分析与定量价值评估的结果，选择定价合理或者价值被低估的股票构建投资组合，并根据股票的预期收益与风险水平对组合进行优化，在合理风险水平下追求基金收益最大化。同时监控组合中各个证券的估值水平，在市

场价格明显高于其内在合理价值时适时卖出证券。

### 3、港股通标的股票投资策略

本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场，本基金将优选基本面因素良好、估值水平合理的港股纳入本基金的股票投资组合。

### 4、存托凭证投资策略

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

### 5、债券投资策略

本基金基于有效利用基金资金及流动性管理的需要，将以保持基金资产流动性、为基金资产提供稳定收益为主要目的，适时对债券等固定收益类金融工具进行投资。本基金将通过研究国内外宏观经济、货币和财政政策、市场结构变化、资金流动情况，采取自上而下的策略判断未来利率变化和收益率曲线变动的趋势及幅度，确定组合久期，优化基金资产在利率债、信用债以及货币市场工具等各类固定收益类金融工具之间的配置比例，在精选个券的基础上构建债券投资组合。

### 6、可转换债券和可交换债券投资策略

可转换债券和可交换债券同时具有债券与权益类证券的双重特性。本基金利用可转换债券及可交换债券的债券底价和到期收益率、信用风险来判断其债性，增强本金投资的安全性；利用可转换债券和可交换债券转股溢价率、基础股票基本面趋势和估值来判断其股性，在市场出现投资机会时，优先选择股性强的品种。综合选择安全边际较高、基础股票基本面优良的品种进行投资，获取超额收益。同时，关注可转债和可交换债流动性、条款博弈、可转债套利等影响转债及可交换债投资的其他因素。

### 7、资产支持证券投资策略

本基金参与资产支持证券投资时，将通过考量宏观经济形势、提前偿还率、违约率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气情况等因素，预判资产池未来现金流变动；研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券平均久期及收益率曲线的影响，同时密切关注流动性变化对标的证券收益率的影响，

在严格控制信用风险暴露程度的前提下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益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

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，适当参与股指期货的投资。通过利用股指期货，调整投资组合的风险暴露，改善组合的风险收益特性，从而实现套期保值；同时，还可利用股指期货流动性好，交易成本低等特点，对投资组合的仓位进行及时调整，提高投资组合的运作效率，从而实现有效管理。

#### 9、国债期货投资策略

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，并积极采用流动性好、交易活跃的国债期货合约，通过对国债市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

#### 10、股票期权投资策略

本基金按照风险管理的原则，以套期保值为目的，在严格控制风险的前提下，选择流动性好、交易活跃的股票期权合约进行投资。本基金基于对证券市场的判断，结合期权定价模型，选择估值合理的股票期权合约。本基金投资股票期权，基金管理人将根据审慎原则，建立期权交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股票期权的投资审批事项，以防范股票期权投资的风险。

#### 11、融资业务的投资策略

本基金参与融资业务，将综合考虑融资成本、保证金比例、冲抵保证金证券折算率、信用资质等条件，选择合适的交易对手方。同时，在保障基金投资组合充足流动性以及有效控制融资杠杆风险的前提下，确定融资比例。

#### 12、其他

未来，随着市场的发展和基金管理运作的需要，基金管理人可以在不改变投资目标的前提下，遵循法律法规和监管机构对基金投资的规定，在履行适当程序后可以相应调整或更新投资策略，并在招募说明书中更新。

### 四、投资限制

#### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

(1) 本基金投资于股票（含存托凭证）的比例占基金资产的 80%-95%，其中投资于港股通标的股票的比例不得超过股票资产的 50%，投资于低碳经济主题相关上市公司股票的比例不低于非现金基金资产的 80%；

(2) 本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，持有的现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

(3) 本基金持有一家公司发行的证券（含存托凭证，同一家公司在境内和香港同时上市的 A 股和 H 股合并计算），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证券投资基金持有一家公司发行的证券（含存托凭证，同一家公司在境内和香港同时上市的 A 股和 H 股合并计算），不超过该证券的 10%，但完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金品种可以不受此条款规定的比例限制；

(5) 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%；

(6) 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%；

(7) 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%；

(8) 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%；

(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) 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；

(11) 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%，进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为 1

年，债券回购到期后不得展期；

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

(13) 本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；完全按照有关指数的构成比例进行投资的部分不受此条款规定的比例限制；

(14) 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；

(15) 本基金资产总值不超过基金资产净值的 140%；

(16) 本基金参与股指期货和国债期货交易时，将依据下列标准建构组合：

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

2) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货、国债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、存托凭证、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、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，持有的卖出股指期货合约价值不得超过本基金持有的股票总市值的 20%；本基金在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%；

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

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

(17) 本基金参与融资的，每个交易日日终，本基金持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；

(18) 本基金参与股票期权交易的，因未平仓的期权合约支付和收取的权利金总额不得超过基金资产净值的 10%；开仓卖出认购期权的，应持有足额标的证券；开仓卖出认沽期权的，应持有合约行权所需的全额现金或交易所规则认可的可冲抵期权保证金的现金等价物；未平仓的期权合约面值不得超过基金资产净值的 20%。其中，合约面值按照行权价乘以合约乘数计算；基金投资股票期权应符合《基金合同》约定的比例限制（如股票仓位、个股占比等）、投资目标和风险收益特征；

(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) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述（2）、（9）、（12）、（14）情形之外，因证券或期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定的投资比例的，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、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或调整上述限制，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以调整后的规定为准，无需另行召开基金份额持有人大会。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

(1) 承销证券；

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

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

法律、行政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以调整后的规定为准，不需经基金份额持有人大会审议。

#### 五、业绩比较基准

中证内地低碳经济主题指数收益率\*70%+中证港股通综合指数收益率\*10%+中证综合债指数收益率\*20%

中证内地低碳经济主题指数由清洁能源发电、能源转换及存储、清洁生产及消费与废物处理等公司组成，以反映沪深市场低碳经济主题上市公司证券的整体表现。

中证港股通综合指数选取符合港股通资格的普通股作为样本股，以反映港股通范围内上市公司的整体状况和走势，适合作为本基金港股通标的股票投资部分的业绩比较基准。

中证综合债指数选取在沪深交易所或银行间市场上市的 **BBB** 及以上、且剩余期限 1 个月及以上的国债、金融债、企业债等债券作为成份券，反映全市场债券的整体表现。

如果上述基准指数停止计算编制或更改名称，或者今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场中出现更适用于本基金的指数时，基金管理人可以根据本基金的投资范围和投资策略，确定变更基金的业绩比较基准或其权重构成。业绩比较基准的变更需经基金管理人与基金托管人协商一致报中国证监会备案后及时公告，并在更新的招募说明书中列示，无需召开基金份额持有人大会。

## 六、风险收益特征

本基金为股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

本基金除投资 A 股外，还可根据法律法规规定和基金合同约定投资港股通标的股票，本基金并非必然投资港股通标的股票，一旦投资需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则不同于内地 A 股市场而带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险、汇率风险以及港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险等。

## 七、基金管理人代表基金行使相关权利的处理原则及方法

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

2、不谋求对上市公司的控股；

3、有利于基金财产的安全与增值；

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

## 八、侧袋机制的实施和投资运作安排

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

## 第十部分 基金的财产

### 一、基金资产总值

基金资产总值是指基金持有的各类有价证券、期货合约、银行存款本息和基金应收款项以及其他资产所形成的价值总和。

### 二、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### 三、基金财产的账户

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

### 四、基金财产的保管和处分

本基金财产独立于基金管理人、基金托管人、证券经纪商、期货经纪商和基金销售机构等基金服务机构的财产，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、证券经纪商、期货经纪商和基金销售机构等基金服务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、基金托管人和基金服务机构因依法解散、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。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

## 第十一部分 基金资产的估值

### 一、估值日

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

### 二、估值对象

基金所拥有的股票、存托凭证、期货合约、期权合约、资产支持证券、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

### 三、估值原则

基金管理人在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，应符合《企业会计准则》、监管部门有关规定。

（一）对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会计准则规定的例外情况外，应将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

（二）对不存在活跃市场的投资品种，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

（三）如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25%以上的，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 四、估值方法

##### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

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

(2) 交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种（另有规定的除外），选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值，具体估值机构由基金管理人与基金托管人另行协商约定；

(3) 交易所上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种（另有规定的除外），选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价进行估值，具体估值机构由基金管理人与基金托管人另行协商约定；

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

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

##### 2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

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

(3) 对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为估值日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表估值日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认估值日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，应采用估值技术确定其公允价值；

(4) 在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

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

4、同一证券同时在两个或两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。

5、同业存单按估值日第三方估值机构提供的估值净价估值；选定的第三方估值机构未提供估值价格的，按成本估值。

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

7、银行存款、债券、回购等计息资产按照约定利率在持有期内逐日计提应收、应付利息，在结息日以实收、实付利息入账。

8、本基金参与融资业务的，应参照相关法律法规及行业协会的相关规定进行估值，确保估值的公允性。

9、估值计算中涉及港币或其他外币币种对人民币汇率的，将依据下列信息提供机构所提供的汇率为基准：当日中国人民银行或其授权机构公布的人民币

汇率的中间价。

10、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。

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

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

13、其他资产按法律法规或监管机构有关规定进行估值。

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

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

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，基金托管人承担复核责任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致意见的，以基金管理人的计算结果为准。

## 五、估值程序

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

基金管理人于每个工作日计算基金资产净值及各类基金份额净值，并按规定公告。

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

## 六、估值错误的处理

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

基金合同的当事人应按照以下约定处理：

### 1、估值错误类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人、或基金托管人、或证券经纪商、或期货经纪商、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。

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

### 2、估值错误处理原则

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

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

（3）因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但估值错误责任方仍应对估值错误负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失（“受损方”），则估值错误

责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给估值错误责任方。

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

### 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

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

### 4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

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

(2) 当任一类基金份额估值错误偏差达到该类基金份额净值的 0.25%时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到该类基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告，并报中国证监会备案。

(3) 基金管理人和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差，以基金管理人计算结果为准。

(4) 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。如果行业另有通行做法，基金管理人、基金托管人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商。

## 七、暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场或外汇市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；



2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

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

4、法律法规规定、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

基金净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的基金资产净值和各类基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人依据基金合同和相关法律法规的规定予以公布。

#### 九、特殊情况的处理

1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 11 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。

2、由于不可抗力原因，或由于证券交易所、期货交易所、外汇市场、登记结算公司、证券经纪商、期货经纪商、存款银行等机构发送的数据错误等非基金管理人和基金托管人原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误或即使发现错误但因前述原因无法及时更正的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

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

#### 十、实施侧袋机制期间的基金资产估值

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

## 第十二部分 基金的收益与分配

### 一、基金利润的构成

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

### 二、基金可供分配利润

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

### 三、基金收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以届时基金管理人发布的公告为准。若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后各类基金份额净值均不能低于面值，即基金收益分配基准日的该类别基金份额净值减去该类别每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、由于本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同，基金管理人可对各类别基金份额分别制定收益分配方案。本基金同一基金份额类别内的每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规及基金合同约定，且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可与基金托管人协商一致并按照监管部门要求履行适当程序后对基金收益分配有关业务规则进行调整，无需召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在规定媒介公告。

### 四、收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截至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，依照《信息披露办法》在规定媒介公告。

#### 六、基金收益分配中发生的费用

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

#### 七、实施侧袋机制期间的收益分配

本基金实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配，详见招募说明书“侧袋机制”章节的规定。

## 第十三部分 基金费用与税收

### 一、基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、C类基金份额的销售服务费；
- 4、除法律法规、中国证监会另有规定外，《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、审计费、律师费、公证费、仲裁费和诉讼费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券、期货交易和结算费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、基金的相关账户开户及维护费用；
- 10、因投资港股通标的股票而产生的各项合理费用；
- 11、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

### 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.50%的年费率计提。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

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给管理人。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，支付日期顺延至最近可支付日支付。

#### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，支付日期顺延至最近可支付日支付。

### 3、C类基金份额的销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.50%，按前一日 C 类基金份额基金资产净值的 0.50% 年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为前一日 C 类基金份额基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，支付日期顺延至最近可支付日支付。

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

### 三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项

目。

#### 四、实施侧袋机制期间的基金费用

本基金实施侧袋机制的，与侧袋账户有关的费用可以从侧袋账户中列支，但应待侧袋账户资产变现后方可列支，有关费用可酌情收取或减免，但不得收取管理费，其他费用详见招募说明书“侧袋机制”章节的规定或基金管理人届时发布的相关公告。

#### 五、基金税收

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

## 第十四部分 基金的会计与审计

### 一、基金会计政策

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

### 二、基金的年度审计

- 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的符合《证券法》规定的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意。
- 3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所需在2日内在规定媒介公告。

## 第十五部分 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。相关法律法规或中国证监会关于信息披露的披露内容、披露方式、登载媒介、报备方式等规定发生变化时，本基金从其最新规定。

### 二、信息披露义务人

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

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

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

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

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

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

### 五、公开披露的基金信息



公开披露的基金信息包括：

（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、基金份额发售公告

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人重大利益的事项的法律文件。

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

基金合同生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在规定网站上。

前款规定的重大变更主要包括：

- （1）基金合同、基金托管协议相关内容发生变更；
- （2）变更基金简称（含场内简称）、基金代码（含场内代码）；
- （3）变更基金管理人、基金托管人的法定名称；
- （4）变更基金经理；
- （5）变更认购费、申购费、赎回费等费率；
- （6）其他对投资者有重大影响的事项。

除上述事项之外，基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。

基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。

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

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

5、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。

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，将基金份额发售公告、基金招募说明书提示性公告和基金合同提示性公告登载在规定报刊上，将基金份额发售公告、基金招募说明书、基金产品资料概要、基金合同和基金托管协议登载在规定网站上，其中基金产品资料概要还应当登载在基金销售机构网站或营业网点；基金托管人应当同时将《基金合同》、托管协议登载在规定网站上。

#### （二）《基金合同》生效公告

基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日在规定报刊和规定网站上登载《基金合同》生效公告。

《基金合同》生效公告中将说明基金募集情况及基金管理人、基金管理人股东、基金管理人高级管理人员或基金经理等人员持有的基金份额、承诺持有的期限等情况。

#### （三）基金净值信息

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

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

#### （四）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各类基金份额的基金份额申购、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。

#### （五）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（含资产组合季度报告）

基金管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成基金年度报告，将

年度报告登载在规定网站上，并将年度报告提示性公告登载在规定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过符合《证券法》规定的会计师事务所审计。

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

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

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

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

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

#### （六）托管人履职报告

1、托管人履职报告作为管理人季度报告、年度报告内容的一部分，由托管人完成管理人季度报告、年度报告的复核工作后，确定托管人履职报告内容并向管理人反馈，同时在管理人、托管人协商一致的季度报告、年度报告上盖章确认，由管理人根据合同约定的方式向投资者披露。托管人履职报告内容包括托管人履职情况、对管理人投资运作的监督情况及有关报告财务数据的复核意见等。

2、管理人应当在每季度结束后 20 日内向托管人提供其编制的季度报告、当期财务会计报告（如有）供托管人复核，托管人复核管理人季度报告、当期财务会计报告中的财务数据后，于 10 日内向管理人反馈复核意见。

3、管理人应当在每年度结束后两个月内向托管人提供其编制的年度报告、当期财务会计报告供托管人复核，托管人复核管理人年度报告、当期财务会计报告中的财务数据后，于一个月内向管理人反馈复核意见。

4、因基金合同生效不足 2 个月，管理人未编制当期的季度报告、中期报告或年度报告的，托管人不编制当期托管人履职报告。

#### （七）临时报告

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

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

- 1、基金份额持有人大会的召开及决定的事项；
- 2、《基金合同》终止、基金清算；
- 3、转换基金运作方式、基金合并；
- 4、更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；
- 5、基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；
- 6、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- 7、基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、变更基金管理人的实际控制人；
- 8、基金募集期延长或提前结束募集；
- 9、基金管理人的高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；
- 10、基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十；
- 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、涉及基金财产、基金管理业务、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，但中国证监会另有规定的除外；

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、某一类别基金份额净值计价错误达该类别基金份额净值百分之零点五；

18、本基金开始办理申购、赎回；

19、本基金发生巨额赎回并延期办理；

20、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；

21、本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；

22、发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；

23、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；

24、调整本基金的份额类别设置或基金份额分类规则；

25、基金推出新业务或服务；

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法律法规、中国证监会规定及基金合同约定的其他事项。

#### （八）澄清公告

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

#### （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，并按照《信息披露办法》的规定予以公告。

#### （十）投资资产支持证券的信息披露

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。

#### （十一）投资港股通标的股票的信息披露

基金管理人应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露参与港股通交易的相关情况。若法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

#### （十二）投资股指期货的信息披露

基金管理人应在季度报告、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）投资国债期货的信息披露

基金管理人应在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露的国债期货交易情况，应当包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示国债期货交易对本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。

#### （十四）参与融资业务的信息披露

本基金参与融资业务，基金管理人应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露参与融资业务情况，包括投资策略、业务开展情况、损益情况、风险及其管理情况等。

#### （十五）投资流通受限证券的信息披露

本基金投资流通受限证券，基金管理人应在本基金投资非公开发行股票后两个交易日内，在中国证监会规定媒介披露所投资非公开发行股票的名称、数量、总成本、账面价值，以及总成本和账面价值占基金资产净值的比例、锁定期等信息。

#### （十六）投资股票期权的信息披露

基金管理人应在定期信息披露文件中披露参与股票期权交易的有关情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标、估值方法等，并充分揭示股票期权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。

(十七) 基金管理人应当按照相关法律法规的规定和监管机构的要求, 在基金合同生效公告、基金定期报告中披露发起资金提供方持有基金的份额、期限及期间的变动情况。

#### (十八) 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规定网站上, 并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

#### (十九) 实施侧袋机制期间的信息披露

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

#### (二十) 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。

基金管理人、基金托管人应加强对未公开披露基金信息的管控。基金管理人、基金托管人及相关从业人员不得泄露未公开披露的基金信息。

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、各类基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告、更新的招募说明书、基金产品资料概要、基金清算报告等公开披露的相关基金信息进行复核、审查, 并向基金管理人进行书面或电子确认。

基金管理人、基金托管人应当在规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。

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。

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

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

#### 七、暂停或延迟信息披露的情形

当出现下述情况时，基金管理人和基金托管人协商一致的，可暂停或延迟披露与基金净值相关的信息：

1、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

2、发生暂停估值的情形；

3、基金投资所涉及的证券/期货交易所或外汇市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

4、法律法规规定、中国证监会或《基金合同》认定的其他情形。

#### 八、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，以供社会公众查阅、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后及时发布临时公告，同时在启用侧袋机制当日报中国证监会及公司所在地中国证监会派出机构备案，并在五个工作日内聘请符合《证券法》规定的会计师事务所进行审计并披露专项审计意见。

### 二、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政策，具体事项届时将由基金管理人在相关公告中规定。

3、当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上的，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停基金估值，并暂停接受基金申购赎回申请或延缓支付赎回款项。

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

5、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。

基金管理人不得在侧袋账户中进行除特定资产处置变现以外的其他投资操作。

## （四）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，基金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，基金管理人应当按照招募说明书“基金的信息披露”部分规定的基金净值信息披露方式和频率披露主袋账户份额的基金净值信息，并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

特定资产恢复流动性后，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。若侧袋账户资产无法一次性完成处置变现，基金管理人在每次处置变现后均应按照相关法律法规要求及时发布临时公告。

#### （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《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《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《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、投资于本基金的主要风险有：

### （一）市场风险

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

#### 1、政策风险

因国家宏观政策（如货币政策、财政政策、产业政策、地区发展政策等）和证券市场监管政策发生变化，导致市场价格波动而产生风险。

#### 2、利率风险

利率风险主要是指因金融市场利率的波动而导致证券市场价格和收益率变动的风险。利率直接影响着债券的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。本基金可投资于股票和债券，其收益水平可能会受到利率变化的影响。

#### 3、再投资风险

债券、票据偿付本息后以及回购到期后可能由于市场利率的下降面临资金再投资的收益率低于原来利率，由此本基金面临再投资风险。

#### 4、购买力风险

如果发生通货膨胀，基金投资于证券所获得的收益可能会被通货膨胀抵消，从而影响基金资产的实际收益率。

#### 5、信用风险

信用风险主要指债券、票据发行主体、存款银行信用状况可能恶化而可能产生的到期不能兑付的风险。

#### 6、公司经营风险

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

## 7、经济周期风险

证券市场受宏观经济运行的影响，而经济运行具有周期性的特点，宏观经济运行状况将对证券市场的收益水平产生影响，从而对基金收益造成影响。

### （二）管理风险

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

2、基金管理人的管理手段和管理技术等因素的变化也会影响基金收益水平。

### （三）流动性风险

基金的流动性风险主要表现在两方面：一是基金管理人建仓时或为实现收益而进行组合调整时，可能由于市场流动性相对不足而无法按预期的价格将股票、债券或其他资产买进或卖出；二是本基金属于开放式基金，在基金的所有开放日，基金管理人都有义务接受投资人的赎回。为应付投资者的赎回，基金管理人的现金支付出现困难，被迫在不适当的价格大量抛售股票、债券或其他资产。两者均可能使基金净值受到不利影响。

#### 1、基金申购、赎回安排

本基金采用开放方式运作，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、北京证券交易所的正常交易日的交易时间（若本基金参与港股通交易且该工作日为非港股通交易日时，则基金管理人可根据实际情况决定本基金是否开放申购、赎回及转换业务，具体以届时提前发布的公告为准）。基金管理人自基金合同生效之日起不超过3个月开始办理申购和赎回，具体业务办理时间在相关公告中规定。

在申购、赎回安排方面，本基金将加强对开放式基金申购环节的管理，合理控制基金份额持有人集中度，审慎确认大额申购申请，在当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人将采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施对基金规模予以控制，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。具体见基金管理人相关公告。

此外，当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定

价机制以确保基金估值的公平性；当特定资产占前一估值日基金资产净值 50% 以上的，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停基金估值，并暂停接受基金申购赎回申请或延缓支付赎回款项。投资者应注意本基金的申购赎回安排和相应的流动性风险，合理安排投资计划。

本基金的申购、赎回安排详见本招募说明书“第八部分基金份额的申购与赎回”章节。

## 2、拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

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

## 3、巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

基金出现巨额赎回情形下，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况或净赎回份额占比情况决定全额赎回或部分延期赎回。同时，如本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人在单个开放日申请赎回基金份额超过基金总份额一定比例以上的，基金管理人有权对其采取延期办理赎回申请的措施。

4、实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响在市场大幅波动、流动性枯竭等极端情况下发生无法应对巨额赎回的情形时，基金管理人将以保障基金份额持有人合法权益为前提，严格按照法律法规及基金合同的规定，谨慎选取延期办理巨额赎回申请、暂停接受赎回申请、延缓支付赎回款项、收取短期赎回费、摆动定价、暂停基金估值、启用侧袋机制等流动性风险管理工具作为辅助措施。对于各类流动性风险管理工具的使用，基金管理人将依照严格审批、审慎决策的原则，及时有效地对风险进行监测和评估，使用前经过内部审批程序并与基金托管人协商一致。在实际运用各类流动性风险管理工具时，基金份额持有人的赎回申请、赎回款项支付等可能受到相应影响，基金管理人将严格依照法律法规及基金合同的约定进行操作，全面保障基金份额持有人的合法权益。

（1）延期办理巨额赎回申请。基金份额持有人的赎回申请可能被延期办理，



部分或全部赎回申请可能被拒绝，同时基金份额持有人完成基金赎回时的基金份额净值可能与其提交赎回申请时的基金份额净值不同。

(2) 暂停接受赎回申请。基金份额持有人可能存在当日无法赎回其持有的基金份额的风险。

(3) 延缓支付赎回款项。赎回款支付时间将后延，基金份额持有人可能存在不能及时取得赎回款项的风险，可能对基金份额持有人的资金安排带来不利影响。

(4) 收取短期赎回费。本基金对持续持有期少于7日的投资人，收取1.5%的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产。短期赎回费的收取将使得基金份额持有人在持续持有期限少于7日时会承担较高的赎回费。

(5) 摆动定价。在发生大额申购或赎回情形下，如果基金管理人采用摆动定价工具，基金份额持有人当日赎回的基金份额净值可能会被调减。当日参与申购和赎回交易的投资者存在承担申购或者赎回产生的交易及其他成本的风险。

(6) 暂停基金估值。在此情形下，投资人没有可供参考的基金份额净值，一方面基金份额持有人将无法知晓本基金的基金份额净值，另一方面基金将延缓支付赎回款项或暂停接受基金份额持有人的申购、赎回申请，延缓支付赎回款项可能影响基金份额持有人的资金安排，暂停接受基金申购、赎回申请将导致基金份额持有人无法申购或赎回本基金。

#### 5、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。特定资产恢复流动性后，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。

#### (四) 本基金的特定风险

本基金为股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

1、通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港市场股票的风险

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所（以下简称：“香港联交所”或“联交所”）上市的股票，除与其他投资于内地市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还面临港股通机制下因投资环境、投资者结构、投资标的构成、市场制度以及交易规则等差异所带来的特有风险，包括但不限于：

#### （1）市场联动的风险

与内地 A 股市场相比，港股市场上外汇资金流动更为自由，海外资金的流动对港股价格的影响巨大，港股价格与海外资金流动表现出高度相关性，本基金在参与港股市场投资时受到全球宏观经济和货币政策变动等因素所导致的系统风险相对更大。

#### （2）股价波动的风险

港股市场实行 T+0 回转交易机制（即当日买入的股票，在交收前可以于当日卖出），同时对个股不设涨跌幅限制，加之香港市场结构性产品和衍生品种类相对丰富以及做空机制的存在；港股股价受到意外事件影响可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动，本基金持仓的波动风险可能相对较大。

#### （3）汇率风险

在现行港股通机制下，港股的买卖是以港币报价，以人民币进行支付，并且资金不留港（港股交易后结算的净资金余额头寸以换汇的方式兑换为人民币），故本基金每日的港股买卖结算将进行相应的港币兑人民币的换汇操作，本基金承担港元对人民币汇率波动的风险，以及因汇率大幅波动引起账户透支的风险。

另外本基金对港股买卖每日结算中所采用的报价汇率可能存在报价差异，本基金可能需额外承担买卖结算汇率报价点差所带来的损失；同时根据港股通的规则设定，本基金在每日买卖港股申请时将参考汇率买入/卖出价冻结相应的资金，该参考汇率买入价和卖出价设定上存在比例差异，以抵御该日汇率波动而带来的结算风险，本基金将因此而遭遇资金被额外占用进而降低基金投资效率的风险。

#### （4）港股通额度限制

现行的港股通规则，对港股通设有总额度以及每日额度上限的限制；本基

金可能因为港股通市场总额度或每日额度不足，而不能买入看好之投资标的进而错失投资机会的风险。

#### （5）港股通可投资标的的范围调整带来的风险

现行的港股通规则，对港股通下可投资的港股范围进行了限制，并定期或不定期根据范围限制规则对具体的可投资标的进行调整，对于调出在投资范围的港股，只能卖出不能买入；本基金可能因为港股通可投资标的的范围的调整而不能及时买入看好的投资标的，而错失投资机会的风险。

#### （6）港股通交易日设定的风险

根据现行的港股通规则，只有沪港两地均为交易日且能够满足结算安排的交易日才为港股通交易日，存在港股通交易日不连贯的情形。

如内地市场因放假等原因休市而香港市场照常交易但港股通不能如常进行交易，将导致基金所持的港股组合在后续港股通交易日开市交易中集中体现市场反应而造成其价格波动骤然增大，进而导致本基金所持港股组合在资产估值上出现波动增大的风险。

如在内地市场开市而香港市场休市的情形下，港股通也不能正常交易，本基金所持港股将不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险等。

#### （7）交收制度带来的基金流动性风险

由于香港市场实行 T+2 日（T 日买卖股票，资金和股票在 T+2 日才进行交收）的交收安排，本基金在 T 日（港股通交易日）卖出股票，T+2 日（港股通交易日，即为卖出当日之后第二个港股通交易日）才能在香港市场完成清算交收，卖出的资金在 T+3 日才能回到人民币资金账户。因此交收制度的不同以及港股通交易日的设定原因，本基金可能面临卖出港股后资金不能及时到账，而造成支付赎回款日期比正常情况延后而给投资者带来流动性风险，同时也存在不能及时调整基金资产组合中 A 股和港股投资比例，造成比例超标的风险。

#### （8）港股通下对公司行为的处理规则带来的风险

根据现行的港股通规则，本基金因所持港股通股票权益分派、转换、上市公司被收购等情形或者异常情况，所取得的港股通股票以外的香港联交所上市证券，只能通过港股通卖出，但不得买入；因港股通股票权益分派或者转换等情形取得的香港联交所上市股票的认购权利在联交所上市的，可以通过港股通

卖出，但不得行权；因港股通股票权益分派、转换或者上市公司被收购等所取得的非联交所上市证券，可以享有相关权益，但不得通过港股通买入或卖出。

本基金存在因上述规则，利益得不到最大化甚至受损的风险。

#### （9）香港联合交易所停牌、退市等制度性差异带来的风险

香港联交所规定，在交易所认为所要求的停牌合理而且必要时，上市公司方可采取停牌措施。此外，不同于内地 A 股市场的停牌制度，联交所对停牌的具体时长并没有量化规定，只是确定了“尽量缩短停牌时间”的原则；同时与 A 股市场存在退市可能的上市公司根据其财务状况在证券简称前加入相应标记(例如，ST 及\*ST 等标记)以警示投资者风险的做法不同，在香港联交所市场没有风险警示板，联交所采用非量化的退市标准且在上市公司退市过程中拥有相对较大的主导权，使得联交所上市公司的退市情形较 A 股市场相对复杂。

因该等制度性差异，本基金可能存在因所持个股遭遇非预期性的停牌甚至退市而给基金带来损失的风险。

#### （10）港股通规则变动带来的风险

本基金是在港股通机制和规则下参与香港联交所证券的投资，受港股通规则的限制和影响；本基金存在因港股通规则变动而带来基金投资受阻或所持资产组合价值发生波动的风险。

#### （11）其他可能的风险

除上述显著风险外，本基金参与港股通投资，还可能面临的其他风险，包括但不限于：

①除因股票交易而发生的佣金、交易征费、交易费、交易系统费、印花税、过户费等税费外，在不进行交易时也可能要继续缴纳证券组合费等项费用，本基金存在因费用估算不准而导致账户透支的风险；

②在香港市场，部分中小市值港股成交量则相对较少，流动较为缺乏，本基金投资此类股票可能因缺乏交易对手而面临个股流动性风险；

③在本基金参与港股通交易中若香港联交所与内地交易所的证券交易服务公司之间的报盘系统或者通信链路出现故障，可能导致 15 分钟以上不能申报和撤销申报的交易中断风险；

④存在港股通香港结算机构因极端情况下无法交付证券和资金的结算风险；

另外港股通境内结算实施分级结算原则，本基金可能面临以下风险：（一）因结算参与人未完成与中国结算的集中交收，导致本基金应收资金或证券被暂不交付或处置；（二）结算参与人对本基金出现交收违约导致本基金未能取得应收证券或资金；（三）结算参与人向中国结算发送的有关本基金的证券划付指令有误的导致本基金权益受损；（四）其他因结算参与人未遵守相关业务规则导致本基金利益受到损害的情况。

## 2、投资可转换债券和可交换债券的特定风险

可转换债券和可交换债券是指持有人可以在约定的时间内按照约定的价格将持有的债券转换为普通股票的债券，是兼具债券性质和权益性质的投资工具。可转换债券和可交换债券既面临发行人无法按期偿付本息的信用风险，也面临二级市场价格波动的风险。另外，可转债和可交换债一般具有强制赎回等条款，可能会增加相应的风险。

## 3、投资资产支持证券的特定风险

（1）与基础资产相关的风险有信用风险、现金流预测风险和原始权益人的风险。

信用风险是指被购买的基础资产的信用风险将全部从原始权益人处最终转移至资产支持证券持有人，如果借款人的履约意愿下降或履约能力恶化，将可能给资产支持证券持有人带来投资损失。

现金流预测风险是指对基础资产未来现金流的预测可能会出现一定程度的偏差，优先级资产支持证券持有人可能面临现金流预测偏差导致的资产支持证券投资风险。

原始权益人的风险，如果原始权益人转让的标的资产项下的债权存在权利瑕疵或转让资产行为不真实，将会导致资产支持证券持有人产生损失。

（2）与资产支持证券相关的风险有市场利率风险、流动性风险、评级风险、提前偿付及延期偿付风险。

市场利率将随宏观经济环境的变化而波动，利率波动可能会影响优先级收益。当市场利率上升时，资产支持证券的相对收益水平就会降低。

流动性风险指资产支持证券持有人可能面临无法在合理的时间内以公允价格出售资产支持证券而遭受损失的风险。

评级机构对资产支持证券的评级不是购买、出售或持有资产支持证券的建议，而仅是对资产支持证券预期收益和/或本金偿付的可能性作出的判断，不能保证资产支持证券的评级将一直保持在该等级，评级机构可能会根据未来具体情况撤销资产支持证券的评级或降低资产支持证券的评级。评级机构撤销或降低资产支持证券的评级可能对资产支持证券的价值带来负面影响。

提前偿付及延期偿付风险指，资产支持证券持有人可能在各档资产支持证券预期到期日之前或之后获得本金及收益偿付，导致实际投资期限短于或长于资产支持证券预期期限。

#### 4、股指期货投资风险

本基金投资于股指期货。投资于股指期货需承受市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险和法律风险等。由于股指期货通常具有杠杆效应，价格波动比标的工具更为剧烈，有时候比投资标的资产要承担更高的风险。并且由于股指期货定价复杂，不适当的估值有可能使基金资产面临损失风险。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，股价指数微小的变动就可能使投资者权益遭受较大损失。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，可能给投资带来损失。

#### 5、国债期货投资风险

本基金投资于国债期货，国债期货市场的风险类型较为复杂，涉及面广，主要包括：利率波动原因造成的市场价格风险、宏观因素和政策因素变化而引起的系统风险、市场和资金流动性原因引起的流动性风险、交易制度不完善而引发的制度性风险等。

#### 6、股票期权投资风险

本基金投资于股票期权，投资股票期权所面临的主要风险是股票期权价格波动带来的市场风险；因保证金不足、备兑证券数量不足或持仓超限而导致的强行平仓风险；股票期权具有高杠杆性，当出现不利行情时，微小的变动可能会使投资人权益遭受较大损失；包括对手方风险和连带风险在内的第三方风险；以及各类操作风险，极端情况下会给投资组合带来较大损失。

#### 7、参与融资业务的特定风险

本基金可根据法律法规和基金合同的约定参与融资业务可能会涉及合规性风险、操作风险、市场风险、流动性风险、信用风险等风险因素，主要风险类型如下：

#### （1）合规性风险

融资业务开展过程中，存在可能违反相关监管法规，从而受到监管部门处罚的风险，主要包括业务超出监管机关规定范围、风险控制指标超过监管部门规定阈值等方面。

#### （2）操作风险

操作风险指不完善的内部流程、岗位设置、系统运营或外部事件所造成融资业务损失的风险，主要包括信息系统风险和人员风险等。

#### （3）融资业务的特定风险

融资业务属于杠杆型的产品业务，除了上述（1）、（2）中提到的合规性和操作风险外，其他的特定风险如下：

##### ①可能放大投资损失的风险

融资业务具有杠杆效应，它在放大投资收益的同时也必然放大投资风险。将股票作为担保品进行融资交易时，既需要承担原有的股票价格下跌带来的风险，又得承担融资买入股票带来的风险，同时还须支付相应的利息和费用，由此承担的风险可能远远超过普通证券交易。

##### ②利率变动带来的成本加大风险

如果在从事融资交易期间，中国人民银行规定的同期贷款基准利率调高，证券公司将相应调高融资利率，投资成本也因为利率的上调而增加，将面临融资成本增加的风险。

##### ③强制平仓风险

融资交易中，基金与证券公司间除了普通交易的委托买卖关系外，还存在着较为复杂的债权债务关系，以及由于债权债务产生的信托关系和担保关系。证券公司为保护自身债权，对基金信用账户的资产负债情况实时监控，在一定条件下（比如不能按照约定的期限清偿债务，或上市证券价格波动导致担保物价值与融资债务之间的比例低于平仓维持担保比例，且不能按照约定的时间追加担保物时等）可以对基金担保资产执行强制平仓，且平仓的品种、数量、价

格、时机将不受基金的控制，平仓的数额可能超过全部负债，由此给基金带来损失。

#### ④外部监管风险

在融资交易出现异常或市场出现系统性风险时，监管部门、证券交易所和证券公司都将可能对融资交易采取相应措施，例如提高可充抵保证金证券的折算率、融资保证金比例、维持担保比例和强制平仓的条件等，以维护市场平稳运行。这些措施将可能带来杠杆效应降低、甚至提前进入追加担保物或强制平仓状态等潜在损失。

#### ⑤融资业务的流动性风险

融资业务的流动性风险主要指当基金不能按照约定的期限清偿债务，或上市证券价格波动导致担保物价值与融资债务之间的比例低于平仓维持担保比例，且不能按照约定的时间追加担保物时面临强制平仓的风险。

#### ⑥融资业务的信用风险

信用风险主要指交易对手违约产生的风险。一方面，如果证券公司没有按照融资合同的要求履行义务可能带来风险；另一方面，若在从事融资交易期间，证券公司融资业务资格、融资业务交易权限被取消或被暂停，证券公司可能无法履约，则基金可能会面临一定的风险。

### 8、投资流通受限证券的特定风险

基金投资流通受限证券将面临证券市场流动性风险，主要表现在几个方面：基金建仓困难，或建仓成本很高；基金资产不能迅速转变成现金，或变现成本很高；不能应付可能出现的投资者大额赎回的风险；证券投资中个券和个股的流动性风险等。

### 9、投资存托凭证的风险

本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他仅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；存托协议自动约束存托凭证持有人的风险；因多地上市造成存托凭



证价格差异以及波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；存托凭证退市的风险；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；境内外证券交易机制、法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险。

#### （五）基金管理人职责终止风险

因违法经营或者出现重大风险等情况，可能发生基金管理人被依法取消基金管理资格或依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等情况。在基金管理人职责终止的情况下，投资者面临基金管理人变更或基金合同终止的风险。基金管理人职责终止，涉及基金管理人、临时基金管理人、新任基金管理人之间责任划分的，相关基金管理人对各自履职行为依法承担责任。

#### （六）本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险

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

#### （七）其他风险

- 1、因技术因素而产生的风险，如电脑等技术系统的故障或差错产生的风险；
- 2、因战争、自然灾害等不可抗力导致的基金管理人、基金托管人、基金服务机构等机构无法正常工作，从而影响基金运作的风险；
- 3、因金融市场危机、代理商违约、基金托管人违约等超出基金管理人自身控制能力的因素出现，可能导致基金或者基金份额持有人利益受损的风险；
- 4、因固定收益类金融工具主要在场外市场进行交易，场外市场交易现阶段自动化程度较场内市场低，本基金在投资运作过程中可能面临操作风险；
- 5、其他意外导致的风险。

## 二、声明

- 1、投资者投资于本基金，须自行承担投资风险；
- 2、除基金管理人直接办理本基金的销售外，本基金还通过基金销售机构代理销售，基金管理人与基金销售机构都不能保证其收益或本金安全。

## 第十八部分 基金合同的变更、终止与基金财产清算

### 一、《基金合同》的变更

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

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

### 二、《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：

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

### 三、基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起30个工作日内成立基金财产清算小组，基金管理人或临时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财产清算。

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或临时基金管理人、基金托管人、符合《证券法》规定的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

在基金财产清算过程中，基金管理人和基金托管人应各自履行职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

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

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

#### 四、清算费用

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

#### 五、基金财产清算剩余资产的分配

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

#### 六、基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经符合《证券法》规定的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算小组进行公告，基金财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

#### 七、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存不低于法律法规规定的最低期限。

## 第十九部分 基金合同摘要

### 一、基金管理人、基金托管人和基金份额持有人的权利、义务

#### (一) 基金管理人的权利与义务

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

- (1) 依法募集资金；
- (2) 自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
- (3) 依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- (4) 销售基金份额；
- (5) 按照规定召集基金份额持有人大会；
- (6) 依据《基金合同》及有关法律规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- (7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- (8) 选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；
- (9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；
- (10) 依据《基金合同》及有关法律规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、赎回或转换申请；
- (12) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使相关权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- (13) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；
- (14) 以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

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

(16) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、定期定额投资和非交易过户、转托管和收益分配等业务规则；

(17) 委托第三方机构办理本基金的交易、清算、估值、结算等业务；

(18) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

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

(2) 办理基金备案手续；

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

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

(5) 建立健全内部风险控制、流动性风险管理、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、中期报告和年度基金报告；

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

(12) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金

法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露，但向审计、法律等外部专业顾问提供的情况除外；

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

(14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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

(16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料，保存期限不低于法律法规的规定；

(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前提下得到有关资料的复印件；

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

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

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

(21) 监督基金托管人按法律法规、《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。

## (二) 基金托管人的权利与义务

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

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

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

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

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

(5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

(6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

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

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

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

(5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；



- (6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户等投资所需账户，按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
- (7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露，但向审计、法律等外部专业顾问提供的情况除外；
- (8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、各类基金份额净值、基金份额申购、赎回价格；
- (9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
- (10) 对基金财务会计报告、季度报告、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，保存期限不低于法律法规的规定；
- (12) 从基金管理人或其委托的登记机构处接收并保存基金份额持有人名册；
- (13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
- (14) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；
- (15) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
- (16) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；
- (17) 参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- (18) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行业监督管理机构，并通知基金管理人；
- (19) 因违反《基金合同》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿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，基金管理人因违反法律法规或《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。

(三) 基金份额持有人

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

除法律法规另有规定或基金合同另有约定外，同一类别每份基金份额具有同等的合法权益。本基金A类基金份额与C类基金份额由于基金份额净值的不同，基金收益分配的金额以及参与清算后的剩余基金财产分配的数量将可能有所不同。

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

(1) 分享基金财产收益；

(2) 参与分配清算后的剩余基金财产；

(3) 依法申请赎回或者转让其持有的基金份额；

(4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会；

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

(6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；

(7) 监督基金管理人的投资运作；

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

(9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

(1) 认真阅读并遵守《基金合同》、招募说明书、基金产品资料概要等信息披露文件；

(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) 交纳基金认购、申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用，并主动查询交易申请的确认情况，妥善行使合法权利；

(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) 发起资金提供方持有的使用发起资金认购的基金份额的期限自基金合同生效日起不少于3年（基金合同生效不满3年提前终止的情况除外），法律法规或监管机构另有规定的除外；

(10) 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

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。

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

### (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，但法律法规、中国证监会或《基金合同》另有规定的除外：

(1) 终止《基金合同》；

(2) 更换基金管理人；

(3) 更换基金托管人；

(4) 转换基金运作方式；

- (5) 调整基金管理人、基金托管人的报酬标准或提高销售服务费；
- (6) 变更基金类别；
- (7) 本基金与其他基金的合并；
- (8) 变更基金投资目标、范围或策略；
- (9) 变更基金份额持有人大会程序；
- (10) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- (11) 单独或合计持有本基金总份额10%以上（含10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；
- (12) 对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；
- (13) 法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

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

- (1) 法律法规要求增加的基金费用的收取；
- (2) 在法律法规规定和《基金合同》约定的范围内且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，调整本基金的申购费率、调低赎回费率及销售服务费率、变更或增加收费方式；
- (3) 在法律法规规定和《基金合同》约定的范围内且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，增加、减少或调整基金份额类别设置及对基金份额分类办法、规则进行调整；
- (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) 履行适当程序后，本基金推出新业务或服务；
- (7) 基金管理人、销售机构、基金登记机构调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则；
- (8) 按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的其

他情形。

## （二）会议召集人及召集方式

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

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。

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

4、单独或合计代表基金份额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，单独或合计代表基金份额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、单独或合计代表基金份额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，召集人应当于会议召开前至少提前30日，在规定媒介公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

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

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

3、如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒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、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或会议通知载明的其他方式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式或会议通知载明的其他方式进行表决。

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

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

(4) 上述第（3）项中直接出具表决意见的基金份额持有人或受托代表他人出具表决意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具表决意

见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并与基金登记机构记录相符。

3、在法律法规和监管机关允许的情况下，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，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

4、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，具体方式由会议召集人在会议通知中列明。

#### （五）议事内容与程序

##### 1、议事内容及提案权

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

基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日基金总份额10%（含10%）以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案。

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

##### 2、议事程序

###### （1）现场开会

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



额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

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

## （2）通讯开会

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

## （六）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

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

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。除法律法规、监管机构另有规定或《基金合同》另有约定外，转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》、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，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

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

在不违背上述规则的前提下，具体规则以召集人发布的基金份额持有人大会通知为准。

### （七）计票

#### 1、现场开会

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

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

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

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

#### 2、通讯开会

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

### （八）生效与公告

基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起2日内在规定媒介上公告。如果采用

通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

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

（九）实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定

若本基金实施侧袋机制，则相关基金份额或表决权的比例指主袋份额持有人和侧袋份额持有人分别持有或代表的基金份额或表决权均需符合该等比例，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表决意见或授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日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50%以上（含50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人；

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

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

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同一类别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或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，或法律法规或监管规则增加新的持有人大会机制的，基金管理人与基金托管人协商一致并提前公告后，可直接对本部分内容进行修改、调整或补充，无需召开基金份额持有人大会审议。

### 三、基金的收益与分配

#### (一) 基金利润的构成

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

#### (二) 基金可供分配利润

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

#### (三) 基金收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以届时基金管理人发布的公告为准。若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后各类基金份额净值均不能低于面值，即基金收益分配基准日的该类别基金份额净值减去该类别每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、由于本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同，基金管理人可对各类别基金份额分别制定收益分配方案。本基金同一基金份额类别内的每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规及基金合同约定，且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可与基金托管人协商一致并按照监管部门要求履行适当程序后对基金收益分配有关业务规则进行调整，无需召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在规定媒介公告。

#### （四）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截至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，依照《信息披露办法》在规定媒介公告。

#### （六）基金收益分配中发生的费用

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

#### （七）实施侧袋机制期间的收益分配

本基金实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配，详见招募说明书的规定。

### 四、与基金财产管理、运作有关费用的提取、支付方式与比例

#### （一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、C类基金份额的销售服务费；
- 4、除法律法规、中国证监会另有规定外，《基金合同》生效后与基金相关

的信息披露费用；

5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、审计费、律师费、公证费、仲裁费和诉讼费；

6、基金份额持有人大会费用；

7、基金的证券、期货交易和结算费用；

8、基金的银行汇划费用；

9、基金的相关账户开户及维护费用；

10、因投资港股通标的股票而产生的各项合理费用；

11、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

## （二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.50%的年费率计提。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

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给管理人。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，支付日期顺延至最近可支付日支付。

### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起5个工作

日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，支付日期顺延至最近可支付日支付。

### 3、C类基金份额的销售服务费

本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年费率为0.50%，按前一日C类基金份额基金资产净值的0.50%年费率计提。

销售服务费计算方法如下：

$$H=E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为前一日C类基金份额基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，支付日期顺延至最近可支付日支付。

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

## 五、基金的投资

### （一）投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括创业板及其他经中国证监会核准、注册上市的股票以及存托凭证）、沪港通允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票及包括深港通允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（简称“港股通标的股票”）、债券（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、地方政府债券、政府支持机构债券、政府支持债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、金融衍生品（包括股指期货、国债期货、股票期权）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）。

本基金将按照法律法规相关规定参与融资业务。

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（包括国内依法发行上市的股票、存托凭证及港股通标的股票）投资占基金资产的比例为80%-95%，其中对港股通标的股票的投资比例不超过股票资产的50%，投资于低碳经济主题相关上市公司股票的比例不低于非现金基金资产的80%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或对投资比例要求有变更的，基金管理人在履行适当程序后，可以做出相应调整。

## （二）投资限制

### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金投资于股票（含存托凭证）的比例占基金资产的80%-95%，其中投资于港股通标的股票的比例不得超过股票资产的50%，投资于低碳经济主题相关上市公司股票的比例不低于非现金基金资产的80%；

（2）本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，持有的现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

（3）本基金持有一家公司发行的证券（含存托凭证，同一家公司在境内和香港同时上市的A股和H股合并计算），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证券投资基金持有一家公司发行的证券（含存托凭证，同一家公司在境内和香港同时上市的A股和H股合并计算），不超过该证券的10%，但完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金品种可以不受此条款规定的比例限制；

（5）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%；



- (6) 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%；
- (7) 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%；
- (8) 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%；
- (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) 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；
- (11) 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%，进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为1年，债券回购到期后不得展期；
- (12) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合该比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；
- (13) 本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%；完全按照有关指数的构成比例进行投资的部分不受此条款规定的比例限制；
- (14) 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本基金合同约定的投资范围保持一致；
- (15) 本基金资产总值不超过基金资产净值的140%；
- (16) 本基金参与股指期货和国债期货交易时，将依据下列标准建构组合：
- 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%；本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的15%；

2) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货、国债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、存托凭证、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、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，持有的卖出股指期货合约价值不得超过本基金持有的股票总市值的20%；本基金在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的30%；

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

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

(17) 本基金参与融资的，每个交易日日终，本基金持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的95%；

(18) 本基金参与股票期权交易的，因未平仓的期权合约支付和收取的权利金总额不得超过基金资产净值的10%；开仓卖出认购期权的，应持有足额标的证券；开仓卖出认沽期权的，应持有合约行权所需的全额现金或交易所规则认可的可冲抵期权保证金的现金等价物；未平仓的期权合约面值不得超过基金资产净值的20%。其中，合约面值按照行权价乘以合约乘数计算；基金投资股票期权应符合《基金合同》约定的比例限制（如股票仓位、个股占比等）、投资目标和风险收益特征；

(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) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。除上述（2）、（9）、（12）、（14）情形之外，因证券或期货市场波动、

证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定的投资比例的，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、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或调整上述限制，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以调整后的规定为准，无需另行召开基金份额持有人大会。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

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

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

法律、行政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以调整后的规定为

准，不需经基金份额持有人大会审议。

## 六、基金资产估值

### （一）估值日

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

### （二）估值对象

基金所拥有的股票、存托凭证、期货合约、期权合约、资产支持证券、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

### （三）估值原则

基金管理人在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，应符合《企业会计准则》、监管部门有关规定。

1、对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会计准则规定的例外情况外，应将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

2、对不存在活跃市场的投资品种，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

3、如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上的，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### （四）估值方法

##### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

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

（2）交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种（另有规定的除外），选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值，具体估值机构由基金管理人与基金托管人另行协商约定；

（3）交易所上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种（另有规定的除外），选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价进行估值，具体估值机构由基金管理人与基金托管人另行协商约定；

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

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

##### 2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

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

(3) 对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为估值日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表估值日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认估值日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，应采用估值技术确定其公允价值；

(4) 在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

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

4、同一证券同时在两个或两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。

5、同业存单按估值日第三方估值机构提供的估值净价估值；选定的第三方估值机构未提供估值价格的，按成本估值。

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

7、银行存款、债券、回购等计息资产按照约定利率在持有期内逐日计提应收、应付利息，在结息日以实收、实付利息入账。

8、本基金参与融资业务的，应参照相关法律法规及行业协会的相关规定进行估值，确保估值的公允性。

9、估值计算中涉及港币或其他外币币种对人民币汇率的，将依据下列信息提供机构所提供的汇率为基准：当日中国人民银行或其授权机构公布的人民币

汇率的中间价。

10、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。

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

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

13、其他资产按法律法规或监管机构有关规定进行估值。

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

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

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，基金托管人承担复核责任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致意见的，以基金管理人的计算结果为准。

#### （五）估值程序

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

基金管理人于每个工作日计算基金资产净值及各类基金份额净值，并按规定公告。

2、基金管理人应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本基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将各类基金份额净值结果以双方认可的方式发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人按规定对外公布。

### （六）暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场或外汇市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

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

4、法律法规规定、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

### （七）基金净值的确认

基金净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的基金资产净值和各类基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人依据基金合同和相关法律法规的规定予以公布。

## 七、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### （一）《基金合同》的变更

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

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

### （二）《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：

1、基金份额持有人大会决定终止的；

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

3、《基金合同》约定的其他情形；

4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### （三）基金财产的清算



1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起30个工作日内成立基金财产清算小组，基金管理人或临时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财产清算。

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或临时基金管理人、基金托管人、符合《证券法》规定的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

在基金财产清算过程中，基金管理人和基金托管人应各自履行职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行本基金合同和托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

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

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

(四) 清算费用

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

(五) 基金财产清算剩余资产的分配

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

#### （六）基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经符合《证券法》规定的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算小组进行公告，基金财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

#### （七）基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存不低于法律法规规定的最低期限。

#### 八、争议的处理和适用的法律

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

争议处理期间，基金管理人、基金托管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（为本基金合同之目的，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区法律）管辖并从其解释。

#### 九、基金合同存放地和投资者取得合同的方式

《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 托管协议摘要

### 一、基金托管协议当事人

#### （一）基金管理人

名称：易米基金管理有限公司

住所：上海市虹口区保定路 450 号 9 幢 320 室

法定代表人：李毅

成立日期：2017 年 5 月 24 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监许可[2020]1577 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：13,000 万元人民币

存续期间：持续经营

#### （二）基金托管人

名称：兴业银行股份有限公司（简称：兴业银行）

注册地址：福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦

法定代表人：吕家进

邮政编码：350013

成立日期：1988 年 8 月 22 日

批准设立机关和批准设立文号：中国人民银行总行，银复〔1988〕347 号

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基金字〔2005〕74 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：207.74 亿元人民币

存续期间：持续经营

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；代理发行股票以外的有价证券；买卖、代理买卖股票以外的有价证券；资产托管业务；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；结汇、售汇业务；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；财务顾问、资信调查、咨询、见证业务；经中

国银行业监督管理机构批准的其他业务（以上范围凡涉及国家专项专营规定的从其规定）。

## 二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

（一）基金托管人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。

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（包括创业板及其他经中国证监会核准、注册上市的股票以及存托凭证）、沪港通允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票及包括深港通允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（简称“港股通标的股票”）、债券（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、地方政府债券、政府支持机构债券、政府支持债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、金融衍生品（包括股指期货、国债期货、股票期权）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）。

本基金将按照法律法规相关规定参与融资业务。

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（包括国内依法发行上市的股票、存托凭证及港股通标的股票）投资占基金资产的比例为 80%-95%，其中对港股通标的股票的投资比例不超过股票资产的 50%，投资于低碳经济主题相关上市公司股票的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或对投资比例要求有变更的，基金管理人在履行适当程序后，可以做出相应调整。

（二）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、本基金投资于股票（含存托凭证）的比例占基金资产的 80%-95%，其中投资于港股通标的股票的比例不得超过股票资产的 50%，投资于低碳经济主题相关上市公司股票的比例不低于非现金基金资产的 80%；

2、本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，持有的现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

3、本基金持有一家公司发行的证券（含存托凭证，同一家公司在境内和香港同时上市的 A 股和 H 股合并计算），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证券投资基金持有一家公司发行的证券（含存托凭证，同一家公司在境内和香港同时上市的 A 股和 H 股合并计算），不超过该证券的 10%，但完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金品种可以不受此条款规定的比例限制；

5、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%；

6、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%；

7、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%；

8、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%；

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、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；

11、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%，进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

12、本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值

的 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合该比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

13、本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 30%；完全按照有关指数的构成比例进行投资的部分不受此条款规定的比例限制；

14、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；

15、本基金资产总值不超过基金资产净值的 140%；

16、本基金参与股指期货和国债期货交易时，将依据下列标准建构组合：

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

(2) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货、国债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、存托凭证、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、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，持有的卖出股指期货合约价值不得超过本基金持有的股票总市值的 20%；本基金在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%；

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

(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%；本基金在任何交易日内交易（不

包括平仓)的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的30%;

17、本基金参与融资的,每个交易日日终,本基金持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的95%;

18、本基金参与股票期权交易的,因未平仓的期权合约支付和收取的权利金总额不得超过基金资产净值的10%;开仓卖出认购期权的,应持有足额标的证券;开仓卖出认沽期权的,应持有合约行权所需的全额现金或交易所规则认可的可冲抵期权保证金的现金等价物;未平仓的期权合约面值不得超过基金资产净值的20%。其中,合约面值按照行权价乘以合约乘数计算;基金投资股票期权应符合《基金合同》约定的比例限制(如股票仓位、个股占比等)、投资目标和风险收益特征;

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、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述2、9、12、14情形之外,因证券或期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定的投资比例的,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、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或调整上述限制,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以调整后的规定为准,无需另行召开基金份额持有人大会。

(三)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(十)款基金投资禁止行为进行监督。基金托管人通过事后监督方式对基金管理人基金投资禁止行为进行监督。

法律、行政法规或监管部门取消或变更上述限制,如适用于本基金,基金

管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准，不需经基金份额持有人大会审议。

（四）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符合法律法规及行业标准的、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。基金管理人应严格按照交易对手名单的范围在银行间债券市场选择交易对手。基金托管人监督基金管理人是否按事前提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易，如基金管理人在基金首次投资银行间债券市场之前仍未向基金托管人提供银行间债券市场交易对手名单的，视为基金管理人认可全市场交易对手。基金管理人可以每半年对银行间债券市场交易对手名单及结算方式进行更新，新名单确定前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。如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及结算方式的，应向基金托管人说明理由，并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，并负责处理因交易对手不履行合同而造成的纠纷，基金托管人不承担由此造成的任何法律责任及损失。若未履约的交易对手在基金托管人与基金管理人确定的时间前仍未承担违约责任及其他相关法律责任的，基金管理人有权向相关交易对手追偿，基金托管人应予以必要的协助与配合。基金托管人根据银行间债券市场成交单对本基金银行间债券交易的交易对手及其结算方式进行监督。如基金托管人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，基金托管人应及时书面或以双方认可的其他方式提醒基金管理人，经提醒后仍未改正，造成基金财产损失的，基金托管人不承担由此造成的相应损失和责任。如果基金托管人未能切实履行监督职责，导致基金出现风险或造成基金资产损失的，基金托管人应承担相应责任。

（五）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金管理人投资流通受限证券进行监督。

基金管理人投资流通受限证券，应事先根据中国证监会相关规定，明确基



金投资流通受限证券的比例，制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险。基金托管人对基金管理人是否遵守相关制度、流动性风险处置预案以及相关投资额度和比例等的情况进行监督。

1、本基金投资的流通受限证券须为经中国证监会批准的非公开发行股票、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。本基金不投资有锁定期但锁定期不明确的证券。

本基金投资的流通受限证券限于可由中国证券登记结算有限责任公司或中央国债登记结算有限责任公司、银行间市场清算所股份有限公司负责登记和存管，并可在证券交易所或全国银行间债券市场交易的证券。

本基金投资的流通受限证券应保证登记存管在本基金名下，基金管理人负责相关工作的落实和协调，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，造成基金托管人无法安全保管本基金资产的责任与损失，及因流通受限证券存管直接影响本基金安全的责任及损失，由基金管理人承担。

本基金投资流通受限证券，不得预付任何形式的保证金。

2、基金管理人投资非公开发行股票，应制订流动性风险处置预案并经其董事会批准。风险处置预案应包括但不限于因投资流通受限证券需要解决的基金投资比例限制失调、基金流动性困难以及相关损失的应对解决措施，以及有关异常情况的处置。基金管理人应在首次投资流通受限证券前向基金托管人提供基金投资非公开发行股票相关流动性风险处置预案。

基金管理人对本基金投资流通受限证券的流动性风险负责，确保对相关风险采取积极有效的措施，在合理的时间内有效解决基金运作的流动性问题。对本基金因投资流通受限证券导致的流动性风险，基金托管人不承担任何责任。

3、本基金投资非公开发行股票，基金管理人应至少于投资前三个工作日向基金托管人提交有关书面资料，并保证向基金托管人提供的有关资料真实、准确、完整。有关资料如有调整，基金管理人应及时提供调整后的资料。上述书

面资料包括但不限于：

(1) 中国证监会批准发行非公开发行股票批准文件。

(2) 非公开发行股票有关发行数量、发行价格、锁定期等发行资料。

(3) 非公开发行股票发行人与中国证券登记结算有限责任公司或中央国债登记结算有限责任公司签订的证券登记及服务协议。

(4) 基金拟认购的数量、价格、总成本、账面价值。

4、基金管理人应在本基金投资非公开发行股票后两个交易日内，在中国证监会规定媒介披露所投资非公开发行股票的名称、数量、总成本、账面价值，以及总成本和账面价值占基金资产净值的比例、锁定期等信息。

本基金有关投资流通受限证券比例如违反有关限制规定，在合理期限内未能进行及时调整，基金管理人应在两日内编制临时报告书，予以公告。

5、基金托管人根据有关规定有权对基金管理人进行以下事项监督：

(1) 本基金投资流通受限证券时的法律法规遵守情况。

(2) 在基金投资流通受限证券管理工作方面有关制度、流动性风险处置预案的建立与完善情况。

(3) 有关比例限制的执行情况。

(4) 信息披露情况。

6、相关法律法规对基金投资流通受限证券有新规定的，从其规定。

(六) 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。

(七) 基金托管人依据有关法律法规的规定、基金合同和本托管协议的约定对于基金关联交易进行监督。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，

并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

根据法律法规有关基金从事的关联交易的规定，基金管理人和基金托管人应事先相互提供与本机构有控股关系的股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司名单及有关关联方发行的证券名单，加盖公章并书面提交，并确保所提供的关联交易名单的真实性、完整性、全面性。基金管理人及基金托管人有责任保管真实、完整、全面的关联交易名单，并负责及时更新该名单。名单变更后基金管理人及基金托管人应及时发送另一方，另一方于2个工作日内进行回函确认已知名单的变更。一方收到另一方书面确认后，新的关联交易名单开始生效。

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

#### （八）基金托管人对基金投资银行存款进行监督。

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。基金管理人应当按照有关法规规定，与基金托管人、存款机构签订相关书面协议。基金托管人应根据有关法律法规及协议对基金银行存款业务进行监督与核查，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。

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。

基金投资银行存款的，基金管理人应根据法律法规的规定及基金合同的约定，确定符合条件的所有存款银行的名单，并及时提供给基金托管人，基金托管人应据以对基金投资银行存款的交易对手是否符合有关规定进行监督。如基金管理人在基金投资运作之前未向基金托管人提供存款银行名单的，视为基金管理人认可所有银行。

基金托管人对定期存款提前支取的损失不承担责任。

（九）基金管理人有关义务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，或就基金托管人的合理疑义进行解释或举证；对基金托管人按照法律法规、《基金合同》和本托管协议的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。

（十）若基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反《基金合同》约定的，应当立即书面或以双方认可的其他方式通知基金管理人，由此造成的相应损失不由基金托管人承担。

（十一）基金托管人发现基金管理人有关重大违规行为，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、阻挠对方根据本托管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。

（十二）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违反法律法规、基金合同和本托管协议的规定，应及时以电话提醒或书面提示等方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。基金管理人收到书面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，就基金托管人的合理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。基金管理人有关基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。如果基金托管人未能切实履行监督职责，导致基金出现风险或造成基金资产损失的，基金托管人应承担相应责任。

（十三）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监督。

### 三、基金管理人 对基金托管人的业务核查

（一）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是否安全保管基金财产、是否开立基金财产的基金托管专户、证券账户及投资所需其他账户、是否及时、准确复核基金管理人计算的基金资产净值和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，是否按照法规规定和《基金合同》规定进行相关信息披露和是否监督基金投资运作等行为。

（二）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》、本托管协议及其他有关规定时，基金管理人应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正。基金托管人收到通知后应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。

（三）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和银行业监督管理机构，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。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人有权报告中国证监会。基金管理人有权要求基金托管人赔偿基金以及基金管理人因此所遭受的损失。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，基金管理人有权报告中国证监会。

#### 四、基金财产的保管

##### （一）基金财产保管的原则

1、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人、证券/期货经纪商和基金销售机构等基金服务机构的固有财产。

2、基金托管人应安全保管基金财产。

3、基金托管人按照规定开设基金财产的基金托管专户、证券账户及投资所需其他账户。

4、基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，与基金托管人的其他业务和其他基金的托管业务实行严格的独立核算与分账管理，确保基金财产的完整与独立。

5、基金托管人按照《基金合同》和本托管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。基金托管人未经基金管理人的合法合规指令，不得自行运用、处分、分配本基金的任何资产（不包含托管资产开户银行扣收结算费和账户维护费等费用）。

6、对于因为基金认（申）购、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并配合基金管理人采取措施进行催收。基金管理人未及时催收给基金财产造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金财产的损失，基金托管人对基金管理人的追偿行为应予以必要的协助和配合。

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）募集资金的验证

1、基金募集期间募集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“基金募集专户”。该账户由基金管理人开立并管理。

2、基金募集期满或基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基

金发售时，发起资金提供方、其使用发起资金认购的金额及其承诺的持有期限符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，基金管理人应将募集的属于本基金财产的全部资金划入基金托管人为本基金开立的基金托管专户，基金托管人在收到资金当日出具书面文件确认资金到账情况。由基金管理人聘请符合《证券法》规定的会计师事务所对基金进行验资，出具验资报告，验资报告需对发起资金提供方及其持有份额进行专门说明。出具的验资报告由参加验资的 2 名以上（含 2 名）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）基金的基金托管专户的开立和管理

1、基金托管人应负责本基金的基金托管专户的开设和管理。

2、基金托管人应以本基金的名义在其营业机构开立本基金的基金托管专户，并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。本基金的一切货币收支活动，均需通过本基金的基金托管专户进行。

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

4、基金托管专户的开立和管理应符合相关法律法规、银行业监督管理机构的有关规定。

### （四）基金证券账户的开设和管理

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本基金联名的证券账户。

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

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

4、若中国证监会或其他监管机构在本托管协议订立日之后允许基金从事其他投资品种的投资业务，涉及相关账户的开立、使用的，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）债券托管账户的开立和管理

《基金合同》生效后，基金托管人根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司、银行间市场清算所股份有限公司的有关规定，以本基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司和银行间市场清算所股份有限公司开立债券托管账户、持有人账户和资金结算账户，并代表基金进行银行间市场债券的结算。基金托管人协助基金管理人完成银行间债券市场准入备案。

#### （六）基金投资银行存款账户的开立和管理

计划财产投资定期存款在存款机构开立的银行账户，包括实体或虚拟账户，其预留印鉴经各方商议后预留。本着便于计划财产的安全保管和日常监督核查的原则，存款行应尽量选择托管人经办行所在地的分支机构。对于任何的定期存款投资，管理人都必须和存款机构签订定期存款协议，约定双方的权利和义务，该协议作为划款指令附件。该协议中必须有如下明确条款：“存款证实书不得被质押或以任何方式被抵押，并不得用于转让和背书；本息到期归还或提前支取的所有款项必须划至托管资金账户（明确户名、开户行、账号等），不得划入其他任何账户。”如定期存款协议中未体现前述条款，托管人有权拒绝定期存款投资的划款指令。在取得存款证实书后，托管人保管证实书正本或者复印件。管理人应该在合理的时间内进行定期存款的投资和支取事宜，若管理人提前支取或部分提前支取定期存款，若产生息差（即本计划财产已计提的资金利息和提前支取时收到的资金利息差额），该息差的处理方法由管理人和托管人双方协商解决。

#### （七）期货账户的开设和管理

基金管理人应依据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定，开设和管理期货账户。

#### （八）证券交易资金账户的开立和管理

1、基金管理人以本基金的名义在代理证券买卖的证券经纪商处开立证券交易资金账户，用于办理基金托管人所托管的本基金在证券交易所进行证券投资所涉及的资金结算业务。



2、证券交易资金账户与基金托管专户建立三方存管关系。证券交易资金账户内的资金，只能通过证银转账方式将资金划转至基金托管专户，不得将资金划转至其他任何银行账户。

3、如因基金管理人、证券经纪商原因致使对应关系无法建立，基金托管人不承担任何责任。基金托管人不负责办理场内的证券交易资金清算，也不负责保管证券交易资金账户内存放的资金。

#### （九）其他账户的开设和管理

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协商一致后，由基金管理人或托管人负责为基金开立。新账户按有关规定使用并管理。

2、法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

#### （十）基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的有关实物证券等有价凭证由基金托管人存放于基金托管人的保管库，也可存入中央国债登记结算有限责任公司、银行间市场清算所股份有限公司、中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司或票据营业中心的代保管库，保管凭证由基金托管人持有。有价凭证的购买和转让，由基金管理人和基金托管人共同办理。属于基金托管人实际有效控制下的实物证券在基金托管人保管期间的损坏、灭失，由此产生的责任应由基金托管人承担；基金托管人对由基金托管人以外机构实际有效控制的资产不承担保管责任。

#### （十一）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应由基金管理人保管。重大合同的保管期限不低于法律法规的规定。

基金管理人应向基金托管人提供与合同原件核对一致的并加盖基金管理人公章的合同传真件或复印件，未经双方协商一致，合同原件不得转移。

### 五、基金资产净值的计算、复核与完成的时间及程序

#### （一）基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

各类基金份额净值是按照每个工作日闭市后，该类基金份额的基金资产净值除以当日该类基金份额的余额数量计算，均精确到 0.0001 元，小数点后第 5

位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。基金管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人于每个工作日计算基金资产净值及各类基金份额净值，并按规定公告。

(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，将各类基金份额净值结果以双方认可的方式发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人按规定对外公布。

#### 六、基金份额持有人名册的保管

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基金份额持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册由基金登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，基金管理人和基金托管人应分别保管基金份额持有人名册，各机构的保存期限不低于法律法规的规定。如不能妥善保管，则按相关法规承担责任。

在基金托管人要求或编制中期报告和年度报告前，基金管理人应将有关资料送交基金托管人，不得无故拒绝或延误提供，并保证其真实性、准确性和完整性。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务，法律法规或有权机关另有规定的除外。

#### 七、争议解决方式

各方当事人同意，因本托管协议而产生的或与本协议有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，任何一方均有权将争议提交上海国际经济贸易仲裁委员会，根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为上海市，仲裁裁决是终局性的，并对各方当事人具有约束力。除非仲裁裁决另有规定，仲裁费、律师费由败诉方承担。

争议处理期间，基金管理人和基金托管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。

本托管协议受中国法律（为本协议之目的，不包括香港特别行政区、澳门

特别行政区和台湾地区法律)管辖并从其解释。

## 八、基金托管协议的变更、终止与基金财产的清算

### (一) 托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致,可以对协议进行修改。修改后的新协议,其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突,并需经基金管理人、基金托管人加盖公章或合同专用章以及双方法定代表人或授权代理人签字(或盖章)确认。基金托管协议的变更报中国证监会备案。

### (二) 基金托管协议终止出现的情形

- 1、《基金合同》终止;
- 2、基金托管人解散、依法被撤销、破产,被依法取消基金托管资格或因其他事由造成其他基金托管人接管基金财产;
- 3、基金管理人解散、依法被撤销、破产,被依法取消基金管理资格或因其他事由造成其他基金管理人接管基金管理权;
- 4、发生法律法规、中国证监会或《基金合同》规定的终止事项。

### (三) 基金财产的清算

1、基金财产清算小组:自出现《基金合同》终止事由之日起30个工作日内成立基金财产清算小组,基金管理人或临时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财产清算。

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或临时基金管理人、基金托管人、符合《证券法》规定的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

在基金财产清算过程中,基金管理人和基金托管人应各自履行职责,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。

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) 基金财产清算小组成立后,由基金财产清算小组统一接管基金财产;
- (2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认;

- (3) 对基金财产进行估值和变现；
- (4) 制作清算报告；
- (5) 聘请符合《证券法》规定的会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- (6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；
- (7) 对基金剩余财产进行分配。

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

#### (四) 清算费用

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

#### (五) 基金财产清算剩余资产的分配

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

#### (六) 基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经符合《证券法》规定的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算小组进行公告，基金财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

#### (七) 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存不低于法律法规规定的最低期限。

## 第二十一部分 对基金份额持有人的服务

对于基金份额持有人和潜在投资者，基金管理人将根据具体情况提供一系列的服务，并将根据基金份额持有人的需要和市场的变化，增加或变更服务项目。主要服务内容如下：

### 一、基金份额持有人登记服务

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

### 二、交易资料的寄送

1、账户资料：基金投资者开户申请被受理的 2 个工作日后（T+2 日后），可以到销售网点查询和打印基金账户开户确认资料。

2、基金交易确认查询服务：基金投资者在交易申请被受理的 2 个工作日后（T+2 日后），可以到销售网点查询和打印该项交易的确认资料。

3、在每季度结束后的 10 个工作日内，登记机构按基金份额持有人意愿，向在该季度内有交易的基金份额持有人以书面或电子文件形式寄送季度对账单；在每年度结束后 20 个工作日内，登记机构按基金份额持有人意愿，对所有的基金份额持有人以书面或电子文件形式寄送年度对账单。

为保护环境，基金管理人积极推行“订阅电子对账单”活动，鼓励基金持有人订阅“更环保、更快捷、更私密”的电子账单代替传统的纸质账单。基金持有人可通过基金管理人官方网站 [www.yimifund.com](http://www.yimifund.com) 或客户热线电话 4006-046-899 订阅电子账单。在时机成熟时，基金管理人将采取以电子账单为主的账单服务方式，仅为坚持订阅纸质账单的客户继续提供纸质账单服务，引导基金持有人共同为保护地球绿色资源贡献一份力量。

### 三、客户服务中心电话服务

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

持有人可通过客服热线电话：4006-046-899 享受业务咨询、信息查询、服务投诉、信息定制、对账单寄送地址资料修改等专项服务。人工座席工作时间（工作日周一至周五，9:00-11:30，13:00-17:00）。

#### 四、网上交易服务

基金管理人已开通个人投资者网上交易业务。个人投资者通过基金管理人网上交易平台可以办理基金认购、申购、赎回、分红方式修改、账户资料修改、交易密码修改、交易申请查询和账户资料查询等各类业务。

在技术条件成熟时，基金管理人还将提供支持其他银行卡种的网上交易业务。

#### 五、信息定制服务

基金持有人可以登录基金管理人公司官网或者拨打客服热线电话提交信息定制申请。基金管理人通过手机短信、电子邮件或其他方式按持有人的定制提供信息。可定制的信息包括：每周基金净值、交易确认信息、分红公告等。基金管理人可以根据实际业务需要，调整定制信息的条件、方式和内容。

#### 六、投资者投诉受理服务

投资者可以通过销售机构或基金管理人客服热线电话、信函及电子邮件等形式对基金管理人或销售机构所提供的服务进行投诉。

客服热线电话投诉、电子邮件投诉、信函投诉是主要投诉受理渠道，基金管理人客户服务部负责管理投诉电话、投诉邮箱。现场投诉和意见簿投诉是补充投诉渠道，由各销售机构和基金管理人分别管理。

基金管理人对于工作日受理的投诉，原则上当日完成首次回复，不能当日完成的，在 3 个工作日内首次回复。对于非工作日受理的投诉，原则上在顺延的第 1 个工作日完成首次回复，不能及时完成的，在 3 个工作日内完成首次回复。

客户服务部邮箱：[service@yimifund.com](mailto:service@yimifund.com)

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

## 第二十二部分 其他应披露事项

基金合同如有未尽事宜，由基金合同当事人各方按有关法律法规协商解决。

## 第二十三部分 招募说明书的存放及查阅方式

招募说明书等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办公场所，以供社会公众查阅、复制。投资者也可在基金管理人规定的网站上进行查阅。

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。



## 第二十四部分 备查文件

以下备查文件存放在基金管理人、基金托管人的住所和办公场所，在办公时间内可供免费查阅。

一、中国证监会准予易米低碳经济股票型发起式证券投资基金募集注册的文件

二、《易米低碳经济股票型发起式证券投资基金基金合同》

三、《易米低碳经济股票型发起式证券投资基金托管协议》

四、法律意见书

五、基金管理人业务资格批件、营业执照

六、基金托管人业务资格批件、营业执照

七、中国证监会要求的其他文件